

【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】	クルーズコントロール
【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】

クルーズコントロール

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

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

(5) 【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2024年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、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

<ファンドの特色>

1 国内外の6資産に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

- 国内外の株式および公社債に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。
 - ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - ・国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
 - ・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
 - ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合があります。
- 実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。
- 各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

2 基準価額の下落を一定水準(下値目安値^(*))までに抑えることを目標とします。

- 資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
- 資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
- 下値目安値は、3ヵ月毎に下値目安値の改定日(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には、翌営業日。)を設け、改定日における基準価額から-2.0%の水準とします。ただし、当該水準は、委託会社の判断により今後変更する場合があります。
- 上記の運用目標は、現金等^(**)を活用し、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(***)を機動的に変更することで行います。

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

(**)現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

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

※各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

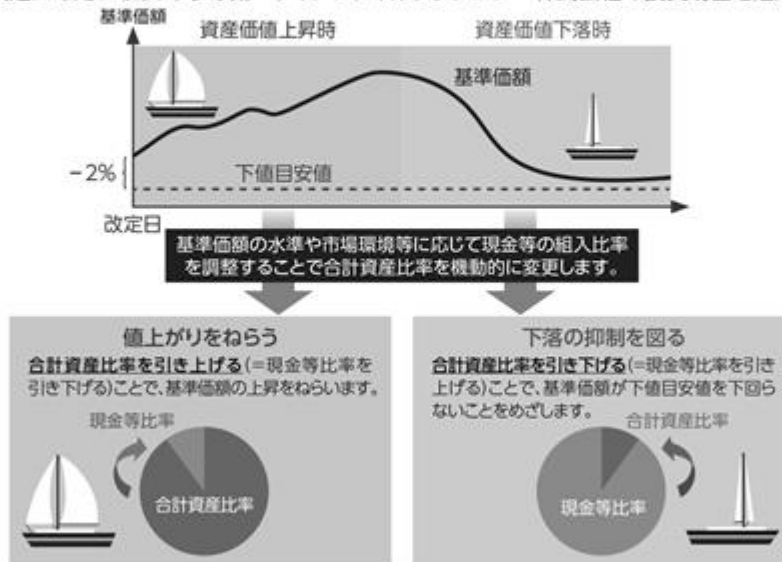
当ファンドの合計資産比率の変更(イメージ)

- 資産価値上昇時は、合計資産比率*1を増加(=現金等*2比率の減少)させることで値上がり益の獲得をめざします。
- 一方、資産価値下落時は、機動的に合計資産比率を減少(=現金等比率の増加)させることで基準価額下落の抑制をめざします。

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

*2 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

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



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

※ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

■ 分配方針

年2回の決算時(毎年1月、7月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

資産複合 (投資信託証券 (債券、株式)、 先物、ETF、 短期金融資産) 資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、ETF、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル (日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

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

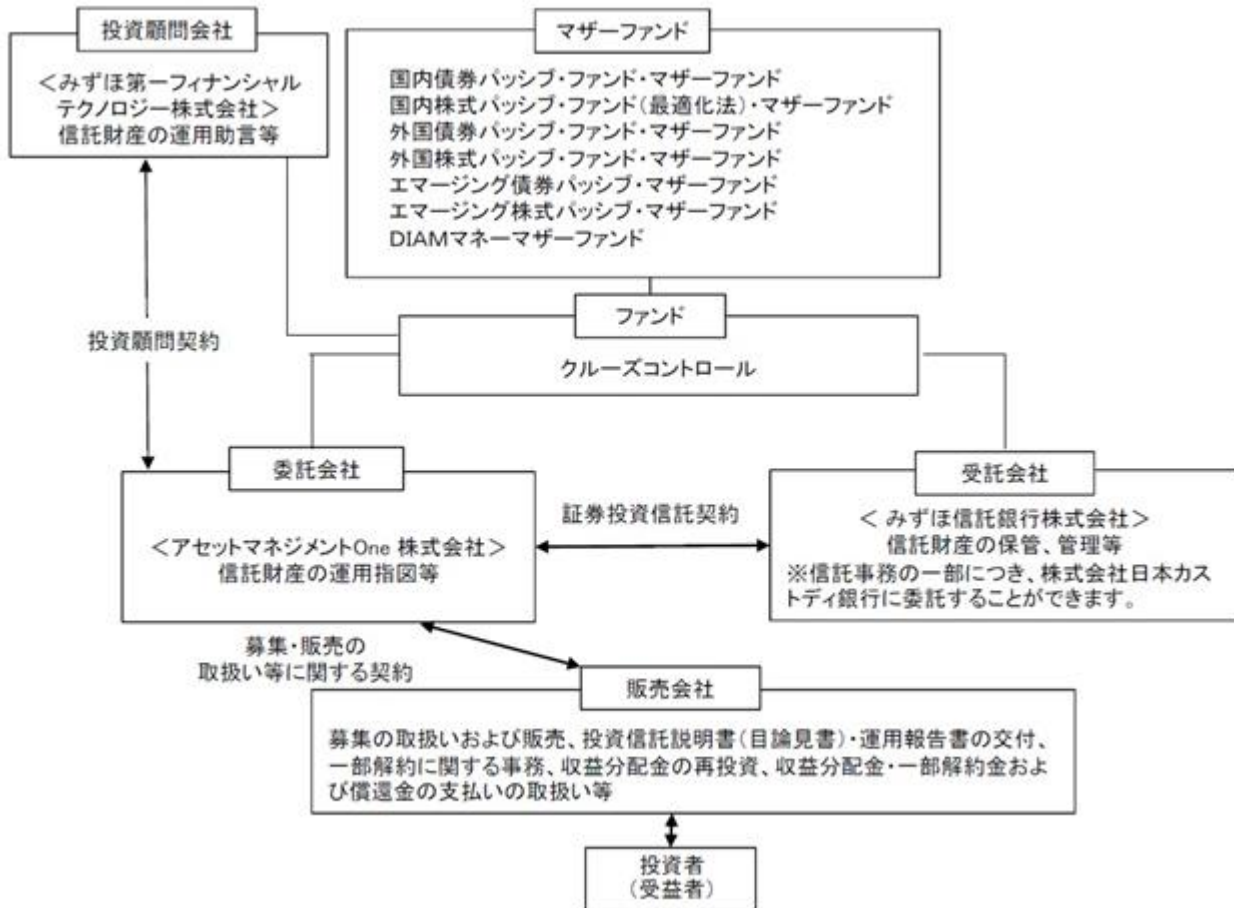
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

(2) 【ファンドの沿革】

2012年10月26日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2013年 5月17日 投資対象、投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・ 「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

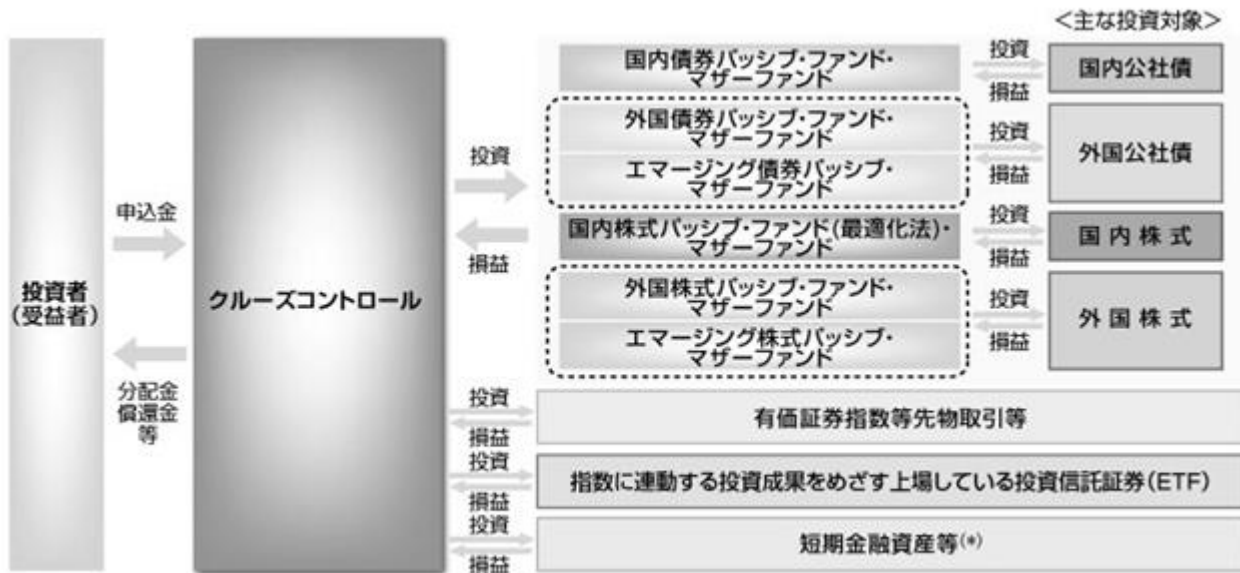
- ・ 「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

「ファミリーファンド方式」とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果を目指す上場している投資信託証券（ETF）、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

以下のマザーファンドへの投資を通じて、国内外の株式、公社債に実質的に分散投資を行います。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

（上記それぞれおよびDIAMマネーマザーファンドを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

・実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。

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

基準価額の下落を一定水準(下値目安値^(*))までに抑えることを目標とします。

- ・ 資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
- ・ 資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
- ・ 下値目安値は、四半期毎に、委託会社の判断により基準価額から一定の水準に設定します。
- ・ 上記の運用目標は、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更することで行います。

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

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

- ・ 各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。
- ・ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

<運用プロセス>

・ 基本配分比率の決定

委託会社は、年に一度、統計的手法を用いて現金等を除く各資産への基本配分比率を決定します。

・ 下値目安値の決定

委託会社は、3ヵ月に一度、下値目安値の改定日を設け、当日の基準価額の98%の水準を翌3ヵ月間の下値目安値とします。

・ リバランスの実施

委託会社は、各資産の上昇益を享受しつつも基準価額が下値目安値を下回らないことを目標として、基準価額と下値目安値の水準、市況などを基に、日々の合計資産比率の推奨値を決定します。ファンドの合計資産比率と推奨値との乖離が一定以上となった場合にはリバランスを実施します。6資産への投資比率は、基本配分比率と合計資産比率から決定します。

・ みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言

基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

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

12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
 15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
 18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

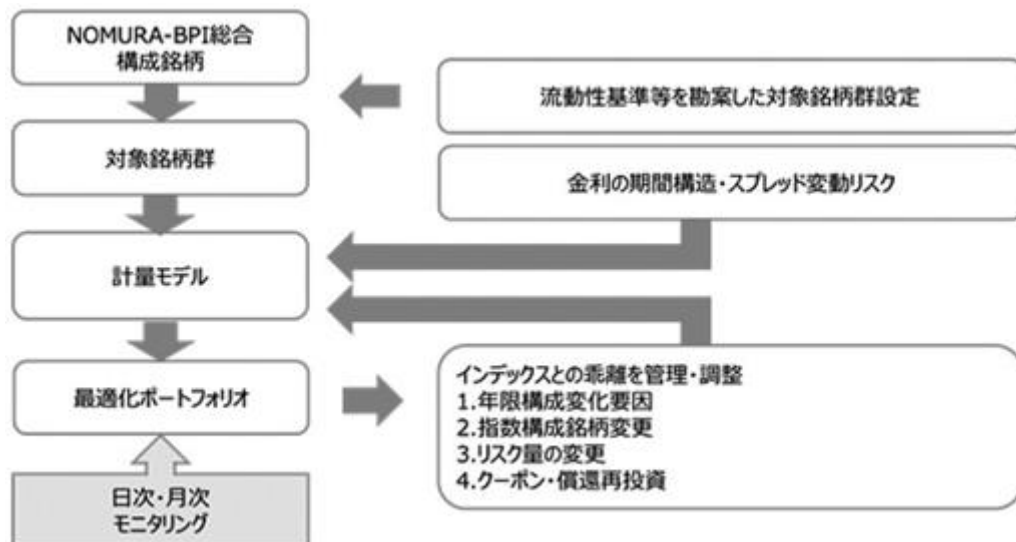
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"><p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p></div>

運用プロセス

- 1.流動性基準等による対象銘柄群設定
NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。
- 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	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

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

投資態度

- 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。

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。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

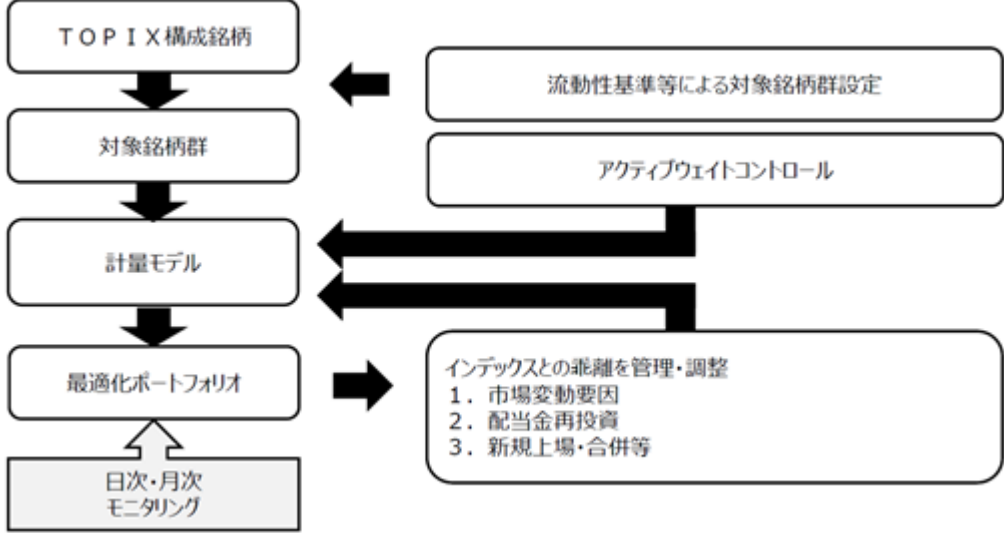
JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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。

JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

<p>運用プロセス</p>	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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 
<p>主な投資制限</p>	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>

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

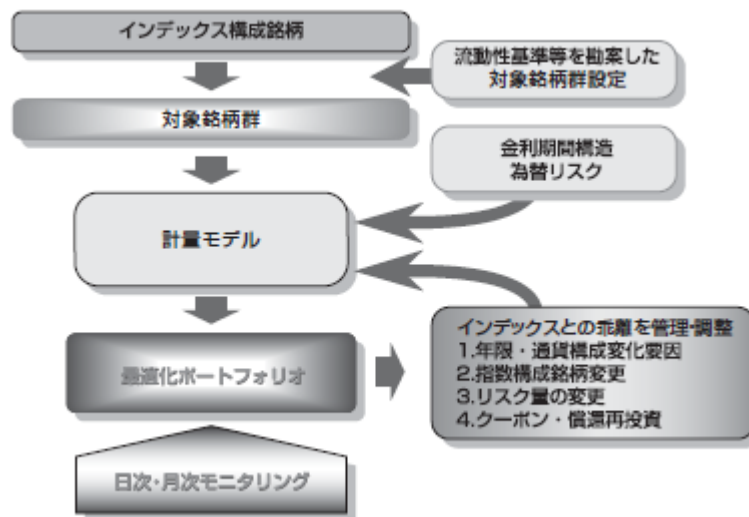
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

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	<p>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--------	--

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">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限りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

たは団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

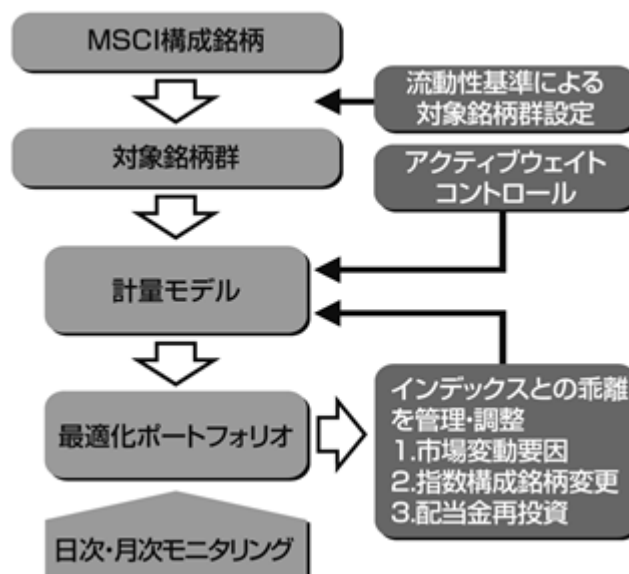
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

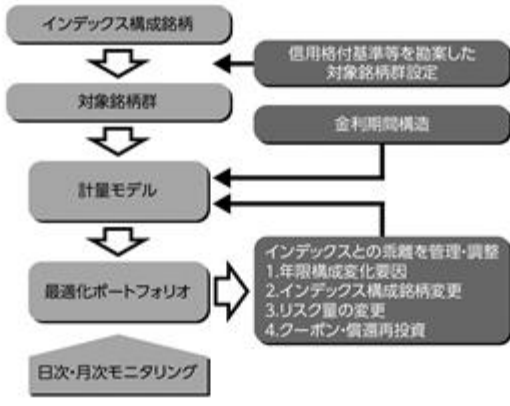
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>

運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[信用格付基準等を勘案した 対象銘柄群設定] --> B G[金利期限構造] --> C H[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限構成変化要因 2. インデックス構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資] --> C </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 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。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 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。 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。 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。 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。

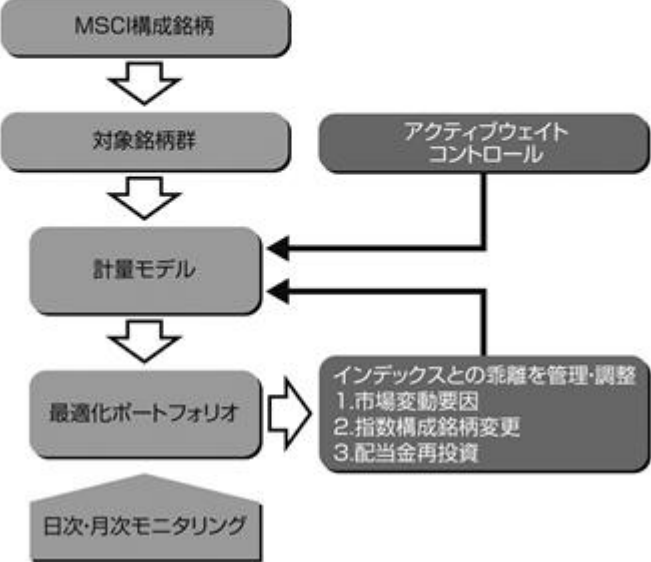
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*) DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none">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限りなく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

	<p>たは団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[アクティブウェイトコントロール] --> C F --> D G["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --> D </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

定期的で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。

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】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年1月、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

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

収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

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

株式への実質投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

委託会社は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。以下同じ。))を除きます。の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。))の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。(約款第17条第3項)

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

非株式割合(マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。))については制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図および範囲(約款第21条)

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

先物取引等の運用指図(約款第22条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

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。

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25条)

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第26条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第27条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ(約款第33条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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

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

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

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

・金利リスク

金利の上昇（債券の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

・為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

・信用リスク

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

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要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、受益者毎に異なります。

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

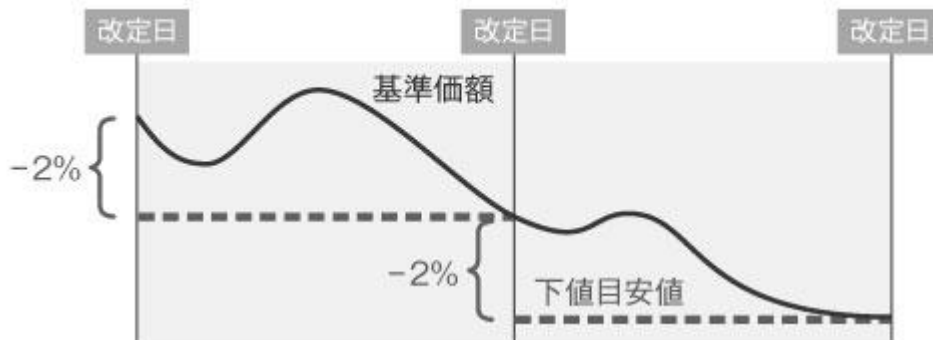
当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

<ケース> 下値目安値の切下げについて

下値目安値は3ヵ月（四半期）毎の改定日にその時点の基準価額をもとに定められます。そのため、当ファンドの基準価額は長期的に2%以上下落する場合があります。

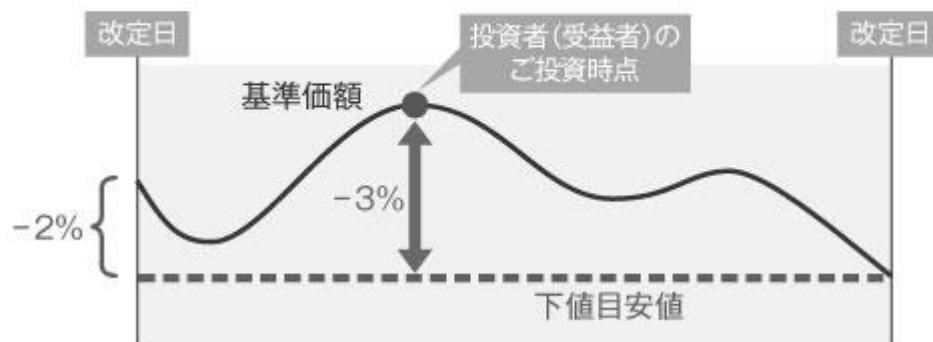
<基準価額の推移(イメージ)>



<ケース> 四半期中途の投資について

当ファンドの基準価額が直近の改定日の基準価額よりも上昇し、この時点でお客さまが当ファンドへ投資された場合、次回改定日までの基準価額の下落は2%以上となる場合があります。したがって、ご投資にあたっては、当該四半期の下値目安値にご留意いただきますようお願いいたします。

<基準価額の推移(イメージ)>



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

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

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

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

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

注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に債券および株式等など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
 - ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
 - ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- 二．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>

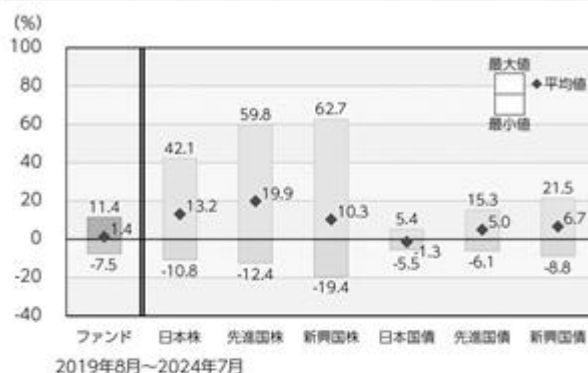
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



*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



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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.54%(税抜1.40%)

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.65%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.70%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

解約時および償還時の差益(譲渡益)については、譲渡所得として、20.315% (所得税15.315% (復興特別所得税を含みます。)) および地方税5%) の税率での申告分離課税が適用されます。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座(源泉徴収口座)を利用する場合、20.315% (所得税15.315% (復興特別所得税を含みます。)) および地方税5%) の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。)を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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 >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

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

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

--- (参考情報)ファンドの総経費率 ---

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.57%	1.54%	0.03%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2024年1月12日~2024年7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	5,775,994,274	69.85
内 日本	5,775,994,274	69.85
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,493,545,041	30.15
純資産総額	8,269,539,315	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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。

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。

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。

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。

D I A Mマネーマザーファンド

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	3,797,205,000	74.71
内 日本	3,797,205,000	74.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,285,233,461	25.29
純資産総額	5,082,438,461	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2024年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	D I A Mマネーマザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,868,885,634	1.0055 4,895,693,907	1.0053 4,894,690,727	- -	59.19
2	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	109,636,898	2.5305 277,436,172	2.4094 264,159,142	- -	3.19

3	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	154,132,975	1.2025 185,346,817	1.2054 185,791,888	- -	2.25
4	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	35,585,879	5.1707 184,004,269	4.9330 175,545,141	- -	2.12
5	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	36,167,100	2.5552 92,414,644	2.4273 87,788,401	- -	1.06
6	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	47,371,675	1.9503 92,389,582	1.7742 84,046,825	- -	1.02
7	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	9,109,881	10.0556 91,605,321	9.2177 83,972,150	- -	1.02

(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	69.85
合計	69.85

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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。

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。

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。

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。

D I A Mマネーマザーファンド

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	1176回 国庫短期証券 日本	国債証券	700,000,000	99.99 699,994,400	99.99 699,944,000	- 2024/8/20	13.77
2	1241回 国庫短期証券 日本	国債証券	500,000,000	99.99 499,970,000	99.97 499,860,000	- 2024/10/7	9.84
3	1244回 国庫短期証券 日本	国債証券	500,000,000	99.82 499,135,000	99.73 498,665,000	- 2025/7/22	9.81
4	1217回 国庫短期証券 日本	国債証券	400,000,000	99.99 399,983,600	99.98 399,932,000	- 2024/9/10	7.87
5	1243回 国庫短期証券 日本	国債証券	400,000,000	99.99 399,983,600	99.96 399,876,000	- 2024/10/15	7.87
6	1183回 国庫短期証券 日本	国債証券	300,000,000	99.99 299,994,600	99.97 299,937,000	- 2024/9/20	5.90
7	1242回 国庫短期証券 日本	国債証券	300,000,000	99.97 299,926,500	99.93 299,799,000	- 2025/1/10	5.90
8	1238回 国庫短期証券 日本	国債証券	300,000,000	99.85 299,568,300	99.77 299,322,000	- 2025/6/20	5.89
9	1228回 国庫短期証券 日本	国債証券	200,000,000	99.99 199,983,800	99.99 199,996,000	- 2024/8/5	3.94
10	440回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	100,000,000	100.00 100,006,000	99.98 99,988,000	0.005 2024/9/1	1.97
11	446回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	100,000,000	99.93 99,930,000	99.88 99,886,000	0.005 2025/3/1	1.97

(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

種類	投資比率(%)
国債証券	74.71
合計	74.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

D I A Mマナーマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2024年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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年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。

DIAMマネーマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【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6計算期間末 (2015年1月13日)	7,664	7,664	1.2660	1.2660
第7計算期間末 (2015年7月13日)	16,373	16,373	1.2816	1.2816
第8計算期間末 (2016年1月12日)	29,373	29,373	1.2200	1.2200
第9計算期間末 (2016年7月11日)	30,524	30,524	1.1796	1.1796

第10計算期間末 (2017年1月11日)	33,083	33,083	1.2331	1.2331
第11計算期間末 (2017年7月11日)	32,461	32,461	1.2524	1.2524
第12計算期間末 (2018年1月11日)	28,678	28,678	1.2864	1.2864
第13計算期間末 (2018年7月11日)	27,026	27,026	1.2537	1.2537
第14計算期間末 (2019年1月11日)	24,449	24,449	1.2062	1.2062
第15計算期間末 (2019年7月11日)	22,938	22,938	1.2287	1.2287
第16計算期間末 (2020年1月14日)	20,607	20,607	1.2590	1.2590
第17計算期間末 (2020年7月13日)	18,748	18,748	1.2562	1.2562
第18計算期間末 (2021年1月12日)	16,160	16,160	1.2941	1.2941
第19計算期間末 (2021年7月12日)	13,725	13,725	1.3111	1.3111
第20計算期間末 (2022年1月11日)	12,268	12,268	1.2898	1.2898
第21計算期間末 (2022年7月11日)	11,212	11,212	1.2429	1.2429
第22計算期間末 (2023年1月11日)	10,436	10,436	1.1999	1.1999
第23計算期間末 (2023年7月11日)	10,240	10,240	1.2573	1.2573
第24計算期間末 (2024年1月11日)	9,300	9,300	1.2833	1.2833
第25計算期間末 (2024年7月11日)	8,575	8,575	1.3992	1.3992
2023年7月末日	10,259	-	1.2713	-
8月末日	10,157	-	1.2740	-
9月末日	9,940	-	1.2616	-
10月末日	9,702	-	1.2438	-
11月末日	9,674	-	1.2664	-
12月末日	9,219	-	1.2678	-
2024年1月末日	9,111	-	1.2899	-
2月末日	8,886	-	1.3182	-
3月末日	8,808	-	1.3442	-
4月末日	8,600	-	1.3433	-
5月末日	8,448	-	1.3451	-
6月末日	8,530	-	1.3770	-
7月末日	8,269	-	1.3721	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
--	--------------

第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000
第25計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率（％）
第6計算期間	6.5
第7計算期間	1.2
第8計算期間	4.8
第9計算期間	3.3
第10計算期間	4.5
第11計算期間	1.6
第12計算期間	2.7
第13計算期間	2.5
第14計算期間	3.8
第15計算期間	1.9
第16計算期間	2.5
第17計算期間	0.2
第18計算期間	3.0
第19計算期間	1.3
第20計算期間	1.6
第21計算期間	3.6
第22計算期間	3.5
第23計算期間	4.8
第24計算期間	2.1
第25計算期間	9.0

（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6計算期間	3,178,106,719	1,190,093,443
第7計算期間	8,113,284,548	1,391,102,184

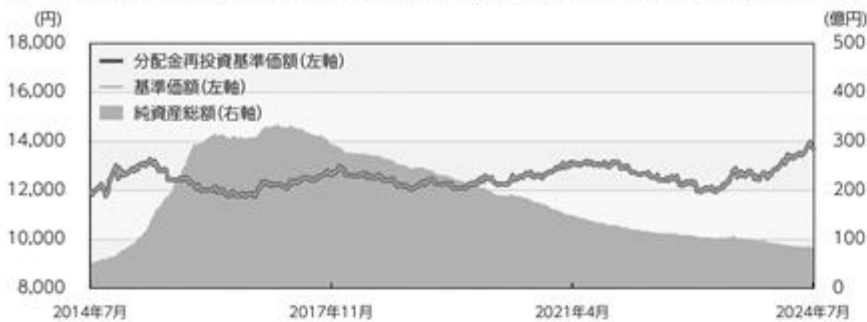
第8計算期間	12,475,200,872	1,174,643,755
第9計算期間	4,218,169,651	2,417,079,166
第10計算期間	3,726,999,882	2,774,409,766
第11計算期間	2,943,838,417	3,853,950,424
第12計算期間	2,426,808,751	6,053,103,346
第13計算期間	2,339,206,033	3,075,836,809
第14計算期間	967,336,189	2,254,647,937
第15計算期間	639,297,067	2,240,826,501
第16計算期間	513,000,084	2,813,656,675
第17計算期間	306,020,884	1,748,348,178
第18計算期間	306,787,422	2,744,453,780
第19計算期間	269,416,421	2,288,470,279
第20計算期間	328,483,921	1,285,084,124
第21計算期間	196,469,949	687,342,399
第22計算期間	156,928,133	479,916,329
第23計算期間	153,313,399	706,379,922
第24計算期間	108,201,861	1,005,962,085
第25計算期間	69,441,005	1,187,847,806

(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:2012年10月26日)

分配の推移(税引前)

2022年 7月	0円
2023年 1月	0円
2023年 7月	0円
2024年 1月	0円
2024年 7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	DIAMマネーマザーファンド	59.19
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.19
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.25
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	2.12
5	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	1.06
6	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	1.02
7	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.02

■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

■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

○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

■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

■エマーシング債券パッシブ・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

■エマーシング株式パッシブ・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

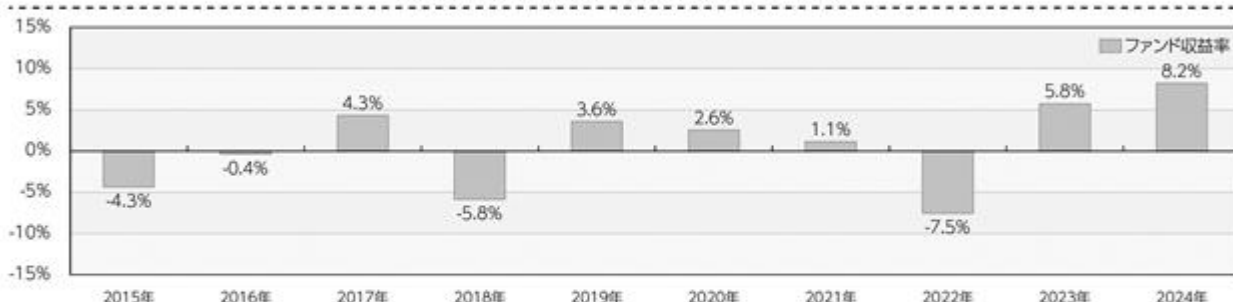
■DIAMマネーマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	1176回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/8/20	13.77
2	1241回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/10/7	9.84
3	1244回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2025/7/22	9.81
4	1217回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/9/10	7.87
5	1243回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/10/15	7.87

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

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

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

・ お申込手数料

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、1口単位となります。当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時まで（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）に行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

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

なお、受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2012年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日よ

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

(5) 【その他】

イ.償還規定

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

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

ロ. 信託約款の変更等

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

ハ. 関係法人との契約の更改

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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二．公告

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

（URL <https://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

- ・委託会社は、毎年1月11日、7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <https://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

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

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、解約の請求をすることができます。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第25期計算期間(2024年1月12日から2024年7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】

【クルーズコントロール】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第24期 2024年1月11日現在	第25期 2024年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,503,344,930	895,073,329
親投資信託受益証券	7,888,861,966	7,780,432,640
流動資産合計	9,392,206,896	8,675,505,969
資産合計	9,392,206,896	8,675,505,969
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,176,003	32,559,676
未払受託者報酬	2,722,202	2,393,722
未払委託者報酬	73,500,861	64,631,663
その他未払費用	193,727	170,341
流動負債合計	91,592,793	99,755,402
負債合計	91,592,793	99,755,402
純資産の部		
元本等		
元本	7,247,329,481	6,128,922,680
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,053,284,622	2,446,827,887
(分配準備積立金)	534,401,753	922,246,649
元本等合計	9,300,614,103	8,575,750,567
純資産合計	9,300,614,103	8,575,750,567
負債純資産合計	9,392,206,896	8,675,505,969

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第24期 自 2023年7月12日 至 2024年1月11日	第25期 自 2024年1月12日 至 2024年7月11日
営業収益		
受取利息	10,802	276,244
有価証券売買等損益	270,648,076	822,570,674
営業収益合計	270,658,878	822,846,918
営業費用		
支払利息	480,971	30,433
受託者報酬	2,722,202	2,393,722
委託者報酬	73,500,861	64,631,663
その他費用	199,667	170,341
営業費用合計	76,903,701	67,226,159
営業利益又は営業損失（ ）	193,755,177	755,620,759
経常利益又は経常損失（ ）	193,755,177	755,620,759
当期純利益又は当期純損失（ ）	193,755,177	755,620,759
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（ ）	5,983,194	48,486,731
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,095,866,705	2,053,284,622
剰余金増加額又は欠損金減少額	28,549,784	23,097,076
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	28,549,784	23,097,076
剰余金減少額又は欠損金増加額	258,903,850	336,687,839
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	258,903,850	336,687,839
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,053,284,622	2,446,827,887

(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25期	
	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。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第24期	第25期
	2024年1月11日現在	2024年7月11日現在
1. 期首元本額	8,145,089,705円	7,247,329,481円
期中追加設定元本額	108,201,861円	69,441,005円
期中一部解約元本額	1,005,962,085円	1,187,847,806円
2. 受益権の総数	7,247,329,481口	6,128,922,680口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第24期	第25期
	自 2023年7月12日 至 2024年1月11日	自 2024年1月12日 至 2024年7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(50,562,569円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,853,194,448円)及び分配準備積立金(483,839,184円)より分配対象収益は2,387,596,201円(1万口当たり3,294.44円)ですが、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(70,562,545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(404,516,588円)、信託約款に規定される収益調整金(1,572,040,947円)及び分配準備積立金(447,167,516円)より分配対象収益は2,494,287,596円(1万口当たり4,069.69円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第24期	第25期
	自 2023年7月12日 至 2024年1月11日	自 2024年1月12日 至 2024年7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24期 2024年1月11日現在	第25期 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。	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24期 2024年1月11日現在	第25期 2024年7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	239,075,686	534,247,660
合計	239,075,686	534,247,660

（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24期 2024年1月11日現在	第25期 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）	1.2833円 (12,833円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2024年7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	289,712,998	1,498,018,998	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,145,496,062	1,377,459,014	
	D I A Mマネーマザーファンド	294,047,243	295,693,907	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	79,514,101	799,561,994	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	894,367,559	2,263,197,108	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	404,503,490	788,903,156	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	296,492,824	757,598,463	
親投資信託受益証券 合計		3,404,134,277	7,780,432,640	
合計			7,780,432,640	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年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
特殊債証券	26,579,203,128
社債証券	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 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(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(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(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)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2024年7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	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	11,558,909,750
地方債証券	422,180,592
特殊債券	631,124,702
社債券	294,011,400
合計	12,906,226,444

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年2月15日から2024年7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7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2025円

(1万口当たり純資産額)

(12,025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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	453回 利付国庫債券(2年)	4,700,000,000	4,690,788,000	
	455回 利付国庫債券(2年)	2,900,000,000	2,891,764,000	
	456回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	1,996,180,000	
	457回 利付国庫債券(2年)	3,200,000,000	3,192,544,000	
	458回 利付国庫債券(2年)	3,300,000,000	3,296,238,000	
	460回 利付国庫債券(2年)	4,300,000,000	4,299,613,000	
	461回 利付国庫債券(2年)	4,300,000,000	4,306,450,000	
	145回 利付国庫債券(5年)	7,300,000,000	7,295,182,000	
	146回 利付国庫債券(5年)	4,700,000,000	4,693,232,000	
	147回 利付国庫債券(5年)	1,050,000,000	1,045,495,500	
	148回 利付国庫債券(5年)	4,610,000,000	4,581,971,200	
	149回 利付国庫債券(5年)	1,680,000,000	1,667,752,800	
	150回 利付国庫債券(5年)	3,570,000,000	3,539,726,400	
	151回 利付国庫債券(5年)	4,600,000,000	4,555,288,000	
	152回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,777,129,900	
	153回 利付国庫債券(5年)	5,210,000,000	5,151,700,100	
	154回 利付国庫債券(5年)	3,900,000,000	3,861,897,000	
	155回 利付国庫債券(5年)	2,700,000,000	2,688,093,000	
	156回 利付国庫債券(5年)	6,700,000,000	6,647,740,000	
	157回 利付国庫債券(5年)	4,900,000,000	4,854,675,000	

158回 利付国庫債券(5年)	3,600,000,000	3,553,632,000	
159回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,152,960,000	
160回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,582,672,000	
162回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,586,528,000	
163回 利付国庫債券(5年)	6,800,000,000	6,770,624,000	
164回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,477,875,000	
165回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	1,979,180,000	
166回 利付国庫債券(5年)	500,000,000	496,960,000	
167回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,587,216,000	
168回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,401,904,000	
169回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,395,198,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	116,977,300	
2回 利付国庫債券(40年)	330,000,000	336,458,100	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	546,728,400	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	724,874,400	
5回 利付国庫債券(40年)	710,000,000	682,629,500	
6回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	878,806,000	
7回 利付国庫債券(40年)	1,030,000,000	914,516,400	
8回 利付国庫債券(40年)	990,000,000	808,612,200	
9回 利付国庫債券(40年)	2,090,000,000	1,219,117,900	
10回 利付国庫債券(40年)	1,730,000,000	1,188,267,800	
11回 利付国庫債券(40年)	1,440,000,000	941,544,000	
12回 利付国庫債券(40年)	1,420,000,000	813,092,000	
13回 利付国庫債券(40年)	1,990,000,000	1,116,191,000	
14回 利付国庫債券(40年)	2,100,000,000	1,254,246,000	
15回 利付国庫債券(40年)	2,340,000,000	1,544,961,600	
16回 利付国庫債券(40年)	2,300,000,000	1,668,604,000	
17回 利付国庫債券(40年)	400,000,000	378,352,000	
340回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,306,693,000	
341回 利付国庫債券(10年)	3,620,000,000	3,625,176,600	

342回 利付国庫債券(10年)	3,520,000,000	3,510,531,200	
343回 利付国庫債券(10年)	3,090,000,000	3,076,867,500	
344回 利付国庫債券(10年)	3,570,000,000	3,551,328,900	
345回 利付国庫債券(10年)	4,890,000,000	4,859,779,800	
346回 利付国庫債券(10年)	4,540,000,000	4,507,357,400	
347回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,462,065,000	
348回 利付国庫債券(10年)	3,770,000,000	3,733,167,100	
349回 利付国庫債券(10年)	2,350,000,000	2,323,680,000	
350回 利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,060,072,000	
351回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,350,020,000	
352回 利付国庫債券(10年)	4,950,000,000	4,867,681,500	
353回 利付国庫債券(10年)	3,690,000,000	3,619,557,900	
354回 利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,407,208,400	
355回 利付国庫債券(10年)	3,730,000,000	3,640,517,300	
356回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,312,722,000	
357回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,264,081,000	
358回 利付国庫債券(10年)	2,150,000,000	2,086,274,000	
359回 利付国庫債券(10年)	4,050,000,000	3,920,359,500	
360回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	3,958,673,000	
361回 利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	3,850,880,000	
362回 利付国庫債券(10年)	4,010,000,000	3,847,675,200	
363回 利付国庫債券(10年)	3,470,000,000	3,317,909,900	
364回 利付国庫債券(10年)	2,850,000,000	2,715,252,000	
365回 利付国庫債券(10年)	4,230,000,000	4,014,989,100	
366回 利付国庫債券(10年)	3,180,000,000	3,030,826,200	

367回 利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,753,637,000	
368回 利付国庫債券(10年)	4,750,000,000	4,494,592,500	
369回 利付国庫債券(10年)	2,720,000,000	2,629,478,400	
370回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,408,725,000	
371回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,569,264,000	
372回 利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	4,915,800,000	
373回 利付国庫債券(10年)	6,400,000,000	6,157,888,000	
374回 利付国庫債券(10年)	5,850,000,000	5,713,812,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	122,337,600	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	109,770,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	227,548,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	222,936,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	265,777,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	252,358,300	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	163,150,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	382,037,600	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	294,725,600	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	272,037,600	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	303,439,500	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	445,476,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	311,589,600	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	373,985,700	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	344,648,700	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	328,474,300	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	396,273,500	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	365,729,100	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	693,519,600	

27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	699,837,400	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	867,782,300	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	956,156,600	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	964,726,400	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	778,024,800	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,059,123,600	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,235,129,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,285,512,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,100,099,800	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,416,251,200	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,379,570,400	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	845,265,500	
39回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,219,329,100	
40回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,019,092,300	
41回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,028,433,200	
42回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	967,870,000	
43回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	685,497,900	
44回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,088,280,400	
45回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,066,567,500	
46回 利付国庫債券(30年)	1,670,000,000	1,544,416,000	
47回 利付国庫債券(30年)	1,340,000,000	1,259,023,800	
48回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,326,866,100	
49回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,169,779,000	
50回 利付国庫債券(30年)	2,050,000,000	1,622,657,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,063,528,800	

52回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,023,722,000	
53回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	984,205,200	
54回 利付国庫債券(30年)	1,590,000,000	1,237,194,900	
55回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	836,719,200	
56回 利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	802,235,200	
57回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,021,493,200	
58回 利付国庫債券(30年)	1,660,000,000	1,269,418,600	
59回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	906,033,000	
60回 利付国庫債券(30年)	1,230,000,000	955,648,500	
61回 利付国庫債券(30年)	1,660,000,000	1,220,564,800	
62回 利付国庫債券(30年)	1,020,000,000	706,951,800	
63回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,071,488,000	
64回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	732,182,000	
65回 利付国庫債券(30年)	900,000,000	595,899,000	
66回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	717,350,800	
67回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,020,062,400	
68回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,062,569,200	
69回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	961,125,600	
70回 利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,196,749,000	
71回 利付国庫債券(30年)	1,930,000,000	1,352,254,500	
72回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	900,278,100	
73回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	896,743,500	
74回 利付国庫債券(30年)	1,590,000,000	1,199,750,400	
75回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,236,216,000	
76回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,098,966,000	

77回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,396,608,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	995,268,000	
79回 利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	1,572,660,000	
80回 利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	1,823,740,000	
81回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,214,108,000	
82回 利付国庫債券(30年)	1,650,000,000	1,500,477,000	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	408,776,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	143,238,200	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	71,911,000	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	174,396,200	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	608,290,000	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	124,123,200	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	123,921,600	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	612,573,400	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,363,400	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	489,067,900	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	114,702,500	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,209,126,000	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	386,150,500	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	701,027,700	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	580,695,500	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	126,000,000	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	697,435,200	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	168,571,200	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	792,735,000	

100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	883,003,800	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	246,357,600	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	537,430,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	171,358,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	116,957,500	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	682,316,800	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	535,115,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	641,010,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	731,172,300	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	371,507,500	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	471,055,200	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	495,663,800	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	793,820,200	
113回 利付国庫債券(20年)	4,970,000,000	5,348,018,200	
114回 利付国庫債券(20年)	2,010,000,000	2,169,433,200	
115回 利付国庫債券(20年)	1,360,000,000	1,475,042,400	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	576,322,000	
117回 利付国庫債券(20年)	3,470,000,000	3,754,193,000	
118回 利付国庫債券(20年)	955,000,000	1,029,900,650	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	501,480,600	
120回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	527,615,000	
121回 利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,117,376,000	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	609,016,500	
123回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,578,020,500	
125回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	877,216,000	

126回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	985,884,900	
127回 利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,227,780,000	
128回 利付国庫債券(20年)	2,870,000,000	3,092,798,100	
130回 利付国庫債券(20年)	3,610,000,000	3,867,320,800	
131回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,170,906,000	
132回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	564,291,000	
133回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,318,227,900	
134回 利付国庫債券(20年)	2,900,000,000	3,108,887,000	
135回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	138,422,700	
136回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	380,581,200	
137回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	510,912,000	
138回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,112,067,200	
139回 利付国庫債券(20年)	2,880,000,000	3,044,044,800	
140回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,011,446,000	
141回 利付国庫債券(20年)	4,460,000,000	4,745,484,600	
142回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	461,080,400	
143回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,297,797,600	
144回 利付国庫債券(20年)	3,750,000,000	3,924,937,500	
145回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,391,997,500	
146回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,378,992,000	
147回 利付国庫債券(20年)	1,290,000,000	1,356,757,500	
148回 利付国庫債券(20年)	1,730,000,000	1,800,826,200	
149回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	2,380,592,400	
150回 利付国庫債券(20年)	3,630,000,000	3,731,494,800	
151回 利付国庫債券(20年)	3,660,000,000	3,682,179,600	

