

**【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】 | 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)<br>投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)<br>投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)  |
| 【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】        | 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)<br>1兆円を上限とします。<br>投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)<br>1兆円を上限とします。<br>投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)<br>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】

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

(以下、総称して「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)」は「ターゲット・イヤー2040」、「投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)」は「ターゲット・イヤー2050」、「投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)」は「ターゲット・イヤー2060」という場合があります。)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権(以下「受益権」といいます。)

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

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

#### <基準価額の照会方法等>

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

・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各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2024年10月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### （６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

#### （７）【申込期間】

継続申込期間：2024年10月12日から2025年4月10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】

各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。

( 1 0 ) 【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）

( 1 1 ) 【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

( 1 2 ) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

#### 振替受益権について

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

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

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドの信託金限度額は、各々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 投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

- 主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)にマザーファンド\*を通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

\*マザーファンドについては、後掲の「マザーファンドの概要」をご覧ください。



※各ファンドでは、主要投資対象資産のうち国内債券、為替ヘッジ先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。

- 外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ\*を行い、一部または全部の為替リスクの軽減をめざします。

\*一部の外貨建資産の通貨については、委託会社はその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。

## 2 信託期間を3つの期間（資産育成期、資産形成期、資産安定期）に分け、それぞれの期間に応じて、基準価額の目標変動リスク\*を変更しつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。

\*価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

・ターゲットイヤーが異なる3つのファンドから選択できます。

|       | ターゲット・イヤー2040                    | ターゲット・イヤー2050                    | ターゲット・イヤー2060                    | 目標変動リスク                      |
|-------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 資産育成期 | 設定日以降<br>2020年の決算日まで             | 設定日以降<br>2030年の決算日まで             | 設定日以降<br>2040年の決算日まで             | 年率6%程度                       |
| 資産形成期 | 2020年の決算日翌日<br>以降<br>2040年の決算日まで | 2030年の決算日翌日<br>以降<br>2050年の決算日まで | 2040年の決算日翌日<br>以降<br>2060年の決算日まで | 年率6%程度から<br>年率2%程度へ<br>月次で逡減 |
| 資産安定期 | 2040年の決算日翌日<br>以降                | 2050年の決算日翌日<br>以降                | 2060年の決算日翌日<br>以降                | 年率2%程度                       |

※目標変動リスクは、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は各ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、各ファンドの収益目標を意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

### 運用プロセス

■資産育成期および資産形成期においては、「基本配分戦略」に基づき、各資産への投資比率(0%～100%)を決定します。

- 基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出し、その時点のファンドの目標変動リスクを考慮したうえで、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定し、各マザーファンド、および為替ヘッジ比率を決定します。

- 基本配分戦略は月次で行います。

※基本配分戦略に関して、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。

■資産安定期においては、「基本配分戦略」に加え、「機動的配分戦略」に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

- 機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%～100%)を変更します。

- 機動的配分戦略は日次で行います。

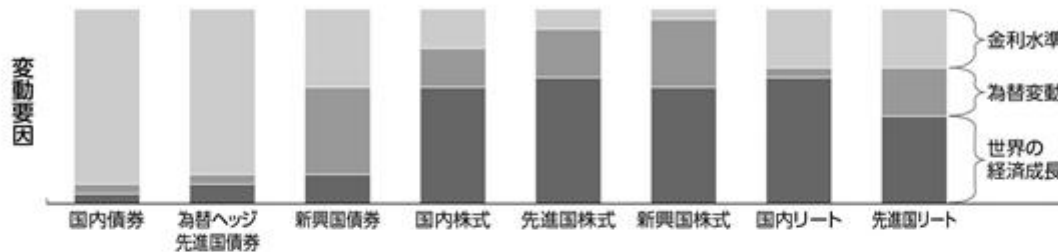
# 基本配分戦略

## (月次戦略)

各ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、それぞれの変動要因からファンドが受ける影響が均等になるように配分することで、各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分比率および通貨配分比率を決定します。

### 基本配分比率決定のイメージ

変動要因と値動きへの影響度合い(例)