152回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,247,436,800	
153回 利付国庫債券(20年)	2,560,000,000	2,587,238,400	
154回 利付国庫債券(20年)	2,420,000,000	2,414,022,600	
155回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,219,602,800	
156回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,064,448,800	
157回 利付国庫債券(20年)	3,480,000,000	3,057,493,200	
158回 利付国庫債券(20年)	2,940,000,000	2,667,197,400	
159回 利付国庫債券(20年)	1,840,000,000	1,682,238,400	
160回 利付国庫債券(20年)	2,120,000,000	1,953,792,000	
161回 利付国庫債券(20年)	1,760,000,000	1,594,384,000	
162回 利付国庫債券(20年)	1,930,000,000	1,739,663,400	
163回 利付国庫債券(20年)	2,330,000,000	2,089,567,300	
164回 利付国庫債券(20年)	3,250,000,000	2,859,805,000	
165回 利付国庫債券(20年)	2,150,000,000	1,881,508,000	
166回 利付国庫債券(20年)	2,140,000,000	1,917,226,000	
167回 利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,515,290,000	
168回 利付国庫債券(20年)	1,690,000,000	1,433,458,000	
169回 利付国庫債券(20年)	2,520,000,000	2,092,179,600	
170回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,403,316,000	
171回 利付国庫債券(20年)	1,940,000,000	1,592,235,600	
172回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,310,989,200	
173回 利付国庫債券(20年)	2,660,000,000	2,194,659,600	
174回 利付国庫債券(20年)	2,030,000,000	1,665,310,500	
175回 利付国庫債券(20年)	2,020,000,000	1,676,216,200	
176回 利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,145,572,000	

	177回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,691,970,000	
	178回 利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,121,418,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	3,910,000,000	3,174,177,100	
	180回 利付国庫債券(20年)	2,320,000,000	1,978,217,600	
	181回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,641,391,000	
	182回 利付国庫債券(20年)	2,750,000,000	2,450,910,000	
	183回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,588,259,000	
	184回 利付国庫債券(20年)	3,280,000,000	2,900,110,400	
	185回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,849,260,000	
	186回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,788,071,000	
	187回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,539,877,000	
	188回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,522,496,000	
国債証券 合計		493,555,000,000	467,770,271,450	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,208,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	108,598,600	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	193,586,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	387,312,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	288,936,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	220,044,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	101,510,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,287,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	207,932,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	312,531,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,264,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,040,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	200,584,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,270,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	394,644,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	392,608,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	95,785,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	240,535,000	

237回 神奈川県公募公債	200,000,000	195,888,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	192,244,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	285,384,000	
3回 神奈川県公募公債 30 年	100,000,000	113,083,000	
11回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	106,968,000	
16回 神奈川県公募公債 2 0年	300,000,000	325,059,000	
19回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	106,759,000	
413回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	99,080,000	
419回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	99,285,000	
464回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	190,876,000	
467回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	191,366,000	
469回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	190,446,000	
472回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	189,346,000	
474回 大阪府公募公債 1 0年	300,000,000	283,677,000	
10回 大阪府公募公債 20 年	200,000,000	211,880,000	
13回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	98,762,000	
14回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	90,178,000	
190回 大阪府公募公債 5 年	300,000,000	296,832,000	
29年度13回 京都府公募公 債	109,330,000	108,046,465	
令和2年度1回 京都府公募公 債	400,000,000	387,172,000	
令和2年度14回 京都府公募 公債	200,000,000	192,518,000	
令和元年度16回 兵庫県公募 公債	200,000,000	193,428,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公 債	100,000,000	95,790,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	108,489,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	205,070,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	308,763,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	101,677,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	100,639,000	

令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	193,686,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	96,330,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	191,494,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	102,774,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	103,086,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	201,278,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	102,305,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	321,717,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	324,783,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	103,183,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	207,394,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	137,746,500	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,283,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	195,146,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	194,469,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	98,680,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	192,436,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	76,021,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	81,859,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	193,954,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	158,698,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	198,219,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	108,235,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	104,831,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	311,313,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	99,169,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	99,493,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	196,448,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	193,814,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	96,222,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	102,794,000	

令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	131,998,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	106,322,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	108,448,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	316,122,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,586,000	
令和3年5回 千葉県公募公債	200,000,000	189,556,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	100,981,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	98,707,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	88,805,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	191,924,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	103,518,000	
150回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,993,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,274,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,404,800	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,756,000	
160回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	496,495,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	496,855,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	496,695,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	396,796,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,942,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,025,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,010,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,263,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	292,158,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	484,945,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,697,000	
227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	476,075,000	

228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	473,890,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	98,205,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	192,216,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	197,920,000	
令和2年2回 大阪市公募公債	300,000,000	289,974,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	214,076,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	192,976,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	103,431,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	99,220,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	104,567,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	217,236,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	211,722,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	296,052,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	137,258,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	387,100,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	112,169,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	106,409,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	103,582,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	103,679,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	267,228,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	196,804,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	214,848,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	103,207,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	106,235,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	324,303,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	103,521,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	107,074,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	176,946,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	81,656,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	178,874,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	296,901,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	88,847,000	

	令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	296,751,000	
	17回 さいたま市公募公債	200,000,000	193,896,000	
	令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	192,216,000	
	30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	195,464,000	
地方債証券 合計		27,239,330,000	26,667,044,365	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	204,268,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	202,368,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	297,633,000	
	125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	402,995,000	
	127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,685,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	69,165,000	
	156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	379,536,000	
	33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,524,000	
	1回 高速道路機構債	300,000,000	342,633,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	164,422,500	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	224,528,000	
	36回 高速道路機構債	300,000,000	332,637,000	
	50回 高速道路機構債	300,000,000	249,627,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,159,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,171,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,526,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	91,378,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	88,749,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	84,087,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	174,388,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	87,506,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,568,000	
	116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,805,000	
	121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	532,095,000	
	153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,627,000	
	188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,192,000	
	239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	297,753,000	

250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,079,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,260,000	
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	177,544,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	489,045,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	86,581,000	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	298,437,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	176,018,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,254,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	793,568,000	
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	179,826,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	88,613,000	
398回 政保道路債	300,000,000	196,416,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	116,448,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	134,410,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	136,060,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	572,040,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	212,312,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	322,548,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	323,184,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	108,257,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,185,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	212,770,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	105,198,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	210,652,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,276,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,144,000	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	103,300,000	

39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,430,000	
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	291,093,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	198,916,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	285,171,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	397,648,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,230,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	89,871,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	495,670,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,152,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,884,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,558,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	238,113,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	197,994,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,675,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	213,328,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,496,330	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	102,502,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	101,774,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	201,508,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	138,708,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	103,636,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	214,332,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,129,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	377,580,000	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,413,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,128,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,915,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	246,880,000	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,827,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,231,000	

187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,410,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,487,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,499,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	86,853,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,905,000	
325回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,905,000	
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,943,000	14,352,784	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,980,000	91,233,500	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,632,000	135,761,295	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,702,000	19,215,369	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,013,000	16,474,174	
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,760,000	19,206,675	
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,870,000	20,331,580	
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,979,000	24,390,959	
64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,564,000	59,857,054	
76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,773,000	27,035,107	
82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,701,000	32,544,689	
84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,160,000	32,990,552	
86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,601,000	36,273,787	
90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,295,000	37,668,493	
93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,566,000	41,921,819	
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,054,000	47,484,272	
99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,946,000	49,548,551	
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,674,000	180,432,508	
117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,993,000	61,814,323	

118回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	65,428,000	61,394,363	
119回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	65,930,000	61,781,025	
126回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	205,392,000	190,932,403	
128回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	205,266,000	190,683,903	
130回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	140,672,000	130,470,466	
131回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	209,568,000	193,772,859	
132回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	207,681,000	192,142,307	
137回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	362,435,000	335,995,366	
139回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	71,917,000	66,603,052	
142回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	74,444,000	68,038,838	
154回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	241,761,000	219,202,281	
156回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	321,708,000	292,484,045	
160回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	246,981,000	224,760,119	
168回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	253,761,000	230,914,897	
170回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	774,810,000	702,899,883	
い第843号 利付商工債	100,000,000	99,769,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	297,813,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	296,865,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	197,798,000	
369回 利附信金中金債(5 年)	400,000,000	398,852,000	
377回 利附信金中金債(5 年)	300,000,000	297,813,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	105,437,000	
72回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,512,000	
77回 東日本高速道路社債	300,000,000	294,987,000	
85回 中日本高速道路債券	300,000,000	298,965,000	
87回 中日本高速道路債券	400,000,000	397,528,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	100,089,000	
90回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	190,860,000	
特殊債券 合計	27,461,960,000	26,579,203,128	
社債券			
25回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2 017)	300,000,000	295,218,000	

11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債(20 16)	100,000,000	99,300,000	
27回 首都高速道路社債	400,000,000	398,248,000	
37回 成田国際空港社債	100,000,000	80,706,000	
57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,288,000	
67回 東日本高速道路社債	200,000,000	193,824,000	
79回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,519,000	
83回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,346,000	
90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,230,000	
91回 中日本高速道路債券	500,000,000	495,025,000	
33回 西日本高速道路債券	300,000,000	298,236,000	
34回 西日本高速道路債券	200,000,000	199,024,000	
61回 西日本高速道路債券	500,000,000	495,770,000	
62回 西日本高速道路債券	500,000,000	495,015,000	
24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,206,000	
3回 ダイドグループHD社 債	300,000,000	288,534,000	
9回 野村不動産ホールディン グス社債	100,000,000	90,020,000	
14回 セブン&アイ・ホール ディングス社債	200,000,000	199,270,000	
30回 東レ社債	300,000,000	297,339,000	
42回 王子ホールディングス 社債	200,000,000	198,302,000	
23回 三菱ケミカルホール ディングス社債	200,000,000	176,064,000	
40回 三菱ケミカルホール ディングス社債	100,000,000	99,066,000	
17回 ダイセル社債	300,000,000	287,799,000	
16回 武田薬品工業社債	500,000,000	469,180,000	
4回 ENEOSホールディン グス社債	300,000,000	287,040,000	
14回 プリヂストン社債	300,000,000	292,710,000	
35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	296,940,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	99,541,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	96,291,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	190,510,000	
58回 川崎重工業社債	300,000,000	280,974,000	
5回 三井住友トラスト・パナ ソニックファイナンス社債	100,000,000	98,196,000	
26回 トヨタ自動車社債	200,000,000	198,466,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	87,780,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	388,900,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社 債	100,000,000	104,465,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,166,000	
20回 三井住友信託銀行社債	300,000,000	296,835,000	
28回 芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,528,000	
17回 NTTファイナンス社 債	300,000,000	295,500,000	

18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	385,620,000	
69回 ホンダファイナンス社債	300,000,000	297,135,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,635,000	
96回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,154,000	
80回 日立キャピタル社債	200,000,000	192,150,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	285,456,000	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	97,536,000	
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,046,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	191,514,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	296,082,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	296,058,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	99,623,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	198,440,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	101,610,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	84,759,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	204,140,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	106,678,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,727,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	213,940,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	86,388,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	78,461,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,943,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,324,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	59,389,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,618,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	160,326,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	133,884,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,448,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	192,388,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	68,859,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	60,177,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	94,809,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	159,854,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,198,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	124,262,400	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	58,306,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	288,414,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	192,012,000	
12回 ソフトバンク社債	400,000,000	389,024,000	
30回 光通信社債	200,000,000	186,056,000	

5 2 7回	中部電力社債	100,000,000	87,743,000	
5 3 2回	中部電力社債	200,000,000	193,176,000	
5 0 8回	関西電力社債	300,000,000	297,870,000	
5 3 0回	関西電力社債	400,000,000	389,332,000	
5 3 1回	関西電力社債	200,000,000	163,880,000	
5 4 1回	関西電力社債	300,000,000	281,463,000	
3 9 6回	中国電力社債	200,000,000	189,238,000	
4 2 5回	中国電力社債	100,000,000	95,919,000	
3 0 7回	北陸電力社債	100,000,000	100,879,000	
3 1 1回	北陸電力社債	100,000,000	100,334,000	
4 8 8回	東北電力社債	100,000,000	99,200,000	
5 2 1回	東北電力社債	400,000,000	385,872,000	
5 2 5回	東北電力社債	200,000,000	196,658,000	
5 3 6回	東北電力社債	300,000,000	279,753,000	
3 2 0回	四国電力社債	300,000,000	282,855,000	
4 6 3回	九州電力社債	100,000,000	85,398,000	
4 6 6回	九州電力社債	100,000,000	84,220,000	
4 9 1回	九州電力社債	300,000,000	282,915,000	
4 9 2回	九州電力社債	100,000,000	78,638,000	
4 9 3回	九州電力社債	200,000,000	198,132,000	
5 0 7回	九州電力社債	200,000,000	189,614,000	
3 4 0回	北海道電力社債	300,000,000	298,074,000	
3 5 0回	北海道電力社債	200,000,000	170,354,000	
5 4回	電源開発社債	100,000,000	98,783,000	
7 5回	電源開発社債	200,000,000	187,168,000	
4 1回	東京瓦斯社債	200,000,000	175,784,000	
5 2回	東京瓦斯社債	100,000,000	82,039,000	
5 5回	東京瓦斯社債	100,000,000	78,735,000	
5 7回	東京瓦斯社債	300,000,000	169,176,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	197,334,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	174,280,000	
社債券 合計		23,020,000,000	21,834,630,400	
合計			542,851,149,343	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2024年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 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

(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 2024年1月12日 至 2024年7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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）

株式	78,281,793,799
合計	78,281,793,799

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2024年2月8日から2024年7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7月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年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)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	8,700	4,045.00	35,191,500	
ニッセイ	209,900	847.90	177,974,210	
マルハニチロ	31,100	3,181.00	98,929,100	
雪国まいたけ	17,900	1,019.00	18,240,100	
カネコ種苗	5,800	1,421.00	8,241,800	
サカタのタネ	23,900	3,470.00	82,933,000	
ホクト	16,800	1,835.00	30,828,000	
ホクリヨウ	1,200	997.00	1,196,400	
ショーボンドホールディングス	28,600	5,715.00	163,449,000	
ミライト・ワン	63,400	2,094.00	132,759,600	
タマホーム	13,200	3,865.00	51,018,000	
サンヨーホームズ	900	731.00	657,900	
日本アクア	3,000	911.00	2,733,000	
ファーストコーポレーション	2,000	767.00	1,534,000	

ベステラ	1,700	988.00	1,679,600
robot home	41,100	179.00	7,356,900
キャンディル	1,300	644.00	837,200
住石ホールディングス	26,700	1,309.00	34,950,300
日鉄鉱業	8,400	5,050.00	42,420,000
三井松島ホールディングス	12,500	5,600.00	70,000,000
INPEX	705,200	2,478.00	1,747,485,600
石油資源開発	24,300	6,420.00	156,006,000
K&Oエナジーグループ	9,500	3,560.00	33,820,000
リョーサン菱洋ホールディングス	29,800	3,090.00	92,082,000
ダイセキ環境ソリューション	1,400	1,051.00	1,471,400
第一カッター興業	6,000	1,623.00	9,738,000
明豊ファシリティワークス	2,600	865.00	2,249,000
安藤・間	121,600	1,189.00	144,582,400
東急建設	65,700	780.00	51,246,000
コムシスホールディングス	67,000	3,244.00	217,348,000
ビーアールホールディングス	30,800	361.00	11,118,800
高松コンストラクショングループ	15,600	3,030.00	47,268,000
東建コーポレーション	5,200	11,490.00	59,748,000
ソネック	900	949.00	854,100
ヤマウラ	10,700	1,326.00	14,188,200
オリエンタル白石	77,900	352.00	27,420,800
大成建設	134,600	6,250.00	841,250,000
大林組	525,300	1,998.00	1,049,549,400
清水建設	416,500	934.30	389,135,950
飛鳥建設	15,100	1,533.00	23,148,300
長谷工コーポレーション	134,800	1,793.00	241,696,400
松井建設	13,700	850.00	11,645,000
銭高組	800	4,210.00	3,368,000
鹿島建設	325,700	2,856.50	930,362,050
不動テトラ	10,200	2,474.00	25,234,800
大末建設	2,000	1,704.00	3,408,000
鉄建建設	10,500	2,575.00	27,037,500
西松建設	28,000	4,758.00	133,224,000
三井住友建設	109,400	392.00	42,884,800
大豊建設	5,000	3,500.00	17,500,000
佐田建設	3,200	791.00	2,531,200
ナカノフード建設	3,600	525.00	1,890,000
奥村組	23,800	5,110.00	121,618,000
東鉄工業	18,200	3,200.00	58,240,000
イチケン	1,300	2,579.00	3,352,700
富士ピー・エス	2,400	454.00	1,089,600
浅沼組	10,900	3,860.00	42,074,000
戸田建設	198,700	1,060.00	210,622,000
熊谷組	24,200	3,605.00	87,241,000
北野建設	900	3,680.00	3,312,000
植木組	1,400	1,643.00	2,300,200
矢作建設工業	20,000	1,654.00	33,080,000
ピーエス・コンストラクション	18,600	1,008.00	18,748,800
日本ハウスホールディングス	31,400	346.00	10,864,400

大東建託	54,100	16,960.00	917,536,000	
新日本建設	20,700	1,642.00	33,989,400	
サムティホールディングス	23,400	2,597.00	60,769,800	
東亜道路工業	29,300	1,300.00	38,090,000	
日本道路	17,200	1,831.00	31,493,200	
東亜建設工業	44,300	1,019.00	45,141,700	
日本国土開発	41,700	471.00	19,640,700	
若築建設	5,000	3,285.00	16,425,000	
東洋建設	37,000	1,480.00	54,760,000	
五洋建設	208,200	663.40	138,119,880	
世紀東急工業	18,800	1,762.00	33,125,600	
福田組	5,500	6,120.00	33,660,000	
日本ドライケミカル	1,200	2,740.00	3,288,000	
住友林業	127,000	5,423.00	688,721,000	
日本基礎技術	3,100	637.00	1,974,700	
巴コーポレーション	6,100	846.00	5,160,600	
大和ハウス工業	406,300	4,165.00	1,692,239,500	
ライト工業	27,100	2,155.00	58,400,500	
積水ハウス	445,400	3,679.00	1,638,626,600	
日特建設	14,000	1,143.00	16,002,000	
北陸電気工事	10,100	1,155.00	11,665,500	
ユアテック	32,300	1,479.00	47,771,700	
日本リーテック	11,500	1,255.00	14,432,500	
四電工	6,100	3,720.00	22,692,000	
中電工	22,700	3,280.00	74,456,000	
関電工	92,000	1,720.00	158,240,000	
きんでん	102,100	3,264.00	333,254,400	
東京エネシス	13,700	1,342.00	18,385,400	
トーエネック	4,800	5,030.00	24,144,000	
住友電設	13,900	4,025.00	55,947,500	
日本電設工業	27,600	1,967.00	54,289,200	
エクシオグループ	143,600	1,621.50	232,847,400	
新日本空調	9,500	4,095.00	38,902,500	
九電工	31,700	5,712.00	181,070,400	
三機工業	31,700	2,169.00	68,757,300	
日揮ホールディングス	145,300	1,269.00	184,385,700	
中外炉工業	4,800	3,315.00	15,912,000	
ヤマト	4,200	964.00	4,048,800	
太平電業	9,100	5,250.00	47,775,000	
高砂熱学工業	39,400	5,810.00	228,914,000	
三晃金属工業	700	4,480.00	3,136,000	
NEC ネットエスアイ	58,500	2,466.00	144,261,000	
朝日工業社	13,700	1,362.00	18,659,400	
明星工業	28,400	1,315.00	37,346,000	
大気社	16,900	5,250.00	88,725,000	
ダイダン	19,300	3,250.00	62,725,000	
日比谷総合設備	10,600	3,315.00	35,139,000	
ニッポン	44,200	2,314.00	102,278,800	
日清製粉グループ本社	136,400	1,841.00	251,112,400	
日東富士製粉	2,400	7,040.00	16,896,000	

昭和産業	14,300	3,145.00	44,973,500
鳥越製粉	4,400	692.00	3,044,800
中部飼料	20,500	1,559.00	31,959,500
フィード・ワン	21,600	930.00	20,088,000
東洋精糖	900	1,642.00	1,477,800
日本甜菜製糖	8,600	2,666.00	22,927,600
D M三井製糖ホールディングス	14,600	3,380.00	49,348,000
塩水港精糖	6,500	272.00	1,768,000
ウェルネオシュガー	7,400	2,358.00	17,449,200
L I F U L L	37,700	156.00	5,881,200
M I X I	33,000	3,040.00	100,320,000
ジェイエシーリクルートメント	55,600	702.00	39,031,200
日本M&Aセンターホールディングス	245,300	876.50	215,005,450
メンバーズ	5,200	920.00	4,784,000
中広	800	545.00	436,000
UTグループ	20,000	3,255.00	65,100,000
アイティメディア	5,800	1,945.00	11,281,000
ケアネット	31,400	552.00	17,332,800
E・Jホールディングス	9,000	1,832.00	16,488,000
オープンアップグループ	46,300	2,151.00	99,591,300
コシダカホールディングス	46,100	886.00	40,844,600
アルトナー	2,200	2,012.00	4,426,400
パソナグループ	18,700	2,007.00	37,530,900
C D S	1,300	1,781.00	2,315,300
リンクアンドモチベーション	44,300	503.00	22,282,900
エス・エム・エス	54,000	1,935.00	104,490,000
サニーサイドアップグループ	1,800	647.00	1,164,600
パーソルホールディングス	1,567,200	256.90	402,613,680
リニカル	3,400	426.00	1,448,400
クックパッド	42,100	206.00	8,672,600
エスクリ	2,300	284.00	653,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,600	788.00	2,048,800
森永製菓	62,300	2,618.50	163,132,550
中村屋	3,600	3,290.00	11,844,000
江崎グリコ	42,200	4,388.00	185,173,600
名糖産業	5,800	1,992.00	11,553,600
井村屋グループ	8,900	2,477.00	22,045,300
不二家	10,200	2,639.00	26,917,800
山崎製パン	98,700	3,347.00	330,348,900
第一屋製パン	900	642.00	577,800
モロゾフ	4,600	4,855.00	22,333,000
亀田製菓	8,400	4,230.00	35,532,000
寿スピリッツ	69,700	1,948.50	135,810,450
カルビー	67,500	3,092.00	208,710,000
森永乳業	51,500	3,459.00	178,138,500
六甲バター	10,900	1,519.00	16,557,100
ヤクルト本社	210,700	2,914.50	614,085,150
明治ホールディングス	180,800	3,638.00	657,750,400
雪印メグミルク	35,700	2,699.00	96,354,300
プリマハム	19,800	2,382.00	47,163,600

日本ハム	63,400	4,819.00	305,524,600
林兼産業	1,700	520.00	884,000
丸大食品	14,900	1,672.00	24,912,800
S Foods	16,300	2,896.00	47,204,800
柿安本店	5,700	2,609.00	14,871,300
伊藤ハム米久ホールディングス	22,500	4,265.00	95,962,500
学情	7,800	1,923.00	14,999,400
スタジオアリス	7,700	2,102.00	16,185,400
クロスキャット	9,500	1,344.00	12,768,000
エプロ	1,500	800.00	1,200,000
システナ	227,100	351.00	79,712,100
NJS	3,400	4,360.00	14,824,000
デジタルアーツ	9,500	4,845.00	46,027,500
日鉄ソリューションズ	51,200	2,893.00	148,121,600
総合警備保障	257,200	951.00	244,597,200
キューブシステム	8,000	1,155.00	9,240,000
いちご	149,700	414.00	61,975,800
日本駐車場開発	175,400	214.00	37,535,600
コア	6,600	1,964.00	12,962,400
カカクコム	99,900	2,140.50	213,835,950
アイロムグループ	6,200	2,766.00	17,149,200
セントケア・ホールディング	11,200	865.00	9,688,000
サイネックス	900	775.00	697,500
ルネサンス	12,000	1,021.00	12,252,000
ディップ	23,500	3,030.00	71,205,000
SBSホールディングス	13,300	2,590.00	34,447,000
デジタルホールディングス	8,000	1,055.00	8,440,000
新日本科学	14,000	1,324.00	18,536,000
キャリアデザインセンター	1,000	1,815.00	1,815,000
エムスリー	304,200	1,563.00	475,464,600
ツカダ・グローバルホールディング	3,300	492.00	1,623,600
プラス	700	728.00	509,600
ウェルネット	4,400	690.00	3,036,000
ワールドホールディングス	6,900	2,225.00	15,352,500
ディー・エヌ・エー	54,700	1,604.50	87,766,150
博報堂DYホールディングス	196,400	1,203.50	236,367,400
ぐるなび	28,700	315.00	9,040,500
タカミヤ	21,000	472.00	9,912,000
ファンコミュニケーションズ	21,800	414.00	9,025,200
ライク	5,700	1,547.00	8,817,900
AobaBBT	2,100	354.00	743,400
エスプール	44,300	323.00	14,308,900
WDBホールディングス	7,900	1,875.00	14,812,500
手間いらず	2,600	3,540.00	9,204,000
ティア	3,700	462.00	1,709,400
CDG	600	1,273.00	763,800
アドウェイズ	21,300	407.00	8,669,100
パリュコマース	13,500	1,222.00	16,497,000
インフォマート	159,900	326.00	52,127,400
サッポロホールディングス	48,500	6,100.00	295,850,000

アサヒグループホールディングス	340,700	5,776.00	1,967,883,200	
キリンホールディングス	614,200	2,159.50	1,326,364,900	
宝ホールディングス	99,600	1,120.00	111,552,000	
オエノンホールディングス	44,100	419.00	18,477,900	
養命酒製造	4,800	2,349.00	11,275,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	115,500	2,180.50	251,847,750	
ライフドリンク カンパニー	3,000	6,370.00	19,110,000	
サントリー食品インターナショナル	103,800	5,612.00	582,525,600	
ダイドーグループホールディングス	16,700	2,650.00	44,255,000	
伊藤園	49,900	3,505.00	174,899,500	
キーコーヒー	16,500	2,075.00	34,237,500	
ユニカフェ	1,800	923.00	1,661,400	
日清オイリオグループ	20,800	4,935.00	102,648,000	
不二製油グループ本社	34,300	3,043.00	104,374,900	
かどや製油	600	3,650.00	2,190,000	
J-オイルミルズ	16,900	1,939.00	32,769,100	
サンエー	12,100	4,970.00	60,137,000	
カワチ薬品	12,400	2,883.00	35,749,200	
エービーシー・マート	69,300	2,790.50	193,381,650	
ハードオフコーポレーション	6,300	2,272.00	14,313,600	
高千穂交易	5,600	4,040.00	22,624,000	
アスクル	38,300	2,122.00	81,272,600	
ゲオホールディングス	17,800	1,689.00	30,064,200	
アダストリア	19,100	3,150.00	60,165,000	
ジーフット	4,300	298.00	1,281,400	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	700	690.00	483,000	
オルパヘルスケアホールディングス	900	2,025.00	1,822,500	
伊藤忠食品	3,600	7,030.00	25,308,000	
くら寿司	18,600	3,900.00	72,540,000	
キャンドゥ	5,600	3,525.00	19,740,000	
エレマテック	14,100	2,107.00	29,708,700	
IKホールディングス	1,900	422.00	801,800	
パルグループホールディングス	31,100	1,663.00	51,719,300	
エディオン	62,800	1,666.00	104,624,800	
あらた	24,200	3,515.00	85,063,000	
サーラコーポレーション	33,300	819.00	27,272,700	
ワッツ	2,300	696.00	1,600,800	
トーメンデバイス	2,300	7,790.00	17,917,000	
ハローズ	7,200	4,375.00	31,500,000	
J Pホールディングス	39,400	562.00	22,142,800	
フジオフードグループ本社	17,800	1,412.00	25,133,600	
あみやき亭	3,900	5,890.00	22,971,000	
東京エレクトロン デバイス	15,800	4,310.00	68,098,000	
ひらまつ	12,600	208.00	2,620,800	
円谷フィールズホールディングス	25,600	1,729.00	44,262,400	
双日	176,400	3,896.00	687,254,400	
アルフレッサ ホールディングス	159,100	2,268.00	360,838,800	
大黒天物産	4,800	8,190.00	39,312,000	
ハニーズホールディングス	14,000	1,577.00	22,078,000	

ファーマライズホールディングス	1,300	626.00	813,800	
キッコーマン	488,600	1,975.00	964,985,000	
味の素	346,600	6,177.00	2,140,948,200	
ブルドックソース	7,800	2,014.00	15,709,200	
キューピー	79,300	3,729.00	295,709,700	
ハウス食品グループ本社	50,800	2,899.00	147,269,200	
カゴメ	63,400	3,437.00	217,905,800	
アリアケジャパン	14,700	5,270.00	77,469,000	
ピエトロ	800	1,797.00	1,437,600	
エバラ食品工業	3,500	2,918.00	10,213,000	
やまみ	700	3,330.00	2,331,000	
ニチレイ	67,500	3,474.00	234,495,000	
横浜冷凍	39,800	1,032.00	41,073,600	
東洋水産	74,600	9,978.00	744,358,800	
イートアンドホールディングス	7,000	2,066.00	14,462,000	
大冷	800	1,942.00	1,553,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,700	1,549.00	10,378,300	
日清食品ホールディングス	155,500	4,283.00	666,006,500	
永谷園ホールディングス	7,200	3,100.00	22,320,000	
一正蒲鉾	2,400	760.00	1,824,000	
フジッコ	15,200	1,863.00	28,317,600	
ロック・フィールド	18,000	1,488.00	26,784,000	
日本たばこ産業	896,100	4,439.00	3,977,787,900	
ケンコーマヨネーズ	10,200	2,045.00	20,859,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,900	2,543.00	25,175,700	
なとり	9,300	2,139.00	19,892,700	
イフジ産業	1,000	1,371.00	1,371,000	
ファーマフーズ	19,600	1,041.00	20,403,600	
北の達人コーポレーション	63,300	182.00	11,520,600	
ユーグレナ	91,800	523.00	48,011,400	
紀文食品	12,900	1,245.00	16,060,500	
ピクルスホールディングス	8,700	1,134.00	9,865,800	
スター・マイカ・ホールディングス	17,200	678.00	11,661,600	
SREホールディングス	6,300	4,900.00	30,870,000	
ADワークスグループ	12,400	229.00	2,839,600	
片倉工業	13,800	2,038.00	28,124,400	
グンゼ	10,700	5,560.00	59,492,000	
ヒューリック	344,000	1,452.50	499,660,000	
神栄	800	1,850.00	1,480,000	
ラサ商事	7,200	1,765.00	12,708,000	
アルペン	13,100	2,080.00	27,248,000	
ハブ	1,700	833.00	1,416,100	
ラクーンホールディングス	11,300	576.00	6,508,800	
クオールホールディングス	21,800	1,513.00	32,983,400	
アルコニックス	20,900	1,538.00	32,144,200	
神戸物産	122,600	3,612.00	442,831,200	
ソリトンシステムズ	7,800	1,275.00	9,945,000	
ジンズホールディングス	12,100	4,335.00	52,453,500	
ビックカメラ	94,800	1,556.00	147,508,800	
DCMホールディングス	82,000	1,409.00	115,538,000	

ペッパーフードサービス	39,000	141.00	5,499,000
ハイパー	1,100	313.00	344,300
Monotaro	224,600	2,092.50	469,975,500
東京一番フーズ	1,500	517.00	775,500
DDグループ	3,400	1,198.00	4,073,200
あいホールディングス	25,300	2,383.00	60,289,900
ディービーエックス	1,500	1,002.00	1,503,000
きちりホールディングス	1,500	885.00	1,327,500
J.フロントリテイリング	181,800	2,012.50	365,872,500
ドトール・日レスホールディングス	28,100	2,168.00	60,920,800
マツキヨココカラ&カンパニー	288,200	2,384.50	687,212,900
ブロンコビリー	9,300	3,775.00	35,107,500
ZOZO	101,000	4,394.00	443,794,000
トレジャー・ファクトリー	9,800	2,109.00	20,668,200
物語コーポレーション	26,500	3,610.00	95,665,000
三越伊勢丹ホールディングス	262,300	3,624.00	950,575,200
東洋紡	64,800	1,045.00	67,716,000
ユニチカ	48,500	299.00	14,501,500
富士紡ホールディングス	6,500	4,795.00	31,167,500
日清紡ホールディングス	113,700	1,094.50	124,444,650
倉敷紡績	10,600	4,740.00	50,244,000
ダイワボウホールディングス	70,100	2,950.00	206,795,000
シキボウ	8,900	1,139.00	10,137,100
日東紡績	19,000	6,700.00	127,300,000
トヨタ紡織	63,100	2,170.50	136,958,550
マクニカホールディングス	37,500	6,680.00	250,500,000
Hamee	6,400	1,210.00	7,744,000
マーケットエンタープライズ	500	942.00	471,000
ラクト・ジャパン	6,100	2,778.00	16,945,800
ウエルシアホールディングス	82,200	1,915.00	157,413,000
クリエイトSDホールディングス	22,400	3,315.00	74,256,000
グリムス	6,600	2,391.00	15,780,600
パイタルケーエスケー・ホールディングス	24,000	1,309.00	31,416,000
八洲電機	12,900	1,773.00	22,871,700
メディアスホールディングス	9,300	891.00	8,286,300
レスター	13,400	3,185.00	42,679,000
ジオリーブグループ	1,300	1,205.00	1,566,500
丸善CHIホールディングス	6,400	343.00	2,195,200
大光	2,800	609.00	1,705,200
OCHIホールディングス	1,300	1,469.00	1,909,700
TOKAIホールディングス	86,000	982.00	84,452,000
黒谷	1,600	723.00	1,156,800
ミサワ	1,100	630.00	693,000
ティーライフ	700	1,418.00	992,600
Cominix	1,100	904.00	994,400
エー・ピーホールディングス	1,300	950.00	1,235,000
三洋貿易	16,200	1,571.00	25,450,200
チムニー	1,700	1,326.00	2,254,200
シュッピン	14,300	1,519.00	21,721,700

ビューティガレージ	5,000	1,540.00	7,700,000
オイシックス・ラ・大地	21,400	1,272.00	27,220,800
ウイン・パートナーズ	10,300	1,239.00	12,761,700
ネクステージ	36,200	2,157.00	78,083,400
ジョイフル本田	44,000	2,166.00	95,304,000
エターナルホスピタリティグループ	5,800	3,815.00	22,127,000
ホットランド	12,200	2,428.00	29,621,600
すかいらーくホールディングス	216,600	2,122.00	459,625,200
SFPホールディングス	7,600	2,125.00	16,150,000
綿半ホールディングス	12,300	1,732.00	21,303,600
日本毛織	38,500	1,320.00	50,820,000
ダイトウボウ	8,200	105.00	861,000
トーア紡コーポレーション	1,800	425.00	765,000
ダイドーリミテッド	6,200	1,023.00	6,342,600
ヨシックスホールディングス	3,700	2,987.00	11,051,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,300	862.00	38,186,600
野村不動産ホールディングス	82,100	4,133.00	339,319,300
三重交通グループホールディングス	31,600	558.00	17,632,800
ディア・ライフ	25,100	989.00	24,823,900
コーセーアールイー	1,600	724.00	1,158,400
地主	11,300	2,737.00	30,928,100
プレサンスコーポレーション	19,500	1,947.00	37,966,500
フィル・カンパニー	2,300	734.00	1,688,200
THEグローバル社	3,400	503.00	1,710,200
ハウスコム	800	1,036.00	828,800
JPMC	8,500	1,215.00	10,327,500
サンセイランディック	1,500	1,001.00	1,501,500
エストラスト	600	753.00	451,800
フージャースホールディングス	22,600	1,135.00	25,651,000
オープンハウスグループ	54,100	5,331.00	288,407,100
東急不動産ホールディングス	443,500	1,082.50	480,088,750
飯田グループホールディングス	141,300	2,119.50	299,485,350
イーグランド	700	1,569.00	1,098,300
ムゲンエステート	3,300	1,334.00	4,402,200
帝国繊維	17,000	2,428.00	41,276,000
日本コークス工業	152,200	118.00	17,959,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,100	541.00	3,841,100
ミタチ産業	1,500	1,183.00	1,774,500
B E E N O S	9,400	2,297.00	21,591,800
あさひ	14,600	1,500.00	21,900,000
日本調剤	10,400	1,497.00	15,568,800
コスモス薬品	13,400	12,655.00	169,577,000
シップヘルスケアホールディングス	57,000	2,259.50	128,791,500
トーエル	2,500	809.00	2,022,500
ソフトクリエイティブホールディングス	12,400	1,906.00	23,634,400
セブン&アイ・ホールディングス	1,622,300	1,940.00	3,147,262,000
クリエイティブ・レストランツ・ホールディングス	107,300	1,090.00	116,957,000
明治電機工業	5,900	1,840.00	10,856,000

ツルハホールディングス	33,300	9,120.00	303,696,000	
デリカフーズホールディングス	2,400	572.00	1,372,800	
スターティアホールディングス	1,400	2,129.00	2,980,600	
サンマルクホールディングス	12,800	2,156.00	27,596,800	
フェリシモ	1,200	944.00	1,132,800	
トリドールホールディングス	44,400	3,850.00	170,940,000	
帝人	144,100	1,336.50	192,589,650	
東レ	1,005,100	774.10	778,047,910	
クラレ	218,600	1,890.00	413,154,000	
旭化成	1,014,900	1,071.50	1,087,465,350	
T O K Y O B A S E	16,900	283.00	4,782,700	
稲葉製作所	8,600	1,868.00	16,064,800	
宮地エンジニアリンググループ	7,700	4,895.00	37,691,500	
トーカロ	44,600	2,033.00	90,671,800	
アルファ	1,900	1,375.00	2,612,500	
S U M C O	274,600	2,643.50	725,905,100	
川田テクノロジーズ	11,000	2,755.00	30,305,000	
R S T e c h n o l o g i e s	10,400	3,495.00	36,348,000	
ジェイテックコーポレーション	900	1,640.00	1,476,000	
信和	3,400	759.00	2,580,600	
ビーロット	3,400	936.00	3,182,400	
ファーストブラザーズ	900	1,157.00	1,041,300	
A n d D o ホールディングス	8,900	1,087.00	9,674,300	
シーアールイー	6,600	1,670.00	11,022,000	
ケイアイスター不動産	7,100	3,465.00	24,601,500	
アグレ都市デザイン	900	1,580.00	1,422,000	
グッドコムアセット	13,600	838.00	11,396,800	
ジェイ・エス・ビー	7,300	3,100.00	22,630,000	
ロードスターキャピタル	9,600	2,799.00	26,870,400	
テンポイノベーション	1,600	910.00	1,456,000	
グローバル・リンク・マネジメント	1,000	2,128.00	2,128,000	
フェイスネットワーク	1,400	1,880.00	2,632,000	
霞ヶ関キャピタル	6,000	14,800.00	88,800,000	
住江織物	1,100	2,440.00	2,684,000	
日本フェルト	2,800	499.00	1,397,200	
イチカワ	700	1,717.00	1,201,900	
エコナックホールディングス	4,800	130.00	624,000	
日東製網	500	1,487.00	743,500	
芦森工業	1,000	2,407.00	2,407,000	
アツギ	3,600	589.00	2,120,400	
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,124.00	1,236,400	
J Mホールディングス	12,000	2,851.00	34,212,000	
コメダホールディングス	38,800	2,588.00	100,414,400	
サツドラホールディングス	2,200	805.00	1,771,000	
アレンザホールディングス	12,000	1,111.00	13,332,000	
串カツ田中ホールディングス	4,300	1,712.00	7,361,600	
バロックジャパンリミテッド	12,300	797.00	9,803,100	
クスリのアオキホールディングス	47,700	2,977.00	142,002,900	
ダイニック	1,600	810.00	1,296,000	
共和レザー	3,000	800.00	2,400,000	

ピーバンドットコム	800	378.00	302,400	
力の源ホールディングス	9,100	1,481.00	13,477,100	
FOOD & LIFE COMPANIES	84,500	2,633.00	222,488,500	
アセンテック	6,100	612.00	3,733,200	
セーレン	29,000	2,377.00	68,933,000	
ソトー	1,600	737.00	1,179,200	
東海染工	500	846.00	423,000	
小松マテール	21,800	749.00	16,328,200	
ワコールホールディングス	28,000	4,500.00	126,000,000	
ホギメディカル	19,800	4,185.00	82,863,000	
クラウドシアホールディングス	1,300	411.00	534,300	
T S Iホールディングス	45,000	925.00	41,625,000	
マツオカコーポレーション	1,600	1,705.00	2,728,000	
ワールド	21,200	2,337.00	49,544,400	
T I S	158,800	3,145.00	499,426,000	
テクミラホールディングス	2,300	400.00	920,000	
グリー	50,200	553.00	27,760,600	
G M Oペパボ	1,900	1,500.00	2,850,000	
コーエーテクモホールディングス	94,000	1,455.00	136,770,000	
三菱総合研究所	7,300	5,260.00	38,398,000	
ボルテージ	1,500	258.00	387,000	
電算	600	1,499.00	899,400	
A G S	2,100	1,014.00	2,129,400	
ファインデックス	11,900	1,087.00	12,935,300	
ブレインパッド	12,500	1,023.00	12,787,500	
K L a b	27,600	230.00	6,348,000	
ポルトゥウィンホールディングス	25,700	489.00	12,567,300	
ネクソン	329,600	3,320.00	1,094,272,000	
アイスタイル	50,100	463.00	23,196,300	
エムアップホールディングス	18,400	1,332.00	24,508,800	
エイチーム	10,000	746.00	7,460,000	
エニグモ	19,200	341.00	6,547,200	
テクノスジャパン	4,400	761.00	3,348,400	
e n i s h	5,100	263.00	1,341,300	
コロブラ	51,000	648.00	33,048,000	
オルトプラス	4,800	132.00	633,600	
ブロードリーフ	71,300	599.00	42,708,700	
クロス・マーケティンググループ	2,400	595.00	1,428,000	
デジタルハーツホールディングス	9,400	1,125.00	10,575,000	
メディアドゥ	6,800	1,461.00	9,934,800	
じげん	43,800	573.00	25,097,400	
バイキューブ	18,000	262.00	4,716,000	
エンカレッジ・テクノロジー	1,300	643.00	835,900	
サイバーリンクス	2,000	815.00	1,630,000	
ディー・エル・イー	3,600	157.00	565,200	
フィクスターズ	15,000	1,884.00	28,260,000	
C A R T A H O L D I N G S	7,100	1,506.00	10,692,600	
オブティム	15,500	668.00	10,354,000	
セレス	6,000	1,585.00	9,510,000	

SHIFT	10,000	11,255.00	112,550,000
特種東海製紙	8,200	3,720.00	30,504,000
ティーガイア	15,700	3,105.00	48,748,500
セック	2,100	4,585.00	9,628,500
テクマトリックス	27,400	1,997.00	54,717,800
プロシップ	7,200	1,443.00	10,389,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,100	2,921.00	114,211,100
GMOペイメントゲートウェイ	34,300	8,948.00	306,916,400
ザッパラス	1,200	427.00	512,400
システムリサーチ	10,300	1,619.00	16,675,700
インターネットイニシアティブ	71,800	2,560.00	183,808,000
さくらインターネット	16,800	4,010.00	67,368,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,500	2,975.00	13,387,500
SRAホールディングス	7,700	4,430.00	34,111,000
システムインテグレータ	1,500	366.00	549,000
朝日ネット	16,100	684.00	11,012,400
eBASE	21,200	714.00	15,136,800
アバントグループ	19,000	1,413.00	26,847,000
アドソル日進	6,300	1,955.00	12,316,500
ODKソリューションズ	1,100	587.00	645,700
フリービット	6,500	1,345.00	8,742,500
コムチュア	21,700	1,854.00	40,231,800
アステリア	11,800	556.00	6,560,800
アイル	8,400	2,536.00	21,302,400
王子ホールディングス	624,600	625.80	390,874,680
日本製紙	84,600	959.00	81,131,400
三菱製紙	6,700	745.00	4,991,500
北越コーポレーション	73,800	1,068.00	78,818,400
中越パルプ工業	2,000	1,482.00	2,964,000
巴川コーポレーション	1,400	1,008.00	1,411,200
大王製紙	66,200	900.70	59,626,340
阿波製紙	1,400	539.00	754,600
マークラインズ	8,100	2,921.00	23,660,100
メディカル・データ・ビジョン	17,900	568.00	10,167,200
gumi	24,400	340.00	8,296,000
ショーケース	1,200	302.00	362,400
モバイルファクトリー	1,100	642.00	706,200
テラスカイ	6,500	2,012.00	13,078,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,915.00	14,937,000
PCIホールディングス	2,100	965.00	2,026,500
アイビーシー	800	537.00	429,600
ネオジャパン	5,000	1,809.00	9,045,000
PR TIMES	3,100	1,871.00	5,800,100
ラクス	71,000	1,902.50	135,077,500
ランドコンピュータ	2,500	811.00	2,027,500
ダブルスタンダード	4,500	1,770.00	7,965,000
オープンドア	8,800	658.00	5,790,400

マイネット	1,600	328.00	524,800
アカツキ	7,300	2,552.00	18,629,600
ベネフィットジャパン	300	1,266.00	379,800
Ubicomホールディングス	4,700	1,437.00	6,753,900
カナミックネットワーク	18,800	546.00	10,264,800
ノムラシステムコーポレーション	5,400	145.00	783,000
レンゴー	136,500	1,012.00	138,138,000
トーモク	8,600	2,732.00	23,495,200
ザ・パック	11,200	3,935.00	44,072,000
チェンジホールディングス	32,700	1,240.00	40,548,000
シンクロ・フード	3,200	522.00	1,670,400
オークネット	5,500	2,758.00	15,169,000
キャピタル・アセット・プランニング	1,000	842.00	842,000
セグエグループ	4,500	627.00	2,821,500
エイトレッド	800	1,644.00	1,315,200
マクロミル	29,500	869.00	25,635,500
ビーグリー	1,100	1,201.00	1,321,100
オロ	5,400	2,594.00	14,007,600
ユーザーローカル	6,300	2,063.00	12,996,900
テモナ	1,200	208.00	249,600
ニーズウェル	5,600	382.00	2,139,200
マネーフォワード	33,600	5,276.00	177,273,600
サインポスト	2,000	605.00	1,210,000
レゾナック・ホールディングス	145,000	3,870.00	561,150,000
住友化学	1,113,300	375.10	417,598,830
住友精化	7,000	5,460.00	38,220,000
日産化学	70,000	5,040.00	352,800,000
ラサ工業	5,700	3,215.00	18,325,500
クレハ	32,800	2,870.00	94,136,000
多木化学	5,800	4,370.00	25,346,000
テイカ	12,300	1,623.00	19,962,900
石原産業	24,800	1,633.00	40,498,400
片倉コープアグリ	1,200	1,186.00	1,423,200
日本曹達	17,700	5,380.00	95,226,000
東ソー	200,200	2,076.50	415,715,300
トクヤマ	48,400	3,014.00	145,877,600
セントラル硝子	16,000	3,830.00	61,280,000
東亜合成	72,100	1,544.00	111,322,400
大阪ソーダ	10,500	10,760.00	112,980,000
関東電化工業	29,000	981.00	28,449,000
SUNASTERISK	10,700	841.00	8,998,700
デンカ	54,600	2,167.00	118,318,200
イビデン	78,900	6,881.00	542,910,900
信越化学工業	1,345,200	6,715.00	9,033,018,000
日本カーバイド工業	7,100	2,082.00	14,782,200
プラスアルファ・コンサルティング	18,900	1,812.00	34,246,800
電算システムホールディングス	6,600	2,780.00	18,348,000
堺化学工業	11,500	3,015.00	34,672,500
第一稀元素化学工業	16,400	869.00	14,251,600
エア・ウォーター	141,500	2,188.50	309,672,750

日本酸素ホールディングス	145,500	5,069.00	737,539,500	
日本化学工業	5,500	2,830.00	15,565,000	
東邦アセチレン	5,400	370.00	1,998,000	
日本パーカライジング	66,800	1,309.00	87,441,200	
高压ガス工業	22,000	1,008.00	22,176,000	
チタン工業	600	1,026.00	615,600	
四国化成ホールディングス	16,900	2,261.00	38,210,900	
戸田工業	3,500	2,106.00	7,371,000	
ステラ ケミファ	8,100	4,325.00	35,032,500	
保土谷化学工業	4,700	5,410.00	25,427,000	
日本触媒	87,300	1,636.50	142,866,450	
大日精化工業	10,500	3,270.00	34,335,000	
カネカ	37,000	4,354.00	161,098,000	
協和キリン	181,400	3,101.00	562,521,400	
A P P I E R G R O U P	51,400	1,188.00	61,063,200	
三菱瓦斯化学	109,500	3,132.00	342,954,000	
三井化学	123,700	4,424.00	547,248,800	
東京応化工業	71,600	4,563.00	326,710,800	
大阪有機化学工業	12,600	4,055.00	51,093,000	
三菱ケミカルグループ	1,096,700	924.20	1,013,570,140	
K H ネオケム	22,800	2,268.00	51,710,400	
ピジョンナル	17,600	7,620.00	134,112,000	
ダイセル	186,100	1,540.00	286,594,000	
住友ベークライト	42,000	4,635.00	194,670,000	
積水化学工業	298,700	2,250.00	672,075,000	
日本ゼオン	102,800	1,407.50	144,691,000	
アイカ工業	37,900	3,543.00	134,279,700	
U B E	71,400	2,819.00	201,276,600	
積水樹脂	22,300	2,520.00	56,196,000	
タキロンシーアイ	38,300	765.00	29,299,500	
旭有機材	10,000	5,240.00	52,400,000	
ニチバン	8,200	1,904.00	15,612,800	
リケンテクノス	28,100	1,023.00	28,746,300	
大倉工業	7,000	2,937.00	20,559,000	
積水化成成品工業	21,200	459.00	9,730,800	
群栄化学工業	3,600	3,280.00	11,808,000	
タイガースポリマー	2,300	900.00	2,070,000	
ミライアル	1,700	1,515.00	2,575,500	
ダイキアクシス	2,000	726.00	1,452,000	
ダイキョーニシカワ	33,100	697.00	23,070,700	
竹本容器	1,900	836.00	1,588,400	
森六ホールディングス	7,800	2,752.00	21,465,600	
恵和	10,800	1,794.00	19,375,200	
日本化薬	114,600	1,278.50	146,516,100	
カーリット	16,200	1,476.00	23,911,200	
ソルクシーズ	4,300	317.00	1,363,100	
C L ホールディングス	3,700	1,683.00	6,227,100	
プレステージ・インターナショナル	72,100	710.00	51,191,000	
フェイス	1,200	444.00	532,800	
プロトコーポレーション	16,400	1,435.00	23,534,000	

ハイマックス	4,500	1,404.00	6,318,000
アミューズ	9,300	1,607.00	14,945,100
野村総合研究所	325,300	4,651.00	1,512,970,300
ドリームインキュベータ	5,200	2,342.00	12,178,400
クイック	10,700	2,197.00	23,507,900
T A C	2,300	182.00	418,600
C Eホールディングス	2,400	559.00	1,341,600
日本システム技術	12,600	1,719.00	21,659,400
電通グループ	151,300	4,095.00	619,573,500
インテージホールディングス	17,000	1,536.00	26,112,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,600	1,003.00	6,619,800
東邦システムサイエンス	6,300	1,737.00	10,943,100
ぴあ	5,100	3,045.00	15,529,500
イオンファンタジー	5,500	2,161.00	11,885,500
ソースネクスト	68,700	212.00	14,564,400
シーティーエス	19,600	821.00	16,091,600
N E X Y Z . G r o u p	1,600	701.00	1,121,600
インフォコム	19,400	6,040.00	117,176,000
メディカルシステムネットワーク	17,200	578.00	9,941,600
日本精化	10,000	3,020.00	30,200,000
扶桑化学工業	15,900	4,045.00	64,315,500
トリケミカル研究所	18,200	4,350.00	79,170,000
シンプレクス・ホールディングス	22,800	2,680.00	61,104,000
H E R O Z	5,900	1,237.00	7,298,300
ラクスル	36,300	973.00	35,319,900
メルカリ	73,300	2,324.00	170,349,200
I P S	4,400	2,362.00	10,392,800
F I G	5,800	345.00	2,001,000
システムサポート	5,800	1,975.00	11,455,000
A D E K A	52,300	3,278.00	171,439,400
日油	135,900	2,291.50	311,414,850
ミヨシ油脂	1,900	1,534.00	2,914,600
新日本理化	6,900	213.00	1,469,700
ハリマ化成グループ	10,600	956.00	10,133,600
イーソル	10,900	910.00	9,919,000
東海ソフト	800	1,300.00	1,040,000
ウイングアーク1 s t	15,600	2,625.00	40,950,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,000	965.00	4,825,000
サーバーワークス	3,100	3,265.00	10,121,500
東名	500	2,410.00	1,205,000
ヴィッツ	500	783.00	391,500
トピラシステムズ	1,500	793.00	1,189,500
S a n s a n	49,300	1,730.00	85,289,000
L i n k - Uグループ	1,000	576.00	576,000
ギフトィ	13,200	1,023.00	13,503,600
花王	339,200	6,772.00	2,297,062,400
第一工業製薬	6,000	3,720.00	22,320,000
石原ケミカル	6,600	2,344.00	15,470,400
日華化学	2,100	1,028.00	2,158,800

ニイタカ	1,000	1,887.00	1,887,000	
三洋化成工業	9,200	4,100.00	37,720,000	
メドレー	20,200	3,890.00	78,578,000	
ベース	5,200	2,860.00	14,872,000	
J M D C	25,600	3,370.00	86,272,000	
武田薬品工業	1,329,400	4,312.00	5,732,372,800	
アステラス製薬	1,317,500	1,662.00	2,189,685,000	
住友ファーマ	111,300	408.00	45,410,400	
塩野義製薬	182,700	6,690.00	1,222,263,000	
わかもと製薬	5,300	239.00	1,266,700	
日本新薬	39,400	3,544.00	139,633,600	
中外製薬	470,200	6,354.00	2,987,650,800	
科研製薬	25,700	4,012.00	103,108,400	
エーザイ	182,700	6,926.00	1,265,380,200	
理研ビタミン	12,800	2,740.00	35,072,000	
ロート製薬	145,500	3,415.00	496,882,500	
小野薬品工業	307,200	2,231.50	685,516,800	
久光製薬	33,400	3,931.00	131,295,400	
有機合成薬品工業	4,200	303.00	1,272,600	
持田製薬	16,800	3,325.00	55,860,000	
参天製薬	265,000	1,792.00	474,880,000	
扶桑薬品工業	5,300	2,351.00	12,460,300	
日本ケミファ	600	1,582.00	949,200	
ツムラ	47,300	4,192.00	198,281,600	
テルモ	834,900	2,779.50	2,320,604,550	
H . U . グループホールディングス	45,000	2,420.50	108,922,500	
キッセイ薬品工業	24,800	3,250.00	80,600,000	
生化学工業	25,400	898.00	22,809,200	
栄研化学	25,900	2,333.00	60,424,700	
鳥居薬品	8,100	3,730.00	30,213,000	
J C R ファーマ	50,800	621.00	31,546,800	
東和薬品	23,000	3,085.00	70,955,000	
富士製薬工業	11,100	1,533.00	17,016,300	
ゼリア新薬工業	20,900	2,145.00	44,830,500	
ネクセラファーマ	65,800	1,655.00	108,899,000	
第一三共	1,308,500	6,027.00	7,886,329,500	
杏林製薬	32,500	1,714.00	55,705,000	
大幸薬品	31,300	458.00	14,335,400	
ダイト	11,500	2,288.00	26,312,000	
大塚ホールディングス	312,500	7,199.00	2,249,687,500	
ペプチドリーム	72,800	2,744.00	199,763,200	
大日本塗料	16,600	1,291.00	21,430,600	
日本ペイントホールディングス	796,700	1,027.00	818,210,900	
関西ペイント	129,600	2,562.00	332,035,200	
神東塗料	4,600	134.00	616,400	
中国塗料	30,800	2,136.00	65,788,800	
日本特殊塗料	3,600	1,221.00	4,395,600	
藤倉化成	17,300	538.00	9,307,400	
太陽ホールディングス	26,100	3,395.00	88,609,500	
D I C	58,500	3,025.00	176,962,500	

サカティンクス	33,300	1,819.00	60,572,700
artience	29,800	3,330.00	99,234,000
アルプス技研	14,600	2,588.00	37,784,800
サニックス	24,600	313.00	7,699,800
日本空調サービス	16,500	1,046.00	17,259,000
オリエンタルランド	814,700	4,576.00	3,728,067,200
フォーカスシステムズ	10,000	1,221.00	12,210,000
ダスキン	33,600	3,733.00	125,428,800
パーク24	95,800	1,602.00	153,471,600
明光ネットワークジャパン	18,700	764.00	14,286,800
ファルコホールディングス	6,800	2,368.00	16,102,400
クレスコ	24,600	1,386.00	34,095,600
フジ・メディア・ホールディングス	144,300	1,868.00	269,552,400
秀英予備校	1,200	302.00	362,400
田谷	1,000	386.00	386,000
ラウンドワン	145,100	822.00	119,272,200
リゾートトラスト	66,800	2,392.00	159,785,600
オービック	50,200	21,375.00	1,073,025,000
ジャストシステム	21,600	3,130.00	67,608,000
TDCソフト	28,200	1,255.00	35,391,000
LINEヤフー	2,138,600	404.00	863,994,400
ピー・エム・エル	18,900	2,998.00	56,662,200
トレンドマイクロ	71,000	7,141.00	507,011,000
IDホールディングス	10,100	1,444.00	14,584,400
リソー教育	78,700	250.00	19,675,000
日本オラクル	28,800	11,630.00	334,944,000
早稲田アカデミー	8,500	1,653.00	14,050,500
アルファシステムズ	4,000	3,145.00	12,580,000
フューチャー	32,000	1,536.00	49,152,000
CAC Holdings	8,000	1,942.00	15,536,000
トーセ	1,400	686.00	960,400
ユー・エス・エス	345,500	1,376.50	475,580,750
オービックビジネスコンサルタント	21,200	7,101.00	150,541,200
アイティフォー	19,200	1,493.00	28,665,600
東京個別指導学院	18,400	410.00	7,544,000
東計電算	4,200	4,375.00	18,375,000
サイバーエージェント	340,200	950.90	323,496,180
楽天グループ	1,321,000	909.60	1,201,581,600
エクスネット	700	1,431.00	1,001,700
クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,536.00	11,827,200
SBIグローバルアセットマネジメント	30,200	667.00	20,143,400
テー・オー・ダブリュー	30,300	356.00	10,786,800
大塚商会	149,000	3,272.00	487,528,000
サイボウズ	20,700	1,844.00	38,170,800
山田コンサルティンググループ	6,700	2,200.00	14,740,000
セントラルスポーツ	5,600	2,493.00	13,960,800
パラカ	4,600	2,072.00	9,531,200
電通総研	18,300	5,040.00	92,232,000
ACCESS	15,600	1,317.00	20,545,200

デジタルガレージ	24,000	2,576.00	61,824,000
イーエムシステムズ	25,000	610.00	15,250,000
ウェザーニューズ	4,600	5,440.00	25,024,000
C I J	37,400	486.00	18,176,400
ビジネスエンジニアリング	3,200	4,005.00	12,816,000
日本エンタープライズ	5,000	137.00	685,000
WOWOW	11,400	1,115.00	12,711,000
スカラ	13,700	669.00	9,165,300
インテリジェント ウェイブ	2,700	1,120.00	3,024,000
フルキャストホールディングス	14,700	1,523.00	22,388,100
エン・ジャパン	25,000	2,609.00	65,225,000
セルソース	5,500	1,356.00	7,458,000
あすか製薬ホールディングス	15,400	2,400.00	36,960,000
サワイグループホールディングス	34,300	6,699.00	229,775,700
富士フイルムホールディングス	836,000	3,909.00	3,267,924,000
コニカミノルタ	337,800	466.10	157,448,580
資生堂	313,600	4,603.00	1,443,500,800
ライオン	191,100	1,290.50	246,614,550
高砂香料工業	11,300	3,795.00	42,883,500
マンダム	32,400	1,226.00	39,722,400
ミルボン	20,400	3,387.00	69,094,800
ファンケル	65,800	2,720.00	178,976,000
コーセー	30,600	10,350.00	316,710,000
コタ	15,200	1,634.00	24,836,800
シーボン	700	1,394.00	975,800
ポーラ・オルビスホールディングス	77,000	1,365.00	105,105,000
ノエビアホールディングス	13,300	5,870.00	78,071,000
アジュバンホールディングス	1,200	878.00	1,053,600
新日本製薬	8,600	1,738.00	14,946,800
I - n e	4,000	1,690.00	6,760,000
アクシージア	9,900	1,067.00	10,563,300
エステー	11,600	1,579.00	18,316,400
アグロ カネショウ	6,000	1,213.00	7,278,000
コニシ	43,400	1,260.00	54,684,000
長谷川香料	28,700	3,255.00	93,418,500
小林製薬	43,700	5,630.00	246,031,000
荒川化学工業	12,900	1,241.00	16,008,900
メック	12,400	4,400.00	54,560,000
日本高純度化学	3,400	3,435.00	11,679,000
タカラバイオ	40,400	1,152.00	46,540,800
J C U	16,600	4,015.00	66,649,000
新田ゼラチン	3,500	767.00	2,684,500
O A T アグリオ	5,500	1,790.00	9,845,000
デクセリアルズ	37,100	8,054.00	298,803,400
アース製薬	13,600	4,945.00	67,252,000
北興化学工業	15,100	1,579.00	23,842,900
大成ラミック	4,300	2,832.00	12,177,600
クミアイ化学工業	59,600	804.00	47,918,400
日本農薬	27,500	741.00	20,377,500
富士興産	1,500	1,742.00	2,613,000

ニチレキ	19,600	2,338.00	45,824,800
ユシロ化学工業	7,800	1,913.00	14,921,400
ビーピー・カストロール	2,000	950.00	1,900,000
富士石油	43,800	481.00	21,067,800
MORESCO	1,900	1,361.00	2,585,900
出光興産	779,800	1,028.50	802,024,300
ENEOSホールディングス	2,378,100	829.30	1,972,158,330
コスモエネルギーホールディングス	44,500	8,012.00	356,534,000
ANYCOLOR	21,300	2,482.00	52,866,600
テスホールディングス	31,600	410.00	12,956,000
インフロニア・ホールディングス	169,400	1,285.00	217,679,000
横浜ゴム	75,900	3,386.00	256,997,400
TOYO TIRE	86,300	2,577.00	222,395,100
ブリヂストン	439,700	6,322.00	2,779,783,400
住友ゴム工業	147,300	1,611.00	237,300,300
藤倉コンポジット	13,000	1,382.00	17,966,000
オカモト	7,100	4,970.00	35,287,000
アキレス	9,500	1,577.00	14,981,500
フコク	7,900	2,235.00	17,656,500
ニッタ	15,200	4,105.00	62,396,000
クリエートメディック	1,600	943.00	1,508,800
住友理工	23,300	1,507.00	35,113,100
三ツ星ベルト	17,400	4,555.00	79,257,000
バンドー化学	22,200	1,989.00	44,155,800
AGC	134,000	5,300.00	710,200,000
日本板硝子	71,700	420.00	30,114,000
石塚硝子	900	2,835.00	2,551,500
有沢製作所	26,300	1,689.00	44,420,700
日本山村硝子	1,900	1,556.00	2,956,400
日本電気硝子	61,300	3,716.00	227,790,800
オハラ	7,100	1,373.00	9,748,300
住友大阪セメント	25,000	4,216.00	105,400,000
太平洋セメント	86,000	4,070.00	350,020,000
リソルホールディングス	500	4,695.00	2,347,500
日本ヒューム	13,200	1,348.00	17,793,600
日本コンクリート工業	29,200	394.00	11,504,800
三谷セキサン	6,300	5,670.00	35,721,000
アジアパイルホールディングス	21,400	996.00	21,314,400
東海カーボン	138,500	948.50	131,367,250
日本カーボン	8,000	5,230.00	41,840,000
東洋炭素	10,600	7,290.00	77,274,000
ノリタケカンパニーリミテド	16,600	4,250.00	70,550,000
TOTO	99,100	4,060.00	402,346,000
日本碍子	174,700	2,126.00	371,412,200
日本特殊陶業	125,800	4,890.00	615,162,000
ダントーホールディングス	3,400	564.00	1,917,600
MARUWA	5,500	40,950.00	225,225,000
品川リフラクトリーズ	18,500	1,950.00	36,075,000
黒崎播磨	12,300	2,727.00	33,542,100
ヨータイ	9,300	1,828.00	17,000,400

東京窯業	5,400	440.00	2,376,000	
ニッカトー	2,400	565.00	1,356,000	
フジインコーポレーテッド	40,300	3,155.00	127,146,500	
クニミネ工業	1,500	1,100.00	1,650,000	
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,361.00	1,497,100	
ニチアス	38,000	4,825.00	183,350,000	
日本製鉄	700,300	3,468.00	2,428,640,400	
神戸製鋼所	310,800	1,989.50	618,336,600	
中山製鋼所	35,400	945.00	33,453,000	
合同製鐵	8,600	5,080.00	43,688,000	
J F Eホールディングス	429,800	2,351.00	1,010,459,800	
東京製鐵	43,500	1,588.00	69,078,000	
共英製鋼	17,600	2,126.00	37,417,600	
大和工業	29,200	8,010.00	233,892,000	
東京鐵鋼	6,800	5,000.00	34,000,000	
大阪製鐵	7,100	2,514.00	17,849,400	
淀川製鋼所	16,000	5,670.00	90,720,000	
中部鋼鈹	10,200	2,714.00	27,682,800	
丸一鋼管	47,100	3,791.00	178,556,100	
モリ工業	3,600	5,640.00	20,304,000	
大同特殊鋼	97,300	1,453.50	141,425,550	
日本高周波鋼業	2,000	484.00	968,000	
日本冶金工業	11,300	5,350.00	60,455,000	
山陽特殊製鋼	15,300	2,098.00	32,099,400	
愛知製鋼	8,900	3,495.00	31,105,500	
日本金属	1,400	781.00	1,093,400	
ミガロホールディングス	1,400	1,990.00	2,786,000	
大平洋金属	13,200	1,288.00	17,001,600	
新日本電工	76,900	295.00	22,685,500	
栗本鐵工所	7,100	4,765.00	33,831,500	
虹 技	700	1,150.00	805,000	
日本鑄鉄管	600	1,826.00	1,095,600	
日本製鋼所	41,600	4,438.00	184,620,800	
三菱製鋼	11,500	1,493.00	17,169,500	
日亜鋼業	5,700	320.00	1,824,000	
日本精線	12,500	1,238.00	15,475,000	
エンビプロ・ホールディングス	13,700	474.00	6,493,800	
大紀アルミニウム工業所	19,700	1,259.00	24,802,300	
日本輕金属ホールディングス	45,300	1,802.00	81,630,600	
三井金属鈹業	45,000	5,411.00	243,495,000	
東邦亜鉛	10,000	826.00	8,260,000	
三菱マテリアル	110,400	3,048.00	336,499,200	
住友金属鈹山	179,200	5,263.00	943,129,600	
D O W Aホールディングス	38,200	5,854.00	223,622,800	
古河機械金属	20,400	1,849.00	37,719,600	
エス・サイエンス	32,600	23.00	749,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,800	2,713.00	72,708,400	
東邦チタニウム	31,900	1,486.00	47,403,400	
U A C J	21,700	3,890.00	84,413,000	
C Kサンエツ	2,800	3,665.00	10,262,000	

古河電気工業	51,400	4,252.00	218,552,800
住友電気工業	578,000	2,524.00	1,458,872,000
フジクラ	182,200	3,397.00	618,933,400
S W C C	17,300	4,655.00	80,531,500
タツタ電線	27,600	728.00	20,092,800
カナレ電気	900	1,572.00	1,414,800
平河ヒューテック	9,900	1,451.00	14,364,900
いよぎんホールディングス	175,500	1,528.00	268,164,000
しずおかフィナンシャルグループ	324,900	1,490.50	484,263,450
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	124,200	1,642.50	203,998,500
楽天銀行	68,400	3,025.00	206,910,000
京都フィナンシャルグループ	185,700	2,898.00	538,158,600
リョービ	16,400	2,247.00	36,850,800
アーレスティ	5,600	797.00	4,463,200
A R E ホールディングス	58,000	2,078.00	120,524,000
東洋製罐グループホールディングス	88,600	2,474.00	219,196,400
ホッカインホールディングス	7,500	1,746.00	13,095,000
コロナ	8,600	962.00	8,273,200
横河ブリッジホールディングス	24,100	2,793.00	67,311,300
駒井ハルテック	900	1,809.00	1,628,100
高田機工	400	3,675.00	1,470,000
三和ホールディングス	153,900	3,102.00	477,397,800
文化シャッター	40,400	1,760.00	71,104,000
三協立山	19,500	813.00	15,853,500
アルインコ	11,800	1,090.00	12,862,000
東洋シャッター	1,200	925.00	1,110,000
L I X I L	241,300	1,785.50	430,841,150
日本フィルコン	3,400	535.00	1,819,000
ノーリツ	24,400	1,829.00	44,627,600
長府製作所	15,300	2,200.00	33,660,000
リンナイ	74,000	3,703.00	274,022,000
ユニプレス	26,900	1,388.00	37,337,200
ダイニチ工業	2,600	683.00	1,775,800
日東精工	22,400	689.00	15,433,600
三洋工業	600	3,295.00	1,977,000
岡部	27,600	788.00	21,748,800
ジーテクト	19,700	1,909.00	37,607,300
東プレ	27,200	2,210.00	60,112,000
高周波熱錬	22,800	1,132.00	25,809,600
東京製綱	10,000	1,324.00	13,240,000
サンコール	15,600	488.00	7,612,800
モリテックスチール	4,700	225.00	1,057,500
パイオラックス	19,200	2,453.00	47,097,600
エイチワン	16,000	1,111.00	17,776,000
日本発条	136,700	1,716.50	234,645,550
中央発条	11,500	1,232.00	14,168,000
アドバネクス	600	1,105.00	663,000
三浦工業	63,200	3,619.00	228,720,800
タクマ	51,100	1,744.00	89,118,400
テクノプロ・ホールディングス	90,200	2,724.50	245,749,900

アトラグループ	1,600	164.00	262,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	8,000	1,222.00	9,776,000	
Keeper 技研	9,500	3,850.00	36,575,000	
ファーストロジック	1,600	545.00	872,000	
三機サービス	900	1,092.00	982,800	
Gunosy	12,200	806.00	9,833,200	
デザインワン・ジャパン	1,600	163.00	260,800	
イー・ガーディアン	7,400	2,012.00	14,888,800	
リブセンス	2,400	221.00	530,400	
ジャパンマテリアル	47,200	2,213.00	104,453,600	
ベクトル	18,400	1,177.00	21,656,800	
ウチヤマホールディングス	2,300	346.00	795,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,900	1,538.00	19,840,200	
キャリアリンク	5,600	2,494.00	13,966,400	
IBJ	11,900	588.00	6,997,200	
アサンテ	7,600	1,738.00	13,208,800	
バリューHR	13,400	1,491.00	19,979,400	
M&Aキャピタルパートナーズ	12,500	2,252.00	28,150,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,100	1,042.00	6,356,200	
ERIホールディングス	1,500	2,110.00	3,165,000	
アビスト	800	3,315.00	2,652,000	
シグマクシス・ホールディングス	20,200	1,571.00	31,734,200	
ウィルグループ	12,900	1,016.00	13,106,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,400	145.00	928,000	
メドピア	12,300	601.00	7,392,300	
レアジョブ	1,000	410.00	410,000	
リクルートホールディングス	1,108,800	9,441.00	10,468,180,800	
エラン	20,400	926.00	18,890,400	
ツガミ	32,300	1,555.00	50,226,500	
オークマ	13,200	7,854.00	103,672,800	
芝浦機械	14,200	3,825.00	54,315,000	
アマダ	229,200	1,863.50	427,114,200	
アイダエンジニアリング	35,000	889.00	31,115,000	
FUJI	71,200	2,682.50	190,994,000	
牧野フライス製作所	16,700	7,030.00	117,401,000	
オーエスジー	66,600	1,930.00	128,538,000	
ダイジェット工業	500	847.00	423,500	
旭ダイヤモンド工業	34,900	966.00	33,713,400	
DMG森精機	103,400	4,191.00	433,349,400	
ソディック	36,800	741.00	27,268,800	
ディスコ	72,900	68,540.00	4,996,566,000	
日東工器	7,300	2,202.00	16,074,600	
日進工具	14,000	982.00	13,748,000	
パンチ工業	5,000	459.00	2,295,000	
富士ダイス	10,100	884.00	8,928,400	
土木管理総合試験所	2,500	321.00	802,500	
日本郵政	1,609,300	1,668.50	2,685,117,050	
ベルシステム24ホールディングス	16,500	1,491.00	24,601,500	

鎌倉新書	13,200	437.00	5,768,400
S M N	1,000	322.00	322,000
一蔵	700	580.00	406,000
グローバルキッズCOMPANY	1,000	686.00	686,000
エアトリ	11,300	1,324.00	14,961,200
アトラエ	11,700	861.00	10,073,700
ストライク	7,600	4,490.00	34,124,000
ソラスト	42,400	476.00	20,182,400
セラク	4,700	1,299.00	6,105,300
インソース	33,400	842.00	28,122,800
豊田自動織機	127,700	13,755.00	1,756,513,500
豊和工業	2,800	880.00	2,464,000
石川製作所	1,300	1,812.00	2,355,600
リケンNPR	16,400	2,850.00	46,740,000
東洋機械金属	4,100	739.00	3,029,900
津田駒工業	900	398.00	358,200
エンシュウ	1,200	718.00	861,600
島精機製作所	24,000	1,726.00	41,424,000
オプトラン	24,800	2,197.00	54,485,600
NCホールディングス	1,200	2,205.00	2,646,000
イワキ	10,100	3,015.00	30,451,500
フリー	14,200	1,077.00	15,293,400
ヤマシンフィルタ	36,000	422.00	15,192,000
日阪製作所	16,500	1,061.00	17,506,500
やまびこ	24,700	2,304.00	56,908,800
野村マイクロ・サイエンス	20,500	4,165.00	85,382,500
平田機工	7,200	6,700.00	48,240,000
PEGASUS	16,700	592.00	9,886,400
マルマエ	6,600	2,075.00	13,695,000
タツモ	9,100	3,585.00	32,623,500
ナブテスコ	94,900	2,816.00	267,238,400
三井海洋開発	19,200	2,886.00	55,411,200
レオン自動機	17,500	1,659.00	29,032,500
S M C	45,300	82,560.00	3,739,968,000
ホソカワミクロン	10,600	4,150.00	43,990,000
ユニオンツール	6,600	5,990.00	39,534,000
瑞光	10,900	1,064.00	11,597,600
オイレス工業	20,500	2,349.00	48,154,500
日精エー・エス・ピー機械	5,100	5,480.00	27,948,000
サトーホールディングス	21,600	2,209.00	47,714,400
技研製作所	14,200	1,934.00	27,462,800
日本エアータック	7,000	1,254.00	8,778,000
カワタ	1,600	886.00	1,417,600
日精樹脂工業	11,300	1,014.00	11,458,200
オカダアイヨン	1,700	2,390.00	4,063,000
ワイエイシイホールディングス	6,400	2,660.00	17,024,000
小松製作所	709,000	4,836.00	3,428,724,000
住友重機械工業	89,500	4,219.00	377,600,500
日立建機	60,200	4,518.00	271,983,600
日工	22,500	781.00	17,572,500

巴工業	5,900	4,710.00	27,789,000
井関農機	14,200	1,037.00	14,725,400
TOWA	16,800	11,170.00	187,656,000
丸山製作所	900	2,390.00	2,151,000
北川鉄工所	5,900	1,594.00	9,404,600
シンニッタン	6,700	232.00	1,554,400
ローツェ	7,900	34,500.00	272,550,000
タカキタ	1,800	475.00	855,000
クボタ	790,800	2,223.50	1,758,343,800
荏原実業	8,000	4,575.00	36,600,000
東洋エンジニアリング	21,600	838.00	18,100,800
三菱化工機	5,300	4,250.00	22,525,000
月島ホールディングス	20,500	1,478.00	30,299,000
帝国電機製作所	10,400	2,600.00	27,040,000
東京機械製作所	1,400	417.00	583,800
新東工業	30,600	1,136.00	34,761,600
澁谷工業	14,200	3,485.00	49,487,000
アイチコーポレーション	20,900	1,245.00	26,020,500
小森コーポレーション	37,200	1,354.00	50,368,800
鶴見製作所	11,600	4,195.00	48,662,000
日本ギア工業	1,900	580.00	1,102,000
酒井重工業	2,700	5,860.00	15,822,000
荏原製作所	310,500	2,437.50	756,843,750
石井鐵工所	600	3,100.00	1,860,000
西島製作所	13,100	3,155.00	41,330,500
北越工業	15,200	2,308.00	35,081,600
ダイキン工業	180,500	23,285.00	4,202,942,500
オルガノ	18,200	7,880.00	143,416,000
トーヨーカネツ	5,100	3,900.00	19,890,000
栗田工業	84,600	7,000.00	592,200,000
椿本チエイン	20,800	6,500.00	135,200,000
大同工業	2,300	927.00	2,132,100
日機装	34,800	1,195.00	41,586,000
木村化工機	11,600	727.00	8,433,200
レイズネクスト	21,300	1,890.00	40,257,000
アネスト岩田	23,300	1,597.00	37,210,100
ダイフク	255,300	2,985.50	762,198,150
サムコ	3,600	4,800.00	17,280,000
加藤製作所	2,600	1,286.00	3,343,600
油研工業	900	2,357.00	2,121,300
タダノ	87,000	1,165.50	101,398,500
フジテック	35,300	4,441.00	156,767,300
CKD	41,800	3,325.00	138,985,000
平和	44,700	2,090.00	93,423,000
理想科学工業	12,100	3,145.00	38,054,500
SANKYO	145,600	1,810.00	263,536,000
日本金銭機械	18,300	1,092.00	19,983,600
マースグループホールディングス	7,600	3,740.00	28,424,000
フクシマガリレイ	9,900	6,620.00	65,538,000
オーイズミ	2,000	355.00	710,000

ダイコク電機	7,400	3,875.00	28,675,000
竹内製作所	27,400	5,810.00	159,194,000
アマノ	42,900	4,179.00	179,279,100
JUKI	23,300	533.00	12,418,900
サンデン	7,600	183.00	1,390,800
ジャノメ	15,200	688.00	10,457,600
ブラザー工業	202,100	3,064.00	619,234,400
マックス	21,300	3,760.00	80,088,000
モリタホールディングス	26,300	1,792.00	47,129,600
グローリー	36,300	2,771.50	100,605,450
新晃工業	15,200	4,255.00	64,676,000
大和冷機工業	23,100	1,562.00	36,082,200
セガサミーホールディングス	135,100	2,501.50	337,952,650
T P R	19,200	2,541.00	48,787,200
ツバキ・ナカシマ	30,400	836.00	25,414,400
ホシザキ	89,300	4,880.00	435,784,000
大豊工業	13,200	792.00	10,454,400
日本精工	279,900	820.20	229,573,980
NTN	327,900	334.90	109,813,710
ジェイテクト	134,700	1,142.50	153,894,750
不二越	11,200	3,340.00	37,408,000
ミネベアミツミ	263,100	3,588.00	944,002,800
日本トムソン	41,100	634.00	26,057,400
THK	87,300	3,030.00	264,519,000
ユーシン精機	12,100	745.00	9,014,500
前澤給装工業	10,900	1,465.00	15,968,500
イーグル工業	16,700	1,866.00	31,162,200
前澤工業	3,200	1,562.00	4,998,400
P I L L A R	14,000	5,580.00	78,120,000
キッツ	50,600	1,140.00	57,684,000
日立製作所	3,634,500	3,779.00	13,734,775,500
三菱電機	1,656,800	2,839.50	4,704,483,600
富士電機	92,000	9,504.00	874,368,000
東洋電機製造	1,800	1,060.00	1,908,000
安川電機	164,300	5,633.00	925,501,900
シンフォニア テクノロジー	16,700	3,445.00	57,531,500
明電舎	28,100	3,630.00	102,003,000
オリジン	1,200	1,330.00	1,596,000
山洋電気	6,500	7,160.00	46,540,000
デンヨー	11,600	2,791.00	32,375,600
PHCホールディングス	28,300	1,139.00	32,233,700
KOKUSAI ELECTRIC	78,200	5,550.00	434,010,000
ソシオネクスト	110,000	4,024.00	442,640,000
ベイカレント・コンサルティング	113,100	3,623.00	409,761,300
Orchestra Holdings	3,400	1,173.00	3,988,200
アイモバイル	19,600	504.00	9,878,400
キャリアインデックス	1,700	196.00	333,200
MS - Japan	6,300	1,085.00	6,835,500
船場	1,100	1,239.00	1,362,900

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	49,800	2,636.00	131,272,800	
フルテック	800	1,131.00	904,800	
グリーンズ	1,900	2,030.00	3,857,000	
ツナググループ・ホールディングス	1,500	674.00	1,011,000	
GAMEWITH	2,200	248.00	545,600	
MS&Consulting	700	644.00	450,800	
エル・ティー・エス	1,800	2,122.00	3,819,600	
ミダックホールディングス	9,300	1,480.00	13,764,000	
キュービーネットホールディングス	8,900	1,330.00	11,837,000	
オープングループ	21,100	269.00	5,675,900	
三櫻工業	22,800	1,045.00	23,826,000	
マキタ	172,500	4,687.00	808,507,500	
東芝テック	19,400	3,600.00	69,840,000	
芝浦メカトロニクス	8,600	9,480.00	81,528,000	
マブチモーター	74,500	2,372.50	176,751,250	
ニデック	334,000	7,047.00	2,353,698,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,600	405.00	3,888,000	
トレックス・セミコンダクター	7,800	1,931.00	15,061,800	
東光高岳	9,100	2,023.00	18,409,300	
ダブル・スコープ	43,300	509.00	22,039,700	
宮越ホールディングス	6,700	2,354.00	15,771,800	
ダイヘン	14,300	8,580.00	122,694,000	
ヤーマン	29,400	827.00	24,313,800	
JVCケンウッド	119,300	889.00	106,057,700	
ミマキエンジニアリング	14,300	2,123.00	30,358,900	
I-PEX	10,500	2,263.00	23,761,500	
大崎電気工業	33,000	702.00	23,166,000	
オムロン	115,500	5,761.00	665,395,500	
日東工業	20,400	3,555.00	72,522,000	
IDEC	22,300	3,055.00	68,126,500	
正興電機製作所	1,700	1,399.00	2,378,300	
不二電機工業	1,200	1,158.00	1,389,600	
ジーエス・ユアサコーポレーション	59,000	2,950.50	174,079,500	
サクサ	1,200	2,614.00	3,136,800	
メルコホールディングス	4,700	3,405.00	16,003,500	
テクノメディカ	3,600	1,798.00	6,472,800	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,600	702.00	3,931,200	
日本電気	198,600	13,620.00	2,704,932,000	
富士通	1,391,900	2,667.50	3,712,893,250	
沖電気工業	68,300	1,063.00	72,602,900	
岩崎通信機	2,400	1,402.00	3,364,800	
電気興業	6,100	2,125.00	12,962,500	
サンケン電気	14,000	7,703.00	107,842,000	
ナカヨ	800	1,133.00	906,400	
アイホン	8,100	3,120.00	25,272,000	
ルネサスエレクトロニクス	942,900	3,382.00	3,188,887,800	
セイコーエプソン	194,100	2,688.00	521,740,800	
ワコム	106,300	815.00	86,634,500	

アルバック	33,100	10,885.00	360,293,500
アクセル	6,800	1,539.00	10,465,200
E I Z O	11,100	4,925.00	54,667,500
ジャパンディスプレイ	650,600	19.00	12,361,400
日本信号	34,400	1,036.00	35,638,400
京三製作所	31,500	684.00	21,546,000
能美防災	20,500	2,417.00	49,548,500
ホーチキ	11,300	2,309.00	26,091,700
星和電機	2,300	572.00	1,315,600
エレコム	36,200	1,674.00	60,598,800
パナソニック ホールディングス	1,786,800	1,354.00	2,419,327,200
シャープ	255,000	975.60	248,778,000
アンリツ	106,500	1,257.50	133,923,750
富士通ゼネラル	42,800	2,104.50	90,072,600
ソニーグループ	1,048,800	15,380.00	16,130,544,000
T D K	239,500	10,985.00	2,630,907,500
帝国通信工業	6,600	2,127.00	14,038,200
タムラ製作所	60,200	728.00	43,825,600
アルプスアルパイン	135,100	1,601.50	216,362,650
池上通信機	1,600	807.00	1,291,200
日本電波工業	18,100	1,509.00	27,312,900
鈴木	8,100	1,442.00	11,680,200
メイコー	15,000	7,380.00	110,700,000
日本トリム	3,400	3,510.00	11,934,000
フォスター電機	11,200	1,803.00	20,193,600
S M K	3,900	2,491.00	9,714,900
ヨコオ	13,300	2,078.00	27,637,400
ティアック	8,000	109.00	872,000
ホシデン	34,400	2,162.00	74,372,800
ヒロセ電機	22,300	19,235.00	428,940,500
日本航空電子工業	36,200	2,692.00	97,450,400
T O A	17,200	1,068.00	18,369,600
マクセル	33,300	1,881.00	62,637,300
古野電気	19,700	2,403.00	47,339,100
スミダコーポレーション	20,300	1,126.00	22,857,800
アイコム	5,800	3,185.00	18,473,000
リオン	6,200	2,838.00	17,595,600
横河電機	165,500	4,122.00	682,191,000
新電元工業	5,700	2,922.00	16,655,400
アズビル	103,000	4,576.00	471,328,000
東亜ディーケーケー	2,500	851.00	2,127,500
日本光電工業	128,600	2,317.50	298,030,500
チノー	6,200	2,503.00	15,518,600
共和電業	4,700	442.00	2,077,400
日本電子材料	9,200	3,960.00	36,432,000
堀場製作所	28,600	13,525.00	386,815,000
アドバンテスト	429,100	6,841.00	2,935,473,100
小野測器	2,100	660.00	1,386,000
エスベック	12,000	3,070.00	36,840,000
キーエンス	149,800	76,750.00	11,497,150,000

日置電機	7,000	7,470.00	52,290,000
シスメックス	387,800	2,565.00	994,707,000
日本マイクロニクス	26,900	7,250.00	195,025,000
メガチップス	11,900	4,315.00	51,348,500
OBARA GROUP	9,400	4,270.00	40,138,000
IMAGICA GROUP	14,900	550.00	8,195,000
澤藤電機	600	1,257.00	754,200
デンソー	1,235,700	2,593.50	3,204,787,950
原田工業	2,300	582.00	1,338,600
コーセル	16,000	1,236.00	19,776,000
イリソ電子工業	13,700	3,210.00	43,977,000
オブテックスグループ	27,500	1,791.00	49,252,500
千代田インテグレ	5,900	3,325.00	19,617,500
レーザーテック	68,600	34,210.00	2,346,806,000
スタンレー電気	95,900	2,922.50	280,267,750
ウシオ電機	66,200	2,190.50	145,011,100
岡谷電機産業	3,900	252.00	982,800
ヘリオス テクノ ホールディング	4,900	849.00	4,160,100
エノモト	1,400	1,558.00	2,181,200
日本セラミック	12,200	2,577.00	31,439,400
遠藤照明	2,300	1,534.00	3,528,200
古河電池	11,100	1,243.00	13,797,300
山一電機	13,400	3,395.00	45,493,000
図研	12,500	4,090.00	51,125,000
日本電子	37,500	7,038.00	263,925,000
カシオ計算機	108,100	1,223.00	132,206,300
ファナック	724,700	4,599.00	3,332,895,300
日本シイエムケイ	35,100	604.00	21,200,400
エンプラス	4,400	8,340.00	36,696,000
大真空	22,200	787.00	17,471,400
ローム	276,900	2,344.00	649,053,600
浜松ホトニクス	120,200	4,400.00	528,880,000
三井ハイテック	13,200	6,194.00	81,760,800
新光電気工業	53,000	5,690.00	301,570,000
京セラ	930,600	1,985.50	1,847,706,300
協栄産業	500	2,771.00	1,385,500
太陽誘電	72,900	4,769.00	347,660,100
村田製作所	1,337,700	3,697.00	4,945,476,900
双葉電子工業	28,900	651.00	18,813,900
日東電工	96,500	13,575.00	1,309,987,500
北陸電気工業	1,900	1,369.00	2,601,100
東海理化電機製作所	42,200	2,146.00	90,561,200
ニチコン	39,300	1,211.00	47,592,300
日本ケミコン	15,900	1,679.00	26,696,100
KOA	22,600	1,556.00	35,165,600
三井E&S	75,000	1,475.00	110,625,000
日立造船	133,400	1,083.00	144,472,200
三菱重工業	2,645,200	1,834.50	4,852,619,400
川崎重工業	122,200	5,943.00	726,234,600
IHI	112,600	5,505.00	619,863,000

名村造船所	41,900	2,371.00	99,344,900
サノヤホールディングス	7,300	220.00	1,606,000
スプリックス	1,600	808.00	1,292,800
マネジメントソリューションズ	6,600	1,358.00	8,962,800
プロレド・パートナーズ	3,800	571.00	2,169,800
and factory	1,500	328.00	492,000
テノ・ホールディングス	700	413.00	289,100
フロンティア・マネジメント	3,900	1,210.00	4,719,000
ピアラ	1,000	268.00	268,000
コプロ・ホールディングス	1,700	1,747.00	2,969,900
ギークス	700	475.00	332,500
アンビスホールディングス	32,900	2,123.00	69,846,700
カーブスホールディングス	42,000	759.00	31,878,000
フォーラムエンジニアリング	21,000	1,025.00	21,525,000
FAST FITNESS JAPAN	5,200	1,338.00	6,957,600
日本車輛製造	4,900	2,688.00	13,171,200
三菱ロジスネクスト	23,900	1,479.00	35,348,100
近畿車輛	700	1,844.00	1,290,800
一家ホールディングス	1,400	695.00	973,000
フルサト・マルカホールディングス	14,100	2,266.00	31,950,600
ヤマエグループホールディングス	13,900	2,442.00	33,943,800
ジャパクラフトホールディングス	4,300	145.00	623,500
FPG	52,600	2,384.00	125,398,400
島根銀行	1,500	552.00	828,000
じもとホールディングス	4,400	340.00	1,496,000
全国保証	38,600	5,995.00	231,407,000
めぶきフィナンシャルグループ	683,300	608.80	415,993,040
ジャパンインベストメントアドバイザー	23,900	1,647.00	39,363,300
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,900	4,600.00	86,940,000
九州フィナンシャルグループ	285,500	938.70	267,998,850
かんぽ生命保険	150,200	3,232.00	485,446,400
ゆうちょ銀行	1,620,900	1,532.50	2,484,029,250
あんしん保証	2,400	220.00	528,000
富山第一銀行	46,800	1,306.00	61,120,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	784,700	937.20	735,420,840
ジェイリース	9,900	1,342.00	13,285,800
西日本フィナンシャルホールディングス	82,600	2,026.00	167,347,600
イントラスト	1,900	823.00	1,563,700
日本モーゲージサービス	2,700	427.00	1,152,900
CASA	2,000	941.00	1,882,000
SBIアルヒ	14,100	904.00	12,746,400
プレミアグループ	24,900	2,114.00	52,638,600
日産自動車	1,970,500	561.60	1,106,632,800
いすゞ自動車	420,500	2,217.50	932,458,750
トヨタ自動車	7,960,800	3,284.00	26,143,267,200
日野自動車	225,300	430.10	96,901,530