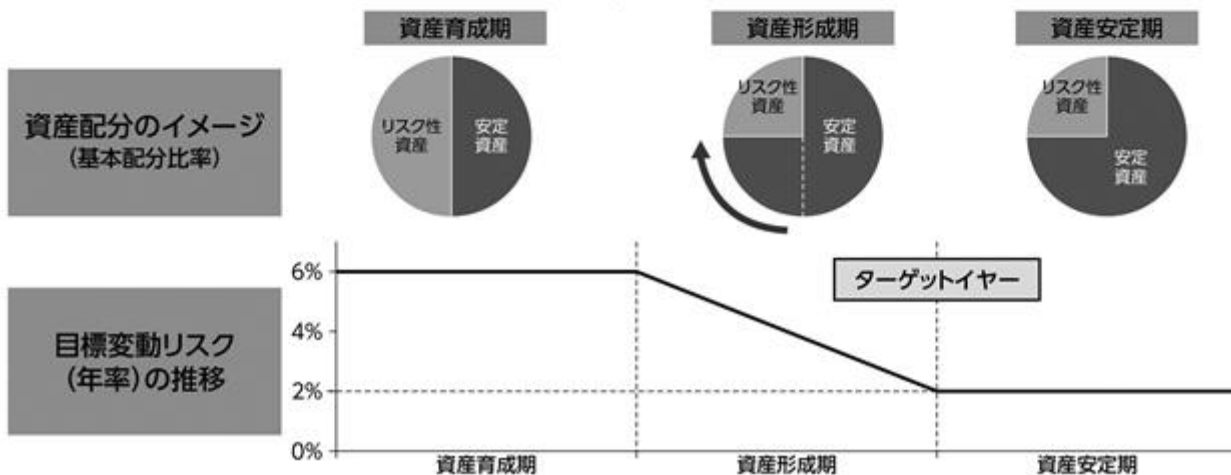


変動要因からファンドが受ける影響を均等に配分



着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

上記の配分から目標変動リスクになるように最適と判断される資産配分比率および通貨配分比率を決定



※基本配分比率決定のイメージについては、現金等は考慮しません。

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。



# 機動的配分戦略

(日次戦略)

市場環境に応じて、安定資産、リスク性資産、現金等\*の比率を調整します。

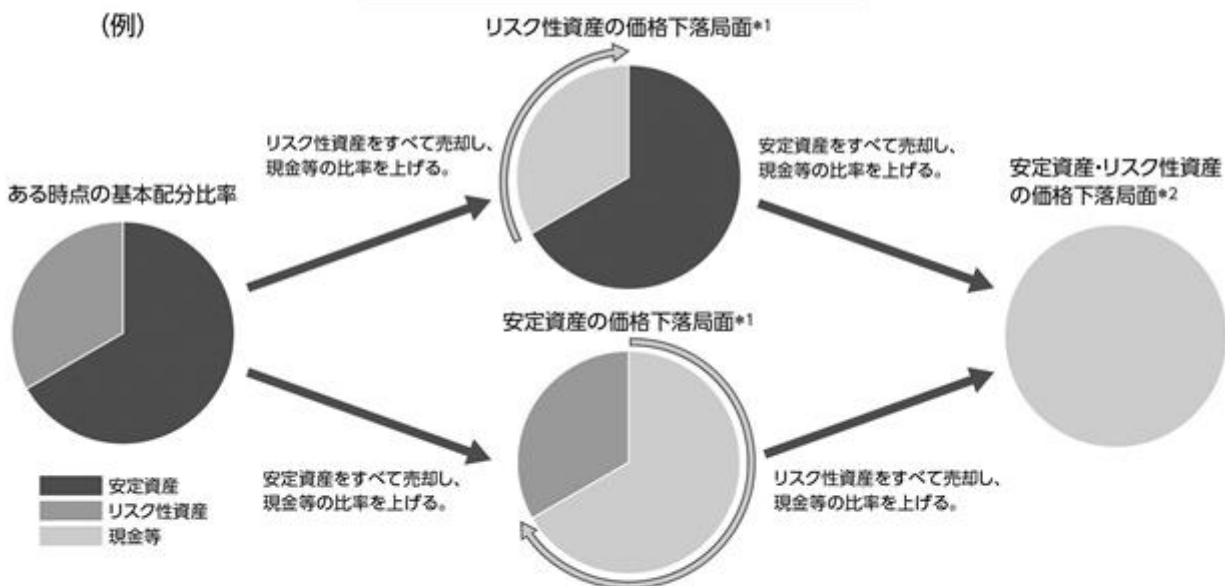
※比率の調整は、「安定局面」、下落の危険性が高まった「警戒局面」、下落の危険性が最も高まった「危機局面」の各判定局面に応じて行います。

資産安定期において、リスク性資産と安定資産のそれぞれに対して相場環境を日々判定し、下落の危険性が高まったと判定した場合は、安定資産、リスク性資産、現金等の比率を調整することで基準価額の下落の抑制をめざします。

\* 現金等とは、短期国債およびコール・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。

※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

## 価格下落局面における配分比率変更のイメージ



\*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。

\*2 両資産価格についての下落の危険性が最も高まった場合は、速やかにリスク性資産および安定資産をすべて売却し、現金等に入れ替えます。

※相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合があります。

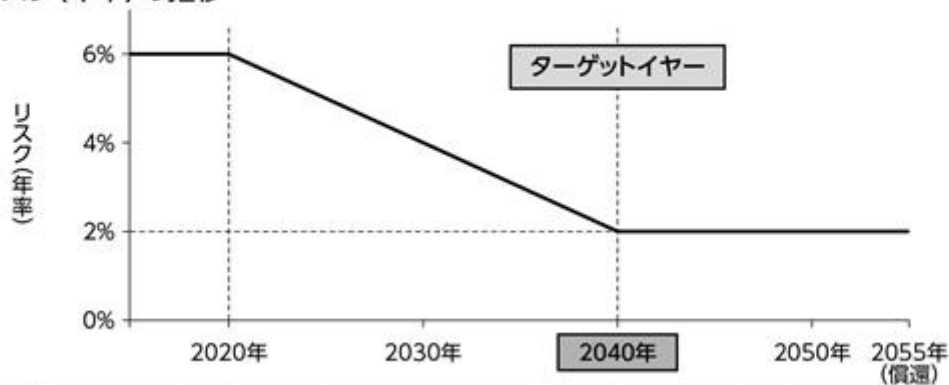
※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