三菱自動車工業	584,200	510.00	297,942,000
エフテック	3,500	641.00	2,243,500
レシップホールディングス	2,200	665.00	1,463,000
G M B	1,000	1,514.00	1,514,000
ファルテック	1,000	554.00	554,000
武蔵精密工業	36,600	1,984.00	72,614,400
日産車体	15,200	989.00	15,032,800
新明和工業	43,100	1,455.00	62,710,500
極東開発工業	24,700	2,558.00	63,182,600
トピー工業	12,200	2,406.00	29,353,200
ティラド	3,400	3,695.00	12,563,000
曙ブレーキ工業	91,400	168.00	15,355,200
タチエス	27,600	2,061.00	56,883,600
N O K	58,200	2,207.00	128,447,400
フタバ産業	40,100	870.00	34,887,000
カヤバ	14,100	5,270.00	74,307,000
市光工業	27,000	531.00	14,337,000
大同メタル工業	29,300	625.00	18,312,500
プレス工業	59,700	649.00	38,745,300
ミクニ	6,300	402.00	2,532,600
太平洋工業	34,300	1,550.00	53,165,000
河西工業	8,000	210.00	1,680,000
アイシン	115,500	5,503.00	635,596,500
マツダ	495,400	1,570.50	778,025,700
今仙電機製作所	3,300	619.00	2,042,700
本田技研工業	3,548,500	1,723.50	6,115,839,750
スズキ	1,100,300	1,954.00	2,149,986,200
S U B A R U	464,400	3,529.00	1,638,867,600
安永	2,200	582.00	1,280,400
ヤマハ発動機	647,200	1,596.00	1,032,931,200
小糸製作所	155,100	2,304.00	357,350,400
T B K	5,500	303.00	1,666,500
エクセディ	24,500	3,170.00	77,665,000
ミツバ	28,100	1,191.00	33,467,100
豊田合成	42,900	2,863.00	122,822,700
愛三工業	24,800	1,414.00	35,067,200
盟和産業	700	1,013.00	709,100
日本プラスト	4,400	426.00	1,874,400
ヨロズ	14,000	1,145.00	16,030,000
エフ・シー・シー	26,500	2,387.00	63,255,500
新家工業	1,100	5,400.00	5,940,000
シマノ	60,400	25,050.00	1,513,020,000
テイ・エス テック	53,300	1,966.00	104,787,800
三十三フィナンシャルグループ	13,200	2,069.00	27,310,800
第四北越フィナンシャルグループ	23,100	5,070.00	117,117,000
ひろぎんホールディングス	209,900	1,211.00	254,188,900
マーキュリアホールディングス	2,600	907.00	2,358,200
おきなわフィナンシャルグループ	12,600	2,535.00	31,941,000
ダイレクトマーケティングミックス	15,900	248.00	3,943,200
ポピンズ	2,300	1,229.00	2,826,700

LITALICO	12,000	1,658.00	19,896,000
コンフィデンス・インターワークス	500	1,819.00	909,500
十六フィナンシャルグループ	19,100	4,630.00	88,433,000
北國フィナンシャルホールディングス	14,400	5,240.00	75,456,000
ネットプロテクションズホールディングス	49,100	199.00	9,770,900
プロクレアホールディングス	16,900	1,868.00	31,569,200
F Pパートナー	3,900	3,095.00	12,070,500
あいちフィナンシャルグループ	30,300	2,613.00	79,173,900
ジャムコ	8,100	1,593.00	12,903,300
小野建	16,000	1,642.00	26,272,000
はるやまホールディングス	2,500	592.00	1,480,000
南陽	2,300	1,104.00	2,539,200
ノジマ	46,000	1,617.00	74,382,000
佐鳥電機	9,900	2,089.00	20,681,100
カップ・クリエイト	24,800	1,764.00	43,747,200
エコートレーディング	1,000	1,142.00	1,142,000
伯東	9,100	5,170.00	47,047,000
コンドーテック	12,200	1,375.00	16,775,000
中山福	3,100	374.00	1,159,400
ライトオン	4,000	374.00	1,496,000
ナガイレーベン	20,000	2,539.00	50,780,000
三菱食品	14,600	5,510.00	80,446,000
良品計画	188,700	2,712.00	511,754,400
パリミキホールディングス	6,600	435.00	2,871,000
松田産業	12,100	2,898.00	35,065,800
第一興商	61,300	1,690.50	103,627,650
メディバルホールディングス	161,100	2,606.50	419,907,150
アドヴァングループ	13,500	951.00	12,838,500
S P K	7,000	2,283.00	15,981,000
萩原電気ホールディングス	6,800	3,995.00	27,166,000
アルビス	5,100	2,695.00	13,744,500
アズワン	49,100	3,119.00	153,142,900
スズデン	5,400	1,983.00	10,708,200
尾家産業	1,300	2,034.00	2,644,200
シモジマ	10,700	1,359.00	14,541,300
ドウシシャ	14,600	2,242.00	32,733,200
小津産業	1,200	1,631.00	1,957,200
コナカ	6,200	274.00	1,698,800
高速	9,500	2,357.00	22,391,500
ハウス オブ ローゼ	700	1,580.00	1,106,000
G - 7ホールディングス	17,300	1,590.00	27,507,000
たけびし	5,900	2,364.00	13,947,600
イオン北海道	46,900	896.00	42,022,400
コジマ	30,700	973.00	29,871,100
ヒマラヤ	2,000	913.00	1,826,000
コーナン商事	19,500	4,125.00	80,437,500
ネットワンシステムズ	58,400	3,002.00	175,316,800
エコス	5,900	2,345.00	13,835,500
ワタミ	16,700	943.00	15,748,100

マルシェ	1,900	250.00	475,000	
リックス	3,600	3,180.00	11,448,000	
システムソフト	53,300	71.00	3,784,300	
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	320,100	3,954.00	1,265,675,400	
丸文	14,100	1,251.00	17,639,100	
西松屋チェーン	31,100	2,189.00	68,077,900	
ゼンショーホールディングス	80,700	6,133.00	494,933,100	
ハビネット	13,400	3,315.00	44,421,000	
幸楽苑ホールディングス	11,800	1,323.00	15,611,400	
ハークスレイ	1,600	796.00	1,273,600	
橋本総業ホールディングス	6,100	1,340.00	8,174,000	
日本ライフライン	42,400	1,169.00	49,565,600	
サイゼリヤ	23,400	5,620.00	131,508,000	
タカショー	13,800	582.00	8,031,600	
V Tホールディングス	61,200	509.00	31,150,800	
アルゴグラフィックス	13,700	4,785.00	65,554,500	
魚力	5,500	2,510.00	13,805,000	
I D O M	41,900	1,457.00	61,048,300	
日本エム・ディ・エム	12,000	672.00	8,064,000	
ポブラ	1,400	278.00	389,200	
フジ・コーポレーション	7,500	2,228.00	16,710,000	
ユナイテッドアローズ	18,600	2,171.00	40,380,600	
進和	9,700	2,823.00	27,383,100	
エスケイジャパン	1,300	827.00	1,075,100	
ダイトロン	6,200	2,977.00	18,457,400	
ハイデイ日高	23,500	2,751.00	64,648,500	
シークス	22,500	1,297.00	29,182,500	
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	3,100	127.00	393,700	
コロワイド	68,100	2,025.50	137,936,550	
田中商事	1,600	791.00	1,265,600	
オーハシテクニカ	8,300	1,825.00	15,147,500	
壱番屋	62,600	1,089.00	68,171,400	
白銅	4,500	2,865.00	12,892,500	
トップカルチャー	2,100	164.00	344,400	
P L A N T	1,200	1,474.00	1,768,800	
スギホールディングス	95,700	2,311.00	221,162,700	
ダイコー通産	600	1,214.00	728,400	
薬王堂ホールディングス	7,700	2,777.00	21,382,900	
島津製作所	198,900	4,289.00	853,082,100	
J M S	13,800	529.00	7,300,200	
クボテック	1,400	211.00	295,400	
長野計器	10,900	3,485.00	37,986,500	
ブイ・テクノロジー	7,900	3,300.00	26,070,000	
スター精密	27,800	2,140.00	59,492,000	
東京計器	11,500	3,735.00	42,952,500	
愛知時計電機	6,500	2,304.00	14,976,000	
インターアクション	9,000	1,679.00	15,111,000	
オーバル	4,400	467.00	2,054,800	

東京精密	30,700	13,490.00	414,143,000
マニー	59,900	2,052.00	122,914,800
ニコン	216,500	1,708.00	369,782,000
トプコン	72,800	1,850.00	134,680,000
オリンパス	857,400	2,698.50	2,313,693,900
理研計器	21,200	4,115.00	87,238,000
S C R E E Nホールディングス	51,200	16,295.00	834,304,000
キヤノン電子	16,500	2,299.00	37,933,500
タムロン	18,400	4,345.00	79,948,000
H O Y A	294,900	20,770.00	6,125,073,000
シード	3,100	567.00	1,757,700
ノーリツ鋼機	14,100	4,500.00	63,450,000
A & Dホロンホールディングス	21,900	3,370.00	73,803,000
朝日インテック	182,500	2,366.50	431,886,250
キヤノン	747,000	4,560.00	3,406,320,000
リコー	375,500	1,435.50	539,030,250
シチズン時計	137,700	1,093.00	150,506,100
リズム	1,100	3,725.00	4,097,500
大研医器	4,400	537.00	2,362,800
メニコン	51,500	1,333.00	68,649,500
シンシア	600	449.00	269,400
K Y O R I T S U	7,400	171.00	1,265,400
中本パックス	1,700	1,647.00	2,799,900
パラマウントベッドホールディングス	31,100	2,702.00	84,032,200
トランザクション	9,900	1,787.00	17,691,300
粧美堂	1,400	554.00	775,600
ニホンフラッシュ	14,100	920.00	12,972,000
前田工織	26,000	1,623.00	42,198,000
永大産業	6,100	246.00	1,500,600
アートネイチャー	13,500	818.00	11,043,000
フルヤ金属	14,100	4,695.00	66,199,500
バンダイナムコホールディングス	406,600	3,218.00	1,308,438,800
アイフィスジャパン	1,500	624.00	936,000
S H O E I	42,100	2,030.00	85,463,000
フランスベッドホールディングス	19,300	1,221.00	23,565,300
マーベラス	24,300	651.00	15,819,300
パイロットコーポレーション	21,100	4,456.00	94,021,600
萩原工業	10,000	1,551.00	15,510,000
エイベックス	25,500	1,453.00	37,051,500
フジシールインターナショナル	30,400	2,380.00	72,352,000
タカラトミー	68,100	3,177.00	216,353,700
広済堂ホールディングス	43,500	557.00	24,229,500
エステールホールディングス	1,200	652.00	782,400
レック	19,300	1,130.00	21,809,000
タカノ	2,000	888.00	1,776,000
三光合成	18,900	689.00	13,022,100
プロネクサス	15,600	1,298.00	20,248,800
ホクシン	4,000	120.00	480,000
ウッドワン	1,800	919.00	1,654,200
きもと	8,400	214.00	1,797,600

TOPPANホールディングス	178,500	4,617.00	824,134,500	
大日本印刷	155,200	5,510.00	855,152,000	
共同印刷	4,200	3,985.00	16,737,000	
NISSHA	25,600	2,039.00	52,198,400	
光村印刷	400	1,635.00	654,000	
藤森工業	11,900	4,375.00	52,062,500	
ヴィア・ホールディングス	8,200	133.00	1,090,600	
TAKARA & COMPANY	8,800	3,055.00	26,884,000	
前澤化成工業	9,700	1,905.00	18,478,500	
未来工業	5,300	3,875.00	20,537,500	
アシックス	510,400	2,527.00	1,289,780,800	
ツツミ	3,600	2,174.00	7,826,400	
ウェーブロックホールディングス	2,000	644.00	1,288,000	
JSP	10,600	2,316.00	24,549,600	
ニチハ	18,800	3,590.00	67,492,000	
ローランド	11,100	3,985.00	44,233,500	
エフピコ	28,400	2,427.50	68,941,000	
小松ウオール工業	6,100	3,335.00	20,343,500	
ヤマハ	94,400	3,700.00	349,280,000	
河合楽器製作所	4,500	3,215.00	14,467,500	
クリナップ	14,700	732.00	10,760,400	
ビジョン	95,300	1,484.50	141,472,850	
天馬	10,000	2,855.00	28,550,000	
キングジム	13,200	868.00	11,457,600	
象印マホービン	40,600	1,509.00	61,265,400	
リンテック	30,100	3,575.00	107,607,500	
信越ポリマー	32,400	1,575.00	51,030,000	
東リ	11,100	408.00	4,528,800	
イトーキ	28,600	1,619.00	46,303,400	
任天堂	945,600	9,100.00	8,604,960,000	
三菱鉛筆	21,300	2,711.00	57,744,300	
松風	6,700	4,930.00	33,031,000	
タカラスタANDARD	30,700	1,776.00	54,523,200	
コクヨ	61,300	2,639.50	161,801,350	
ナカパヤシ	16,200	552.00	8,942,400	
ニフコ	44,900	3,962.00	177,893,800	
立川ブラインド工業	7,000	1,344.00	9,408,000	
グローブライト	13,400	2,107.00	28,233,800	
オカムラ	45,100	2,222.00	100,212,200	
バルカー	12,600	3,715.00	46,809,000	
MUTOHホールディングス	700	2,432.00	1,702,400	
伊藤忠商事	1,065,200	8,100.00	8,628,120,000	
丸紅	1,314,400	3,039.00	3,994,461,600	
スクロール	23,500	1,045.00	24,557,500	
高島	3,600	1,011.00	3,639,600	
ヨンドシーホールディングス	15,000	1,930.00	28,950,000	
三陽商会	6,300	2,532.00	15,951,600	
長瀬産業	70,800	3,259.00	230,737,200	
ナイガイ	1,800	260.00	468,000	
蝶理	10,000	3,640.00	36,400,000	

豊田通商	416,400	3,249.00	1,352,883,600
オンワードホールディングス	88,400	573.00	50,653,200
三共生興	22,000	733.00	16,126,000
兼松	66,200	2,675.00	177,085,000
美津濃	14,900	7,570.00	112,793,000
ツカモトコーポレーション	800	1,260.00	1,008,000
ルックホールディングス	4,600	2,876.00	13,229,600
三井物産	2,373,400	3,765.00	8,935,851,000
日本紙パルプ商事	7,600	6,250.00	47,500,000
東京エレクトロン	317,000	38,050.00	12,061,850,000
カメイ	16,900	2,288.00	38,667,200
東都水産	300	6,840.00	2,052,000
OUGホールディングス	800	2,687.00	2,149,600
スターゼン	11,000	3,150.00	34,650,000
セイコーグループ	20,900	4,905.00	102,514,500
山善	48,100	1,469.00	70,658,900
椿本興業	9,900	2,151.00	21,294,900
住友商事	959,000	4,061.00	3,894,499,000
BIPROGY	49,100	4,537.00	222,766,700
内田洋行	6,400	7,990.00	51,136,000
三菱商事	3,042,500	3,369.00	10,250,182,500
第一実業	14,900	2,423.00	36,102,700
キャノンマーケティングジャパン	36,700	4,610.00	169,187,000
西華産業	6,200	4,185.00	25,947,000
佐藤商事	11,100	1,664.00	18,470,400
東京産業	14,500	731.00	10,599,500
ユアサ商事	12,400	5,450.00	67,580,000
神鋼商事	4,000	8,550.00	34,200,000
トルク	3,900	228.00	889,200
阪和興業	28,500	5,960.00	169,860,000
正栄食品工業	10,600	4,880.00	51,728,000
カナデン	11,900	1,659.00	19,742,100
RYODEN	12,800	2,860.00	36,608,000
ニプロ	124,800	1,291.50	161,179,200
岩谷産業	36,100	10,315.00	372,371,500
ナイス	1,700	1,921.00	3,265,700
ニチモウ	1,700	2,187.00	3,717,900
極東貿易	9,500	1,783.00	16,938,500
アステナホールディングス	29,800	542.00	16,151,600
三愛オブリ	37,000	2,137.00	79,069,000
稲畑産業	31,200	3,555.00	110,916,000
GSイレオス	8,500	2,267.00	19,269,500
明和産業	18,700	726.00	13,576,200
クワザワホールディングス	1,900	784.00	1,489,600
キムラタン	33,200	17.00	564,400
ゴールドウイン	26,600	9,000.00	239,400,000
ユニ・チャーム	312,900	5,275.00	1,650,547,500
デサント	25,800	3,840.00	99,072,000
キング	2,000	758.00	1,516,000
ワキタ	26,200	1,708.00	44,749,600

ヤマトインターナショナル	4,000	367.00	1,468,000	
東邦ホールディングス	42,800	4,367.00	186,907,600	
サンゲツ	36,500	2,944.00	107,456,000	
ミツウロコグループホールディングス	20,300	1,738.00	35,281,400	
シナネンホールディングス	4,400	4,595.00	20,218,000	
伊藤忠エネクス	39,300	1,513.00	59,460,900	
サンリオ	128,600	3,177.00	408,562,200	
サンワテクノス	8,000	2,274.00	18,192,000	
新光商事	21,200	945.00	20,034,000	
トーヨー	6,100	3,795.00	23,149,500	
三信電気	6,300	2,178.00	13,721,400	
東陽テクニカ	14,500	1,660.00	24,070,000	
モスフードサービス	23,200	3,520.00	81,664,000	
加賀電子	14,400	5,730.00	82,512,000	
三益半導体工業	13,900	3,690.00	51,291,000	
都築電気	7,900	2,459.00	19,426,100	
ソーダニッカ	15,100	1,196.00	18,059,600	
立花エレテック	10,500	3,150.00	33,075,000	
木曽路	23,900	2,603.00	62,211,700	
SRSホールディングス	26,100	1,330.00	34,713,000	
千趣会	29,300	308.00	9,024,400	
リテールパートナーズ	23,500	1,721.00	40,443,500	
上新電機	15,700	2,651.00	41,620,700	
日本瓦斯	83,900	2,393.00	200,772,700	
ロイヤルホールディングス	27,900	2,489.00	69,443,100	
東天紅	400	921.00	368,400	
いなげや	15,400	1,218.00	18,757,200	
チヨダ	15,100	1,006.00	15,190,600	
ライフコーポレーション	16,600	3,645.00	60,507,000	
リンガーハット	20,400	2,208.00	45,043,200	
MrMaxHD	20,000	681.00	13,620,000	
テナアライド	7,300	299.00	2,182,700	
AOKIホールディングス	34,000	1,336.00	45,424,000	
オークワ	22,800	906.00	20,656,800	
コメリ	24,400	3,575.00	87,230,000	
青山商事	33,800	1,527.00	51,612,600	
しまむら	37,200	7,241.00	269,365,200	
はせがわ	2,500	349.00	872,500	
高島屋	100,900	3,063.00	309,056,700	
松屋	26,900	1,181.00	31,768,900	
エイチ・ツー・オーリテイリング	70,100	2,666.00	186,886,600	
近鉄百貨店	6,800	2,265.00	15,402,000	
丸井グループ	105,200	2,367.00	249,008,400	
クレディセゾン	93,400	3,386.00	316,252,400	
アクシアルリテイリング	43,200	1,014.00	43,804,800	
井筒屋	2,500	461.00	1,152,500	
イオン	537,100	3,325.00	1,785,857,500	
イズミ	28,100	3,392.00	95,315,200	
フォーバル	6,200	1,633.00	10,124,600	
平和堂	26,500	2,396.00	63,494,000	

フジ	24,300	1,947.00	47,312,100
ヤオコー	18,800	9,180.00	172,584,000
ゼビオホールディングス	21,500	1,161.00	24,961,500
ケーズホールディングス	106,400	1,582.50	168,378,000
PALTA C	21,400	4,292.00	91,848,800
三谷産業	27,900	364.00	10,155,600
Olympicグループ	2,500	541.00	1,352,500
日産東京販売ホールディングス	7,900	513.00	4,052,700
あおぞら銀行	106,000	2,498.00	264,788,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,982,700	1,792.00	16,096,998,400
りそなホールディングス	1,705,800	1,066.00	1,818,382,800
三井住友トラスト・ホールディングス	525,200	3,835.00	2,014,142,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,032,900	11,065.00	11,429,038,500
千葉銀行	411,000	1,380.50	567,385,500
群馬銀行	286,100	1,015.50	290,534,550
武蔵野銀行	20,600	3,195.00	65,817,000
千葉興業銀行	31,300	1,058.00	33,115,400
筑波銀行	64,800	308.00	19,958,400
七十七銀行	42,900	4,410.00	189,189,000
秋田銀行	9,900	2,475.00	24,502,500
山形銀行	16,400	1,144.00	18,761,600
岩手銀行	9,300	2,710.00	25,203,000
東邦銀行	116,700	315.00	36,760,500
東北銀行	2,400	1,224.00	2,937,600
ふくおかフィナンシャルグループ	128,400	4,278.00	549,295,200
スルガ銀行	110,400	1,074.00	118,569,600
八十二銀行	316,500	1,045.00	330,742,500
山梨中央銀行	16,500	1,954.00	32,241,000
大垣共立銀行	28,100	2,211.00	62,129,100
福井銀行	13,200	2,116.00	27,931,200
清水銀行	5,900	1,601.00	9,445,900
富山銀行	900	1,757.00	1,581,300
滋賀銀行	24,500	4,080.00	99,960,000
南都銀行	22,100	3,525.00	77,902,500
百五銀行	138,600	669.00	92,723,400
紀陽銀行	52,800	1,906.00	100,636,800
ほくほくフィナンシャルグループ	91,300	2,007.50	183,284,750
山陰合同銀行	92,300	1,414.00	130,512,200
鳥取銀行	1,700	1,364.00	2,318,800
百十四銀行	14,400	3,190.00	45,936,000
四国銀行	21,700	1,162.00	25,215,400
阿波銀行	20,700	2,703.00	55,952,100
大分銀行	8,800	3,365.00	29,612,000
宮崎銀行	8,900	3,280.00	29,192,000
佐賀銀行	8,700	2,588.00	22,515,600
琉球銀行	31,300	1,227.00	38,405,100
セブン銀行	462,200	274.30	126,781,460
みずほフィナンシャルグループ	1,991,000	3,484.00	6,936,644,000
高知銀行	1,700	885.00	1,504,500
山口フィナンシャルグループ	144,600	1,801.00	260,424,600

芙蓉総合リース	13,500	12,160.00	164,160,000
みずほリース	123,500	1,131.00	139,678,500
東京センチュリー	110,200	1,509.50	166,346,900
SBIホールディングス	236,700	4,083.00	966,446,100
日本証券金融	54,200	1,627.00	88,183,400
アイフル	217,000	385.00	83,545,000
日本アジア投資	3,600	234.00	842,400
名古屋銀行	9,400	7,780.00	73,132,000
北洋銀行	223,500	520.00	116,220,000
大光銀行	1,600	1,588.00	2,540,800
愛媛銀行	19,900	1,238.00	24,636,200
トマト銀行	1,800	1,297.00	2,334,600
京葉銀行	60,600	833.00	50,479,800
栃木銀行	73,800	352.00	25,977,600
北日本銀行	4,800	2,684.00	12,883,200
東和銀行	27,100	692.00	18,753,200
福島銀行	5,100	269.00	1,371,900
大東銀行	2,200	765.00	1,683,000
リコーリース	13,900	5,300.00	73,670,000
イオンフィナンシャルサービス	84,600	1,302.50	110,191,500
アコム	263,300	425.80	112,113,140
ジャックス	15,700	4,650.00	73,005,000
オリエントコーポレーション	48,100	1,025.00	49,302,500
オリックス	884,600	3,697.00	3,270,366,200
三菱HCキャピタル	657,200	1,080.00	709,776,000
ジャフコグループ	43,900	1,970.00	86,483,000
九州リースサービス	2,000	1,102.00	2,204,000
トモニホールディングス	139,600	413.00	57,654,800
大和証券グループ本社	1,142,600	1,290.50	1,474,525,300
野村ホールディングス	2,480,400	965.20	2,394,082,080
岡三証券グループ	129,400	777.00	100,543,800
丸三証券	49,000	1,114.00	54,586,000
東洋証券	39,200	411.00	16,111,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	175,000	577.00	100,975,000
光世証券	1,200	590.00	708,000
水戸証券	43,500	568.00	24,708,000
いちよし証券	27,600	846.00	23,349,600
松井証券	72,500	845.00	61,262,500
SOMPOホールディングス	665,600	3,493.00	2,324,940,800
日本取引所グループ	380,300	3,906.00	1,485,451,800
マネックスグループ	144,500	701.00	101,294,500
極東証券	20,200	1,496.00	30,219,200
岩井コスモホールディングス	16,800	2,255.00	37,884,000
アイザワ証券グループ	21,300	2,822.00	60,108,600
フィデアホールディングス	15,200	1,621.00	24,639,200
池田泉州ホールディングス	204,400	387.00	79,102,800
アニコムホールディングス	50,100	684.00	34,268,400
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	990,700	3,862.00	3,826,083,400

マネーパートナーズグループ	5,100	246.00	1,254,600
スパークス・グループ	16,400	1,749.00	28,683,600
小林洋行	2,200	287.00	631,400
第一生命ホールディングス	693,500	4,735.00	3,283,722,500
東京海上ホールディングス	1,440,100	6,476.00	9,326,087,600
アドバンテッジリスクマネジメント	2,600	535.00	1,391,000
イー・ギャランティ	24,000	1,463.00	35,112,000
アサックス	2,100	812.00	1,705,200
NECキャピタルソリューション	7,200	4,205.00	30,276,000
T&Dホールディングス	396,000	3,023.00	1,197,108,000
アドバンスクリエイト	11,300	1,077.00	12,170,100
三井不動産	2,046,400	1,493.00	3,055,275,200
三菱地所	925,500	2,613.00	2,418,331,500
平和不動産	23,900	3,935.00	94,046,500
東京建物	128,800	2,675.50	344,604,400
京阪神ビルディング	27,600	1,764.00	48,686,400
住友不動産	213,300	4,896.00	1,044,316,800
太平洋興発	2,000	798.00	1,596,000
テーオーシー	26,300	724.00	19,041,200
レオパレス21	147,500	521.00	76,847,500
スターツコーポレーション	21,200	3,330.00	70,596,000
フジ住宅	18,600	799.00	14,861,400
空港施設	20,800	603.00	12,542,400
明和地所	9,500	970.00	9,215,000
ゴールドクレスト	12,100	2,674.00	32,355,400
リログループ	77,100	1,762.00	135,850,200
エスリード	6,900	4,710.00	32,499,000
日神グループホールディングス	23,700	595.00	14,101,500
日本エスコン	27,500	1,085.00	29,837,500
MIRARTHホールディングス	67,800	532.00	36,069,600
A V A N T I A	2,700	853.00	2,303,100
イオンモール	76,400	1,877.50	143,441,000
毎日コムネット	2,000	749.00	1,498,000
ファースト住建	2,100	1,076.00	2,259,600
ランド	818,100	8.00	6,544,800
カチタス	39,600	1,821.00	72,111,600
東祥	10,800	737.00	7,959,600
トーセイ	24,500	2,487.00	60,931,500
穴吹興産	1,200	2,098.00	2,517,600
サンフロンティア不動産	21,900	2,044.00	44,763,600
FJネクストホールディングス	15,500	1,306.00	20,243,000
インテリックス	1,200	588.00	705,600
ランドビジネス	1,900	236.00	448,400
サンネクスタグループ	1,700	988.00	1,679,600
グランディハウス	12,500	617.00	7,712,500
東武鉄道	164,500	2,680.00	440,860,000
相鉄ホールディングス	53,600	2,383.50	127,755,600
東急	419,900	1,735.00	728,526,500
京浜急行電鉄	185,300	1,187.50	220,043,750
小田急電鉄	247,700	1,557.00	385,668,900

京王電鉄	72,000	3,750.00	270,000,000
京成電鉄	96,600	5,235.00	505,701,000
富士急行	18,500	3,090.00	57,165,000
東日本旅客鉄道	825,400	2,710.50	2,237,246,700
西日本旅客鉄道	355,300	2,931.50	1,041,561,950
東海旅客鉄道	576,800	3,527.00	2,034,373,600
西武ホールディングス	181,100	2,284.50	413,722,950
鴻池運輸	25,500	2,404.00	61,302,000
西日本鉄道	39,900	2,479.50	98,932,050
ハマキョウレックス	12,800	4,595.00	58,816,000
サカイ引越センター	16,600	2,632.00	43,691,200
近鉄グループホールディングス	149,500	3,454.00	516,373,000
阪急阪神ホールディングス	199,300	4,300.00	856,990,000
南海電気鉄道	66,600	2,676.00	178,221,600
京阪ホールディングス	82,500	2,877.00	237,352,500
神戸電鉄	4,100	2,768.00	11,348,800
名古屋鉄道	154,200	1,778.00	274,167,600
山陽電気鉄道	11,300	2,045.00	23,108,500
アルプス物流	12,100	5,730.00	69,333,000
トランコム	4,400	6,180.00	27,192,000
ヤマトホールディングス	181,700	1,838.00	333,964,600
山九	36,100	5,441.00	196,420,100
日新	11,400	4,635.00	52,839,000
丸運	3,300	444.00	1,465,200
丸全昭和運輸	9,300	5,340.00	49,662,000
センコーグループホールディングス	79,000	1,113.00	87,927,000
トナミホールディングス	3,300	5,940.00	19,602,000
ニッコンホールディングス	46,100	3,618.00	166,789,800
日本石油輸送	600	3,015.00	1,809,000
福山通運	13,700	3,955.00	54,183,500
セイノーホールディングス	84,100	2,226.50	187,248,650
神奈川中央交通	4,100	3,190.00	13,079,000
A Z - C O M 丸和ホールディングス	38,300	1,195.00	45,768,500
C & F ロジホールディングス	14,400	5,730.00	82,512,000
日本郵船	387,300	4,782.00	1,852,068,600
商船三井	324,700	4,937.00	1,603,043,900
川崎汽船	360,200	2,493.00	897,978,600
N S コナインテッド海運	8,000	5,160.00	41,280,000
明海グループ	5,400	721.00	3,893,400
飯野海運	54,900	1,326.00	72,797,400
共栄タンカー	1,000	1,285.00	1,285,000
九州旅客鉄道	105,700	3,565.00	376,820,500
S G ホールディングス	251,000	1,444.50	362,569,500
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	50,700	7,366.00	373,456,200
I D & E ホールディングス	9,300	4,065.00	37,804,500
日本航空	367,200	2,576.50	946,090,800
A N A ホールディングス	406,900	3,021.00	1,229,244,900
ビーウィズ	3,200	1,900.00	6,080,000
パスコ	900	1,851.00	1,665,900

TREホールディングス	29,500	1,306.00	38,527,000	
人・夢・技術グループ	6,300	1,819.00	11,459,700	
西本Wismettacホールディングス	12,300	1,427.00	17,552,100	
シルバーライフ	4,300	962.00	4,136,600	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	2,685.00	1,074,000	
Genky DrugStores	13,800	2,749.00	37,936,200	
コア商事ホールディングス	11,100	724.00	8,036,400	
KPPグループホールディングス	41,000	765.00	31,365,000	
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,320.00	1,188,000	
ブックオフグループホールディングス	10,400	1,443.00	15,007,200	
ギフトホールディングス	6,700	2,548.00	17,071,600	
三菱倉庫	35,700	5,379.00	192,030,300	
三井倉庫ホールディングス	13,900	4,805.00	66,789,500	
住友倉庫	39,900	2,767.00	110,403,300	
澁澤倉庫	6,800	3,065.00	20,842,000	
ヤマタネ	7,000	3,365.00	23,555,000	
東陽倉庫	1,400	1,501.00	2,101,400	
乾汽船	17,500	1,166.00	20,405,000	
日本トランスシティ	30,200	1,007.00	30,411,400	
ケイヒン	900	2,107.00	1,896,300	
中央倉庫	8,000	1,299.00	10,392,000	
川西倉庫	1,000	1,203.00	1,203,000	
安田倉庫	10,200	1,607.00	16,391,400	
ファイズホールディングス	700	1,132.00	792,400	
NISSOホールディングス	13,300	847.00	11,265,100	
大栄環境	28,000	2,666.00	74,648,000	
日本管財ホールディングス	16,100	2,682.00	43,180,200	
東洋埠頭	1,500	1,362.00	2,043,000	
上組	69,000	3,399.00	234,531,000	
サンリツ	1,200	890.00	1,068,000	
キムラユニティー	2,400	1,647.00	3,952,800	
キューソー流通システム	7,600	1,782.00	13,543,200	
東海運	2,800	293.00	820,400	
エーアイティー	9,400	1,880.00	17,672,000	
内外トランスライン	6,000	2,760.00	16,560,000	
ショーエイコーポレーション	1,700	596.00	1,013,200	
日本コンセプト	5,400	1,824.00	9,849,600	
TBSホールディングス	75,500	4,397.00	331,973,500	
日本テレビホールディングス	133,000	2,458.00	326,914,000	
朝日放送グループホールディングス	14,200	682.00	9,684,400	
テレビ朝日ホールディングス	36,500	2,156.00	78,694,000	
スカパーJ SATホールディングス	116,700	886.00	103,396,200	
テレビ東京ホールディングス	10,800	3,750.00	40,500,000	
日本BS放送	1,900	924.00	1,755,600	
ビジョン	22,600	1,289.00	29,131,400	
スマートバリュー	1,500	383.00	574,500	
U-NEXT HOLDINGS	16,800	4,300.00	72,240,000	
ワイヤレスゲート	2,200	250.00	550,000	
日本通信	147,700	197.00	29,096,900	

ク Robbins	700	1,056.00	739,200	
日本電信電話	44,678,600	159.50	7,126,236,700	
KDDI	1,104,700	4,541.00	5,016,442,700	
ソフトバンク	2,397,300	2,068.00	4,957,616,400	
光通信	14,900	30,070.00	448,043,000	
エムティーアイ	10,300	920.00	9,476,000	
GMOインターネットグループ	55,000	2,551.00	140,305,000	
ファイバーゲート	8,000	1,182.00	9,456,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,700	232.00	394,400	
KADOKAWA	79,400	2,826.00	224,384,400	
学研ホールディングス	27,500	1,036.00	28,490,000	
ゼンリン	25,600	924.00	23,654,400	
昭文社ホールディングス	2,100	371.00	779,100	
インプレスホールディングス	4,900	162.00	793,800	
東京電力ホールディングス	1,350,000	829.70	1,120,095,000	
中部電力	551,900	1,884.50	1,040,055,550	
関西電力	578,300	2,668.50	1,543,193,550	
中国電力	260,100	1,027.50	267,252,750	
北陸電力	153,100	999.40	153,008,140	
東北電力	394,300	1,387.00	546,894,100	
四国電力	139,400	1,349.00	188,050,600	
九州電力	345,200	1,564.50	540,065,400	
北海道電力	144,700	1,121.50	162,281,050	
沖縄電力	38,400	1,073.00	41,203,200	
電源開発	122,900	2,498.00	307,004,200	
エフオン	11,100	400.00	4,440,000	
イーレックス	26,700	700.00	18,690,000	
レノバ	39,900	977.00	38,982,300	
東京瓦斯	291,600	3,435.00	1,001,646,000	
大阪瓦斯	298,500	3,408.00	1,017,288,000	
東邦瓦斯	64,900	3,882.00	251,941,800	
北海道瓦斯	8,900	3,245.00	28,880,500	
広島ガス	31,800	393.00	12,497,400	
西部ガスホールディングス	15,600	1,955.00	30,498,000	
静岡ガス	30,000	932.00	27,960,000	
メタウォーター	17,900	1,921.00	34,385,900	
M&A総研ホールディングス	16,400	3,705.00	60,762,000	
アイネット	9,100	2,041.00	18,573,100	
松竹	7,800	9,072.00	70,761,600	
東宝	83,600	4,526.00	378,373,600	
エイチ・アイ・エス	44,700	1,573.00	70,313,100	
東映	24,800	3,835.00	95,108,000	
ラックランド	7,000	2,166.00	15,162,000	
NTTデータグループ	392,700	2,382.00	935,411,400	
共立メンテナンス	48,400	2,975.00	143,990,000	
イチネンホールディングス	16,200	1,709.00	27,685,800	
建設技術研究所	7,900	5,070.00	40,053,000	
スペース	10,000	1,169.00	11,690,000	
アインホールディングス	21,900	5,423.00	118,763,700	

燦ホールディングス	14,400	1,165.00	16,776,000
ピー・シー・エー	8,600	2,302.00	19,797,200
スバル興業	5,300	2,989.00	15,841,700
東京テアトル	2,100	1,112.00	2,335,200
タナベコンサルティンググループ	5,900	1,398.00	8,248,200
ビジネスブレイン太田昭和	5,900	2,224.00	13,121,600
ナガワ	4,800	7,740.00	37,152,000
東京都競馬	12,900	4,205.00	54,244,500
常磐興産	1,900	1,205.00	2,289,500
カナモト	23,800	2,903.00	69,091,400
D T S	29,700	4,260.00	126,522,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	68,600	4,928.00	338,060,800
シーイーシー	19,000	2,051.00	38,969,000
カプコン	268,600	3,297.00	885,574,200
ニシオホールディングス	12,800	3,975.00	50,880,000
アイ・エス・ピー	7,700	1,500.00	11,550,000
アゴーラ ホスピタリティグループ	33,000	50.00	1,650,000
日本空港ビルデング	52,200	5,579.00	291,223,800
トランス・コスモス	17,200	3,435.00	59,082,000
乃村工藝社	67,000	882.00	59,094,000
S C S K	105,100	3,183.00	334,533,300
藤田観光	6,100	9,570.00	58,377,000
K N T - C Tホールディングス	9,200	1,375.00	12,650,000
トーカイ	13,600	2,220.00	30,192,000
白洋舎	800	2,352.00	1,881,600
セコム	156,800	9,603.00	1,505,750,400
N S W	6,600	3,260.00	21,516,000
セントラル警備保障	8,300	2,916.00	24,202,800
アイネス	11,700	1,802.00	21,083,400
丹青社	29,800	977.00	29,114,600
メイテックグループホールディングス	52,400	3,421.00	179,260,400
T K C	26,800	3,485.00	93,398,000
富士ソフト	30,200	7,270.00	219,554,000
応用地質	14,300	2,705.00	38,681,500
船井総研ホールディングス	30,800	2,280.00	70,224,000
N S D	53,000	3,025.00	160,325,000
進学会ホールディングス	1,700	244.00	414,800
丸紅建材リース	400	3,125.00	1,250,000
オオバ	3,600	1,069.00	3,848,400
コナミグループ	56,300	12,165.00	684,889,500
いであ	1,400	2,360.00	3,304,000
学究社	6,100	2,112.00	12,883,200
イオンディライト	16,500	3,840.00	63,360,000
ナック	13,200	593.00	7,827,600
福井コンピュータホールディングス	9,300	2,619.00	24,356,700
ダイセキ	31,400	3,715.00	116,651,000
ステップ	5,600	1,970.00	11,032,000
泉州電業	9,800	5,110.00	50,078,000

元気寿司	9,000	3,420.00	30,780,000
トラスコ中山	33,300	2,404.00	80,053,200
ヤマダホールディングス	487,600	443.30	216,153,080
オートバックスセブン	55,200	1,579.00	87,160,800
モリト	11,400	1,475.00	16,815,000
アーケランズ	47,200	1,844.00	87,036,800
ニトリホールディングス	57,600	16,580.00	955,008,000
グルメ杵屋	12,900	1,100.00	14,190,000
愛眼	4,200	181.00	760,200
ケーユーホールディングス	7,400	1,273.00	9,420,200
吉野家ホールディングス	58,300	2,854.00	166,388,200
加藤産業	19,600	4,320.00	84,672,000
北恵	1,400	872.00	1,220,800
イノテック	10,000	1,742.00	17,420,000
イエローハット	25,200	2,306.00	58,111,200
松屋フーズホールディングス	7,500	6,000.00	45,000,000
JBCホールディングス	10,000	3,700.00	37,000,000
JKホールディングス	12,300	1,079.00	13,271,700
サガミホールディングス	23,700	1,652.00	39,152,400
日伝	10,400	3,530.00	36,712,000
関西フードマーケット	10,800	2,756.00	29,764,800
ミロク情報サービス	13,600	1,955.00	26,588,000
北沢産業	3,300	346.00	1,141,800
杉本商事	7,700	2,508.00	19,311,600
因幡電機産業	41,000	4,030.00	165,230,000
王将フードサービス	11,800	8,610.00	101,598,000
ミニストップ	11,600	1,717.00	19,917,200
アークス	29,100	2,647.00	77,027,700
パローホールディングス	30,300	2,427.00	73,538,100
東テック	15,800	2,405.00	37,999,000
ミスミグループ本社	239,300	2,811.50	672,791,950
アルテック	2,900	267.00	774,300
ベルク	7,900	6,360.00	50,244,000
大庄	8,500	1,235.00	10,497,500
タキヒヨー	1,300	1,203.00	1,563,900
ファーストリテイリング	89,100	45,200.00	4,027,320,000
ソフトバンクグループ	741,000	11,920.00	8,832,720,000
蔵王産業	1,000	2,517.00	2,517,000
スズケン	56,600	5,196.00	294,093,600
サンドラッグ	53,500	3,995.00	213,732,500
サックスパーホールディングス	13,300	820.00	10,906,000
ジェコス	9,600	1,010.00	9,696,000
ヤマザワ	1,200	1,269.00	1,522,800
やまや	1,100	3,120.00	3,432,000
ベルーナ	38,100	812.00	30,937,200
合計	246,376,200		616,533,357,860

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2024年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	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,354,593,230円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	1,477,145円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	9,887,977円
M I T O 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
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	7,023,388,413円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	2,019,037,002円
O n e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 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

D I A M国際分散バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	18,454,022円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	5,683,458円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	50,916円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	1,543,096円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	4,038,361円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,097,136,193円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限定)	1,165,771,487円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,241,167,585円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	47,301,106円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	88,540,084円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	978,483,977円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	170,747,219円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	149,751円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	155,539,231円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	186,029,158円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	314,004,483円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	30,818,414円
動的パッケージファンド< D C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
M H A M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
M H A M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)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2024年7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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年7月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	558,768,684	
合計	558,768,684	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2024年2月22日から2024年7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7月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	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。

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

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

おります。

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年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)	2.5305円 (25,305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7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 07/31/25	3,800,000.000	3,617,088.820	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,404,610.170	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,515,835.940	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,768,515.640	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,327,162.080	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,349,951.170	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,357,934.580	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,881,336.890	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,750,546.880	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,827,083.600	
		US T N/B 0.5 04/30/27	4,270,000.000	3,832,491.780	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,667,100.000	
		US T N/B 0.5 06/30/27	3,580,000.000	3,195,709.370	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,715,092.580	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,228,734.770	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,890,437.500	
		US T N/B 0.625 05/15/30	4,050,000.000	3,296,874.020	
		US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,706,443.340	
		US T N/B 0.625 08/15/30	7,740,000.000	6,247,026.580	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,446,015.620	
		US T N/B 0.625 12/31/27	4,020,000.000	3,542,075.370	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,680,000.000	4,130,374.190			
US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,349,317.160			
US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,596,171.840			

US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,236,449.820	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,568,308.560	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,510,000.000	4,196,325.970	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,510,000.000	4,165,583.960	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,680,000.000	7,071,826.520	
US T N/B 1.0 07/31/28	6,270,000.000	5,506,456.070	
US T N/B 1.125 02/15/31	8,690,000.000	7,156,859.940	
US T N/B 1.125 02/28/27	3,300,000.000	3,029,425.760	
US T N/B 1.125 02/29/28	4,690,000.000	4,187,107.420	
US T N/B 1.125 05/15/40	1,800,000.000	1,119,339.840	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,060,000.000	2,501,261.320	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,230,000.000	3,725,952.520	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,157,810.130	
US T N/B 1.25 03/31/28	4,610,000.000	4,125,950.000	
US T N/B 1.25 04/30/28	5,700,000.000	5,090,144.510	
US T N/B 1.25 05/15/50	5,380,000.000	2,700,297.640	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,689,694.140	
US T N/B 1.25 06/30/28	2,710,000.000	2,410,312.100	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,860,000.000	7,245,991.770	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,399,032.400	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,356,496.080	
US T N/B 1.25 12/31/26	4,290,000.000	3,970,428.480	
US T N/B 1.375 08/15/50	5,370,000.000	2,782,750.720	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,800,000.000	2,619,093.730	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,175,801.350	
US T N/B 1.375 11/15/31	8,890,000.000	7,287,542.700	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	2,756,531.250	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,062,824.220	
US T N/B 1.5 01/31/27	8,940,000.000	8,305,294.930	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,830,000.000	4,173,799.180	
US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,449,707.050	
US T N/B 1.625 02/15/26	5,290,000.000	5,036,658.600	
US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,894,131.990	
US T N/B 1.625 05/15/31	8,740,000.000	7,390,591.790	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,491,606.240	
US T N/B 1.625 09/30/26	5,050,000.000	4,741,871.110	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,258,057.010	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,280,000.000	2,925,243.750	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,692,491.390	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	4,034,619.130	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,310,000.000	3,548,366.010	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,250,000.000	1,988,393.540	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,976,229.280	
US T N/B 1.875 02/15/32	7,980,000.000	6,754,789.410	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,100,000.000	3,525,275.370	
US T N/B 1.875 02/15/51	5,780,000.000	3,414,264.020	
US T N/B 1.875 02/28/27	5,210,000.000	4,878,473.040	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,700,000.000	4,230,917.940	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,732,849.990	

US T N/B 1.875 07/31/26	3,200,000.000	3,030,124.990	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,370,000.000	3,154,035.920	
US T N/B 2.0 02/15/50	4,020,000.000	2,469,944.500	
US T N/B 2.0 08/15/25	3,550,000.000	3,438,646.470	
US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,529,575.000	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,150,000.000	2,880,359.370	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,850,000.000	2,721,082.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,576,529.700	
US T N/B 2.25 02/15/52	5,000,000.000	3,222,265.590	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,167,097.640	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,231,866.010	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,978,643.760	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,570,000.000	1,057,664.850	
US T N/B 2.25 08/15/49	4,140,000.000	2,707,010.120	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	4,946,100.010	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,056,619.710	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,653,208.990	
US T N/B 2.375 03/31/29	2,000,000.000	1,839,296.880	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,978,646.070	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,830,000.000	3,621,294.900	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,770,000.000	3,461,478.480	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,760,000.000	3,834,000.000	
US T N/B 2.375 11/15/49	4,890,000.000	3,283,940.620	
US T N/B 2.5 02/15/45	1,700,000.000	1,224,664.050	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,370,000.000	975,482.810	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,199,932.790	
US T N/B 2.5 03/31/27	3,000,000.000	2,853,632.810	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,730,000.000	1,228,773.050	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,380,914.830	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,330,000.000	4,965,956.820	
US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,674,089.810	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,844,606.820	
US T N/B 2.625 12/31/25	3,000,000.000	2,907,773.430	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,300,053.910	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,082,212.890	
US T N/B 2.75 07/31/27	5,020,000.000	4,785,569.900	
US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	7,032,112.450	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	962,453.120	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,641,750.370	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,785,322.260	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,056,000.000	817,038.750	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,653,662.090	
US T N/B 2.875 04/30/29	4,000,000.000	3,760,546.870	
US T N/B 2.875 05/15/28	3,560,000.000	3,377,271.880	
US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,309,777.380	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,890,000.000	2,265,263.250	
US T N/B 2.875 05/15/49	4,800,000.000	3,583,687.480	
US T N/B 2.875 05/15/52	8,510,000.000	6,307,871.290	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,152,653.440	

US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,760,030.430	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,470,000.000	1,127,191.410	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	819,154.670	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,360,000.000	3,271,406.240	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,960,000.000	2,292,612.500	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,037,498.030	
US T N/B 3.0 02/15/49	2,010,000.000	1,538,278.120	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	874,335.930	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	1,012,599.610	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,252,272.640	
US T N/B 3.0 07/15/25	2,200,000.000	2,156,955.900	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,510,000.000	1,924,267.950	
US T N/B 3.0 08/15/52	4,740,000.000	3,605,732.770	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,710,283.190	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,216,176.160	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,960,000.000	1,545,567.170	
US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	672,412.500	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,125,825.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,540,000.000	1,257,867.180	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,223,097.660	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,970,879.480	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,590,000.000	1,282,744.900	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,040,000.000	2,928,553.110	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,949,033.210	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,180,000.000	3,987,736.330	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	847,277.330	
US T N/B 3.25 05/15/42	3,060,000.000	2,569,802.340	
US T N/B 3.25 06/30/27	4,200,000.000	4,067,929.690	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,500,000.000	3,342,705.050	
US T N/B 3.375 05/15/33	6,000,000.000	5,603,085.950	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,730,000.000	1,454,146.090	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,489,300.000	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,450,000.000	2,831,021.450	
US T N/B 3.5 01/31/28	3,680,000.000	3,579,159.380	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,700,000.000	2,600,595.690	
US T N/B 3.5 02/15/33	7,250,000.000	6,847,709.960	
US T N/B 3.5 02/15/39	800,000.000	725,781.240	
US T N/B 3.5 04/30/28	3,100,000.000	3,011,601.570	
US T N/B 3.5 04/30/30	3,000,000.000	2,885,332.020	
US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,950,488.270	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,424,785.540	
US T N/B 3.625 02/15/53	4,800,000.000	4,131,656.250	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,416,533.170	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,500,000.000	2,420,703.120	
US T N/B 3.625 05/15/26	3,900,000.000	3,828,550.780	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,510,000.000	3,022,233.410	
US T N/B 3.625 05/31/28	2,500,000.000	2,439,355.470	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,288,719.120	
US T N/B 3.75 04/15/26	6,000,000.000	5,904,140.640	

US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,409,082.040	
US T N/B 3.75 06/30/30	3,200,000.000	3,116,062.490	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,220,000.000	1,110,342.970	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,301,624.210	
US T N/B 3.875 01/15/26	4,300,000.000	4,242,638.680	
US T N/B 3.875 02/15/43	3,500,000.000	3,192,109.370	
US T N/B 3.875 05/15/43	800,000.000	728,531.240	
US T N/B 3.875 08/15/33	7,000,000.000	6,784,804.670	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,100,000.000	1,028,435.550	
US T N/B 3.875 09/30/29	2,950,000.000	2,897,395.490	
US T N/B 3.875 11/30/27	3,300,000.000	3,249,919.920	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,800,000.000	2,749,195.310	
US T N/B 3.875 12/31/27	3,600,000.000	3,545,156.230	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,748,375.000	
US T N/B 4.0 01/15/27	4,000,000.000	3,953,750.000	
US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	3,953,359.360	
US T N/B 4.0 02/15/34	5,000,000.000	4,889,453.100	
US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	2,962,617.180	
US T N/B 4.0 02/29/28	6,200,000.000	6,130,734.340	
US T N/B 4.0 06/30/28	2,000,000.000	1,978,203.120	
US T N/B 4.0 07/31/30	2,500,000.000	2,466,699.220	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,900,000.000	2,865,449.210	
US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	2,902,026.560	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,760,000.000	4,384,964.050	
US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,092,778.120	
US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,655,570.330	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,484,130.850	
US T N/B 4.125 08/15/53	2,600,000.000	2,449,941.410	
US T N/B 4.125 08/31/30	2,500,000.000	2,482,666.010	
US T N/B 4.125 09/30/27	3,220,000.000	3,196,290.230	
US T N/B 4.125 10/31/27	3,340,000.000	3,315,341.400	
US T N/B 4.125 11/15/32	8,600,000.000	8,518,367.130	
US T N/B 4.25 02/28/29	4,930,000.000	4,930,866.590	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,000,000.000	2,000,390.620	
US T N/B 4.25 03/15/27	3,850,000.000	3,830,975.570	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	935,156.250	
US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,968,125.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	976,328.100	
US T N/B 4.375 02/15/38	400,000.000	402,445.310	
US T N/B 4.375 05/15/34	3,500,000.000	3,525,976.580	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,210,000.000	1,203,146.480	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,430,000.000	1,413,856.630	
US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	3,982,734.360	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	1,947,734.380	
US T N/B 4.375 08/31/28	3,500,000.000	3,510,937.500	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,195,640.620	
US T N/B 4.375 12/15/26	4,800,000.000	4,785,749.990	
US T N/B 4.5 04/15/27	800,000.000	801,281.240	
US T N/B 4.5 05/15/27	1,000,000.000	1,001,835.940	

US T N/B 4.5 05/15/38	500,000.000	508,564.440	
US T N/B 4.5 05/31/29	4,000,000.000	4,046,562.480	
US T N/B 4.5 07/15/26	4,100,000.000	4,090,710.950	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,480,000.000	1,495,840.600	
US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,552,916.970	
US T N/B 4.5 11/15/33	7,000,000.000	7,115,390.660	
US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	911,189.630	
US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,623,973.610	
US T N/B 4.625 05/31/31	2,000,000.000	2,044,843.760	
US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,503,007.830	
US T N/B 4.625 09/30/28	1,300,000.000	1,316,681.630	
US T N/B 4.625 09/30/30	3,000,000.000	3,060,468.750	
US T N/B 4.625 10/15/26	3,400,000.000	3,405,445.290	
US T N/B 4.625 11/15/26	3,900,000.000	3,908,683.570	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,272,857.810	
US T N/B 4.75 11/15/43	2,620,000.000	2,678,950.000	
US T N/B 4.75 11/15/53	3,100,000.000	3,240,468.750	
US T N/B 4.875 10/31/28	3,000,000.000	3,069,257.820	
US T N/B 4.875 10/31/30	4,500,000.000	4,653,984.370	
US T N/B 5.0 05/15/37	855,000.000	914,716.400	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,403,314.450	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,860,000.000	1,989,691.390	
US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,451,843.730	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,200,000.000	1,267,359.370	
US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	837,093.980	
アメリカ・ドル 小計	885,830,000.000 (143,265,285,900)	791,083,805.520 (127,941,983,865)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,646,050.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,169,744.920
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,732,326.400
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,430,000.000	2,228,098.270
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,990,000.000	1,599,870.830
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,880,000.000	1,609,815.800
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	564,873.060
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	2,150,000.000	1,476,835.000
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,640,000.000	660,089.000
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,050,000.000	520,956.770
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,700,000.000	1,289,042.000
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,030,000.000	882,215.600

UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,870,000.000	2,311,324.360	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,670,000.000	1,086,335.000	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	267,806.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	1,012,258.500	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,730,000.000	840,434.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	2,450,000.000	1,503,810.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,230,000.000	1,164,619.840	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,200,000.000	674,435.040	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,410,000.000	714,870.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	936,682.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	659,079.200	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	378,177.880	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	830,000.000	484,139.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,910,000.000	1,006,188.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,890,000.000	1,409,373.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,077,965.400	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	785,000.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,660,000.000	1,376,970.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,200,000.000	2,069,716.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,050,000.000	897,645.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	880,000.000	713,046.740	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,700,000.000	1,674,326.600	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,150,000.000	1,079,620.000	
UK TREASURY 3.75 03/07/27	700,000.000	689,468.140	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	838,908.760	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,546,380.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,300,000.000	1,169,818.000	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	900,000.000	896,701.500	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	820,000.000	735,125.080	
UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,440,000.000	2,428,518.570	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,300,000.000	1,301,820.000	

	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,570,000.000	1,596,881.540	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	760,000.000	744,800.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,210,000.000	1,217,222.610	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,190,000.000	1,158,435.710	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,214,259.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,147,000.000	1,082,847.700	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,512,000.000	1,421,032.770	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	2,100,000.000	2,128,266.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,250,000.000	1,284,875.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,745,000.000	1,735,926.000	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	1,350,000.000	1,402,245.000	
	UK TREASURY 4.75 10/22/43	500,000.000	510,962.500	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,995,000.000	2,081,649.820	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,030,000.000	1,070,479.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,180,000.000	1,275,650.800	
	イギリス・ボンド 小計	84,289,000.000 (17,527,054,660)	69,036,012.910 (14,355,348,525)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,430,000.000	1,344,620.420	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	3,110,000.000	2,549,322.980	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	2,350,000.000	1,826,749.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,490,000.000	1,667,064.960	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,946,858.000	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,170,000.000	736,222.500	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,660,000.000	1,558,733.360	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	3,810,000.000	3,478,103.280	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,445,932.980	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,410,000.000	1,465,071.780	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,268,941.520	

イスラエル・シュケル 小計		22,460,000.000 (993,434,998)	19,287,620.780 (853,116,541)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,382,982.110	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,515,000.000	1,400,996.760	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,970,000.000	2,367,597.120	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,370,000.000	1,126,694.170	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,200,000.000	1,760,093.440	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,810,000.000	1,517,799.100	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	2,020,000.000	1,100,302.840	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,521,594.290	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,080,000.000	1,010,785.170	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,660,000.000	1,519,885.300	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	749,199.590	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	850,000.000	730,225.950	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,130,000.000	1,083,647.480	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,600,000.000	1,516,708.760	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,309,613.920	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	826,039.110	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,820,000.000	1,635,130.370	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,000,000.000	964,106.420	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	705,683.510	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,500,000.000	1,392,237.300	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,080,000.000	1,007,326.400		
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,340,000.000	1,276,756.640		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,602,044.470		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,682,831.130		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,540,000.000	1,566,767.350		
オーストラリア・ドル 小計		37,325,000.000 (4,072,157,500)	32,757,048.700 (3,573,794,013)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27	35,000,000.000	35,140,808.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	16,000,000.000	16,025,760.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	50,000,000.000	50,409,345.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	16,000,000.000	16,096,776.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34	5,000,000.000	4,993,550.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	23,000,000.000	23,121,032.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	31,800,000.000	32,065,606.320	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	49,500,000.000	50,032,966.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.33 12/15/25	4,000,000.000	4,037,462.400	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	26,000,000.000	25,979,389.020	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	5,000,000.000	5,076,524.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26	35,000,000.000	35,491,848.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	31,000,000.000	31,433,063.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,332,329.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,533,105.520	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	39,410,000.000	40,091,796.940	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	20,000,000.000	20,268,386.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	6,000,000.000	6,131,853.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	23,000,000.000	23,466,642.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	22,300,000.000	22,803,750.310	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	11,000,000.000	11,259,814.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	5,000,000.000	5,113,257.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	25,000,000.000	25,614,672.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	18,000,000.000	18,486,991.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	19,500,000.000	20,127,350.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	8,000,000.000	8,209,235.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	48,600,000.000	49,954,579.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	55,600,000.000	56,698,272.360	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	20,000,000.000	20,569,690.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	15,500,000.000	16,033,046.550	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	22,000,000.000	22,712,219.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,313,493.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	22,000,000.000	22,768,501.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,371,633.900	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,342,066.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	19,300,000.000	20,059,767.660	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	28,000,000.000	28,809,152.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	11,200,000.000	11,709,206.880	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	11,100,000.000	11,589,619.890	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	32,100,000.000	33,243,973.380	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	3,000,000.000	3,285,256.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	39,000,000.000	40,560,588.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	25,000,000.000	26,316,710.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	49,000,000.000	50,150,216.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	11,500,000.000	12,842,625.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,451,293.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	10,800,000.000	12,280,878.720	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	19,011,983.310	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30	9,000,000.000	9,653,972.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,394,745.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	11,000,000.000	11,699,377.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	8,820,000.000	10,109,775.940	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	23,100,000.000	26,561,812.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	10,450,000.000	12,387,396.560	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,295,183.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,600,000.000	9,266,230.080	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	18,000,000.000	22,175,899.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	16,300,000.000	20,148,672.870	
CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	11,300,000.000	14,551,935.470	

オフショア・人民元 小計		1,189,830,000.000 (26,388,525,672)	1,237,663,093.780 (27,449,387,159)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,810,000.000	1,705,471.130	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,217,422.540	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,167,502.350	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	511,980.900	
	CANADA 1.0 09/01/26	2,670,000.000	2,520,171.550	
	CANADA 1.25 03/01/27	2,110,000.000	1,983,613.410	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,940,000.000	1,717,185.040	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,629,300.420	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,177,548.950	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,740,000.000	1,520,105.720	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,512,024.030	
	CANADA 2.0 06/01/28	930,000.000	881,285.910	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,590,000.000	1,430,758.230	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,460,000.000	2,587,376.430	
	CANADA 2.25 12/01/29	900,000.000	852,322.560	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,414,483.130	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,330,000.000	1,257,957.810	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,024,223.740	
	CANADA 2.75 12/01/48	500,000.000	444,501.600	
	CANADA 2.75 12/01/55	800,000.000	700,405.040	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	341,897.350	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,350,000.000	1,329,367.120	
	CANADA 3.0 06/01/34	1,700,000.000	1,633,698.000	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,660,000.000	1,637,189.010	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,400,000.000	1,387,112.020	
	CANADA 3.25 12/01/33	1,620,000.000	1,591,828.710	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,030,000.000	1,028,881.210	
	CANADA 3.5 03/01/34	400,000.000	401,710.360	
	CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	396,897.980	
	CANADA 3.5 12/01/45	900,000.000	906,360.660	
CANADA 4.0 03/01/29	1,700,000.000	1,738,952.990		
CANADA 4.0 05/01/26	500,000.000	500,664.830		
CANADA 4.0 06/01/41	590,000.000	628,777.240		
CANADA 5.0 06/01/37	330,000.000	381,463.710		
CANADA 5.75 06/01/29	640,000.000	707,685.540		
CANADA 5.75 06/01/33	1,110,000.000	1,302,531.730		
カナダ・ドル 小計		49,880,000.000 (5,922,252,400)	46,170,658.950 (5,481,842,337)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	280,000.000	269,248.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	486,840.900	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	840,000.000	758,520.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	630,000.000	498,960.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	400,712.100	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	690,000.000	674,199.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	770,000.000	697,620.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	240,000.000	216,322.800	

	SINGAPORE 2.625 05/01/28	240,000.000	234,864.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	624,016.800	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	626,010.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	520,000.000	512,980.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	300,000.000	296,700.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	609,646.000	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	320,000.000	317,379.200	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	124,500.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	820,000.000	832,136.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	805,040.000	
シンガポール・ドル 小計		9,535,000.000 (1,143,532,550)	8,985,694.800 (1,077,654,377)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,290,682.800	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,207,360.950	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,960,000.000	3,700,062.840	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	6,910,000.000	6,685,120.300	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,300,000.000	3,180,452.660	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,030,000.000	4,048,882.560	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,340,000.000	3,836,223.800	
スウェーデン・クローナ 小計		29,850,000.000 (457,600,500)	28,948,785.910 (443,784,888)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,268,138.080	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,560,000.000	2,413,138.320	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,850,000.000	4,538,273.520	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,140,000.000	4,647,842.420	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,640,000.000	3,586,152.380	
	DENMARK 2.25 11/15/26	1,000,000.000	989,100.000	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,540,000.000	1,510,908.400	
	DENMARK 4.5 11/15/39	6,650,000.000	8,151,354.530	
デンマーク・クローネ 小計		32,460,000.000 (762,485,400)	30,104,907.650 (707,164,281)	
ニュージーラン ド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	950,000.000	813,038.730	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	380,000.000	352,581.650	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	727,496.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	255,996.320	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	890,000.000	743,355.130	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	790,000.000	639,794.690	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	810,000.000	546,012.900	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	706,771.820	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	910,000.000	841,061.200	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	126,572.210	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	801,013.830	

	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	200,000.000	200,998.340	
ニュージーランド・ドル 小計		7,890,000.000 (776,849,400)	6,754,692.820 (665,067,055)	
ノルウェー・ク ロネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,950,000.000	2,510,157.200	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,610,000.000	4,044,466.620	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,510,000.000	3,375,099.800	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,700,000.000	4,471,323.850	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,662,403.330	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,420,000.000	2,274,074.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,530,000.000	2,270,338.510	
	NORWAY 3.0 08/15/33	3,500,000.000	3,325,739.200	
	NORWAY 3.5 10/06/42	2,160,000.000	2,140,516.800	
	NORWAY 3.625 04/13/34	1,230,000.000	1,228,370.250	
ノルウェー・クローネ 小計		30,530,000.000 (460,697,700)	28,302,489.560 (427,084,567)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,280,000.000	2,042,269.520	
	POLAND 04/25/26	1,000,000.000	918,350.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,720,000.000	3,666,572.660	
	POLAND 1.75 04/25/32	6,050,000.000	4,604,287.420	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,290,000.000	3,124,093.520	
	POLAND 2.5 07/25/27	5,060,000.000	4,666,697.560	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,153,940.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,751,648.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,567,313.080	
	POLAND 3.75 05/25/27	2,620,000.000	2,512,103.160	
	POLAND 4.75 07/25/29	1,800,000.000	1,739,746.550	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,190,000.000	3,213,857.040	
	POLAND 6.0 10/25/33	500,000.000	511,710.600	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,400,000.000	3,642,804.200	
ポーランド・ズロチ 小計		40,960,000.000 (1,683,587,072)	37,115,393.810 (1,525,561,455)	
マレーシア・リ ンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,863,770.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	650,152.750	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,374,568.210	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,010,188.800	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,400,000.000	1,350,291.700	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,270,000.000	2,264,848.930	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,657,365.480	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,100,000.000	1,112,787.500	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,010,161.700	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	2,030,000.000	2,054,311.680	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,678,492.890	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,220,000.000	1,232,218.780	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,650,000.000	1,662,902.340	
MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,656,547.430		
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	687,249.410	

	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,400,000.000	1,439,174.520	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,068,164.370	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,450,000.000	1,506,209.250	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,246,554.840	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,590,000.000	1,649,658.700	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,450,000.000	1,539,175.000	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,160,000.000	1,245,637.100	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	322,851.240	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,900,000.000	2,048,645.550	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,200,383.790	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,763,249.440	
マレーシア・リングギット 小計		37,500,000.000 (1,291,770,000)	38,295,561.400 (1,319,174,863)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	9,500,000.000	8,929,335.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	28,080,000.000	25,087,233.600	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,290,000.000	16,536,738.300	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	16,790,000.000	13,469,105.900	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	11,010,000.000	10,253,062.500	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	4,805,000.000	4,829,937.950	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	31,672,000.000	29,378,657.070	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	25,146,000.000	23,463,984.060	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,148,000.000	26,897,744.120	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	24,707,000.000	19,859,980.740	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	10,035,000.000	8,637,525.900	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	17,461,000.000	14,181,474.980	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	18,419,000.000	17,354,934.370	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	21,642,000.000	19,105,124.760	
メキシコ・ペソ 小計		268,705,000.000 (2,436,536,329)	237,984,839.250 (2,157,975,127)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,280,000.000	1,091,755.180	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,360,000.000	1,125,207.700	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	620,000.000	549,905.900	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	770,000.000	458,766.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	640,000.000	453,760.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,367,799.360	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,190,000.000	1,115,955.820	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	360,000.000	158,421.500	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	935,000.000	868,496.290	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	334,787.240	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,330,000.000	1,267,441.760	

AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	138,645.950	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	600,000.000	518,061.690	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	310,000.000	302,285.960	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	680,000.000	491,866.100	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	110,542.000	
AUSTRIA 1.85 05/23/49	460,000.000	351,944.160	
AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	451,439.630	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	287,955.330	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	670,000.000	635,131.520	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,150,000.000	1,143,010.870	
AUSTRIA 2.9 02/20/34	450,000.000	444,735.000	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	541,916.370	
AUSTRIA 3.15 10/20/53	420,000.000	410,691.750	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	350,000.000	392,969.500	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,114,868.500	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,010,000.000	1,038,657.420	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	674,009.250	
BELGIUM 0.0 10/22/27	1,030,000.000	939,576.440	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	843,724.690	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,100,000.000	935,000.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,050,000.000	857,115.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	780,000.000	496,919.930	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	361,590.890	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,360,000.000	1,281,793.200	
BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	866,774.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,240,000.000	1,130,956.560	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,340,000.000	1,290,617.650	
BELGIUM 1.0 06/22/31	940,000.000	829,025.940	
BELGIUM 1.25 04/22/33	860,000.000	747,122.850	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,540,000.000	950,420.240	
BELGIUM 1.45 06/22/37	560,000.000	455,140.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	649,629.930	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,020,000.000	708,067.160	
BELGIUM 1.9 06/22/38	810,000.000	684,636.820	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	325,440.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	293,565.090	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	298,639.360	
BELGIUM 2.85 10/22/34	520,000.000	508,768.910	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,200,000.000	1,199,718.960	
BELGIUM 3.0 06/22/34	180,000.000	179,036.690	
BELGIUM 3.3 06/22/54	420,000.000	398,018.460	
BELGIUM 3.45 06/22/43	240,000.000	240,312.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	666,142.190	
BELGIUM 4.0 03/28/32	740,000.000	792,614.290	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,180,000.000	1,306,798.530	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,096,379.440	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,370,000.000	1,598,337.900	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,746,921.110	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,310,000.000	3,150,458.000	

BUNDESOBL 0.0 04/16/27	2,460,000.000	2,287,597.040	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	2,760,000.000	2,596,194.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,150,000.000	1,107,795.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,301,400.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	3,080,000.000	2,956,153.200	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,050,000.000	1,007,569.500	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,000,000.000	980,770.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,700,000.000	1,676,727.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	2,000,000.000	1,987,160.000	
BUNDESSCHAT 2.5 03/19/26	800,000.000	794,000.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,020,000.000	1,763,742.800	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,040,000.000	887,910.400	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,850,000.000	2,374,095.600	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,460,000.000	1,109,804.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,680,000.000	1,239,134.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,530,000.000	1,321,812.900	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	890,000.000	768,790.900	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,890,000.000	2,438,986.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,400,000.000	1,181,961.980	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,583,710.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,140,000.000	575,677.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,190,000.000	1,050,192.600	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,486,674.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,660,000.000	1,491,240.350	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,970,000.000	2,791,651.500	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,630,000.000	1,474,496.760	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,770,000.000	1,616,204.700	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,860,000.000	3,716,215.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,120,000.000	1,972,066.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,610,000.000	2,448,955.800	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,290,000.000	2,162,550.050	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,690,000.000	2,376,282.170	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	2,160,000.000	1,745,755.200	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,620,000.000	1,954,087.700	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,780,000.000	2,628,879.200	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	2,400,000.000	1,970,520.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,800,000.000	1,762,830.000	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	400,000.000	389,468.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,950,000.000	1,924,162.500	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	700,000.000	690,900.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	1,300,000.000	1,292,902.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,220,000.000	2,142,078.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	2,158,719.360	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	750,000.000	719,010.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,900,000.000	1,917,195.000	

DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,080,000.000	1,159,336.800	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,730,000.000	1,979,824.960	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,580,000.000	1,879,346.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,275,603.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,720,000.000	2,052,837.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	2,033,591.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,720,000.000	2,020,982.800	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,140,000.000	1,251,811.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	840,000.000	997,600.800	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	941,757.500	
FINLAND 0.0 09/15/26	100,000.000	93,775.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	110,000.000	92,330.000	
FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	198,092.160	
FINLAND 0.125 04/15/52	640,000.000	290,294.400	
FINLAND 0.125 09/15/31	700,000.000	574,802.120	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	182,610.100	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	440,515.320	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	236,226.770	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	371,943.630	
FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	591,022.430	
FINLAND 0.5 09/15/29	770,000.000	683,509.040	
FINLAND 0.75 04/15/31	700,000.000	608,790.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	810,000.000	788,375.430	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	404,537.520	
FINLAND 1.375 04/15/27	210,000.000	201,606.820	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	198,695.340	
FINLAND 1.5 09/15/32	850,000.000	761,256.160	
FINLAND 2.625 07/04/42	400,000.000	368,330.980	
FINLAND 2.75 04/15/38	370,000.000	351,410.060	
FINLAND 2.75 07/04/28	320,000.000	319,374.550	
FINLAND 2.95 04/15/55	20,000.000	18,786.000	
FINLAND 3.0 09/15/34	600,000.000	597,941.700	
FINLAND 4.0 07/04/25	220,000.000	221,455.410	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,830,000.000	2,691,821.710	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,000,000.000	3,701,560.000	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,790,000.000	2,996,374.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	4,310,000.000	3,691,081.840	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,980,000.000	3,306,018.840	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	4,270,000.000	3,434,852.050	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,120,000.000	2,924,964.120	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,060,000.000	4,827,064.140	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	4,290,000.000	3,820,982.280	

FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,950,000.000	1,263,951.970	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	289,584.160	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,490,000.000	862,779.280	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,780,000.000	3,499,410.600	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,690,000.000	4,321,100.710	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,750,000.000	1,926,071.250	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	3,660,000.000	1,831,134.600	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	5,200,000.000	4,739,195.490	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,560,000.000	3,369,297.920	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,560,000.000	2,992,998.800	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,680,000.000	2,959,088.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,400,000.000	1,075,060.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,680,000.000	4,259,562.840	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,420,000.000	1,592,886.340	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	940,000.000	595,059.940	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,450,000.000	1,995,022.750	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,475,335.870	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	3,550,000.000	3,277,297.870	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,650,000.000	3,563,451.970	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,250,000.000	1,079,885.930	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,320,000.000	4,269,430.080	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,300,000.000	3,270,395.700	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,240,000.000	4,210,404.800	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,200,000.000	3,177,216.000	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	900,000.000	800,021.250	
FRANCE OAT 3.0 11/25/34	1,000,000.000	984,061.570	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,340,000.000	2,257,880.040	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,850,000.000	3,877,349.230	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	400,000.000	411,901.680	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,640,665.660	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,581,591.720	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,540,000.000	1,653,568.980	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,490,000.000	2,830,594.650	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,655,122.600	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,800,000.000	3,112,026.950	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,610,000.000	4,307,921.300	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	170,000.000	175,811.870	
IRISH 0.0 10/18/31	670,000.000	549,225.130	
IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	390,295.500	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	299,698.950	
IRISH 0.35 10/18/32	350,000.000	287,405.110	
IRISH 0.4 05/15/35	520,000.000	399,204.000	
IRISH 0.55 04/22/41	300,000.000	200,758.800	
IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	663,015.750	
IRISH 1.0 05/15/26	890,000.000	858,819.930	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	676,434.790	
IRISH 1.3 05/15/33	290,000.000	255,726.930	
IRISH 1.35 03/18/31	540,000.000	494,242.340	
IRISH 1.5 05/15/50	550,000.000	390,193.790	

IRISH 1.7 05/15/37	780,000.000	671,020.340	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	696,603.600	
IRISH 2.4 05/15/30	690,000.000	676,793.400	
IRISH 3.0 10/18/43	280,000.000	274,661.210	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,911,526.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,850,000.000	1,731,970.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,310,496.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,900,000.000	1,671,525.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,542,300.910	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	987,690.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,420,000.000	1,163,761.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,614,411.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,510,000.000	1,277,037.200	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,480,000.000	1,040,736.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	2,180,000.000	1,788,690.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,167,615.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,566,936.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,416,342.250	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,300,000.000	1,228,760.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,980,000.000	1,892,706.740	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,654,379.150	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,320,000.000	1,018,776.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	510,000.000	321,198.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,380,000.000	1,339,290.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,290,000.000	1,127,400.310	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,340,000.000	2,096,696.160	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,170,000.000	707,112.310	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	828,345.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,160,000.000	1,112,877.890	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,631,481.200	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,643,156.250	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,840,000.000	1,800,334.190	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	217,404.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	960,000.000	632,352.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,547,388.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,141,312.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,080,000.000	976,497.650	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,480,000.000	1,063,084.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,230,388.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,520,000.000	1,492,944.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,270,000.000	990,346.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	500,000.000	362,800.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,800,000.000	1,756,800.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,904,351.530	
ITALY BTPS 2.95 02/15/27	1,300,000.000	1,291,940.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	220,000.000	192,170.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,210,000.000	2,176,297.500	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,060,000.000	934,464.200	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	549,360.000	

ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,186,995.260	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,720,000.000	1,643,401.940	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,150,000.000	1,156,555.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,440,000.000	1,268,120.160	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,310,000.000	1,313,537.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,184,320.910	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,000,000.000	1,013,100.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,513,381.800	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.000	1,024,699.500	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	1,600,000.000	1,620,640.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,738,590.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,340,000.000	2,356,614.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,160,000.000	1,176,240.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,900,000.000	1,957,570.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	1,029,300.000	
ITALY BTPS 4.05 10/30/37	800,000.000	802,800.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	500,000.000	516,400.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	560,000.000	559,720.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	720,000.000	744,336.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	700,000.000	732,550.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,400,000.000	1,474,060.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	800,000.000	818,640.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,150,512.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	770,000.000	785,092.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,180,000.000	2,303,388.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,460,000.000	1,556,933.040	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,360,000.000	2,594,348.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,890,000.000	2,067,471.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,650,000.000	1,805,760.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,884,728.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,660,000.000	3,055,542.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,260,000.000	2,603,972.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,216,025.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,250,000.000	1,361,375.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	1,500,000.000	1,434,149.050	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,280,000.000	1,193,856.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,240,000.000	1,098,850.800	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,240,000.000	838,563.740	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,330,000.000	621,929.160	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,200,000.000	1,022,364.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,900,000.000	1,576,557.010	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	760,000.000	674,092.250	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,310,000.000	918,211.750	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,560,000.000	1,488,474.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	900,000.000	757,570.260	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	942,945.490	

NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,180,000.000	1,092,925.540	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	543,399.440	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	350,000.000	346,082.940	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,310,000.000	1,286,717.370	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	350,000.000	342,460.120	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	500,000.000	486,100.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,290,000.000	1,256,637.360	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	140,000.000	146,052.480	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,490,000.000	1,650,439.450	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,020,000.000	1,142,400.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,090,000.000	1,187,664.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,563,341.880	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,010,000.000	1,862,868.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,880,000.000	1,692,282.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,830,000.000	1,496,574.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,567,175.400	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,540,000.000	1,287,004.950	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,130,000.000	1,001,433.680	
SPAIN 0.7 04/30/32	2,850,000.000	2,386,319.250	
SPAIN 0.8 07/30/27	500,000.000	467,850.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,523,880.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,600,000.000	1,163,259.580	
SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	352,944.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,790,000.000	977,025.840	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,020,000.000	717,519.000	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,150,000.000	1,930,592.500	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,130,000.000	2,050,944.740	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	2,052,025.230	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,470,000.000	1,382,461.500	
SPAIN 1.45 04/30/29	2,550,000.000	2,383,871.310	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,773,724.950	
SPAIN 1.45 10/31/71	660,000.000	324,145.800	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,660,000.000	1,594,928.000	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,640,000.000	1,418,950.960	
SPAIN 1.9 10/31/52	1,370,000.000	921,005.790	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,500,519.960	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,070,000.000	1,955,034.760	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,786,314.900	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,970,000.000	1,832,888.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,648,888.320	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,560,000.000	1,299,556.440	
SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,789,848.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,138,007.000	
SPAIN 3.15 04/30/33	1,570,000.000	1,567,927.600	
SPAIN 3.25 04/30/34	1,270,000.000	1,269,737.420	

	SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	712,115.320	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	1,018,760.830	
	SPAIN 3.5 05/31/29	1,300,000.000	1,331,812.300	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,820,000.000	1,868,230.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	540,000.000	559,056.870	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,660,000.000	1,791,166.220	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,095,000.000	1,109,611.350	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,880,000.000	2,132,582.690	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,193,062.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,660,000.000	1,802,677.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,455,161.120	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,635,000.000	1,941,710.460	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,330,000.000	2,459,629.550	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,215,020.500	
	ユーロ 小計	520,150,000.000 (91,130,280,000)	477,635,707.740 (83,681,775,996)	
国債証券 合計		298,312,050,080.500 (298,312,050,081)	271,660,715,049 (271,660,715,049)	
合計			271,660,715,049 (271,660,715,049)	

(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 245銘柄	46.41	47.10
イギリス・ポンド	国債証券 58銘柄	5.21	5.28
イスラエル・シケル	国債証券 11銘柄	0.31	0.31
オーストラリア・ドル	国債証券 25銘柄	1.30	1.32
オフショア・人民元	国債証券 59銘柄	9.96	10.10
カナダ・ドル	国債証券 36銘柄	1.99	2.02
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.39	0.40
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.16	0.16
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.26	0.26
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	0.15	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.55	0.56
マレーシア・リンギット	国債証券 26銘柄	0.48	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.78	0.79
ユーロ	国債証券 350銘柄	30.36	30.80

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年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

D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,786,814,481円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,326,759円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	6,348,704円
M I T O 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
D I A M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
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	114,533,318円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	695,225,687円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	955,326,040円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	61,391,912円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	188,107,574円
D I A M 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
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	129,457,591円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	169,369,244円
D I A M 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
D I A M 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 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

D I A M バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	574,488,282円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A（適格機関投資家限定）	24,296,786円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A 2（適格機関投資家限定）	19,486,538円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A（適格機関投資家限定）	124,554,861円
D I A M 世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）	3,927,619円
D I A M 世界バランスファンド5 5 V A（適格機関投資家限定）	115,385円
D I A M 世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	39,870,314円
D I A M 世界アセットバランスファンド4 0 V A（適格機関投資家限定）	3,555,175円
D I A M 世界アセットバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	15,717,802円
D I A M 世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	23,838,992円
D I A M 世界アセットバランスファンド4 V A（適格機関投資家限定）	60,342,065円
動的パッケージファンド< D C 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
M H A M 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
M H A M 動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,330,095,505円
M H A M 外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2,005,942,374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)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2024年7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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	157,571,020,417
投資信託受益証券	158,980,663
投資証券	609,190,699
合計	158,339,191,779

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2024年2月16日から2024年7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7月11日現在			
	契約額等(円)	うち	時価(円)	評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	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。

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2024年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。

（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）	10.0556円 (100,556円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年7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	1,513,035	199.790	302,289,262.650	
	ABBOTT LABORATORIES	278,390	103.050	28,688,089.500	
	AES CORP	109,122	17.920	1,955,466.240	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	148,437	177.840	26,398,036.080	
	ADVANCED MICRO DEVICES	261,874	183.960	48,174,341.040	
	ADOBE INC	72,550	564.550	40,958,102.500	
	CHUBB LTD	66,374	256.320	17,012,983.680	

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	35,944	255.660	9,189,443.040	
ALLSTATE CORP	41,541	159.970	6,645,313.770	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	105,726	214.490	22,677,169.740	
AMGEN INC	86,870	321.670	27,943,472.900	
HESS CORP	44,111	147.680	6,514,312.480	
AMERICAN EXPRESS CO	93,420	238.930	22,320,840.600	
AMERICAN ELECTRIC POWER	87,379	88.250	7,711,196.750	
AFLAC INC	88,693	90.210	8,000,995.530	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	75.960	8,215,074.000	
ANALOG DEVICES	79,488	238.330	18,944,375.040	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	107,814	67.800	7,309,789.200	
VALERO ENERGY CORP	54,956	144.900	7,963,124.400	
ANSYS INC	14,299	331.000	4,732,969.000	
APPLE INC	2,370,279	232.980	552,227,601.420	
APPLIED MATERIALS INC	134,998	254.970	34,420,440.060	
ALBEMARLE CORP	18,991	96.900	1,840,227.900	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	64.230	5,235,001.920	
AMEREN CORP	47,284	71.810	3,395,464.040	
AUTODESK INC	34,964	247.050	8,637,856.200	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	65,712	234.150	15,386,464.800	
AUTOZONE INC	2,716	2,856.350	7,757,846.600	
AVERY DENNISON CORP	13,185	216.520	2,854,816.200	
BALL CORP	51,188	59.290	3,034,936.520	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	211,732	413.790	87,612,584.280	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	122,230	60.700	7,419,361.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	80,219	34.250	2,747,500.750	
BECTON DICKINSON & CO	47,357	223.870	10,601,811.590	
AMETEK INC	38,817	165.870	6,438,575.790	
VERIZON COMM INC	681,663	41.080	28,002,716.040	
WR BERKLEY CORP	31,607	79.630	2,516,865.410	
BEST BUY CO INC	30,568	85.570	2,615,703.760	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	280.350	846,937.350	
YUM! BRANDS INC	44,894	129.170	5,798,957.980	
FIRSTENERGY CORP	83,697	38.920	3,257,487.240	
BOEING CO	92,640	183.730	17,020,747.200	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	239,703	77.110	18,483,498.330	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	85.440	1,472,387.520	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	26,064	148.830	3,879,105.120	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,324.100	4,516,505.100	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	328,703	41.120	13,516,267.360	
ONEOK INC	94,258	82.320	7,759,318.560	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,940	122.700	1,587,738.000	
UNITED RENTALS INC	10,788	645.190	6,960,309.720	
SEMPRA	104,544	76.100	7,955,798.400	
FEDEX CORP	38,278	293.270	11,225,789.060	
VERISIGN INC	14,698	174.620	2,566,564.760	
AMPHENOL CORP	196,954	70.020	13,790,719.080	
BROWN-FORMAN CORP	37,193	42.660	1,586,653.380	
QUANTA SERVICES INC	23,271	257.870	6,000,892.770	
CSX CORP	315,936	32.920	10,400,613.120	
COTERRA ENERGY INC	114,711	26.630	3,054,753.930	
CAMPBELL SOUP CO	37,612	45.570	1,713,978.840	
CONSTELLATION BRANDS INC	26,080	253.080	6,600,326.400	
CARDINAL HEALTH INC	38,298	95.590	3,660,905.820	
CARLISLE COS INC	7,520	416.880	3,134,937.600	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	168,166	17.740	2,983,264.840	
CATERPILLAR INC	81,144	328.480	26,654,181.120	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	17,148	170.310	2,920,475.880	
JPMORGAN CHASE & CO	464,279	207.800	96,477,176.200	
CHURCH & DWIGHT CO INC	38,911	104.850	4,079,818.350	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	25,734	119.100	3,064,919.400	
CINTAS CORP	14,733	715.760	10,545,292.080	
CISCO SYSTEMS INC	655,514	46.270	30,330,632.780	
CLEVELAND-CLIFFS INC	83,513	15.400	1,286,100.200	
CLOROX COMPANY	21,219	134.680	2,857,774.920	
COCA-COLA CO/THE	661,895	62.830	41,586,862.850	
COPART INC	142,917	54.130	7,736,097.210	
COLGATE-PALMOLIVE CO	125,111	97.390	12,184,560.290	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	39,791	242.520	9,650,113.320	
MOLINA HEALTHCARE INC	8,928	286.950	2,561,889.600	
NRG ENERGY, INC.	34,874	79.160	2,760,625.840	
COMCAST CORP-CL A	637,069	37.430	23,845,492.670	
CONAGRA BRANDS INC	73,639	28.810	2,121,539.590	
CONSOLIDATED EDISON INC	55,106	89.870	4,952,376.220	
CMS ENERGY CORP	51,134	59.190	3,026,621.460	
COOPER COS INC	31,884	85.550	2,727,676.200	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	50.430	1,534,887.480	
CORNING INC	126,561	45.480	5,755,994.280	
HEICO CORP-CL A	11,614	179.300	2,082,390.200	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	246.230	2,324,903.660	
CUMMINS INC	22,263	274.090	6,102,065.670	

DR HORTON INC	48,787	139.590	6,810,177.330	
DANAHER CORP	114,278	242.200	27,678,131.600	
MOODY'S CORP	26,573	437.290	11,620,107.170	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	81,647	67.830	5,538,116.010	
TARGET CORP	73,884	146.110	10,795,191.240	
DEERE & CO	42,486	351.530	14,935,103.580	
MORGAN STANLEY	198,385	103.460	20,524,912.100	
REPUBLIC SERVICES INC	35,619	196.880	7,012,668.720	
COSTAR GROUP INC	66,181	71.840	4,754,443.040	
DECKERS OUTDOOR CORP	4,174	893.370	3,728,926.380	
THE WALT DISNEY CO	298,237	96.970	28,920,041.890	
DOLLAR TREE INC	31,756	102.480	3,254,354.880	
DOVER CORP	22,599	178.560	4,035,277.440	
OMNICOM GROUP	30,586	91.160	2,788,219.760	
DTE ENERGY CO	33,700	109.080	3,675,996.000	
DUKE ENERGY CORP	123,490	102.830	12,698,476.700	
DARDEN RESTAURANTS INC	20,213	138.060	2,790,606.780	
EBAY INC	84,227	52.980	4,462,346.460	
BANK OF AMERICA CORP	1,150,276	41.740	48,012,520.240	
CITIGROUP INC	311,525	66.980	20,865,944.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	20,322	96.100	1,952,944.200	
EATON CORP PLC	64,118	327.070	20,971,074.260	
CADENCE DESIGN SYS INC	43,858	319.800	14,025,788.400	
ECOLAB INC	41,402	243.270	10,071,864.540	
REVVITY INC	21,035	106.690	2,244,224.150	
ELECTRONIC ARTS INC	41,597	144.090	5,993,711.730	
SALESFORCE INC	157,393	252.590	39,755,897.870	
ERIE INDEMNITY CO	4,050	357.940	1,449,657.000	
EMERSON ELECTRIC CO	91,786	111.500	10,234,139.000	
ATMOS ENERGY CORP	24,532	117.010	2,870,489.320	
ENTERGY CORP	33,557	105.920	3,554,357.440	
EOG RESOURCES INC	93,097	126.220	11,750,703.340	
EQUIFAX INC	20,668	239.860	4,957,426.480	
EQT CORP	69,040	36.640	2,529,625.600	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	39,404	102.210	4,027,482.840	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	120.570	2,702,576.550	
EXXON MOBIL CORP	725,341	111.920	81,180,164.720	
NEXTERA ENERGY INC	333,190	72.900	24,289,551.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,019	414.650	2,495,778.350	
FAIR ISAAC CORP	4,036	1,534.090	6,191,587.240	
ASSURANT INC	8,766	164.800	1,444,636.800	
FASTENAL CO	95,108	63.510	6,040,309.080	
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	36.850	3,884,358.500	
M&T BANK CORP	27,461	152.380	4,184,507.180	
FISERV INC	93,994	148.890	13,994,766.660	
FORD MOTOR CO	640,176	13.170	8,431,117.920	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	22.450	1,065,858.650	

FREEMPORT-MCMORAN INC	235,891	51.590	12,169,616.690	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,743.190	2,761,212.960	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	35,124	267.800	9,406,207.200	
GENERAL DYNAMICS CORP	37,155	281.910	10,474,366.050	
GENERAL MILLS INC	88,517	62.660	5,546,475.220	
GENUINE PARTS CO	23,115	132.480	3,062,275.200	
GILEAD SCIENCES INC	202,868	68.750	13,947,175.000	
GARTNER INC	12,805	448.510	5,743,170.550	
MCKESSON CORP	20,854	586.820	12,237,544.280	
NVIDIA CORP	4,039,878	134.910	545,019,940.980	
GRACO INC	27,006	78.800	2,128,072.800	
GENERAL ELECTRIC CO	177,580	165.700	29,425,006.000	
VW GRAINGER INC	7,145	903.280	6,453,935.600	
HALLIBURTON CO	139,251	33.020	4,598,068.020	
MONSTER BEVERAGE CORP	124,220	49.850	6,192,367.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	51,952	478.890	24,879,293.280	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	30,142	227.270	6,850,372.340	
HENRY SCHEIN INC	20,863	64.190	1,339,195.970	
HEICO CORP	6,878	225.890	1,553,671.420	
HERSHEY FOODS CORP	24,324	185.680	4,516,480.320	
HP INC	161,800	36.070	5,836,126.000	
F5 INC	8,981	173.010	1,553,802.810	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	72.480	1,313,700.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	329.250	2,507,238.750	
JUNIPER NETWORKS INC	50,704	36.940	1,873,005.760	
HOLOGIC INC	38,399	75.770	2,909,492.230	
HOME DEPOT INC	160,510	344.180	55,244,331.800	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29,668	82.290	2,441,379.720	
HORMEL FOODS CORP	49,054	30.410	1,491,732.140	
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	29.590	2,893,191.840	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	544.660	2,678,093.220	
HUBBELL INC	8,750	375.320	3,284,050.000	
HUMANA INC	19,692	379.170	7,466,615.640	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	159.780	1,961,459.280	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	240,636	13.070	3,145,112.520	
BIOGEN INC	23,241	232.750	5,409,342.750	
IDEX CORP	12,292	198.440	2,439,224.480	
ILLINOIS TOOL WORKS	48,344	235.910	11,404,833.040	
INTUIT INC	45,413	632.840	28,739,162.920	
IDEXX LABORATORIES INC	13,177	483.390	6,369,630.030	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	36,581	340.820	12,467,536.420	
INTEL CORP	690,544	34.870	24,079,269.280	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	96.270	3,946,396.110	

INTERNATIONAL PAPER CO	53,419	42.700	2,280,991.300	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	63,859	28.490	1,819,342.910	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	160.870	1,907,435.590	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	113.690	2,226,732.340	
INCYTE CORP	31,654	60.730	1,922,347.420	
EMCOR GROUP INC	7,710	372.760	2,873,979.600	
JOHNSON & JOHNSON	390,048	149.430	58,284,872.640	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	51,957	100.100	5,200,895.700	
KLA CORPORATION	22,022	892.350	19,651,331.700	
DEVON ENERGY CORP	104,410	45.910	4,793,463.100	
KELLANOVA	42,451	56.890	2,415,037.390	
KEYCORP	144,072	14.670	2,113,536.240	
KIMBERLY-CLARK CORP	52,932	140.790	7,452,296.280	
BLACKROCK INC/NEW YORK	23,868	812.000	19,380,816.000	
KROGER CO	109,187	52.990	5,785,819.130	
LAM RESEARCH CORP	21,128	1,127.300	23,817,594.400	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	7,446	388.700	2,894,260.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	15,926	179.670	2,861,424.420	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	61.600	1,248,016.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,313	93.780	2,186,293.140	
LENNAR CORP	39,936	145.720	5,819,473.920	
ELI LILLY & CO	130,668	939.780	122,799,173.040	
BATH & BODY WORKS INC	34,638	36.540	1,265,672.520	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	116,681	135.650	15,827,777.650	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	47,654	127.070	6,055,393.780	
LOCKHEED MARTIN CORP	34,947	461.010	16,110,916.470	
LOEWS CORP	30,289	75.650	2,291,362.850	
LOWE'S COS INC	93,093	220.740	20,549,348.820	
DOMINION ENERGY INC	133,247	49.750	6,629,038.250	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	43.910	1,774,007.910	
MCCORMICK & CO INC	40,279	71.330	2,873,101.070	
MCDONALD'S CORPORATION	117,058	250.490	29,321,858.420	
S&P GLOBAL INC	51,859	466.000	24,166,294.000	
EVEREST GROUP LTD	6,670	378.150	2,522,260.500	
MARKEL GROUP INC	2,274	1,561.480	3,550,805.520	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	96,225	93.780	9,023,980.500	
MARSH & MCLENNAN COS	79,491	214.870	17,080,231.170	
MASCO CORP	34,561	66.150	2,286,210.150	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,993	545.120	5,447,384.160	

METLIFE INC	97,405	71.620	6,976,146.100	
MEDTRONIC PLC	216,967	77.060	16,719,477.020	
CVS HEALTH CORP	203,136	57.530	11,686,414.080	
MERCK & CO. INC.	410,297	127.300	52,230,808.100	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	69,835	76.590	5,348,662.650	
MICROSOFT CORP	1,140,439	466.250	531,729,683.750	
MICRON TECH INC	179,807	136.390	24,523,876.730	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	85,807	95.980	8,235,755.860	
3M CO	90,581	101.670	9,209,370.270	
ENTEGRIS INC	23,675	143.770	3,403,754.750	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	202.710	1,555,596.540	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	26,688	391.050	10,436,342.400	
ILLUMINA INC	24,379	113.170	2,758,971.430	
XCEL ENERGY INC	88,125	52.590	4,634,493.750	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	147.120	2,149,864.560	
NETAPP INC	32,785	134.620	4,413,516.700	
NEWMONT CORP	182,697	45.460	8,305,405.620	
NVR INC	547	7,623.760	4,170,196.720	
NIKE INC-CL B	198,029	72.540	14,365,023.660	
NORDSON CORP	8,735	229.880	2,008,001.800	
NORFOLK SOUTHERN CORP	37,384	214.830	8,031,204.720	
EVERSOURCE ENERGY	57,685	58.090	3,350,921.650	
NISOURCE INC	78,491	29.210	2,292,722.110	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	85.400	2,806,927.200	
NORTHROP GRUMMAN CORP	23,281	426.240	9,923,293.440	
WELLS FARGO & CO	574,031	59.720	34,281,131.320	
NUCOR CORP	37,496	153.360	5,750,386.560	
CHENIERE ENERGY INC	36,422	174.920	6,370,936.240	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	63,054	136.610	8,613,806.940	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	104,338	61.410	6,407,396.580	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	31,348	182.120	5,709,097.760	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,565	1,028.190	9,834,637.350	
ORACLE CORP	266,758	142.070	37,898,309.060	
PACCAR INC	84,799	101.500	8,607,098.500	
PTC INC	20,287	176.690	3,584,510.030	
EXELON CORP	157,197	34.690	5,453,163.930	
PARKER HANNIFIN CORP	20,725	523.170	10,842,698.250	
PAYCHEX INC	51,491	116.970	6,022,902.270	
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,452	249.130	2,853,036.760	
PPL CORPORATION	113,687	27.680	3,146,856.160	
PEPSICO INC	222,822	163.590	36,451,450.980	
PENTAIR PLC	25,545	75.740	1,934,778.300	
PFIZER INC	905,749	28.350	25,677,984.150	

ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	37.810	1,524,461.390	
CONOCOPHILLIPS	187,999	112.530	21,155,527.470	
PG&E CORP	322,749	17.640	5,693,292.360	
ALTRIA GROUP INC	271,033	46.930	12,719,578.690	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	64,128	164.300	10,536,230.400	
BROWN & BROWN INC	41,135	90.930	3,740,405.550	
GARMIN LTD	25,453	163.450	4,160,292.850	
PPG INDUSTRIES INC	37,839	126.640	4,791,930.960	
COSTCO WHOLESALE CORP	71,768	884.310	63,465,160.080	
T ROWE PRICE GROUP INC	37,449	116.080	4,347,079.920	
QUEST DIAGNOSTICS	19,218	140.450	2,699,168.100	
PROCTER & GAMBLE CO	380,193	166.800	63,416,192.400	
PROGRESSIVE CORP	93,976	209.990	19,734,020.240	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	78,981	76.290	6,025,460.490	
PULTE GROUP INC	33,950	107.150	3,637,742.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	40,068	94.820	3,799,247.760	
QUALCOMM INC	181,003	208.800	37,793,426.400	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	32,000	119.790	3,833,280.000	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	45.330	1,180,619.850	
RELIANCE INC	8,747	284.150	2,485,460.050	
REGENERON PHARMACEUTICALS	17,218	1,071.120	18,442,544.160	
REPLIGEN CORP	8,576	120.950	1,037,267.200	
RESMED INC	22,899	192.330	4,404,164.670	
US BANCORP	250,551	40.800	10,222,480.800	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	60,197	97.500	5,869,207.500	
ROSS STORES INC	53,462	148.030	7,913,979.860	
ROLLINS INC	45,708	49.600	2,267,116.800	
ROPER TECHNOLOGIES INC	17,283	553.060	9,558,535.980	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,355	265.080	4,865,543.400	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	39,604	162.680	6,442,778.720	
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	106.170	2,044,621.860	
ACCENTURE PLC-CL A	101,855	295.440	30,092,041.200	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	220,462	65.930	14,535,059.660	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	258.160	4,186,580.720	
AXON ENTERPRISE INC	11,039	293.290	3,237,628.310	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	37,112	207.190	7,689,235.280	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	93,547	73.920	6,914,994.240	
BOOKING HOLDINGS INC	5,560	3,990.050	22,184,678.000	
SCHLUMBERGER LTD	233,747	45.280	10,584,064.160	
SCHWAB (CHARLES) CORP	241,353	74.630	18,012,174.390	
POOL CORP	6,305	298.870	1,884,375.350	

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	106.900	3,432,986.600	
SEI INVESTMENTS CO	20,388	65.770	1,340,918.760	
ELEVANCE HEALTH INC	37,838	534.590	20,227,816.420	
CENCORA INC	29,478	222.420	6,556,496.760	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	40,653	81.550	3,315,252.150	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	38,886	305.370	11,874,617.820	
CENTENE CORP	89,770	66.660	5,984,068.200	
SMITH (A.O.) CORP	19,563	82.990	1,623,533.370	
SNAP-ON INC	8,204	261.400	2,144,525.600	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	57,528	120.390	6,925,795.920	
EDISON INTERNATIONAL	65,558	72.390	4,745,743.620	
SOUTHERN CO	177,376	78.440	13,913,373.440	
TRUIST FINANCIAL CORP	219,068	39.260	8,600,609.680	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	27.630	544,311.000	
AT&T INC	1,142,521	18.740	21,410,843.540	
CHEVRON CORP	283,787	155.130	44,023,877.310	
STANLEY BLACK & DECKER INC	27,754	83.080	2,305,802.320	
STATE STREET CORP	50,416	75.490	3,805,903.840	
STARBUCKS CORP	181,598	72.510	13,167,670.980	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	127.280	2,919,421.360	
STRYKER CORP	55,610	337.340	18,759,477.400	
NETFLIX INC	70,128	677.650	47,522,239.200	
GEN DIGITAL INC	92,583	24.600	2,277,541.800	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	49.080	1,344,792.000	
SYNOPSIS INC	24,535	619.560	15,200,904.600	
SYSCO CORP	81,369	69.640	5,666,537.160	
INTUITIVE SURGICAL INC	57,598	444.740	25,616,134.520	
TELEFLEX INC	6,985	220.580	1,540,751.300	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	16.980	2,873,865.000	
TERADYNE INC	24,830	159.130	3,951,197.900	
TEXAS INSTRUMENTS INC	147,371	203.620	30,007,683.020	
TEXTRON INC	29,841	86.310	2,575,576.710	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	61,920	536.870	33,242,990.400	
TORO CO	18,011	88.250	1,589,470.750	
DAVITA INC	9,106	139.370	1,269,103.220	
TRACTOR SUPPLY CO	16,808	259.250	4,357,474.000	
BIO-TECHNE CORP	25,934	72.070	1,869,063.380	
TRIMBLE INC	37,504	55.350	2,075,846.400	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,817	511.880	3,489,485.960	
TYSON FOODS INC	47,194	56.430	2,663,157.420	
MARATHON OIL CORP	92,952	28.160	2,617,528.320	
UNION PACIFIC CORP	97,412	224.410	21,860,226.920	

RTX CORP	216,975	100.680	21,845,043.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	149,263	500.930	74,770,314.590	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,903	180.180	1,784,322.540	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	11.700	951,514.200	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	41,424	491.620	20,364,866.880	
VULCAN MATERIALS CO	21,478	247.720	5,320,530.160	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	11.260	1,206,216.240	
WALMART INC	716,767	70.410	50,467,564.470	
WASTE MANAGEMENT INC	64,483	211.180	13,617,519.940	
WATERS CORP	9,943	288.310	2,866,666.330	
WATSCO INC	5,565	485.900	2,704,033.500	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,464	321.350	3,683,956.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,707	109.370	2,045,984.590	
WESTERN DIGITAL CORP	53,991	80.240	4,332,237.840	
WABTEC CORP	28,400	160.570	4,560,188.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,319	110.820	2,805,851.580	
WYNN RESORTS LTD	15,379	83.910	1,290,451.890	
NASDAQ INC	66,854	61.630	4,120,212.020	
CME GROUP INC	57,788	193.580	11,186,601.040	
WILLIAMS COS INC	196,846	42.500	8,365,955.000	
WILLIAMS-SONOMA INC	19,292	146.240	2,821,262.080	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	199.030	1,701,905.530	
LKQ CORP	43,882	41.760	1,832,512.320	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	52.000	2,107,248.000	
WEC ENERGY GROUP INC	53,231	78.190	4,162,131.890	
MICROSTRATEGY INC-CL A	2,539	1,305.720	3,315,223.080	
CARMAX INC	27,022	76.930	2,078,802.460	
TJX COMPANIES INC	184,001	112.970	20,786,592.970	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	323.810	2,520,860.850	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.270	510,280.230	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	35.550	836,420.400	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	20,936	257.760	5,396,463.360	
CBRE GROUP INC	48,577	89.950	4,369,501.150	
REGIONS FINANCIAL CORP	152,588	20.190	3,080,751.720	
DOMINO'S PIZZA INC	5,925	477.990	2,832,090.750	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,931	860.810	6,827,084.110	
CRH PLC	109,430	77.070	8,433,770.100	
WESTLAKE CORP	6,030	141.350	852,340.500	
T-MOBILE US INC	87,040	180.520	15,712,460.800	
LAS VEGAS SANDS CORP	59,474	41.430	2,464,007.820	

MOSAIC CO/THE	48,502	26.830	1,301,308.660	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	206.940	1,267,714.440	
CELANESE CORP	18,981	134.690	2,556,550.890	
DEXCOM INC	61,139	110.790	6,773,589.810	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	136.720	2,673,422.880	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	129.530	2,846,810.340	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	69.750	2,160,087.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,470	440.600	7,256,682.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	92,872	144.410	13,411,645.520	
LIVE NATION	27,355	94.430	2,583,132.650	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	226,036	58.300	13,177,898.800	
TRANSDIGM GROUP INC	8,828	1,272.680	11,235,219.040	
MASTERCARD INC	134,412	433.640	58,286,419.680	
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	56.910	1,344,384.930	
OWENS CORNING	13,227	167.160	2,211,025.320	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,679	148.840	3,077,862.360	
AERCAP HOLDINGS NV	33,912	93.910	3,184,675.920	
FIRST SOLAR INC	15,579	228.570	3,560,892.030	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	18,398	200.580	3,690,270.840	
SUPER MICRO COMPUTER INC	8,410	899.980	7,568,831.800	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	83.710	1,765,778.740	
DELTA AIR LINES INC	21,592	46.860	1,011,801.120	
INSULET CORP	12,022	197.670	2,376,388.740	
DISCOVER FINANCIAL	39,188	129.200	5,063,089.600	
TE CONNECTIVITY LTD	48,949	153.510	7,514,160.990	
LULULEMON ATHLETICA INC	19,016	288.080	5,478,129.280	
MERCADOLIBRE INC	7,435	1,703.550	12,665,894.250	
ULTA BEAUTY INC	8,188	396.030	3,242,693.640	
MSCI INC	12,591	489.000	6,156,999.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	251,312	102.760	25,824,821.120	
VISA INC	255,530	263.000	67,204,390.000	
KEURIG DR PEPPER INC	173,573	31.950	5,545,657.350	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	31,751	132.230	4,198,434.730	
MARATHON PETROLEUM CORP	57,711	162.180	9,359,569.980	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	64.840	1,389,521.200	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	314,617	20.100	6,323,801.700	
XYLEM INC	39,414	136.340	5,373,704.760	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	40,421	92.850	3,753,089.850	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	246.680	1,598,733.080	

EPAM SYSTEMS INC	9,031	181.690	1,640,842.390	
HCA HEALTHCARE INC	31,963	315.350	10,079,532.050	
VERISK ANALYTICS INC	23,047	277.520	6,396,003.440	
CORPAY INC	11,338	273.220	3,097,768.360	
NXP SEMICONDUCTOR NV	41,921	282.370	11,837,232.770	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	21,225	155.650	3,303,671.250	
TARGA RESOURCES CORP	33,263	132.890	4,420,320.070	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	18,053	169.330	3,056,914.490	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	61.480	2,108,456.600	
DOLLAR GENERAL CORP	35,900	127.500	4,577,250.000	
FORTINET INC	100,599	59.590	5,994,694.410	
HYATT HOTELS CORP	6,647	152.310	1,012,404.570	
TESLA INC	463,451	263.260	122,008,110.260	
ENPHASE ENERGY INC	21,539	106.750	2,299,288.250	
GENERAL MOTORS CO	184,183	46.530	8,570,034.990	
ALLY FINANCIAL INC	49,311	41.250	2,034,078.750	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	272.940	3,246,621.300	
APTIV PLC	43,097	69.600	2,999,551.200	
PHILLIPS 66	68,358	133.970	9,157,921.260	
META PLATFORMS INC	354,138	534.690	189,354,047.220	
IQVIA HOLDINGS INC	29,794	211.980	6,315,732.120	
DIAMONDBACK ENERGY INC	26,616	202.390	5,386,812.240	
SERVICENOW INC	32,909	743.150	24,456,323.350	
PALO ALTO NETWORKS INC	52,557	337.060	17,714,862.420	
WORKDAY INC	34,175	223.080	7,623,759.000	
ABBVIE INC	286,271	168.140	48,133,605.940	
ZOETIS INC	74,669	173.490	12,954,324.810	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	27.790	1,506,523.690	
CDW CORP	22,078	218.870	4,832,211.860	
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	80.180	5,060,159.800	
TWILIO INC	25,710	56.030	1,440,531.300	
SNAP INC	174,273	16.840	2,934,757.320	
TRADE DESK INC A	69,828	99.820	6,970,230.960	
OKTA INC	25,106	92.790	2,329,585.740	
BAKER HUGHES CO	165,304	33.840	5,593,887.360	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	77.970	1,698,576.450	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	9.580	1,551,595.960	
BROADCOM INC	71,184	1,744.690	124,194,012.960	
ARES MANAGEMENT CORP	30,178	138.740	4,186,895.720	
MONGODB INC	12,304	246.180	3,028,998.720	
BURLINGTON STORES INC	10,565	242.310	2,560,005.150	
VEEVA SYSTEMS INC	25,024	182.020	4,554,868.480	
EVERGY INC	41,706	53.680	2,238,778.080	
ALLEGION PLC	13,423	117.000	1,570,491.000	
DAYFORCE INC	22,002	48.990	1,077,877.980	
STERIS PLC	15,540	215.400	3,347,316.000	

DOCUSIGN INC	31,974	53.790	1,719,881.460	
WIX.COM LTD	8,997	163.010	1,466,600.970	
KKR & CO INC	99,156	109.450	10,852,624.200	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	9,649	69.460	670,219.540	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	39,400	56.000	2,206,400.000	
MODERNA INC	52,618	117.440	6,179,457.920	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40,232	219.850	8,845,005.200	
CIGNA GROUP	45,163	329.910	14,899,725.330	
DELL TECHNOLOGIES INC	41,930	145.770	6,112,136.100	
DOW INC	113,128	51.710	5,849,848.880	
OVINTIV INC	48,950	47.340	2,317,293.000	
AMCOR PLC	223,348	9.750	2,177,643.000	
PINTEREST INC	90,936	42.740	3,886,604.640	
FOX CORP-A	36,501	35.320	1,289,215.320	
FOX CORP-B	27,507	32.930	905,805.510	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	36,603	374.450	13,705,993.350	
AVANTOR INC	107,376	20.900	2,244,158.400	
DYNATRACE INC	39,362	42.950	1,690,597.900	
CLOUDFLARE INC	46,487	82.370	3,829,134.190	
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	105.050	1,777,235.900	
CARRIER GLOBAL CORP	129,836	63.600	8,257,569.600	
OTIS WORLDWIDE CORP	62,600	96.870	6,064,062.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	304,320	69.270	21,080,246.400	
CORTEVA INC	115,815	51.020	5,908,881.300	
MATCH GROUP INC	44,764	30.850	1,380,969.400	
FERGUSON PLC	32,186	191.600	6,166,837.600	
BLACKSTONE INC	115,054	124.260	14,296,610.040	
PAYLOCITY HOLDING CORP	7,385	132.770	980,506.450	
CARLYLE GROUP INC	34,847	41.500	1,446,150.500	
DATADOG INC	45,536	126.290	5,750,741.440	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	106.730	3,296,889.700	
VERTIV HOLDINGS CO	57,675	94.100	5,427,217.500	
INGERSOLL RAND INC	66,121	94.300	6,235,210.300	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	70,281	79.140	5,562,038.340	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	140.280	1,254,243.480	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	131,052	16.370	2,145,321.240	
DRAFTKINGS INC	63,900	36.640	2,341,296.000	
CHORD ENERGY CORP	10,665	168.770	1,799,932.050	
UNITY SOFTWARE INC	40,967	15.380	630,072.460	
AON PLC	31,309	295.410	9,248,991.690	
WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	7.320	2,572,401.720	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	3,255	776.960	2,529,004.800	
BENTLEY SYSTEMS INC	27,315	48.410	1,322,319.150	
COINBASE GLOBAL INC	29,730	219.560	6,527,518.800	

UIPATH INC	77,540	12.090	937,458.600	
AIRBNB INC	70,377	151.840	10,686,043.680	
CONSTELLATION ENERGY CORP	50,134	219.550	11,006,919.700	
MONDAY.COM LTD	6,356	234.610	1,491,181.160	
SOLVENTUM CORP	21,683	48.180	1,044,686.940	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	39,050	29.950	1,169,547.500	
APPROVIN CORP	29,028	84.360	2,448,802.080	
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	25.730	1,599,711.290	
ROBLOX CORP	78,921	39.660	3,130,006.860	
VIATRIS INC	184,148	10.890	2,005,371.720	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	36.610	1,266,852.440	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	19,577	83.020	1,625,282.540	
HF SINCLAIR CORP	25,560	47.530	1,214,866.800	
SNOWFLAKE INC	48,671	137.500	6,692,262.500	
DOORDASH INC	45,626	106.000	4,836,356.000	
ARISTA NETWORKS INC	43,272	363.750	15,740,190.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	61,704	119.210	7,355,733.840	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	36.140	574,373.020	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	307,250	28.420	8,732,045.000	
FNF GROUP	38,907	49.000	1,906,443.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	21,226	138.570	2,941,286.820	
MARVELL TECHNOLOGY INC	139,693	74.880	10,460,211.840	
APA CORP	66,483	28.770	1,912,715.910	
CONFLUENT INC	27,524	25.790	709,843.960	
LINDE PLC	77,966	434.950	33,911,311.700	
ROBINHOOD MARKETS INC	87,606	22.320	1,955,365.920	
U-HAUL HOLDING CO	16,864	57.660	972,378.240	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	186.900	695,454.900	
TOAST INC	56,667	23.860	1,352,074.620	
GE VERNOVA INC	44,235	179.730	7,950,356.550	
GRAB HOLDINGS LTD	369,622	3.580	1,323,246.760	
CATALENT INC	27,357	57.430	1,571,112.510	
SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	48.090	3,303,831.090	
VERALTO CORP	40,316	95.810	3,862,675.960	
SAMSARA INC	27,908	35.180	981,803.440	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	32,552	74.390	2,421,543.280	
BUNGE GLOBAL SA	21,715	111.190	2,414,490.850	
KENVUE INC	319,052	17.700	5,647,220.400	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	36.680	2,678,116.840	
CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	271.260	1,844,296.740	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	137.520	3,811,091.760	
HUBSPOT INC	7,895	492.310	3,886,787.450	

	QORVO INC	14,144	124.950	1,767,292.800	
	SMURFIT WESTROCK PLC	82,035	45.830	3,759,664.050	
	LABCORP HOLDINGS INC	12,876	200.370	2,579,964.120	
	GODADDY INC	22,534	142.460	3,210,193.640	
	ETSY INC	18,558	57.320	1,063,744.560	
	TRANSUNION	31,262	76.330	2,386,228.460	
	ALBERTSONS COS INC	54,086	19.340	1,046,023.240	
	BLOCK INC	90,085	64.340	5,796,068.900	
	DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	79.570	5,429,458.950	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	72.780	2,257,053.360	
	KRAFT HEINZ CO	149,302	31.920	4,765,719.840	
	FORTIVE CORP	55,370	73.660	4,078,554.200	
	WASTE CONNECTIONS INC	41,029	180.010	7,385,630.290	
	ALPHABET INC-CL A	954,753	191.180	182,529,678.540	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	206,262	21.350	4,403,693.700	
	PAYPAL HOLDINGS INC	166,327	58.900	9,796,660.300	
	SEA LTD ADR	58,070	74.710	4,338,409.700	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	41.630	2,344,976.270	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	47.350	1,059,408.900	
	ALPHABET INC-CL C	822,547	192.660	158,471,905.020	
	PURE STORAGE INC	50,378	67.710	3,411,094.380	
	ZSCALER INC	14,051	197.370	2,773,245.870	
	ATLASSIAN CORP PLC	25,643	174.450	4,473,421.350	
	ROKU INC	19,331	61.370	1,186,343.470	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,049	293.950	4,423,653.550	
	VISTRA CORP	58,067	92.310	5,360,164.770	
アメリカ・ドル	小計	58,770,743		7,814,294,556.740 (1,263,805,858,663)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	21.860	1,339,908.700	
	ASHTREAD GROUP	71,219	50.400	3,589,437.600	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	26.170	1,191,991.160	
	BARCLAYS PLC	2,403,221	2.195	5,275,070.090	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	180,896	4.851	877,526.490	
	BT GROUP PLC	1,150,803	1.398	1,608,822.590	
	BUNZL PLC	53,979	31.600	1,705,736.400	
	AVIVA PLC	429,205	4.831	2,073,489.350	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	39.960	822,097.080	
	DIAGEO PLC	357,390	25.025	8,943,684.750	
	SCHRODERS PLC	110,366	3.768	415,859.080	
	DCC PLC	17,471	56.900	994,099.900	
	NATIONAL GRID PLC	776,127	9.416	7,308,011.830	
	KINGFISHER PLC	336,026	2.626	882,404.270	
	BAE SYSTEMS PLC	481,015	12.800	6,156,992.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	326,962	24.880	8,134,814.560	

HALMA PLC	62,208	26.520	1,649,756.160	
NEXT PLC	18,588	88.920	1,652,844.960	
IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	20.660	2,606,858.140	
ANGLO AMERICAN PLC	206,873	24.075	4,980,467.470	
COMPASS GROUP PLC	273,244	21.610	5,904,802.840	
HSBC HOLDINGS PLC	3,014,241	6.705	20,210,485.900	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	949,467	2.320	2,202,763.440	
CENTRICA PLC	793,776	1.397	1,108,905.070	
UNILEVER PLC	399,042	44.080	17,589,771.360	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,134	10.660	1,227,328.440	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	24.530	1,350,204.790	
PEARSON PLC	84,159	10.075	847,901.920	
PERSIMMON PLC	56,989	14.425	822,066.320	
PRUDENTIAL PLC	458,067	7.352	3,367,708.580	
RIO TINTO PLC	180,086	52.240	9,407,692.640	
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.724	2,594,021.770	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	119,560	43.210	5,166,187.600	
RELX PLC	300,202	35.950	10,792,261.900	
RENTOKIL INITIAL PLC	440,722	4.672	2,059,053.180	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,360,328	4.542	6,178,609.770	
NATWEST GROUP PLC	1,067,086	3.227	3,443,486.520	
SSE PLC	184,226	18.425	3,394,364.050	
BP PLC	2,686,693	4.546	12,213,706.370	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	10.330	1,572,184.680	
SMITHS GROUP PLC	51,695	17.310	894,840.450	
SPIRAX GROUP PLC	10,751	85.550	919,748.050	
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	7.214	2,615,276.990	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,422,243	0.581	6,055,323.180	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.516	863,912.300	
TESCO PLC	1,122,991	3.106	3,488,010.040	
3I GROUP PLC	161,486	29.800	4,812,282.800	
SMITH & NEPHEW PLC	158,836	10.920	1,734,489.120	
GSK PLC	664,700	15.050	10,003,735.000	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	72,616	92.160	6,692,290.560	
WPP PLC	176,061	7.272	1,280,315.590	
ASTRAZENECA PLC	251,060	120.780	30,323,026.800	
WHITBREAD PLC	31,475	29.240	920,329.000	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	47.620	1,109,974.580	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	8.608	449,587.230	
INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	82.620	2,220,329.880	
SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.608	693,224.650	
ADMIRAL GROUP PLC	40,084	26.240	1,051,804.160	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	47.740	787,184.860	

	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	34,042	18.170	618,543.140	
	EXPERIAN PLC	149,242	36.350	5,424,946.700	
	MONDI PLC	67,554	15.535	1,049,451.390	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,623	10.960	719,228.080	
	INFORMA PLC	223,961	8.486	1,900,533.040	
	GLENCORE PLC	1,698,909	4.790	8,137,774.110	
	ENTAIN PLC	96,924	6.602	639,892.240	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	27.000	837,945.000	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	5.425	736,866.900	
	M&G PLC	439,818	2.119	931,974.340	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	18.310	514,053.250	
	WISE PLC	96,207	7.290	701,349.030	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.114	425,627.090	
	HALEON PLC	1,088,551	3.342	3,637,937.440	
	SHELL PLC	1,036,184	28.330	29,355,092.720	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	8.118	1,162,400.180	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	28,963	155.500	4,503,746.500	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	5.746	1,241,848.500	
イギリス・ポンド 小計		43,952,504		313,118,274.610 (65,109,814,022)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	187,404	35.000	6,559,140.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	32.420	7,751,070.860	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	686.300	2,285,379.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	244,057	19.800	4,832,328.600	
	ICL GROUP LTD	103,067	16.000	1,649,072.000	
	NICE LTD	10,202	620.600	6,331,361.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	135.900	4,001,439.600	
	AZRIELI GROUP	4,672	243.100	1,135,763.200	
イスラエル・シュケル 小計		821,259		34,545,554.460 (1,527,994,783)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	46.790	1,324,437.740	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	560,369	27.520	15,421,354.880	
	FORTESCUE LTD	272,505	21.590	5,883,382.950	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.820	2,291,438.460	
	ASX LTD	31,215	62.360	1,946,567.400	
	BHP GROUP LTD	816,044	43.170	35,228,619.480	
	AMPOL LTD	31,828	33.120	1,054,143.360	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	26.950	2,469,266.800	
	CSL LIMITED	78,336	297.660	23,317,493.760	
	REA GROUP LTD	9,317	197.690	1,841,877.730	
	TRANSURBAN GROUP	476,258	12.570	5,986,563.060	
	COCHLEAR LTD	10,446	325.140	3,396,412.440	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	10.650	2,744,419.800	

COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	268,429	128.540	34,503,863.660	
RIO TINTO LIMITED	61,394	119.370	7,328,601.780	
APA GROUP	222,829	7.830	1,744,751.070	
ARISTOCRAT LEISU	86,829	51.700	4,489,059.300	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	7.070	2,545,779.740	
PRO MEDICUS LTD	11,011	133.680	1,471,950.480	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	69,336	45.780	3,174,202.080	
ORICA LTD	96,633	17.660	1,706,538.780	
BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	19.930	1,526,378.910	
MACQUARIE GROUP LTD	59,527	203.030	12,085,766.810	
SUNCORP GROUP LTD	199,628	16.890	3,371,716.920	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	501,142	35.820	17,950,906.440	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.140	691,726.260	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	259,760	17.120	4,447,091.200	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	191,685	13.020	2,495,738.700	
REECE LTD	31,558	24.000	757,392.000	
SANTOS LTD	554,781	7.890	4,377,222.090	
SONIC HEALTHCARE	64,897	25.830	1,676,289.510	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	33.560	1,322,935.200	
WESFARMERS LTD	183,319	66.450	12,181,547.550	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	314,666	28.510	8,971,127.660	
WOOLWORTHS GROUP LTD	210,430	33.990	7,152,515.700	
SEEK LTD	58,513	19.940	1,166,749.220	
MINERAL RESOURCES LTD	28,865	55.490	1,601,718.850	
BRAMBLES LTD	220,767	14.150	3,123,853.050	
PILBARA MINERALS LTD	404,496	2.940	1,189,218.240	
CAR GROUP LTD	58,310	34.280	1,998,866.800	
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	28,600	35.010	1,001,286.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	396,990	3.600	1,429,164.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	12.130	1,636,458.300	
XERO LTD	23,149	136.840	3,167,709.160	
LOTTERY CORP LTD	366,780	4.940	1,811,893.200	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.030	1,175,209.200	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	491,554	29.700	14,599,153.800	
MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.630	1,498,286.130	
SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.640	2,485,166.320	
COLES GROUP LTD	230,734	17.110	3,947,858.740	
WISETECH GLOBAL LTD	27,325	98.480	2,690,966.000	
オーストラリア・ドル 小計	11,040,517		283,402,636.710	

(30,919,227,665)

カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	80,569	99.790	8,039,980.510	
	BARRICK GOLD CORP	288,555	24.250	6,997,458.750	
	BANK OF MONTREAL	118,191	116.190	13,732,612.290	
	BANK OF NOVA SCOTIA	197,216	63.080	12,440,385.280	
	NATIONAL BANK OF CANADA	57,488	113.370	6,517,414.560	
	BCE INC	14,197	43.280	614,446.160	
	BROOKFIELD CORP	218,478	60.040	13,117,419.120	
	SAPUTO INC	34,582	31.170	1,077,920.940	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	15,252	135.830	2,071,679.160	
	CGI INC	34,495	140.120	4,833,439.400	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	71.360	1,502,698.880	
	CAE INC	55,407	25.530	1,414,540.710	
	CAMECO CORP	73,563	73.110	5,378,190.930	
	ROGERS COMM-CL B	53,375	49.520	2,643,130.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	153,504	66.760	10,247,927.040	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	342,624	49.070	16,812,559.680	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	137.540	1,225,618.940	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	30.250	493,982.500	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	87,929	161.500	14,200,533.500	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	53.180	1,602,951.560	
	OPEN TEXT CORP	40,459	42.450	1,717,484.550	
	EMPIRE CO LTD	20,608	35.100	723,340.800	
	KINROSS GOLD CORP	192,737	12.190	2,349,464.030	
	RB GLOBAL INC	31,137	105.350	3,280,282.950	
	FORTIS INC	82,632	54.240	4,481,959.680	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	117,480	18.310	2,151,058.800	
	TELUS CORP	31,890	20.830	664,268.700	
	GREAT WEST LIFECO INC	43,551	39.710	1,729,410.210	
	IMPERIAL OIL LTD	33,303	94.130	3,134,811.390	
	ENBRIDGE INC	339,116	48.700	16,514,949.200	
	IGM FINANCIAL INC	12,478	37.920	473,165.760	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	283,749	37.010	10,501,550.490	
	LOBLAW CO LTD	24,803	166.090	4,119,530.270	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	127,068	81.660	10,376,372.880	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	59.360	2,509,681.440	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	97,841	67.890	6,642,425.490	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,425	1,552.000	5,315,600.000	
	METRO INC	35,059	78.870	2,765,103.330	
	EMERA INC	44,643	45.560	2,033,935.080	
	ONEX CORP	10,157	94.210	956,890.970	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	30.840	1,707,703.320	
	POWER CORP OF CANADA	89,864	39.620	3,560,411.680	

QUEBECOR INC-B	30,598	28.240	864,087.520	
ROYAL BANK OF CANADA	224,529	150.860	33,872,444.940	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	150,626	110.600	16,659,235.600	
STANTEC INC	18,358	116.340	2,135,769.720	
SUNCOR ENERGY INC	211,175	51.620	10,900,853.500	
LUNDIN MINING CORP	119,660	16.040	1,919,346.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	72,863	67.640	4,928,453.320	
THOMSON REUTERS CORP	24,837	228.460	5,674,261.020	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	121.380	1,589,713.860	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	284,440	76.000	21,617,440.000	
TC ENERGY CORP	164,747	52.380	8,629,447.860	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	101.940	825,917.880	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	208.050	2,047,003.950	
INTACT FINANCIAL CORP	28,756	236.920	6,812,871.520	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	73,865	79.440	5,867,835.600	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,192	4,115.180	13,135,654.560	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	32,697	171.130	5,595,437.610	
TOURMALINE OIL CORP	57,694	61.500	3,548,181.000	
KEYERA CORP	39,997	37.700	1,507,886.900	
PARKLAND CORP	24,129	36.630	883,845.270	
ALTAGAS LTD	47,249	30.770	1,453,851.730	
PEMBINA PIPELINE CORP	94,699	51.220	4,850,482.780	
DOLLARAMA INC	45,462	130.120	5,915,515.440	
MEG ENERGY CORP	47,181	27.960	1,319,180.760	
CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	26.760	6,068,284.920	
ARC RESOURCES LTD	96,301	23.720	2,284,259.720	
NORTHLAND POWER INC	34,152	23.840	814,183.680	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	25.390	1,301,059.770	
TMX GROUP LTD	46,884	40.240	1,886,612.160	
BRP INC	4,307	86.710	373,459.970	
IVANHOE MINES LTD	98,820	19.440	1,921,060.800	
NUTRIEN LTD	77,339	65.740	5,084,265.860	
TFI INTERNATIONAL INC	11,591	203.930	2,363,752.630	
WSP GLOBAL INC	20,394	217.810	4,442,017.140	
IA FINANCIAL CORP INC	16,448	85.850	1,412,060.800	
GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	52.430	1,870,020.810	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28,942	41.460	1,199,935.320	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	63,263	53.240	3,368,122.120	
AIR CANADA	41,858	17.320	724,980.560	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	51,312	95.050	4,877,205.600	

	SHOPIFY INC	196,708	89.350	17,575,859.800	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	210.130	1,100,450.810	
	HYDRO ONE LTD	56,437	40.270	2,272,717.990	
カナダ・ドル	小計	6,652,980		436,169,320.130 (51,786,383,379)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	289,800	4.400	1,275,120.000	
	SEBMCORP INDUSTRIES	162,200	4.820	781,804.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	310,981	38.150	11,863,925.150	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.650	1,350,035.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.845	643,208.080	
	KEPPEL LTD	249,600	6.680	1,667,328.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	561,898	15.230	8,557,706.540	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	2.930	3,928,631.900	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	7.070	1,725,080.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	33.100	6,340,834.600	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.120	806,520.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.680	1,086,177.200	
シンガポール・ドル	小計	4,915,758		40,026,370.470 (4,800,362,610)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	81.940	1,944,763.960	
	NESTLE SA-REGISTERED	432,036	93.300	40,308,958.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	86,620	139.350	12,070,497.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	114,058	249.000	28,400,442.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,805	227.200	1,546,096.000	
	SIKA INHABER	24,746	259.000	6,409,214.000	
	SGS SA-REG	22,978	81.040	1,862,137.120	
	NOVARTIS AG-REG SHS	318,766	98.300	31,334,697.800	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,117	161.200	1,308,460.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	711	1,599.000	1,136,889.000	
	CLARIANT AG-REG	45,795	14.620	669,522.900	
	SWISSCOM AG-REG	4,457	526.000	2,344,382.000	
	ABB LTD	254,623	50.380	12,827,906.740	
	ADECCO GROUP AG-REG	26,454	29.620	783,567.480	
	GEBERIT AG	5,783	540.400	3,125,133.200	
	LONZA GROUP AG-REG	12,241	510.000	6,242,910.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	161	10,970.000	1,766,170.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	108,400.000	1,734,400.000	
	GIVAUDAN-REG	1,459	4,335.000	6,324,765.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	23,540	481.100	11,325,094.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	276.800	1,331,408.000	
	HOLCIM LTD	86,117	81.240	6,996,145.080	
	TEMENOS GROUP	10,930	64.900	709,357.000	

	BACHEM HOLDING AG	4,673	86.050	402,111.650	
	SONOVA HOLDING AG	8,100	273.300	2,213,730.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,597	260.000	2,235,220.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	19,256	116.950	2,251,989.200	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	185.300	796,790.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	37.000	342,583.000	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	124.800	612,268.800	
	SCHINDLER NAMEN	4,209	226.000	951,234.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	679.800	3,061,139.400	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	96.850	474,855.550	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	765.000	952,425.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,356	87.650	1,170,653.400	
	AVOLTA AG	12,933	35.320	456,793.560	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,730	1,220.500	4,552,465.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	51.300	1,647,448.200	
	SWISS RE LTD	49,210	110.700	5,447,547.000	
	BKW AG	3,194	150.400	480,377.600	
	SIG GROUP AG	50,969	17.400	886,860.600	
	ALCON INC	78,777	79.280	6,245,440.560	
	SANDOZ GROUP AG	65,523	34.000	2,227,782.000	
	UBS GROUP AG	528,915	27.550	14,571,608.250	
	VAT GROUP AG	4,131	517.200	2,136,553.200	
スイス・フラン	小計	2,431,760		236,620,793.450 (42,544,418,662)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	422,695	192.800	81,495,596.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	270,066	167.350	45,195,545.100	
	ERICSSON LM-B SHS	465,668	67.940	31,637,483.920	
	GETINGE AB-B SHS	38,925	184.100	7,166,092.500	
	LUNDBERGS B	14,872	525.000	7,807,800.000	
	SKF AB-B SHS	64,018	206.500	13,219,717.000	
	SANDVIK AB	169,218	210.500	35,620,389.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	250,203	154.000	38,531,262.000	
	SKANSKA AB-B SHS	65,048	196.100	12,755,912.800	
	SWEDBANK AB	132,581	214.600	28,451,882.600	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	92,795	153.000	14,197,635.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	101.650	22,245,695.900	
	TRELLEBORG AB-B SHS	37,154	405.200	15,054,800.800	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	271.000	6,557,658.000	
	VOLVO AB-B SHS	263,434	266.400	70,178,817.600	
	HOLMEN AB-B SHS	17,320	418.600	7,250,152.000	
	TELE2 AB-B SHS	100,027	103.500	10,352,794.500	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	347.000	5,306,324.000	
	INDUSTRIVARDEN C	31,300	342.900	10,732,770.000	
	SAAB AB-B	47,156	265.700	12,529,349.200	

	SECURITAS AB-B SHS	76,085	105.000	7,988,925.000	
	INVESTOR AB-B SHS	271,548	287.000	77,934,276.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	169.700	17,762,329.300	
	ASSA ABLOY AB-B	168,340	297.500	50,081,150.000	
	TELIA CO AB	344,810	28.130	9,699,505.300	
	BOLIDEN AB	49,208	353.900	17,414,711.200	
	ALFA LAVAL AB	44,407	451.000	20,027,557.000	
	FASTIGHETS AB BALDER	117,966	82.400	9,720,398.400	
	INDUTRADE AB	39,178	282.200	11,056,031.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	85.540	4,086,160.260	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	43.300	9,215,625.600	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	283.400	10,310,375.400	
	HEXAGON AB-B SHS	333,533	117.450	39,173,450.850	
	SAGAX AB	28,022	299.600	8,395,391.200	
	EPIROC AB-A	103,115	206.900	21,334,493.500	
	EPIROC AB-B	61,487	189.900	11,676,381.300	
	ESSITY AB-B	99,980	278.500	27,844,430.000	
	EQT AB	55,194	331.900	18,318,888.600	
	VOLVO CAR AB	143,747	31.055	4,464,063.080	
	BEIJER REF AB	50,493	172.800	8,725,190.400	
	LIFCO AB	39,631	299.200	11,857,595.200	
	EVOLUTION AB	28,266	1,140.000	32,223,240.000	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	284.300	7,857,483.400	
スウェーデン・クローナ 小計		5,225,115		913,455,330.510 (14,003,270,217)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	15,167	873.000	13,240,791.000	
	A P MOLLER A/S	663	11,815.000	7,833,345.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	11,590.000	6,293,370.000	
	DANSKE BANK A/S	115,438	205.100	23,676,333.800	
	GENMAB A/S	11,480	1,765.000	20,262,200.000	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	59,656	428.200	25,544,699.200	
	ROCKWOOL AS	1,677	2,904.000	4,870,008.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	527,758	976.200	515,197,359.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	162.550	25,117,388.550	
	COLOPLAST-B	21,291	871.200	18,548,719.200	
	DSV A/S	28,190	1,173.500	33,080,965.000	
	DEMANT A/S	17,700	298.400	5,281,680.000	
	TRYG A/S	58,222	152.100	8,855,566.200	
	PANDORA A/S	12,473	1,019.000	12,709,987.000	
ORSTED A/S	32,927	398.800	13,131,287.600		
デンマーク・クローネ 小計		1,057,706		733,643,700.150 (17,233,290,517)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	229,726	7.710	1,771,187.460	
	FISHER & PAYKEL	95,209	31.250	2,975,281.250	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	4.090	1,279,037.070	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.720	422,244.480	

	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	6.600	1,579,432.800	
ニュージーランド・ドル 小計		939,800		8,027,183.060 (790,356,444)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	173.250	12,667,693.500	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	66.940	14,805,923.080	
	TELENOR ASA	119,576	122.800	14,683,932.800	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	14,874	993.000	14,769,882.000	
	ORKLA ASA	116,068	85.750	9,952,831.000	
	EQUINOR ASA	141,333	288.350	40,753,370.550	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	291.100	8,562,415.400	
	AKER BP ASA	40,933	260.500	10,663,046.500	
	SALMAR ASA	12,897	567.000	7,312,599.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	195.500	5,028,455.500	
	DNB BANK ASA	143,909	205.000	29,501,345.000	
ノルウェー・クローネ 小計		939,025		168,701,494.330 (2,545,705,549)	
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	25,025	77.850	1,948,196.250	
	KINGSPAN GROUP PLC	24,704	83.500	2,062,784.000	
	UMICORE	33,545	13.540	454,199.300	
	AIR LIQUIDE	93,790	162.100	15,203,359.000	
	AIRBUS SE	95,749	133.300	12,763,341.700	
	AXA SA	290,876	31.970	9,299,305.720	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	107,926	28.620	3,088,842.120	
	ADIDAS AG	25,992	221.300	5,752,029.600	
	GENERALI	159,200	23.640	3,763,488.000	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	170.900	533,208.000	
	DANONE	101,632	58.140	5,908,884.480	
	SAFRAN SA	55,443	204.800	11,354,726.400	
	INTESA SANPAOLO	2,332,761	3.574	8,337,287.810	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	53,290	89.500	4,769,455.000	
	ACCOR SA	31,427	39.080	1,228,167.160	
	BOUYGUES	29,123	31.750	924,655.250	
	BNP PARIBAS	165,547	61.620	10,201,006.140	
	THALES SA	15,023	153.300	2,303,025.900	
	CAPGEMINI SA	25,063	186.800	4,681,768.400	
	LOTUS BAKERIES NV	77	9,820.000	756,140.000	
	UNICREDIT SPA	248,704	37.110	9,229,405.440	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	167.550	2,078,122.650	
	D'IETEREN TRDG	2,736	204.200	558,691.200	
	COMMERZBANK AG	184,441	14.630	2,698,371.830	
	EIFFAGE	12,706	91.060	1,157,008.360	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	68,521	29.010	1,987,794.210	
PUBLICIS GROUPE	36,027	99.060	3,568,834.620		
IBERDROLA SA	939,014	11.825	11,103,840.550		
ENI SPA	332,847	14.180	4,719,770.460		

JERONIMO MARTINS	45,606	19.300	880,195.800	
KESKO OYJ-B	58,242	16.945	986,910.690	
KBC GROUPE	40,769	67.440	2,749,461.360	
HANNOVER RUECK SE	9,638	238.300	2,296,735.400	
WARTSILA OYJ	77,148	18.200	1,404,093.600	
L'OREAL	38,554	403.400	15,552,683.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	44,641	697.600	31,141,561.600	
GEA GROUP AG	25,513	39.300	1,002,660.900	
BOLLORE	114,808	5.705	654,979.640	
MEDIOBANCA SPA	86,792	14.350	1,245,465.200	
MICHELIN(CGDE)-B	109,281	34.630	3,784,401.030	
CONTINENTAL AG	17,635	59.200	1,043,992.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	161,929	39.970	6,472,302.130	
OMV AG	23,354	39.800	929,489.200	
VERBUND AG	10,663	76.200	812,520.600	
PERNOD-RICARD	33,037	127.950	4,227,084.150	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	42.770	997,011.470	
RENAULT SA	27,902	49.400	1,378,358.800	
REPSOL SA	195,049	13.990	2,728,735.510	
REMY COINTREAU	2,866	73.500	210,651.000	
MERCK KGAA	20,216	149.150	3,015,216.400	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	74,653	75.680	5,649,739.040	
RWE AG	98,751	33.050	3,263,720.550	
SEB SA	2,596	101.300	262,974.800	
SOCIETE GENERALE-A	116,635	23.095	2,693,685.320	
VINCI S.A.	82,622	103.900	8,584,425.800	
SODEXO	12,910	79.500	1,026,345.000	
SOFINA	2,281	214.200	488,590.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	88,675	227.850	20,204,598.750	
VIVENDI SE	142,241	10.320	1,467,927.120	
SAP SE	169,225	185.800	31,442,005.000	
TELEFONICA S.A	755,720	3.995	3,019,101.400	
TOTALENERGIES SE	349,595	63.040	22,038,468.800	
E.ON SE	369,338	12.280	4,535,470.640	
VOEST-ALPINE AG	18,032	25.480	459,455.360	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	72.550	1,297,629.300	
SIEMENS AG-REG	121,756	176.380	21,475,323.280	
UPM-KYMMENE OYJ	86,201	31.700	2,732,571.700	
ING GROEP NV-CVA	531,085	16.686	8,861,684.310	
PUMA AG	17,210	42.980	739,685.800	
BAYER AG	157,617	26.125	4,117,744.120	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	12.470	1,196,870.600	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	81.480	1,971,082.680	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	129,331	63.950	8,270,717.450	
BASF SE	143,233	43.675	6,255,701.270	

BEIERSDORF AG	15,743	138.400	2,178,831.200	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	97.940	2,114,132.840	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	36.220	1,218,151.040	
ASM INTERNATIONAL NV	7,273	732.200	5,325,290.600	
ORANGE	286,957	10.000	2,869,570.000	
SAMPO OYJ-A SHS	70,999	39.510	2,805,170.490	
RANDSTAD NV	15,584	43.050	670,891.200	
ALLIANZ SE	63,725	262.300	16,715,067.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	3.558	1,798,359.070	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	28.810	4,225,476.270	
HERMES INTL	5,084	2,086.000	10,605,224.000	
ENDESA S.A.	50,946	17.995	916,773.270	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	5.932	644,494.000	
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	45.920	2,597,878.080	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	21,873	462.600	10,118,449.800	
ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	20.790	1,686,671.910	
DASSAULT SYSTEMES SA	111,221	33.640	3,741,474.440	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	38.960	1,357,210.560	
RHEINMETALL STAMM	7,468	501.200	3,742,961.600	
HEINEKEN NV	47,066	89.260	4,201,111.160	
AKZO NOBEL	26,032	56.180	1,462,477.760	
ASML HOLDING NV	64,662	1,002.000	64,791,324.000	
AEGON LTD	232,433	5.906	1,372,749.290	
VOLKSWAGEN AG	5,460	113.600	620,256.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	33,164	106.250	3,523,675.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	966,798	9.662	9,341,202.270	
KERING	12,439	324.950	4,042,053.050	
ACCIONA S.A.	5,005	112.000	560,560.000	
FORTUM OYJ	73,699	13.825	1,018,888.670	
AGEAS	24,086	43.600	1,050,149.600	
UCB SA	20,020	145.000	2,902,900.000	
NEMETSCHKE SE	10,222	91.850	938,890.700	
CARREFOUR SA	90,642	14.100	1,278,052.200	
NOKIA OYJ	827,068	3.642	3,012,181.650	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	125,932	24.420	3,075,259.440	
WOLTERS KLUWER-CVA	41,069	155.350	6,380,069.150	
SANOFI	182,752	93.550	17,096,449.600	
STMICROELECTRONICS NV	110,999	38.995	4,328,406.000	
ELISA OYJ	20,242	43.240	875,264.080	
BANCO SANTANDER SA	2,548,588	4.497	11,461,000.230	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	16.450	1,078,939.050	
QIAGEN N.V.	34,544	37.750	1,304,036.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	308,007	15.430	4,752,548.010	

BMW VORZUG	7,821	83.300	651,489.300	
ENEL SPA	1,296,394	6.732	8,727,324.400	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	516,417	23.850	12,316,545.450	
SARTORIUS AG	3,651	231.700	845,936.700	
LEONARDO SPA	64,915	23.030	1,494,992.450	
CTS EVENTIM AG	11,578	76.000	879,928.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	206,726	35.395	7,317,066.770	
RATIONAL AG	860	767.000	659,620.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	7,150	64.300	459,745.000	
BECHTLE AG	14,521	41.920	608,720.320	
KONINKLIJKE KPN NV	693,784	3.675	2,549,656.200	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	47.750	1,100,064.500	
TELEPERFORMANCE	9,581	108.100	1,035,706.100	
DEUTSCHE BOERSE AG	31,372	186.600	5,854,015.200	
EURAZEO	5,673	76.400	433,417.200	
BANCO SABADELL	905,307	1.872	1,694,734.700	
GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	67.950	877,778.100	
HEINEKEN HOLDING NV-A	23,687	73.450	1,739,810.150	
INDITEX	175,294	45.800	8,028,465.200	
ESSILORLUXOTTICA	47,029	196.650	9,248,252.850	
SNAM SPA	317,518	4.268	1,355,166.820	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	13.440	2,243,418.240	
TENARIS SA	76,002	14.290	1,086,068.580	
TELECOM ITALIA SPA	1,970,516	0.237	467,012.290	
TERNA SPA	207,655	7.454	1,547,860.370	
BIOMERIEUX	8,691	91.950	799,137.450	
GRIFOLS SA	31,982	10.120	323,657.840	
NESTE OYJ	66,248	16.660	1,103,691.680	
RECORDATI SPA	18,197	50.000	909,850.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	8.424	707,110.560	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	246.700	2,144,316.400	
KONE OYJ	54,590	46.690	2,548,807.100	
ELIA GROUP	4,078	91.400	372,729.200	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,801	160.550	770,800.550	
ENGIE	303,298	14.080	4,270,435.840	
ALSTOM	47,494	16.770	796,474.380	
IPSEN SA	5,964	109.200	651,268.800	
ARKEMA SA	10,489	80.750	846,986.750	
LEGRAND SA	44,975	92.700	4,169,182.500	
AMPLIFON SPA	20,249	30.540	618,404.460	
ADP	6,104	115.900	707,453.600	
ORION OYJ	13,559	40.790	553,071.610	
METSO CORPORATION	102,831	9.792	1,006,921.150	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	19.675	1,565,834.870	
SYMRISE AG	22,802	113.900	2,597,147.800	
REXEL SA	33,916	24.120	818,053.920	

PRYSMIAN SPA	44,284	62.060	2,748,265.040	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	99.280	241,151.120	
CAIXABANK	569,844	5.196	2,960,909.420	
BUREAU VERITAS SA	54,064	26.140	1,413,232.960	
GETLINK	63,968	15.955	1,020,609.440	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	13.730	544,916.240	
AMADEUS IT GROUP SA	74,359	62.100	4,617,693.900	
BRENTAG SE	21,559	63.480	1,368,565.320	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	18.950	811,742.200	
EDENRED	42,160	40.000	1,686,400.000	
TALANX AG	10,349	71.600	740,988.400	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	80.580	960,110.700	
VONOVIA SE	120,411	28.350	3,413,651.850	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	10.150	1,666,183.400	
KNORR-BREMSE AG	10,342	72.150	746,175.300	
OCI NV	12,329	23.280	287,019.120	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	53.760	2,417,157.120	
FERRARI NV	20,398	399.600	8,151,040.800	
ASR NEDERLAND NV	27,365	44.970	1,230,604.050	
AIB GROUP PLC	293,677	5.215	1,531,525.550	
NORDEA BANK ABP	492,403	10.815	5,325,338.440	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	33.020	571,014.860	
MONCLER SPA	33,422	56.640	1,893,022.080	
NEXI SPA	83,576	5.876	491,092.570	
PROSUS NV	231,019	32.950	7,612,076.050	
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	75.240	1,382,234.040	
JDE PEET'S BV	14,385	18.660	268,424.100	
EXOR NV	14,142	97.900	1,384,501.800	
SIEMENS ENERGY AG	100,301	27.200	2,728,187.200	
INPOST SA	36,721	15.800	580,191.800	
EURONEXT NV	14,077	90.600	1,275,376.200	
IMCD NV	9,332	128.950	1,203,361.400	
NN GROUP NV	43,478	45.740	1,988,683.720	
FINECOBANK SPA	96,393	15.065	1,452,160.540	
ARGENX SE	9,891	430.400	4,257,086.400	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	137,946	27.350	3,772,823.100	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	83,468	36.510	3,047,416.680	
DSM-FIRMENICH AG	28,846	109.700	3,164,406.200	
SYENQO SA	11,217	81.950	919,233.150	
ZALANDO SE	31,321	23.840	746,692.640	
STELLANTIS NV	363,425	18.480	6,716,094.000	
FERROVIAL SE	84,753	37.180	3,151,116.540	
AENA SME SA	11,603	190.800	2,213,852.400	
CELLNEX TELECOM SAU	84,962	31.630	2,687,348.060	
BANCO BPM SPA	202,727	6.312	1,279,612.820	
ABN AMRO BANK NV	75,982	16.105	1,223,690.110	
SCOUT24 SE	10,048	72.950	733,001.600	

	COVESTRO AG	27,558	54.640	1,505,769.120	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	143,260	55.520	7,953,795.200	
	POSTE ITALIANE SPA	88,762	12.120	1,075,795.440	
	AMUNDI SA	11,288	64.750	730,898.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	89,823	9.800	880,265.400	
	ADYEN NV	3,378	1,132.600	3,825,922.800	
	DELIVERY HERO SE	34,547	20.990	725,141.530	
ユーロ 小計		29,982,959		832,633,957.970 (145,877,469,436)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	241,796	63.200	15,281,507.200	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	45.100	4,208,461.400	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	192,391	241.400	46,443,187.400	
	MTR CORP	346,441	24.600	8,522,448.600	
	HANG SENG BANK LTD	122,096	98.650	12,044,770.400	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	21.100	6,287,209.200	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	42.750	9,098,055.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	23.450	4,736,900.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	6.140	9,433,532.840	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	33.850	11,404,200.400	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	22.700	15,447,236.500	
	SINO LAND CO	659,200	8.020	5,286,784.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	248,565	65.700	16,330,720.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	70.200	3,722,004.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	88.300	18,998,274.800	
	AIA GROUP LTD	1,849,316	52.000	96,164,432.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	9.000	7,174,224.000	
	SANDS CHINA LTD	335,800	16.180	5,433,244.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	19.360	2,710,400.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	12.660	2,552,256.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	20.250	5,186,733.750	
	WH GROUP LTD	1,550,000	4.920	7,626,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	427,945	36.950	15,812,567.750	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	29.500	7,852,752.500	
香港・ドル 小計		11,262,703		337,757,902.240 (6,994,966,155)	
合計		177,992,829		1,647,939,118,102 (1,647,939,118,102)	

(2) 株式以外の有価証券

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	1,059,368.940	
		GOODMAN GROUP	271,455.000	9,517,212.300	
		GPT GROUP	349,447.000	1,439,721.640	
		MIRVAC GROUP	700,332.000	1,295,614.200	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,608,434.640	
		STOCKLAND	369,843.000	1,568,134.320	
	オーストラリア・ドル 小計		3,226,165.000	18,527,939.760 (2,021,398,228)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,582,334.310	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,570,470.460	
	シンガポール・ドル 小計		1,398,309.000	3,152,804.770 (378,115,876)	
投資信託受益証券 合計			4,624,474	2,399,514,104 (2,399,514,104)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,823.000	3,136,681.620	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,902,623.450	
		AMERICAN TOWER CORP	76,129.000	14,979,903.330	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,554,527.940	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,527.000	4,792,920.440	
		BXP INC	24,473.000	1,513,165.590	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,836,421.980	
		CROWN CASTLE INC	71,882.000	7,030,059.600	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	50,391.000	7,842,351.330	
		EQUINIX INC	15,314.000	11,883,051.440	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,762,115.300	
		EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	3,670,415.360	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,734,227.340	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	34,180.000	5,254,149.600	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	41,252.000	1,862,115.280	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	117,820.000	2,335,192.400	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	1,974,220.200	
INVITATION HOMES INC	96,467.000	3,457,377.280			

	IRON MOUNTAIN INC	47,906.000	4,558,255.900	
	KIMCO REALTY	111,968.000	2,208,008.960	
	MID AMERICA	17,537.000	2,455,530.740	
	PROLOGIS INC	148,197.000	17,270,878.380	
	PUBLIC STORAGE	26,065.000	7,491,081.000	
	REALTY INCOME CORP	142,408.000	7,630,220.640	
	REGENCY CENTERS CORP	27,176.000	1,693,064.800	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	18,765.000	3,662,740.350	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	53,628.000	7,960,540.320	
	SUN COMMUNITIES INC	21,946.000	2,603,453.980	
	UDR INC	50,449.000	2,050,751.850	
	VENTAS INC	67,969.000	3,541,864.590	
	VICI PROPERTIES INC	164,307.000	4,582,522.230	
	WELLTOWER INC	91,071.000	9,521,473.050	
	WEYERHAEUSER CO	114,764.000	3,165,191.120	
	WP CAREY INC	32,996.000	1,818,409.560	
アメリカ・ドル	小計	2,065,171.000	161,735,506.950 (26,157,483,540)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	770,540.750	
	SEGRO PLC	207,676.000	1,921,003.000	
イギリス・ポンド	小計	329,021.000	2,691,543.750 (559,679,607)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	407,927.940	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	244,775.280	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	652,703.220 (77,495,453)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	229,185.840	
	GECINA SA	8,697.000	762,726.900	
	KLEPIERRE	36,407.000	903,621.740	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,477.000	1,397,230.740	
	WAREHOUSES DE PAUW	31,043.000	805,876.280	
ユーロ	小計	99,690.000	4,098,641.500 (718,081,991)	
香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	12,323,985.800	
香港・ドル	小計	410,116.000	12,323,985.800 (255,229,746)	
投資証券	合計	2,927,144	27,767,970,337 (27,767,970,337)	
合計			30,167,484,441 (30,167,484,441)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証 券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証 券 時価比 率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式	580銘柄 74.31	-	-	-	76.87
	投資証券	34銘柄 -	-	-	1.54	
イギリス・ポンド	株式	77銘柄 3.83	-	-	-	3.91
	投資証券	2銘柄 -	-	-	0.03	
イスラエル・シケル	株式	8銘柄 0.09	-	-	-	0.09
オーストラリア・ドル	株式	51銘柄 1.82	-	-	-	1.96
	投資信託受益証 券	7銘柄 -	-	0.12	-	
カナダ・ドル	株式	85銘柄 3.05	-	-	-	3.09
	新株予約権証券	1銘柄 -	0.00	-	-	
	投資証券	2銘柄 -	-	-	0.00	
シンガポール・ドル	株式	12銘柄 0.28	-	-	-	0.31
	投資信託受益証 券	2銘柄 -	-	0.02	-	
スイス・フラン	株式	45銘柄 2.50	-	-	-	2.54
スウェーデン・クロー ナ	株式	43銘柄 0.82	-	-	-	0.83
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄 1.01	-	-	-	1.03
ニュージーランド・ド ル	株式	5銘柄 0.05	-	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄 0.15	-	-	-	0.15
ユーロ	株式	217銘柄 8.58	-	-	-	8.74
	投資証券	5銘柄 -	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	24銘柄 0.41	-	-	-	0.43
	投資証券	1銘柄 -	-	-	0.02	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年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
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	255,341,487円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	409,557,576円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	839,978,604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
D I A M 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)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2024年7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	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年7月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	3,235,930,184	
合計	3,235,930,184	

(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(2024年4月19日から2024年7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7月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 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。

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年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)	2,5552円 (25,552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7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	8,000,000.000	7,093,600.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	6,000,000.000	4,985,040.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	10,000,000.000	8,301,515.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	6,000,000.000	5,871,141.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	7,000,000.000	6,293,581.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,307,236.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	5,000,000.000	4,602,370.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	8,000,000.000	5,619,880.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	4,000,000.000	3,208,236.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 4.875 04/30/29	2,000,000.000	2,006,540.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 5.0 04/30/34	3,000,000.000	3,039,676.500	
		ABU DHABI GOVT INT'L 5.5 04/30/54	1,000,000.000	1,020,760.500	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	4,000,000.000	3,896,644.760	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	14,000,000.000	12,114,172.980	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	9,000,000.000	8,033,205.780	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	10,000,000.000	9,497,431.300	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	9,000,000.000	6,574,076.280	
		BRAZIL 6.0 10/20/33	10,000,000.000	9,762,196.000	
		BRAZIL 6.125 03/15/34	3,000,000.000	2,926,912.590	
		BRAZIL 6.25 03/18/31	2,000,000.000	2,001,851.160	
BRAZIL 7.125 05/13/54	3,000,000.000	2,947,592.790			

CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	4,000,000.000	3,342,436.000	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,712,575.360	
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	2,000,000.000	1,975,630.000	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	9,000,000.000	7,477,363.710	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	12,000,000.000	9,605,470.680	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	10,000,000.000	7,782,030.800	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	3,000,000.000	1,825,058.430	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	7,000,000.000	7,070,655.270	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	7,000,000.000	7,318,627.400	
COLOMBIA 8.0 11/14/35	3,000,000.000	3,111,256.890	
COLOMBIA 8.75 11/14/53	3,000,000.000	3,182,170.470	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	9,000,000.000	8,304,833.250	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	7,000,000.000	6,356,795.060	
DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41	3,000,000.000	2,572,843.350	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	9,000,000.000	8,797,365.720	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	6,000,000.000	5,155,091.940	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	6,200,000.000	6,076,140.550	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	6,000,000.000	5,683,225.320	
HUNGARY 2.125 09/22/31	13,000,000.000	10,382,043.750	
HUNGARY 3.125 09/21/51	6,000,000.000	3,849,325.500	
HUNGARY 5.25 06/16/29	13,000,000.000	12,843,246.000	
HUNGARY 5.5 03/26/36	1,000,000.000	968,445.500	
HUNGARY 6.125 05/22/28	9,000,000.000	9,200,110.500	
HUNGARY 6.25 09/22/32	12,000,000.000	12,388,800.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,623,348.000	
INDONESIA 3.05 03/12/51	4,000,000.000	2,722,350.000	
INDONESIA 3.4 09/18/29	200,000.000	185,322.400	
INDONESIA 3.85 10/15/30	9,400,000.000	8,783,115.600	
INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,185,221.500	
INDONESIA 4.2 10/15/50	8,000,000.000	6,649,820.000	
INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,571,524.800	
INDONESIA 4.75 01/08/26	1,000,000.000	993,639.250	
INDONESIA 7.75 01/17/38	500,000.000	616,226.870	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	5,000,000.000	5,018,122.500	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	9,000,000.000	9,188,356.500	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	4,000,000.000	4,140,000.000	

PANAMA 2.252 09/29/32	9,000,000.000	6,556,656.420	
PANAMA 3.16 01/23/30	9,000,000.000	7,671,894.390	
PANAMA 3.87 07/23/60	3,000,000.000	1,735,273.020	
PANAMA 4.5 01/19/63	8,000,000.000	5,167,642.320	
PANAMA 4.5 04/01/56	9,000,000.000	5,903,249.490	
PANAMA 6.4 02/14/35	7,000,000.000	6,700,494.290	
PERU 2.78 12/01/60	3,000,000.000	1,711,925.910	
PERU 2.783 01/23/31	11,000,000.000	9,473,292.730	
PERU 3.0 01/15/34	10,000,000.000	8,192,148.900	
PERU 3.55 03/10/51	7,000,000.000	5,021,159.570	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	6,000,000.000	3,953,124.000	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	7,000,000.000	5,035,184.000	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	3,200,000.000	2,757,558.360	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	7,200,000.000	6,110,700.550	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	5,000,000.000	4,102,919.900	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	8,200,000.000	7,737,072.850	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	3,000,000.000	1,884,308.760	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	8,000,000.000	5,922,679.760	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	4,000,000.000	2,912,686.280	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	10,200,000.000	8,960,035.770	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	5,000,000.000	3,577,220.600	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	7,000,000.000	6,106,154.320	
REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29	1,000,000.000	995,415.150	
REPUBLIC OF CHILE 4.95 01/05/36	2,000,000.000	1,936,366.020	
REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	10,000,000.000	9,918,565.000	
REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	11,000,000.000	10,776,851.250	
REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34	9,000,000.000	8,916,727.500	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	9,000,000.000	8,725,612.500	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	10,000,000.000	9,779,875.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	7,000,000.000	7,156,103.500	

REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	11,000,000.000	11,460,416.000	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	4,000,000.000	3,897,092.480	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	4,000,000.000	4,176,000.000	
ROMANIA 3.0 02/14/31	6,000,000.000	5,052,873.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	8,000,000.000	5,594,660.000	
ROMANIA 5.875 01/30/29	8,000,000.000	8,022,672.000	
ROMANIA 6.375 01/30/34	1,000,000.000	1,017,500.000	
ROMANIA 6.625 02/17/28	7,000,000.000	7,195,370.000	
ROMANIA 7.125 01/17/33	12,000,000.000	12,758,406.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	12,000,000.000	9,618,846.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	4,000,000.000	3,883,720.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	11,200,000.000	10,120,927.600	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	2,000,000.000	1,317,967.500	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	4,400,000.000	3,131,046.600	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	14,000,000.000	13,665,358.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,889,199.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	3,263,647.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30	3,000,000.000	2,963,700.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	10,000,000.000	9,918,675.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	11,000,000.000	10,771,255.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	4,000,000.000	3,541,976.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	2,000,000.000	1,862,431.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	14,000,000.000	14,327,355.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54	2,000,000.000	1,962,780.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	13,000,000.000	12,093,666.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	400,000.000	392,755.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	14,000,000.000	10,813,537.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	10,000,000.000	9,234,380.000	

STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	6,000,000.000	5,907,000.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	5,000,000.000	4,780,062.500	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	8,000,000.000	7,783,660.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	5,000,000.000	4,382,500.000	
STATE OF QATAR 4.75 05/29/34	4,000,000.000	4,023,384.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	8,000,000.000	7,519,380.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	5,000,000.000	3,389,227.500	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	5,000,000.000	4,771,500.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	2,000,000.000	2,022,790.500	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	6,000,000.000	4,995,736.800	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,337,449.700	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	8,000,000.000	6,600,795.040	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	4,000,000.000	2,450,445.680	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	4,000,000.000	2,505,577.760	
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	7,000,000.000	5,533,252.830	
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	3,000,000.000	2,230,106.070	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	6,000,000.000	4,593,225.300	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	7,000,000.000	6,760,668.040	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	6,000,000.000	5,618,311.860	
UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	6,000,000.000	5,600,689.200	
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	6,000,000.000	4,884,946.680	
UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/07/36	2,000,000.000	1,976,957.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	5,000,000.000	4,787,559.200	
UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	10,000,000.000	10,189,897.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54	2,000,000.000	1,934,315.680	

	アメリカ・ドル 小計	885,100,000.000 (143,147,223,000)	787,688,796.140 (127,392,909,000)	
国債証券	合計	143,147,223,000 (143,147,223,000)	127,392,909,000 (127,392,909,000)	
合計			127,392,909,000 (127,392,909,000)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 140銘柄	97.87	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	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	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C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
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,049,103円
M I T O 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）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2024年7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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	8,913,336,464

投資信託受益証券	23,372,516
投資証券	8,017,388
合計	8,881,946,560

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年4月19日から2024年7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・リアル	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。

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2024年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。

(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)	1.9503円 (19,503円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	14,076	16.850	237,180.600	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	5,400	169.360	914,544.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,905	116.340	803,327.700	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	219,522	1.576	345,966.670	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	1.830	162,870.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	61,882	1.642	101,610.240	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	71,084	0.000	0.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	16,003	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC GDR	7,413	0.000	0.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,953	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC	7,574	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	107,951	0.000	0.000	
	SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000	
	TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000	
	VTB BANK PJSC	304,000,000	0.000	0.000	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,573	13.390	409,372.470		
TAL EDUCATION GROUP-ADR	35,582	10.460	372,187.720		
VK CO LTD GDR	9,858	0.000	0.000		
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	897,112	0.000	0.000		
YANDEX NV	25,601	0.000	0.000		
PHOSAGRO PJSC GDR	18,163	0.000	0.000		

	H WORLD GROUP LTD ADR	16,409	30.660	503,099.940	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	QIFU TECHNOLOGY INC ADR	10,000	20.130	201,300.000	
	NIO INC ADR	108,122	4.620	499,523.640	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	59,863	15.060	901,536.780	
	AUTOHOME INC ADR	4,983	27.610	137,580.630	
	KANZHUN LTD ADR	21,614	18.760	405,478.640	
	KE HOLDINGS INC ADR	52,192	15.490	808,454.080	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,782	47.320	273,604.240	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	PDD HOLDINGS INC ADR	48,325	138.070	6,672,232.750	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	32,205	30.480	981,608.400	
	IQIYI INC ADR	33,439	3.920	131,080.880	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	34,164	20.010	683,621.640	
アメリカ・ドル	小計	307,244,720		15,546,181.020 (2,514,283,856)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	118,172	12.040	1,422,790.880	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	243,692	5.800	1,413,413.600	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	284,657	16.080	4,577,284.560	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	230,790	8.100	1,869,399.000	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	350,911	12.440	4,365,332.840	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	532,492	8.050	4,286,560.600	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	323,840	6.450	2,088,768.000	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	151,332	16.650	2,519,677.800	
	MULTIPLY GROUP	316,386	2.070	654,919.020	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	250,589	3.100	776,825.900	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	268,290	3.390	909,503.100	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	3,071,151		24,884,475.300 (1,097,405,361)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	245,849	3,168.450	778,960,264.050	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	118,378	300.350	35,554,832.300	
	ASIAN PAINTS LTD	30,691	2,996.450	91,964,046.950	
	BANK OF BARODA	74,365	256.550	19,078,340.750	
	EICHER MOTORS LTD	11,149	4,849.150	54,063,173.350	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	21,488	2,802.150	60,212,599.200	
	HDFC BANK LTD	226,901	1,626.100	368,963,716.100	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,480	2,732.000	206,211,360.000	

SHREE CEMENT LTD	759	27,905.450	21,180,236.550	
ICICI BANK LTD	419,311	1,243.200	521,287,435.200	
INDUSIND BANK LTD	21,721	1,425.950	30,973,059.950	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	63,885	335.150	21,411,057.750	
STATE BANK OF INDIA LTD	144,138	849.000	122,373,162.000	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	19,695	1,044.000	20,561,580.000	
TATA STEEL LTD	609,848	167.980	102,442,267.040	
TATA MOTORS LTD	136,135	1,005.500	136,883,742.500	
JSW STEEL LTD	47,396	925.400	43,860,258.400	
TATA COMMUNICATIONS LTD	8,325	1,854.750	15,440,793.750	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,653	1,150.800	52,537,472.400	
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,047	9,767.800	19,994,686.600	
TATA POWER CO LTD	116,480	437.350	50,942,528.000	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,690	5,755.550	50,015,729.500	
NESTLE INDIA LTD	27,443	2,616.450	71,803,237.350	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	82,126	327.950	26,933,221.700	
GAIL INDIA LTD	176,391	229.230	40,434,108.930	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	88,970	1,829.850	162,801,754.500	
VEDANTA LTD	90,404	456.700	41,287,506.800	
SUPREME INDUSTRIES LTD	5,257	5,918.000	31,110,926.000	
AXIS BANK LTD	184,556	1,291.650	238,381,757.400	
TITAN COMPANY LTD	28,558	3,225.000	92,099,550.000	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	253,743	298.150	75,653,475.450	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,612	3,040.500	35,306,286.000	
BHARAT ELECTRONICS LTD	294,208	333.850	98,221,340.800	
LUPIN LTD	17,611	1,826.900	32,173,535.900	
NMDC LTD	81,582	244.910	19,980,247.620	
MPHASIS LTD	6,550	2,550.000	16,702,500.000	
BAJAJ FINANCE LTD	22,600	7,054.950	159,441,870.000	
INFOSYS LTD	268,642	1,648.250	442,789,176.500	
WIPRO LTD	105,400	535.550	56,446,970.000	
TATA ELXSI LTD	2,960	7,119.450	21,073,572.000	
MRF LTD	175	130,872.450	22,902,678.750	
INDIAN OIL CORP LTD	231,980	171.900	39,877,362.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	66,717	2,610.450	174,161,392.650	
TRENT LTD	14,859	5,568.000	82,734,912.000	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,212	6,375.700	52,357,248.400	
CUMMINS INDIA LTD	11,753	4,032.750	47,396,910.750	
HCL TECHNOLOGIES LTD	75,976	1,509.950	114,719,961.200	
DABUR INDIA LTD	46,381	631.700	29,298,877.700	
HERO MOTOCORP LTD	9,704	5,508.750	53,456,910.000	

SRF LTD	11,493	2,399.950	27,582,625.350	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,405	3,178.000	20,355,090.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,588	6,592.550	63,209,369.400	
BHARTI AIRTEL LTD	183,172	1,445.050	264,692,698.600	
PUNJAB NATIONAL BANK LTD	175,051	119.220	20,869,580.220	
UNITED SPIRITS LTD	22,698	1,281.050	29,077,272.900	
UNION BANK OF INDIA LTD	119,319	138.370	16,510,170.030	
CANARA BANK	149,548	114.760	17,162,128.480	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	77,006	1,598.550	123,097,941.300	
DIVI'S LABORATORIES LTD	10,063	4,636.950	46,661,627.850	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,365	12,772.800	145,162,872.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	21,722	1,337.100	29,044,486.200	
HAVELLS INDIA LTD	19,728	1,929.450	38,064,189.600	
TVS MOTOR COMPANY LTD	19,342	2,440.250	47,199,315.500	
JINDAL STEEL & POWER LTD	27,284	1,007.850	27,498,179.400	
JINDAL STAINLESS LTD	27,489	794.150	21,830,389.350	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	218,936	200.500	43,896,668.000	
SHRIRAM FINANCE LTD	22,941	2,762.100	63,365,336.100	
PETRONET LNG LTD	61,507	332.800	20,469,529.600	
CIPLA LTD/INDIA	42,866	1,513.200	64,864,831.200	
LARSEN & TOUBRO LTD	54,568	3,650.050	199,175,928.400	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,165	11,634.250	106,627,901.250	
ASHOK LEYLAND LTD	121,319	225.970	27,414,454.430	
BOSCH LTD	592	35,389.950	20,950,850.400	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	73,032	3,909.150	285,493,042.800	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,628	3,096.000	42,192,288.000	
NTPC LTD	350,103	381.400	133,529,284.200	
YES BANK LTD	1,178,292	24.960	29,410,168.320	
AMBUJA CEMENTS LTD	48,912	665.000	32,526,480.000	
BHARAT FORGE LTD	21,319	1,659.800	35,385,276.200	
SUZLON ENERGY LTD	778,252	54.890	42,718,252.280	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	108,877	693.300	75,484,424.100	
ITC LTD	243,422	451.450	109,892,861.900	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,991	3,161.650	37,911,345.150	
UNITED PHOSPHORUS LTD	38,855	559.800	21,751,029.000	
SUNDARAM FINANCE LTD	5,486	4,560.900	25,021,097.400	
PHOENIX MILLS LTD	8,172	3,998.000	32,671,656.000	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,201	2,951.750	24,207,301.750	
THERMAX LTD	3,487	5,326.950	18,575,074.650	
SIEMENS INDIA LTD	7,243	7,846.650	56,833,285.950	
INFO EDGE INDIA LTD	6,037	6,781.700	40,941,122.900	
GMR INFRASTRUCTURE LTD	191,362	97.550	18,667,363.100	

CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	50,227	742.050	37,270,945.350	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	33,447	1,444.100	48,300,812.700	
TECH MAHINDRA LTD	44,064	1,463.350	64,481,054.400	
INDIAN HOTELS CO LTD	70,981	609.850	43,287,762.850	
TORRENT POWER LTD	13,970	1,545.250	21,587,142.500	
MARICO LTD	39,330	646.100	25,411,113.000	
POWER FINANCE CORP LTD	120,494	560.800	67,573,035.200	
PAGE INDUSTRIES LTD	508	39,480.550	20,056,119.400	
ABB LTD/INDIA	4,375	8,542.850	37,374,968.750	
DLF LTD	58,079	836.700	48,594,699.300	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	373,975	346.050	129,414,048.750	
NHPC LTD	249,136	108.820	27,110,979.520	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	7,778	4,558.550	35,456,401.900	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,728	1,487.800	63,570,718.400	
REC LTD	107,503	629.850	67,710,764.550	
BAJAJ FINSERV LTD	29,864	1,582.550	47,261,273.200	
BAJAJ AUTO LTD	5,635	9,542.450	53,771,705.750	
JUBILANT FOODWORKS LTD	30,266	580.150	17,558,819.900	
ADANI POWER LTD	63,076	727.550	45,890,943.800	
MUTHOOT FINANCE LTD	9,935	1,823.700	18,118,459.500	
JSW ENERGY LTD	28,936	724.400	20,961,238.400	
COAL INDIA LTD	125,313	490.750	61,497,354.750	
TATA MOTORS LTD	33,523	682.550	22,881,123.650	
INDUS TOWERS LTD	66,139	382.900	25,324,623.100	
PI INDUSTRIES LTD	6,463	3,845.700	24,854,759.100	
VARUN BEVERAGES LTD	36,645	1,599.350	58,608,180.750	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	8,731	4,528.650	39,539,643.150	
LTIMINDTREE LTD	7,301	5,376.250	39,252,001.250	
ADANI GREEN ENERGY LTD	25,426	1,755.650	44,639,156.900	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	78,639	632.750	49,758,827.250	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,495	629.950	19,210,325.250	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	16,100	5,486.150	88,327,015.000	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,421	4,159.650	30,868,762.650	
BANDHAN BANK LTD	72,375	192.430	13,927,121.250	
GODREJ PROPERTIES LTD	9,790	3,313.900	32,443,081.000	
POLYCAB INDIA LTD	4,354	6,358.300	27,684,038.200	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	33,361	1,421.050	47,407,649.050	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	22,115	745.300	16,482,309.500	

	INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	18,362	1,021.850	18,763,209.700	
	ZOMATO LTD	537,478	211.370	113,606,724.860	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	24,489	1,525.150	37,349,398.350	
	MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	64,064	907.550	58,141,283.200	
	APL APOLLO TUBES LTD	12,592	1,565.550	19,713,405.600	
	SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	32,684	689.950	22,550,325.800	
	PB FINTECH LTD	24,230	1,420.600	34,421,138.000	
	MANKIND PHARMA LTD	8,411	2,150.250	18,085,752.750	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	228,797	347.950	79,609,916.150	
	ASTRAL POLYTECHNIK LTD	10,569	2,349.500	24,831,865.500	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	12,852	4,834.450	62,132,351.400	
	IDFC BANK LTD	288,299	78.210	22,547,864.790	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	18,897	1,877.750	35,483,841.750	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	30,106	660.750	19,892,539.500	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	14,217	4,281.250	60,866,531.250	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	2,247	12,362.150	27,777,751.050	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	35,181	1,558.800	54,840,142.800	
インド・ルピー	小計	12,514,565		9,946,537,443.370 (19,395,748,015)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	547,000	1,345.000	735,715,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,181,870	1,110.000	2,421,875,700.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	112,201	23,550.000	2,642,333,550.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	364,000	6,000.000	2,184,000,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	591,600	2,960.000	1,751,136,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,654,200	4,540.000	7,510,068,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,947,700	3,160.000	12,474,732,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	620,600	5,425.000	3,366,755,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	192,100	8,725.000	1,676,072,500.000	
	BANK MANDIRI	3,023,800	6,375.000	19,276,725,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,522,400	4,850.000	26,783,640,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,203,900	4,820.000	5,802,798,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,953,000	1,530.000	2,988,090,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,463,000	10,100.000	45,076,300,000.000	

	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	633,400	9,500.000	6,017,300,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,308,000	2,900.000	3,793,200,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	194,100	10,300.000	1,999,230,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,482,800	2,900.000	4,300,120,000.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	74,896,200	50.000	3,744,810,000.000	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL PT	528,400	11,350.000	5,997,340,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	794,082	2,420.000	1,921,678,440.000	
	インドネシア・ルピア 小計	106,214,353		162,463,919,190.000 (1,624,639,192)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	14,732	35.240	519,155.680	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	63.990	371,142.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	41.250	245,025.000	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	36.940	110,820.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	15,000	11.820	177,300.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	8.500	102,000.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	5,180	27.820	144,107.600	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	13.670	166,774.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	17.210	301,175.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	18,640	22.130	412,503.200	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	14.120	269,692.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	47.260	56,712.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	14.210	230,202.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	2,200	30.550	67,210.000	
	CHANGCHUN HIGH-TECH INDUSTRY GROUP CO LTD	2,100	91.520	192,192.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	19.400	228,920.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	19.690	159,489.000	

SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	26.040	361,956.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	17.690	422,791.000	
GEM CO LTD	29,100	6.350	184,785.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	46.730	121,498.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	10.930	75,417.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	3.270	189,987.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	21.090	356,421.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	8,260	57.570	475,528.200	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	5.660	88,256.380	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	20.850	123,098.400	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,812	19.670	114,322.040	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	14.950	199,732.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	27.060	138,006.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	44.990	418,407.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	18.320	190,528.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	1,000	36.430	36,430.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	24,000	43.690	1,048,560.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	8,950	26.260	235,027.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	9.700	174,600.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	8.070	145,260.000	
TIANQI LITHIUM CORP	4,300	27.920	120,056.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	8.450	94,640.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	8.450	209,560.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	12.970	182,877.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	30.920	371,040.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	15.410	120,198.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	9.250	476,837.500	

CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	7,800	41.110	320,658.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,239	50.910	113,987.490	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	11,470	39.200	449,624.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.250	130,175.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	3.470	127,349.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	39,729	9.860	391,727.940	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	29.260	316,008.000	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	500	27.010	13,505.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	13.150	90,735.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	33,100	6.670	220,777.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	57.760	283,024.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	9.680	148,104.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	6,200	26.730	165,726.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	33.000	165,000.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	70,900	3.620	256,658.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	12.520	199,068.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	19.490	191,002.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,600	133.500	1,014,600.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	4,800	50.990	244,752.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	8.230	112,545.250	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	8,740	7.760	67,822.400	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	29.970	272,727.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	96.230	346,428.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.990	254,995.200	

BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	7.600	108,680.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	31,154	41.080	1,279,806.320	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	15.900	475,410.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.020	429,226.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	9.270	184,473.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	14.800	282,680.000	
IFLYTEK CO LTD	7,900	38.860	306,994.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	1.940	181,196.000	
GOERTEK INC	25,100	21.450	538,395.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	5.930	126,309.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	21.330	750,816.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	30,200	19.570	591,014.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	54,420	4.150	225,843.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	4.760	134,708.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	14.160	573,310.080	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.080	138,016.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,300	23.800	292,740.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	51.020	536,730.400	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	77,918	10.120	788,530.160	
JIANGSU YANGHE DISTILLERY CO LTD	7,800	77.680	605,904.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	18,600	126.540	2,353,644.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	58,900	7.750	456,475.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	137,400	4.190	575,706.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	8.680	398,412.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	37.880	458,348.000	
MIDEA GROUP CO LTD	16,200	63.810	1,033,722.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	8.140	344,322.000	
PING AN BANK CO LTD	97,200	10.140	985,608.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	24,480	19.610	480,052.800	

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	113,500	4.260	483,510.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	6.650	366,415.000	
ZTE CORP	16,500	28.850	476,025.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	7.320	208,620.000	
WEICHAI POWER CO LTD	44,200	14.100	623,220.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	35.680	149,856.000	
GF SECURITIES CO LTD	15,300	11.690	178,857.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	6.690	141,159.000	
BYD CO LTD	8,400	252.500	2,121,000.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	7.470	254,727.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	15.840	153,014.400	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	30.970	161,663.400	
LB GROUP CO LTD	11,000	18.450	202,950.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	7.590	324,852.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	11.120	130,104.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	14.920	189,484.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,200	319.580	703,076.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	6.890	207,389.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	22.950	293,760.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	6.970	238,374.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	197.140	335,138.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	7.340	114,504.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	28.670	189,222.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	47.190	28,314.000	
NINESTAR CORP	10,400	27.940	290,576.000	
HISENSE HOME APPLIANCES GROUP CO LTD	5,700	27.680	157,776.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	5.350	204,370.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	6.970	177,177.400	

HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	20.070	339,183.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	61.610	112,130.200	
SF HOLDING CO LTD	24,400	34.850	850,340.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	4.890	115,404.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	55.420	138,550.000	
ELOPTOLINK TECHNOLOGY INC LTD	3,900	119.400	465,660.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	80,290	7.270	583,708.300	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	7.150	278,135.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	82,800	5.260	435,528.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	42.480	97,704.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	28,900	18.560	536,384.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	13.390	86,512.790	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	24,800	13.760	341,248.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	35.730	110,763.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.490	236,025.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46	13.180	606.280	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	4.440	172,272.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	17.710	270,573.380	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	2,200	75.250	165,550.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	37.100	163,611.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,700	29.400	108,780.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	27.930	75,411.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	46.720	98,112.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	23.260	212,038.160	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	12.560	119,320.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	4,340	157.530	683,680.200	
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY NETWORK & TECHNOLOGY HOLDINGS CO LTD	27,500	11.760	323,400.000	

JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	100	66.600	6,660.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	19.240	132,756.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	3,340	120.730	403,238.200	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	101.310	303,930.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	25.980	124,704.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	23.810	73,811.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	15.020	48,064.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	6.470	82,169.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	45.170	108,408.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	14.730	313,749.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	140	46.350	6,489.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	27.510	52,269.000	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	21.050	248,390.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	57,600	28.950	1,667,520.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,800	278.900	1,617,620.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,600	49.230	78,768.000	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	4,050	39.410	159,610.500	
SG MICRO CORP	3,395	76.120	258,427.400	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	21,540	173.050	3,727,497.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	97.040	292,672.640	
WUXI APPTTEC CO LTD	13,972	37.540	524,508.880	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	51,400	9.470	486,758.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	18.320	188,696.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,400	5.150	120,510.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	3.090	254,925.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	28.810	210,313.000	

MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	73.770	188,851.200	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	25,300	17.240	436,172.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	18.700	138,847.500	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,540	169.890	261,630.600	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	61.610	67,771.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	34.450	86,814.000	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	142.020	426,060.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	60.600	327,240.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	53,400	6.250	333,750.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	28,700	9.010	258,587.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	5,030	104.440	525,333.200	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.810	321,183.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	2.360	166,852.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	42.480	454,536.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	6.560	162,688.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	47.490	137,721.000	
CGN POWER CO LTD	69,500	4.830	335,685.000	
CITIC PACIFIC SPECIAL STEEL GROUP CO LTD	21,200	12.890	273,268.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	199,300	5.440	1,084,192.000	
GONEO GROUP CO LTD	2,755	74.400	204,972.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	62.700	200,640.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,120	79.360	88,883.200	
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO LTD	2,800	100.000	280,000.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	105.530	162,094.080	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	5,520	23.230	128,229.600	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	117,600	5.130	603,288.000	

BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	8.680	182,280.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	33.490	107,168.000	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	1,350	26.800	36,180.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	8.400	365,400.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	48.920	68,488.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	26.040	158,844.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,860	32.820	93,865.200	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	10.020	115,951.440	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	5.430	193,308.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	6,577	65.590	431,385.430	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	61.300	177,770.000	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	5,320	8.230	43,783.600	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	71.600	186,160.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,900	27.160	214,564.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	54.600	251,160.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	4,000	105.120	420,480.000	
PIOTECH INC	876	114.680	100,459.680	
RANGE INTELLIGENT COMPUTING TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9,100	23.010	209,391.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	7.240	291,048.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,800	211.140	591,192.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,060	26.680	108,320.800	
ANKER INNOVATIONS TECHNOLOGY CO LTD	3,400	62.910	213,894.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,540	160.340	246,923.600	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	4,480	80.140	359,027.200	

BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	187.330	458,396.510	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	14.810	281,390.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	840	367.660	308,834.400	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	18.800	161,680.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.100	389,760.000	
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	16,800	19.150	321,720.000	
PETROCHINA CO LTD	117,300	10.330	1,211,709.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	305,700	6.000	1,834,200.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	413,100	4.550	1,879,605.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	4.750	931,000.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	160,800	6.420	1,032,336.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	31.270	431,526.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,900	41.710	1,413,969.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	93,700	34.680	3,249,516.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	51,800	41.860	2,168,348.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	99,900	16.610	1,659,339.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	166,700	8.690	1,448,623.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	133,400	3.890	518,926.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	13.820	587,350.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	6,000	1,437.590	8,625,540.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	194,300	7.380	1,433,934.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	59,700	18.170	1,084,749.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,200	28.930	1,162,986.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	6.000	229,800.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	110,600	30.100	3,329,060.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	7.140	589,764.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	3.280	755,384.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	168,300	5.210	876,843.000	

HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	8.180	453,990.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	6.450	456,015.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	29,600	25.130	743,848.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	138,300	5.550	767,565.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	124,800	4.730	590,304.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	117,500	6.920	813,100.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	24.510	568,632.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	13.960	576,548.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	9.350	551,650.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	25.210	294,957.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	55,700	8.520	474,564.000	
CRRC CORP LTD	108,900	7.660	834,174.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	32,652	39.410	1,286,815.320	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	17.020	296,148.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	12.280	494,884.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	85,600	6.140	525,584.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,600	30.730	202,818.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	25,700	26.360	677,452.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	45,600	15.520	707,712.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	5.790	586,527.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	7.740	434,988.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	22.170	274,908.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	5.770	152,328.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	38,100	11.810	449,961.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	14,500	77.750	1,127,375.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	3.520	277,024.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GENERATION CO LTD	81,400	3.170	258,038.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	103,500	18.380	1,902,330.000	

FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	7.600	418,760.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	18.550	708,610.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	41,712	24.690	1,029,869.280	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.880	175,224.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	63.350	620,830.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	7.570	233,913.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.410	313,725.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	66.660	293,304.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	2.150	53,750.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	76,300	7.560	576,828.000	
AIR CHINA LTD	44,800	7.070	316,736.000	
TBEA CO LTD	24,180	12.890	311,680.200	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	7.600	330,600.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	3.080	173,096.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	5.380	560,596.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	21,200	41.120	871,744.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,600	33.970	394,052.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	29.100	200,790.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	23.700	353,130.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.580	122,794.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	5,800	15.870	92,046.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	25,200	7.270	183,204.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	8.680	286,440.000	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	23,700	19.640	465,468.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	18.830	214,662.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	35.520	330,336.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.030	574,719.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	20,450	4.690	95,910.500	

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	72,870	14.370	1,047,141.900	
CMOC GROUP LIMITED	79,800	8.780	700,644.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	31,700	16.860	534,462.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	4.900	165,620.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	36.380	327,420.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	29.470	592,936.400	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	18.170	141,726.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	10.700	296,390.000	
PEOPLE.CN CO LTD	7,000	19.250	134,750.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.090	292,447.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	27,300	15.120	412,776.000	
YUTONG BUS CO LTD	6,000	24.870	149,220.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	8.890	381,381.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	3.730	296,535.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	16.250	244,058.750	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	6.520	378,160.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	16,400	16.640	272,896.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	16.340	167,713.760	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	9.080	147,550.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	16.680	55,044.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	5.760	259,776.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.110	124,490.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	49.230	502,146.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	8.300	156,870.000	
YOUNGOR FASHION CO LTD	25,600	7.090	181,504.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	38.400	176,640.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	5.790	97,272.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	800	16.330	13,064.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	14,200	7.240	102,808.000	

SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	8.610	192,433.500	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	3.720	146,568.000	
HISENSE VISUAL TECHNOLOGY CO LTD	9,300	22.090	205,437.000	
WESTERN MINING CO LTD	15,100	18.780	283,578.000	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,500	203.700	509,250.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	6.730	229,493.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	6,080	191.280	1,162,982.400	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	8.140	462,352.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	5.160	129,000.000	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-TECH PARK DEVELOPMENT CO LTD	16,400	18.150	297,660.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	1,250	28.370	35,462.500	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	23.100	468,930.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	4.000	116,800.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	3,240	23.700	76,788.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	15.370	193,662.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	15,900	14.560	231,504.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	19.680	82,656.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.260	218,232.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	7.490	355,475.400	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	20.480	260,096.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	17.790	103,715.700	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	9.570	186,615.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	10.590	124,962.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	10.250	229,600.000	

SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	15,400	22.730	350,042.000	
SHANXI COAL INTERNATIONAL ENERGY GROUP CO LTD	11,100	13.540	150,294.000	
TONGWEI CO LTD	17,000	16.780	285,260.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	12,784	30.000	383,520.000	
JCET GROUP CO LTD	10,900	32.780	357,302.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	18.100	123,080.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	59.670	149,175.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	22.120	117,236.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	25.420	266,655.800	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	74.870	127,279.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	10.210	206,711.660	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	1.660	103,584.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	7.570	99,924.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	3,924	43.000	168,732.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	16.250	318,500.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	14.560	286,832.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	14.590	229,063.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	2,210	52.590	116,223.900	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	30.180	147,882.000	
NINGBO SANXING MEDICAL ELECTRIC CO LTD	9,004	32.560	293,170.240	
SHEDE SPIRITS CO LTD	2,100	52.570	110,397.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	2,100	28.280	59,388.000	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	44.430	39,987.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	2,156	73.300	158,034.800	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	1,000	210.480	210,480.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	59.810	95,696.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	38.220	271,362.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	15.940	176,934.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	4.450	675,510.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	24.470	283,852.000	

SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	52,200	6.920	361,224.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	7,760	37.460	290,689.600	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	12,200	72.820	888,404.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	44,968	13.560	609,766.080	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	14.800	187,960.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	123.770	222,786.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	7.530	551,949.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	700	31.960	22,372.000	
HEILAN HOME CO LTD	44,100	8.040	354,564.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	40,151	25.400	1,019,835.400	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	25,519	34.130	870,963.470	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	4,400	46.160	203,104.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	7.890	104,148.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	60.140	420,980.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	1,000	11.090	11,090.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	13.470	548,229.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	11.240	1,180,200.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	37.090	126,106.000	
SERES GROUP CO LTD	9,000	85.200	766,800.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	55.320	293,196.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.700	640,640.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	33,900	13.320	451,548.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	18.170	207,138.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	43.330	60,662.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	21,200	14.170	300,404.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	950	27.300	25,935.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	10.020	304,608.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	5.480	231,804.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	20.220	372,048.000	

	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,616	13.620	76,489.920	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,804	23.070	110,828.280	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	53.370	156,907.800	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	19.470	220,205.700	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	15,900	7.430	118,137.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	52.500	346,500.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	14.130	226,080.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	29.330	131,985.000	
オフショア・人民元 小計		13,126,235		171,999,298.670 (3,814,669,246)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	364,684	15.080	5,499,434.720	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	268,621	4.100	1,101,346.100	
	OOREDOO QSC	60,920	10.480	638,441.600	
	QATAR FUEL QSC	46,222	14.900	688,707.800	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,416	15.650	585,560.400	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	83,628	10.520	879,766.560	
	INDUSTRIES QATAR QSC	123,793	13.230	1,637,781.390	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	145,929	19.750	2,882,097.750	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	239,235	4.650	1,112,442.750	
	MASRAF AL RAYAN	479,150	2.326	1,114,502.900	
	BARWA REAL ESTATE CO	190,141	2.771	526,880.710	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	429,105	1.672	717,463.560	
	DUKHAN BANK	131,518	3.793	498,847.770	
カタール・リアル 小計		2,600,362		17,883,274.010 (794,553,864)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	836,149	0.724	605,371.870	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	152,316	0.450	68,542.200	
	GULF BANK KSCP	154,340	0.278	42,906.520	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	647,282	0.856	554,073.390	
	MABANEE CO KPSC	49,098	0.880	43,206.240	
	BOUBYAN BANK KSCP	113,874	0.578	65,819.170	
クウェート・ディナール 小計		1,953,059		1,379,919.390	

				(730,763,911)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	31,105	18,100.000	563,000,500.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,049	35,200.000	705,724,800.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	39,539	33,840.000	1,337,999,760.000	
コロンビア・ペソ 小計		90,693		2,606,725,060.000 (106,065,036)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	21,587	39.200	846,210.400	
	JARIR MARKETING CO	45,430	12.760	579,686.800	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	5,690	144.800	823,912.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	31,195	53.100	1,656,454.500	
	SAUDI BRITISH BANK	80,349	38.150	3,065,314.350	
	AL RAJHI BANK	158,927	80.500	12,793,623.500	
	ARAB NATIONAL BANK	74,025	20.780	1,538,239.500	
	BANK ALBILAD	48,216	32.500	1,567,020.000	
	BANK AL-JAZIRA	37,396	16.180	605,067.280	
	BANQUE SAUDI FRANSI	47,579	35.150	1,672,401.850	
	RIYAD BANK	120,931	26.100	3,156,299.100	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	56,260	12.480	702,124.800	
	SAUDI TELECOM CO	162,904	38.650	6,296,239.600	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,317	113.400	2,077,147.800	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	73,284	74.000	5,423,016.000	
	SAUDI ELECTRICITY CO	70,794	16.240	1,149,694.560	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	27,847	21.040	585,900.880	
	SAVOLA GROUP	20,951	46.100	965,841.100	
	ALMARAI CO JSC	19,978	57.800	1,154,728.400	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,121	229.400	715,957.400	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	30,296	28.100	851,317.600	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,164	39.050	396,904.200	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	60,476	8.000	483,808.000	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	38,509	12.040	463,648.360	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	36,059	11.000	396,649.000	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,510	241.800	1,574,118.000		
ALINMA BANK	100,733	31.500	3,173,089.500		
SAUDI ARABIAN MINING CO	105,148	42.800	4,500,334.400		
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,975	122.600	977,735.000		

	DALLAH HEALTHCARE CO	2,553	157.600	402,352.800	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	291,673	28.100	8,196,011.300	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	6,966	283.000	1,971,378.000	
	ACWA POWER CO	11,887	374.000	4,445,738.000	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	3,981	129.600	515,937.600	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	1,686	277.000	467,022.000	
	NAHDI MEDICAL CO	3,277	133.400	437,151.800	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,500	229.400	802,900.000	
	ELM CO	1,959	865.000	1,694,535.000	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	6,635	60.500	401,417.500	
	ADES HOLDING CO	26,333	19.660	517,706.780	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	2,057	311.400	640,549.800	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	238,281	36.050	8,590,030.050	
	サウジアラビア・リアル 小計	2,121,439		89,275,214.510 (3,855,796,515)	
タイ・パーツ	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	303,000	17.400	5,272,200.000	
	CP AXTRA PCL NVDR	159,300	30.000	4,779,000.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	45,400	128.500	5,833,900.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL- NVDR	1,667,200	1.780	2,967,616.000	
	SHIN CORP PCL	70,700	74.500	5,267,150.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	24.200	7,260,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	94,100	221.000	20,796,100.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	516,920	9.350	4,833,202.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	250,000	86.500	21,625,000.000	
	PTT PCL	783,400	33.250	26,048,050.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	80,500	38.500	3,099,250.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	65,050	231.000	15,026,550.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	347,800	58.250	20,259,350.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	156,500	56.500	8,842,250.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	911,100	26.250	23,916,375.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	51,300	247.000	12,671,100.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	274,010	29.250	8,014,792.500	
	THAI OIL PCL NVDR	89,000	53.000	4,717,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	480,400	57.500	27,623,000.000	

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	110,445	151.000	16,677,195.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	135,122	19.800	2,675,415.600	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	183,408	31.000	5,685,648.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	138,000	12.400	1,711,200.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	629,900	7.650	4,818,735.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	253,500	41.250	10,456,875.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	527,100	3.620	1,908,102.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	158,333	31.750	5,027,072.750	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	97,800	30.500	2,982,900.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	208,600	16.200	3,379,320.000	
	SCB X PCL NVDR	67,700	106.000	7,176,200.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	896,328	9.100	8,156,584.800	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	68,800	40.500	2,786,400.000	
	タイ・パーツ 小計	10,120,716		302,293,533.650 (1,348,229,160)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,881	780.000	4,587,180.000	
	CEZ	13,485	895.000	12,069,075.000	
	MONETA MONEY BANK AS	23,959	104.200	2,496,527.800	
	チェコ・コルナ 小計	43,325		19,152,782.800 (132,152,286)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,279,808	45.400	239,703,283.200	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	7,027	26,500.000	186,215,500.000	
	BANCO DE CHILE	3,896,607	109.500	426,678,466.500	
	EMPRESAS CMPC SA	84,902	1,693.000	143,739,086.000	
	EMPRESAS COPEC SA	29,969	6,962.000	208,644,178.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,173,923	73.400	86,165,948.200	
	ENEL AMERICAS SA	1,683,461	87.160	146,730,460.760	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	13,823,587	12.600	174,177,196.200	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	11,501	37,920.000	436,117,920.000	
	FALABELLA SA	63,470	2,940.000	186,601,800.000	
	CENCOSUD SA	116,272	1,703.000	198,011,216.000	
	ENEL CHILE SA	1,930,415	54.000	104,242,410.000	
	チリ・ペソ 小計	28,100,942		2,537,027,464.860 (449,563,804)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	260,091	64.000	16,645,824.000	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	108,854	65.000	7,075,510.000	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	107,671	55.000	5,921,905.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,691	1,039.000	5,912,949.000	
	KOC HOLDING AS	59,863	224.700	13,451,216.100	
	SASA POLYESTER SANAYI	105,230	43.080	4,533,308.400	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	109,000	49.480	5,393,320.000	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	9,553	315.000	3,009,195.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,686	304.750	13,618,058.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	105,442	109.000	11,493,178.000	
	TURKIYE IS BANKASI	657,193	15.810	10,390,221.330	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	79,870	168.000	13,418,160.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	281,190	30.400	8,548,176.000	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	82,771	101.000	8,359,871.000	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,340	825.500	5,233,670.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	36,989	543.000	20,085,027.000	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	16,769	245.600	4,118,466.400	
	トルコ・リラ 小計	2,077,203		157,208,055.730 (773,762,329)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	11,886	9,625.000	114,402,750.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	32,609	2,830.000	92,283,470.000	
	OTP BANK NYRT	18,316	17,925.000	328,314,300.000	
	ハンガリー・フォロント 小計	62,811		535,000,520.000 (238,136,756)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	496,800	29.050	14,432,040.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	144,448	121.500	17,550,432.000	
	AYALA CORP	21,463	573.000	12,298,299.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	79,760	356.400	28,426,464.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	204,960	26.300	5,390,448.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	34,240	222.000	7,601,280.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	153,485	65.350	10,030,244.750	
	BDO UNIBANK INC	189,682	141.000	26,745,162.000	
	PLDT INC	5,690	1,490.000	8,478,100.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	843,375	28.400	23,951,850.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	75,450	115.500	8,714,475.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,383	846.500	16,407,709.500	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,420	377.000	9,206,340.000	
	フィリピン・ペソ 小計	2,293,156		189,232,844.250	

(524,496,674)

ブラジル・リアル	BRF SA	49,200	21.930	1,078,956.000	
	VALE SA	275,289	62.170	17,114,717.130	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	83,500	9.980	833,330.000	
	RAIA DROGASIL SA	102,064	25.140	2,565,888.960	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,450	42.640	871,988.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	96,400	38.230	3,685,372.000	
	BANCO DO BRASIL SA	136,600	26.610	3,634,926.000	
	ITAUSA SA	440,107	10.110	4,449,481.770	
	GERDAU SA	111,337	17.880	1,990,705.560	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	302,010	40.770	12,312,947.700	
	VIBRA ENERGIA SA	84,500	22.480	1,899,560.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	384,212	38.070	14,626,950.840	
	CCR SA	79,920	12.780	1,021,377.600	
	WEG SA	133,344	44.050	5,873,803.200	
	BANCO BRADESCO SA PRAF	427,902	12.670	5,421,518.340	
	BANCO BRADESCO SA	126,592	11.550	1,462,137.600	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	48,206	12.890	621,375.340	
	SUZANO SA	62,775	52.450	3,292,548.750	
	CPFL ENERGIA SA	16,900	33.460	565,474.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	391,547	33.450	13,097,247.150	
	ENGIE BRASIL SA	15,287	45.780	699,838.860	
	LOCALIZA RENT A CAR	77,089	45.250	3,488,277.250	
	LOJAS RENNER SA	84,020	13.300	1,117,466.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	62,004	23.000	1,426,092.000	
	COSAN SA	108,400	14.030	1,520,852.000	
	TOTVS SA	43,300	30.180	1,306,794.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	82,600	33.630	2,777,838.000	
	JBS SA	63,800	30.820	1,966,316.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	142,040	10.460	1,485,738.400	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,498	85.100	2,340,079.800	
	ENEVA SA	44,000	13.410	590,040.000	
	HYPERA SA	29,800	29.210	870,458.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	450,048	10.730	4,829,015.040	
PRIO SA	66,200	45.470	3,010,114.000		
TELEFONICA BRASIL SA	35,328	47.450	1,676,313.600		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	57,900	33.320	1,929,228.000		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	404,761	4.070	1,647,377.270		

	ATACADA O DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	54,800	10.400	569,920.000	
	AMBEV SA	373,395	11.400	4,256,703.000	
	NATURA & CO HOLDING SA	68,800	15.600	1,073,280.000	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACOES S/A	52,100	14.300	745,030.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	108,900	11.300	1,230,570.000	
	TIM SA	61,300	16.100	986,930.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	46,300	28.650	1,326,495.000	
	LOCALIZA RENT A CAR SA- RTS	778	12.300	9,569.400	
	RUMO SA	104,500	22.350	2,335,575.000	
	ブラジル・リアル 小計	6,037,803		141,636,216.560 (4,224,951,685)	
ポーランド・ズ ロチ	MBANK	1,196	631.000	754,676.000	
	BUDIMEX SA	1,092	677.000	739,284.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,446	153.350	1,755,244.100	
	BANK PEKAO SA	15,205	167.450	2,546,077.250	
	ORLEN SA	47,436	65.800	3,121,288.800	
	LPP SA	91	16,860.000	1,534,260.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,835	554.000	1,570,590.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,671	147.650	689,673.150	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	69,657	61.420	4,278,332.940	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	80,249	7.178	576,027.320	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	47,901	49.540	2,373,015.540	
	DINO POLSKA SA	3,914	393.500	1,540,159.000	
	ALLEGRO.EU SA	47,943	35.765	1,714,681.390	
	ポーランド・ズロチ 小計	333,636		23,193,309.490 (953,319,239)	
マレーシア・リ ンギット	AMMB HOLDINGS BHD	201,900	4.360	880,284.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	566,200	7.090	4,014,358.000	
	CELCOMDIGI BHD	272,700	3.590	978,993.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	82,820	10.100	836,482.000	
	RHB BANK BHD	103,780	5.530	573,903.400	
	GAMUDA BHD	156,100	7.520	1,173,872.000	
	GENTING BHD	164,900	4.540	748,646.000	
	YTL CORP BHD	263,000	3.770	991,510.000	
	HONG LEONG BANK BHD	49,008	19.120	937,032.960	
	IOI CORP BHD	206,713	3.680	760,703.840	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,900	20.020	878,878.000	
	MALAYAN BANKING BHD	426,075	10.020	4,269,271.500	
	MISC BHD	102,180	8.670	885,900.600	

	NESTLE MALAYSIA BHD	6,000	122.700	736,200.000	
	PPB GROUP BHD	50,260	14.280	717,712.800	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,900	17.200	393,880.000	
	PETRONAS GAS BHD	61,000	17.880	1,090,680.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	240,100	2.490	597,849.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,300	6.940	661,382.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	213,750	14.400	3,078,000.000	
	QL RESOURCES BHD	87,050	6.530	568,436.500	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,185,250	4.140	4,906,935.000	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	193,300	5.220	1,009,026.000	
	SIME DARBY BERHAD	234,400	2.640	618,816.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	264,700	2.490	659,103.000	
	MAXIS BHD	175,800	3.460	608,268.000	
	INARI AMERTRON BHD	221,900	3.950	876,505.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	217,400	6.170	1,341,358.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	190,200	6.300	1,198,260.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	284,100	6.080	1,727,328.000	
	SD GUTHRIE BHD	161,500	4.210	679,915.000	
	MR DIY GROUP M BHD	245,100	1.930	473,043.000	
	マレーシア・リンギット 小計	6,789,286		39,872,532.600 (1,373,497,105)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	262,900	11.200	2,944,480.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	105,200	64.170	6,750,684.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,115	351.100	5,657,976.500	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	15,860	170.270	2,700,482.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	47,400	136.350	6,462,990.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	206,800	149.790	30,976,572.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	87,025	23.790	2,070,324.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,495	258.210	4,000,963.950	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	121,600	31.390	3,817,024.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	13,950	556.660	7,765,407.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	250,652	111.790	28,020,387.080	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	153,200	45.470	6,966,004.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	39,700	178.920	7,103,124.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	419,200	64.420	27,004,864.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	32,725	290.020	9,490,904.500	

	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	22,800	162.120	3,696,336.000	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	104,000	17.730	1,843,920.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,481,678	16.320	24,180,984.960	
	BANCO DEL BAJIO SA	67,400	58.350	3,932,790.000	
メキシコ・ペソ	小計	3,463,700		185,386,218.940 (1,681,026,617)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	81,745	3.650	298,369.250	
	ALPHA BANK A.E.	185,591	1.640	304,369.240	
	NATIONAL BANK OF GREECE	60,562	7.860	476,017.320	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,676	14.070	234,631.320	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	220,148	2.069	455,486.210	
	METLEN ENERGY & METALS SA	8,906	36.880	328,453.280	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,506	22.800	125,536.800	
	OPAP SA	13,744	15.210	209,046.240	
	JUMBO SA	9,605	26.240	252,035.200	
	PUBLIC POWER CORP	16,875	11.660	196,762.500	
ユーロ	小計	622,488		2,880,707.360 (504,699,929)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	176,300.000	303,236,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,928	175,800.000	514,742,400.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,524	378,000.000	954,072,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,655	107,200.000	391,816,000.000	
	COWAY CO LTD	4,084	60,500.000	247,082,000.000	
	KT&G CORP	8,543	86,100.000	735,552,300.000	
	KAKAO CORP	25,719	42,750.000	1,099,487,250.000	
	KUM YANG CO LTD	2,599	82,500.000	214,417,500.000	
	HANWHA OCEAN CO LTD	7,741	29,850.000	231,068,850.000	
	SK TELECOM CO LTD	3,745	51,200.000	191,744,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	22,468	7,620.000	171,206,160.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,142	191,800.000	219,035,600.000	
	LG UPLUS CORP	17,131	9,800.000	167,883,800.000	
	DOOSAN ENERBILITY	35,773	21,850.000	781,640,050.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	4,225	55,700.000	235,332,500.000	
	LG H&H CO LTD	762	357,500.000	272,415,000.000	
	LG CHEM LTD	4,078	356,000.000	1,451,768,000.000	
	LG CHEM LTD	599	242,000.000	144,958,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	34,460	51,000.000	1,757,460,000.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	20,327	18,120.000	368,325,240.000	

S-OIL CORP	3,289	66,600.000	219,047,400.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	9,175	26,850.000	246,348,750.000	
POSCO FUTURE M CO LTD	2,467	258,000.000	636,486,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,312	106,000.000	139,072,000.000	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,314	164,100.000	543,827,400.000	
HYUNDAI MOBIS	4,809	233,500.000	1,122,901,500.000	
SK HYNIX INC	44,109	239,000.000	10,542,051,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,695	31,800.000	181,101,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,864	170,000.000	316,880,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	10,993	274,500.000	3,017,578,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,856	28,650.000	225,074,400.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,785	13,880.000	302,375,800.000	
KIA CORPORATION	21,109	122,000.000	2,575,298,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	676	530,000.000	358,280,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,038	19,670.000	413,817,460.000	
KOREAN AIR CO LTD	14,033	22,250.000	312,234,250.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,209	154,000.000	186,186,000.000	
KT CORP	3,119	36,000.000	112,284,000.000	
HLB INC	9,430	93,700.000	883,591,000.000	
LG ELECTRONICS INC	8,378	110,300.000	924,093,400.000	
LG CORP	7,791	80,600.000	627,954,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,234	12,760.000	117,825,840.000	
NAVER CORP	10,590	177,500.000	1,879,725,000.000	
L&F CO LTD	2,034	142,000.000	288,828,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,443	70,200.000	241,698,600.000	
POSCO HOLDINGS INC	5,851	368,500.000	2,156,093,500.000	
SAMSUNG E&A CO LTD	12,226	23,350.000	285,477,100.000	
COSMOAM&T CO LTD	1,730	148,300.000	256,559,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,502	373,000.000	1,679,246,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,673	164,300.000	767,773,900.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	385,943	87,800.000	33,885,795,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	54,110	9,840.000	532,442,400.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	2,834	256,500.000	726,921,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	66,036	69,600.000	4,596,105,600.000	
YUHAN CORP	4,700	89,400.000	420,180,000.000	
GS HOLDINGS CORP	3,803	47,150.000	179,311,450.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,592	12,550.000	296,079,600.000	

CELLTRION INC	12,428	184,700.000	2,295,451,600.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3,614	162,400.000	586,913,600.000	
HANA FINANCIAL GROUP	23,172	61,700.000	1,429,712,400.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,620	246,000.000	398,520,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,314	93,200.000	122,464,800.000	
POSCO DX CO LTD	4,364	37,200.000	162,340,800.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,563	94,000.000	616,922,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,280	154,000.000	351,120,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,855	108,300.000	525,796,500.000	
ECOPRO CO LTD	7,950	99,900.000	794,205,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	713	366,000.000	260,958,000.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,242	287,500.000	357,075,000.000	
SK INC	2,945	153,500.000	452,057,500.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	31,100	83,600.000	2,599,960,000.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,645	49,600.000	279,992,000.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,042	81,100.000	652,206,200.000	
HANMI PHARM CO LTD	585	302,000.000	176,670,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,531	42,800.000	236,726,800.000	
HANJIN KAL CORP	2,068	67,500.000	139,590,000.000	
HYUNDAI ELECTRIC & ENERGY SYSTEM CO LTD	1,799	342,000.000	615,258,000.000	
HD HYUNDAI CO LTD	3,943	73,300.000	289,021,900.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,013	92,200.000	185,598,600.000	
NETMARBLE CORP	2,112	58,200.000	122,918,400.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	48,505	14,660.000	711,083,300.000	
ECOPRO BM CO LTD	3,906	189,500.000	740,187,000.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,210	80,000.000	176,800,000.000	
ENCHEM CO LTD	933	214,000.000	199,662,000.000	
KRAFTON INC	2,300	283,000.000	650,900,000.000	
ECOPRO MATERIALS CO LTD	1,066	99,600.000	106,173,600.000	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,930	155,300.000	299,729,000.000	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,878	43,050.000	80,847,900.000	
SK SQUARE CO LTD	8,002	103,000.000	824,206,000.000	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,340	53,500.000	125,190,000.000	
HYBE CO LTD	1,649	190,500.000	314,134,500.000	
LG ENERGY SOLUTION	3,851	362,000.000	1,394,062,000.000	
KAKAObANK CORP	13,292	21,500.000	285,778,000.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,513	160,300.000	563,133,900.000	
ALTEOGEN INC	3,259	270,000.000	879,930,000.000	
SAMSUNG C&T CORP	6,833	147,000.000	1,004,451,000.000	

	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,415	807,000.000	1,141,905,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,542	51,000.000	231,642,000.000	
韓国・ウォン 小計		1,250,297		106,031,081,800.000 (12,426,842,787)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	88,000	15.580	1,371,040.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	7.740	789,480.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	8,700	115.420	1,004,154.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	100,000	19.980	1,998,000.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,500	25.800	1,096,500.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	320,000	5.390	1,724,800.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	476,000	3.120	1,485,120.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	232,700	10.280	2,392,156.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	51,000	24.450	1,246,950.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	691,600	6.020	4,163,432.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	320,120	13.020	4,167,962.400	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	261,388	25.950	6,783,018.600	
	CITIC LTD	463,000	7.040	3,259,520.000	
	LENOVO GROUP LTD	656,000	11.280	7,399,680.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,696,000	8.010	13,584,960.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	116,390	8.180	952,070.200	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,967,200	4.860	9,560,592.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	74,000	9.420	697,080.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	221,000	7.750	1,712,750.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,100	61.700	3,954,970.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	324,000	8.450	2,737,800.000	
	HISENSE KELON ELECTRICAL HOLDINGS CO LTD	28,000	22.650	634,200.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	108,000	12.000	1,296,000.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	310,000	5.240	1,624,400.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	199,000	7.200	1,432,800.000		
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	482,000	8.170	3,937,940.000		
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	77,000	28.500	2,194,500.000		
BYD CO LTD	84,500	236.800	20,009,600.000		

CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	7.170	1,147,200.000	
MMG LTD	252,000	3.000	756,000.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,000	117.900	1,179,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	561,788	9.110	5,117,888.680	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.520	770,880.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	153,200	23.450	3,592,540.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	190,000	12.680	2,409,200.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	608,000	10.800	6,566,400.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	439,000	17.260	7,577,140.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	194,400	3.870	752,328.000	
WEICHAI POWER CO LTD	152,440	12.220	1,862,816.800	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	9.360	1,067,040.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	9.620	1,731,600.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	50,000	48.100	2,405,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	206,000	4.280	881,680.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	129,333	26.350	3,407,924.550	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	94,000	5.200	488,800.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	823,250	2.780	2,288,635.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	263,000	13.780	3,624,140.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	534,100	377.600	201,676,160.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	544,000	35.200	19,148,800.000	
LI NING CO LTD	193,500	14.820	2,867,670.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	268,000	2.220	594,960.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	348,000	3.980	1,385,040.000	
ZTE CORP	63,288	18.920	1,197,408.960	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	272,000	34.550	9,397,600.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	221,250	12.300	2,721,375.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	686,205	5.740	3,938,816.700	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	170,250	10.720	1,825,080.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	51,500	32.400	1,668,600.000	

BAIDU INC	184,800	95.050	17,565,240.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,748,530	5.430	42,074,517.900	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	66,700	71.900	4,795,730.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	408,000	2.570	1,048,560.000	
BANK OF CHINA LTD	6,371,200	3.470	22,108,064.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	320,470	33.150	10,623,580.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,252,235	4.320	22,689,655.200	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	126,500	14.660	1,854,490.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	147,600	4.510	665,676.000	
CHINA COAL ENERGY CO	171,000	8.310	1,421,010.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	21.700	1,193,500.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	37,600	31.550	1,186,280.000	
CMOC GROUP LIMITED	315,000	7.510	2,365,650.000	
CHINA CITIC BANK-H	678,800	4.680	3,176,784.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	58,700	46.100	2,706,070.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	102,200	69.000	7,051,800.000	
FOSUN INTERNATIONAL	242,028	4.180	1,011,677.040	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	316,000	4.100	1,295,600.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,200	22.200	1,691,640.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,821,000	1.090	1,984,890.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	48,000	16.880	810,240.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	351,000	4.080	1,432,080.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	63,500	36.400	2,311,400.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	423,000	4.710	1,992,330.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	208,200	19.320	4,022,424.000	
CRRC CORP LTD - H	342,000	5.010	1,713,420.000	
SINOPHARM GROUP CO	104,000	19.540	2,032,160.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	214,527	2.660	570,641.820	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	230,500	11.440	2,636,920.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	228,000	7.030	1,602,840.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	70,400	11.340	798,336.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	168,800	8.180	1,380,784.000	

LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	155,000	10.600	1,643,000.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	85,200	15.620	1,330,824.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	531,656	2.770	1,472,687.120	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.360	535,720.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,224,000	3.370	7,494,880.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	68,000	11.820	803,760.000	
FAR EAST HORIZON LTD	169,000	5.100	861,900.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	129,000	11.000	1,419,000.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	239,600	3.390	812,244.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	672,000	2.580	1,733,760.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	265,000	3.740	991,100.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	670,000	4.210	2,820,700.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	84,000	9.060	761,040.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	64,000	16.580	1,061,120.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,674,000	1.020	3,747,480.000	
XIAOMI CORP	1,238,800	16.120	19,969,456.000	
BEIGENE LTD	54,600	85.850	4,687,410.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	24,112	27.600	665,491.200	
MEITUAN	410,610	114.900	47,179,089.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	104,800	14.960	1,567,808.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	136,000	13.020	1,770,720.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,000	3.470	1,339,420.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	98,500	36.100	3,555,850.000	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	40,300	22.600	910,780.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	133,000	3.720	494,760.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	88,000	15.960	1,404,480.000	
CHINA FEIHE LTD	341,000	3.550	1,210,550.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,258,968	73.100	92,030,560.800	
JD.COM INC	188,535	103.900	19,588,786.500	

SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	140,000	8.390	1,174,600.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	51.000	387,600.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	186,200	47.100	8,770,020.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	197,800	24.050	4,757,090.000	
BILIBILI INC	19,180	130.500	2,502,990.000	
AKESO INC	50,000	37.350	1,867,500.000	
NETEASE INC	156,600	141.700	22,190,220.000	
NONGFU SPRING CO LTD	163,600	35.250	5,766,900.000	
LI AUTO INC	100,500	77.100	7,748,550.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	88,050	20.650	1,818,232.500	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	30,400	26.100	793,440.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	63,200	24.100	1,523,120.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	163,161	4.380	714,645.180	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	117,900	63.500	7,486,650.000	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	35,600	36.750	1,308,300.000	
JD LOGISTICS INC	148,100	8.210	1,215,901.000	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	24,000	41.250	990,000.000	
TRIP.COM GROUP LTD	44,500	391.600	17,426,200.000	
XPENG INC	101,300	29.600	2,998,480.000	
MINISO GROUP HOLDING LTD	28,600	37.050	1,059,630.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	42,000	22.650	951,300.000	
CGN POWER CO LTD	826,000	3.480	2,874,480.000	
GF SECURITIES CO LTD	83,200	6.320	525,824.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	48,400	46.700	2,260,280.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	80,600	7.990	643,994.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	172,500	5.420	934,950.000	
CHINA LITERATURE LTD	37,600	25.000	940,000.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	25,000	10.640	266,000.000	
BOC AVIATION LTD	18,300	56.750	1,038,525.000	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	98,000	10.240	1,003,520.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	122,800	8.190	1,005,732.000	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	308,000	10.660	3,283,280.000	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	520,000	2.080	1,081,600.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	33,040	15.760	520,710.400	

	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	15.240	914,400.000	
香港・ドル 小計		64,078,604		901,682,230.050 (18,673,838,984)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	40,633	575.000	23,363,975.000	
	ACER INC	237,661	46.800	11,122,534.800	
	ASUSTEK COMPUTER INC	57,108	508.000	29,010,864.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	39,932	570.000	22,761,240.000	
	ASIA CEMENT CORP	164,778	44.400	7,316,143.200	
	TAIWAN BUSINESS BANK	498,399	18.450	9,195,461.550	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	76,954	122.000	9,388,388.000	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	41,646	317.000	13,201,782.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,335	180.000	10,320,300.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	109,525	175.500	19,221,637.500	
	QUANTA COMPUTER INC	215,697	341.000	73,552,677.000	
	EVA AIRWAYS CORP	228,765	35.550	8,132,595.750	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50,554	219.000	11,071,326.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	445,423	18.750	8,351,681.250	
	CHINA AIRLINES	231,823	24.600	5,702,845.800	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	160,684	46.150	7,415,566.600	
	CHINA STEEL CORP	964,670	23.050	22,235,643.500	
	ADVANTECH CO LTD	38,979	372.500	14,519,677.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	353,445	34.900	12,335,230.500	
	DELTA ELECTRONICS INC	158,235	420.500	66,537,817.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	110,788	72.300	8,009,972.400	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	300,565	118.500	35,616,952.500	
	AUD CORP	526,500	18.650	9,819,225.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	147,784	102.000	15,073,968.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	83,482	177.000	14,776,314.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	225,768	36.950	8,342,127.600	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	40,131	139.500	5,598,274.500		
ECLAT TEXTILE CO LTD	14,780	547.000	8,084,660.000		
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	46,961	570.000	26,767,770.000		
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	9,804	945.000	9,264,780.000		
FORMOSA PLASTICS CORP	312,857	56.500	17,676,420.500		
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	281,026	47.050	13,222,273.300		
MEDIATEK INC	122,945	1,435.000	176,426,075.000		

FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	630,238	89.100	56,154,205.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	727,923	27.150	19,763,109.450	
HOTAI MOTOR CO LTD	23,556	619.000	14,581,164.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	150,343	79.500	11,952,268.500	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	826,220	33.550	27,719,681.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	775,894	63.600	49,346,858.400	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,234,386	16.650	20,552,526.900	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,137,113	29.600	33,658,544.800	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,008,195	223.500	225,331,582.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	909,173	41.650	37,867,055.450	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,159	3,110.000	25,374,490.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	934,391	19.750	18,454,222.250	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,048,098	11.850	12,419,961.300	
INVENTEC CO LTD	220,927	57.000	12,592,839.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	165,221	109.000	18,009,089.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	836,686	26.400	22,088,510.400	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,434,831	40.850	58,612,846.350	
ASIA VITAL COMPONENTS CO LTD	26,609	726.000	19,318,134.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	859,997	28.750	24,724,913.750	
NAN YA PLASTICS CORP	375,894	48.000	18,042,912.000	
WISTRON CORP	210,211	108.000	22,702,788.000	
POU CHEN CORP	168,225	34.150	5,744,883.750	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	389,625	84.700	33,001,237.500	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	43,796	279.500	12,240,982.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	87,341	63.700	5,563,621.700	
E INK HOLDINGS INC	68,620	266.500	18,287,230.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121,517	45.300	5,504,720.100	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	106,935	72.400	7,742,094.000	
TCC GROUP HOLDINGS	548,163	33.850	18,555,317.550	

	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,989,940	1,045.000	2,079,487,300.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	899,843	54.700	49,221,412.100	
	WAN HAI LINES LTD	51,482	76.100	3,917,780.200	
	WALSIN LIHWA CORP	221,605	35.250	7,811,576.250	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	247,693	25.400	6,291,402.200	
	YAGEO CORP	27,165	764.000	20,754,060.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	144,188	65.100	9,386,638.800	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	145,465	30.500	4,436,682.500	
	GLOBAL UNICHIP CORP	6,904	1,605.000	11,080,920.000	
	INNOLUX CORPORATION	691,396	15.100	10,440,079.600	
	WPG HOLDINGS CO LTD	133,481	93.000	12,413,733.000	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	4,925	2,780.000	13,691,500.000	
	PEGATRON CORP	158,874	105.500	16,761,207.000	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	6,436	2,785.000	17,924,260.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,248	985.000	11,079,280.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	120,333	158.000	19,012,614.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	56,562	148.500	8,399,457.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	836,951	26.300	22,011,811.300	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	322,570	44.500	14,354,365.000	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	4,934	2,000.000	9,868,000.000	
	WIWYNN CORP	7,791	2,620.000	20,412,420.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	267,472	179.500	48,011,224.000	
	SILERGY CORP	26,396	430.000	11,350,280.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	17,593	578.000	10,168,754.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	22,335	588.000	13,132,980.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,658	383.000	5,614,014.000	
	台湾・ドル 小計	27,912,164		4,046,377,740.650 (20,063,154,756)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	27,835	283.000	7,877,305.000	
	CLICKS GROUP LTD	19,196	338.340	6,494,774.640	
	DISCOVERY LTD	42,619	137.550	5,862,243.450	
	GOLD FIELDS LTD	71,833	289.100	20,766,920.300	
	REMGRO LTD	41,148	136.040	5,597,773.920	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	43,521	176.360	7,675,363.560	
	EXXARO RESOURCES LTD	21,000	193.000	4,053,000.000	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,963	2,627.030	18,292,009.890	
	MTN GROUP LTD	135,077	81.990	11,074,963.230	

FIRSTRAND LTD	409,321	77.900	31,886,105.900	
NASPERS LTD	14,368	3,505.240	50,363,288.320	
NEDBANK GROUP LTD	37,719	254.500	9,599,485.500	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,842	642.990	3,756,347.580	
SASOL LTD	48,138	136.660	6,578,539.080	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,769	288.500	11,473,356.500	
STANDARD BANK GROUP LTD	106,544	208.920	22,259,172.480	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	78,996	60.000	4,739,760.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,167	235.000	7,089,245.000	
ABSA GROUP LTD	70,074	154.520	10,827,834.480	
SANLAM LTD	139,073	81.350	11,313,588.550	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	69,363	96.100	6,665,784.300	
KUMBA IRON ORE LTD	5,386	449.860	2,422,945.960	
OUTSURANCE GROUP LTD	70,350	46.800	3,292,380.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	51,779	96.820	5,013,242.780	
NEPI ROCKCASTLE NV	45,937	130.500	5,994,778.500	
OLD MUTUAL LTD	391,487	12.300	4,815,290.100	
REINET INVESTMENTS SCA	11,620	451.240	5,243,408.800	
PEPKOR HOLDINGS LTD	169,735	19.150	3,250,425.250	
SIBANYE STILLWATER LTD	224,039	21.690	4,859,405.910	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	30,906	126.730	3,916,717.380	
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	34,335	522.770	17,949,307.950	
BID CORP LTD	26,051	423.790	11,040,153.290	
南アフリカ・ランド 小計	2,520,191		332,044,917.600 (2,965,161,114)	
合計	604,642,899		100,266,758,221 (100,266,758,221)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	91,500.000	2,901,465.000		
		ENERGISA SA	19,900.000	945,250.000		
		KLABIN SA	65,450.000	1,362,669.000		
		ブラジル・リアル	小計	176,850.000	5,209,384.000 (155,393,841)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,205,475.000	14,369,262.000		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,900.000	6,071,583.000		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	154,410.000	31,490,375.400		
		メキシコ・ペソ	小計	1,399,785.000	51,931,220.400 (470,896,728)	
	投資信託受益証券	合計		1,576,635	626,290,569 (626,290,569)	

投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	229,200.000	5,402,244.000	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA DE CV	69,100.000	4,599,987.000	
	メキシコ・ペソ	小計	298,300.000	10,002,231.000 (90,697,230)	
投資証券 合計			298,300	90,697,230 (90,697,230)	
合計				716,987,799 (716,987,799)	

(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 41銘柄	2.37	-	-	2.49
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 11銘柄	1.03	-	-	1.09
インド・ルピー	株式 146銘柄	18.27	-	-	19.21
インドネシア・ルピア	株式 21銘柄	1.53	-	-	1.61
オフショア・人民元	株式 432銘柄	3.59	-	-	3.78
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.75	-	-	0.79
クウェート・ディナール	株式 6銘柄	0.69	-	-	0.72
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.10	-	-	0.11
サウジアラビア・リアル	株式 42銘柄	3.63	-	-	3.82
タイ・バーツ	株式 32銘柄	1.27	-	-	1.34
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.12	-	-	0.13
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.42	-	-	0.45
トルコ・リラ	株式 17銘柄	0.73	-	-	0.77
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.22	-	-	0.24
フィリピン・ペソ	株式 13銘柄	0.49	-	-	0.52
ブラジル・レアル	株式 46銘柄 投資信託受益証券 3銘柄	3.98 -	- 0.15	- -	4.34
ポーランド・ズロチ	株式 13銘柄	0.90	-	-	0.94
マレーシア・リンギット	株式 32銘柄	1.29	-	-	1.36
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 2銘柄	1.58 - -	- 0.44 -	- - 0.09	2.22
ユーロ	株式 11銘柄	0.48	-	-	0.50
韓国・ウォン	株式 98銘柄	11.71	-	-	12.31

香港・ドル	株式	156銘柄	17.59	-	-	18.49
台湾・ドル	株式	88銘柄	18.90	-	-	19.87
南アフリカ・ランド	株式	32銘柄	2.79	-	-	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。

DIAMマネーマザーファンド

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	83,747,990
国債証券	399,959,000
未収利息	2,756
前払費用	712
流動資産合計	483,710,458
資産合計	483,710,458
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	481,035,704
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,674,754
元本等合計	483,710,458
純資産合計	483,710,458
負債純資産合計	483,710,458

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。

(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	496,151,514円
同期中追加設定元本額	1,292,889,110円
同期中一部解約元本額	1,308,004,920円
元本の内訳	
ファンド名	
バンクローン・ファンド（ヘッジなし）	15,843,407円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり）	13,867,169円
バンクローン・ファンド（ヘッジなし/年1回決算型）	1,088,285円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり/年1回決算型）	98,095円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	3,959,763円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号	989,197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号	48,517円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号	11,377円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号	98,027円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号	989,197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号	494,102円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり>	791,316円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし>	2,474,972円
クルーズコントロール	294,047,243円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>	10,530,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149,716円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>	5,972円
USストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジあり）	993,740円
USストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）	1,987,479円
D I A M - ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>	9,935円
マシューズ・アジア株式ファンド	14,723,185円

One世界分散セレクト(Aコース)	99,040円
One世界分散セレクト(Bコース)	99,040円
One世界分散セレクト(Cコース)	99,040円
世界8資産リスク分散バランスファンド(目標払出し型)	99,109円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(毎月決算型) (為替ヘッジあり)	188,380円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(毎月決算型) (為替ヘッジなし)	109,063円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(年1回決算型) (為替ヘッジあり)	297,442円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(年1回決算型) (為替ヘッジなし)	118,977円
ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド	99,255,584円
PIMCOストラテジック・インカム・ファンド(為替ヘッジあり)	301,134円
PIMCOストラテジック・インカム・ファンド(為替ヘッジなし)	1,493,740円
One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド(成長型)	9,943,324円
One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド(隔月決算・予想分配金提示型)	1,988,665円
計	481,035,704円
2. 受益権の総数	481,035,704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 2024年1月12日 至 2024年7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ぬ。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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7月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		30,176
合計		30,176

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2024年4月6日から2024年7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)	1.0056円 (10,056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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	440回 利付国庫債券(2年)	100,000,000	100,000,000	
	446回 利付国庫債券(2年)	100,000,000	99,961,000	
	1228回 国庫短期証券	200,000,000	199,998,000	
国債証券 合計		400,000,000	399,959,000	
合計			399,959,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年7月31日現在

資産総額	8,337,841,386円
負債総額	68,302,071円
純資産総額（ - ）	8,269,539,315円
発行済数量	6,026,965,093口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3721円

（参考）

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

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年7月31日現在

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

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

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

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

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

DIAMマネーマザーファンド

2024年7月31日現在

資産総額	5,082,438,461円
負債総額	0円
純資産総額(-)	5,082,438,461円
発行済数量	5,055,874,095口
1口当たり純資産額(/)	1.0053円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2024年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)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年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		
建物	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		
ソフトウェア	5,021	4,495
ソフトウェア仮勘定	3,367	2,951
ソフトウェア仮勘定	1,651	1,543
電話加入権	2	0
投資その他の資産		
投資有価証券	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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							12,360	12,360	12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034
当期変動額									
剰余金の配当							11,040	11,040	11,040
当期純利益							12,852	12,852	12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,812	1,812	1,812
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	79,034
当期変動額			
剰余金の配当			11,040
当期純利益			12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	1,812
当期末残高	0	0	80,846

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 ... 8～18年 器具備品 ... 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

(1) 委託者報酬

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

(2) 運用受託報酬

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

(3) 投資助言報酬

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

(4) 成功報酬

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

注記事項**（貸借対照表関係）**

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（百万円）

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

（損益計算書関係）

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

（百万円）

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

2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

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

（株主資本等変動計算書関係）

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2024年6月17日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生(予定)日
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類 株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第38期(2023年3月31日現在)

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

第39期(2024年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	28,143	28,143	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,145	28,145	-

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

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期(2023年3月31日現在)

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

第39期(2024年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	41,183	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,143	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	19,018	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,577	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	91,923	1	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第38期（2023年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	29,184	-	29,184
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,186	-	29,186

第39期（2024年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	28,143	-	28,143
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,145	-	28,145

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第38期の貸借対照表計上額5,810百万円、第39期の貸借対照表計上額4,447百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第38期（2023年3月31日現在）

（百万円）

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

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

第39期（2024年3月31日現在）

（百万円）

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、有価証券について1,362百万円(関係会社株式1,362百万円)減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	191	246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

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

(百万円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

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

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において24百万円、当事業年度において6百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.56%	1.00% ~ 3.56%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103百万円、当事業年度104百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

	第38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	30.62 %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.69 %	1.44 %
その他	0.06 %	0.14 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.87 %	29.04 %

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,039百万円	7,649百万円
経常利益	8,039百万円	7,649百万円
税引前当期純利益	8,039百万円	7,649百万円
当期純利益	6,744百万円	6,474百万円
1株当たり当期純利益	168,617円97銭	161,850円28銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,228百万円	3,837百万円

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

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

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（持分法損益等）

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	8,140	未払 手数料	1,870
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	16,655	未払 手数料	3,137

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	1,975,862円96銭	2,021,173円74銭
1株当たり当期純利益金額	345,535円19銭	321,310円79銭

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

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

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2024年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社東北銀行（ 1）	13,233	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行（ 1）	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社群馬銀行	48,652	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社富山銀行	6,730	日本において銀行業務を営んでおります。
スルガ銀行株式会社	30,043	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行（ 1）	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社池田泉州銀行	61,385	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社紀陽銀行	80,096	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行（ 1）	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社伊予銀行	20,948	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十八親和銀行	36,878	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社肥後銀行	18,128	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社鹿児島銀行	18,130	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社きらやか銀行（ 1）	34,183	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社仙台銀行	22,735	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東和銀行	38,653	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社神奈川銀行	6,191	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	（ 2）890,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一生命保険株式会社（ 1）	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
アイザワ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
a uカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

池田泉州TT証券株式会社	1,250	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
四国アライアンス証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	54,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
OKB証券株式会社(1)	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三証券株式会社	5,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
九州FG証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ぐんぎん証券株式会社(1)	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
静岡東海証券株式会社	600	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社(1)	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
十六TT証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	(3)19,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東海東京証券株式会社	6,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
とうほう証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
内藤証券株式会社	3,002	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	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。
株式会社証券ジャパン	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
野村証券株式会社(1)	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ひろぎん証券株式会社(1)	5,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
フィデリティ証券株式会社	12,658	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ワイエム証券株式会社	1,270	「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

- (1) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。
- (2) 出資の総額
- (3) 2023年12月31日現在

(3) 投資顧問会社

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

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書(目論見書)および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2024年5月23日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長 谷 川 敬指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲 葉 宏 和

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2024年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 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているクルーズコントロールの2024年1月12日から2024年7月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、クルーズコントロールの2024年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計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。