## 運用期間中のポートフォリオ変化のイメージ

## ターゲット・イヤー2040

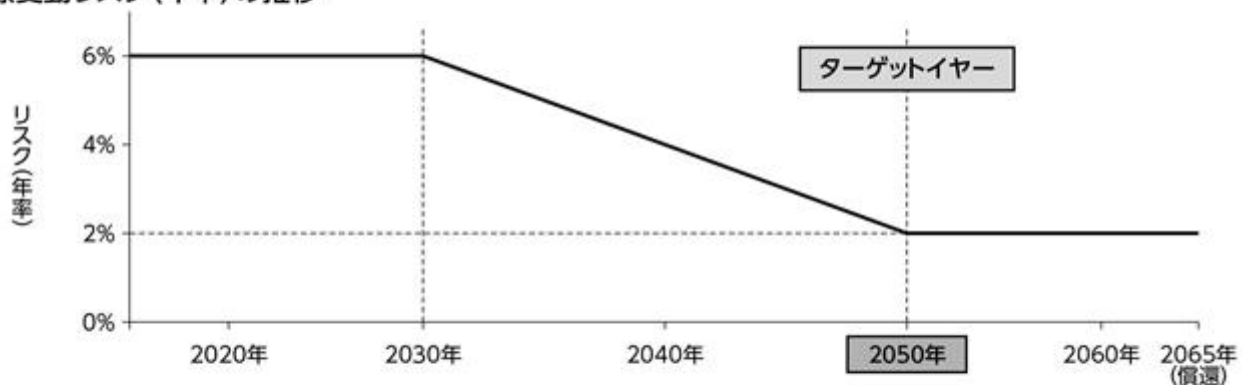
## 目標変動リスク(年率)の推移



|                   | 設定日～2020年決算日 | 2020年決算日翌日～2040年決算日  | 2040年決算日翌日～    |
|-------------------|--------------|----------------------|----------------|
| 投資局面              | 資産育成期        | 資産形成期                | 資産安定期          |
| 運用戦略              | 基本配分戦略       | 基本配分戦略               | 基本配分戦略/機動的配分戦略 |
| 基準価額の変動リスクの目標値    | 年率6%程度       | 年率6%程度から年率2%程度へ月次で逡減 | 年率2%程度         |
| 資産配分のイメージ(基本配分比率) |              |                      |                |

## ターゲット・イヤー2050

## 目標変動リスク(年率)の推移

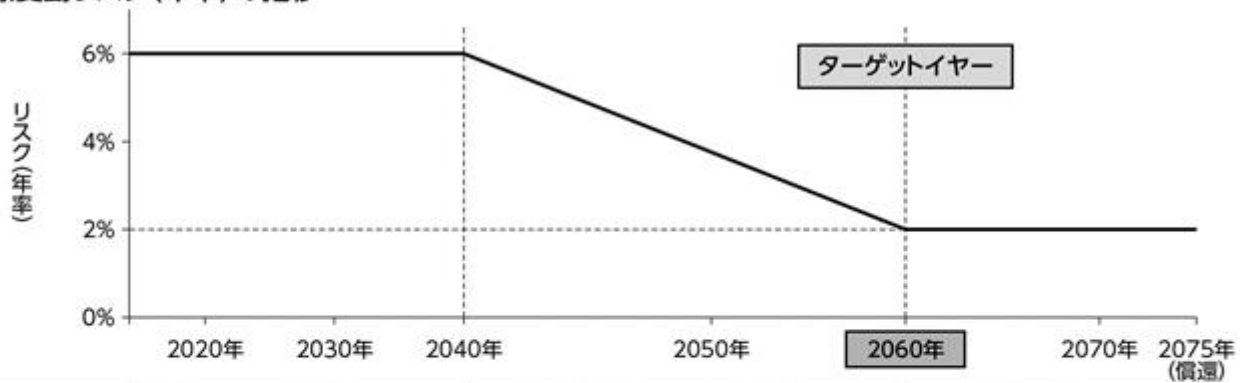


|                   | 設定日～2030年決算日 | 2030年決算日翌日～2050年決算日  | 2050年決算日翌日～    |
|-------------------|--------------|----------------------|----------------|
| 投資局面              | 資産育成期        | 資産形成期                | 資産安定期          |
| 運用戦略              | 基本配分戦略       | 基本配分戦略               | 基本配分戦略/機動的配分戦略 |
| 基準価額の変動リスクの目標値    | 年率6%程度       | 年率6%程度から年率2%程度へ月次で逡減 | 年率2%程度         |
| 資産配分のイメージ(基本配分比率) |              |                      |                |

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

## ターゲット・イヤー2060

### 目標変動リスク(年率)の推移



|                   | 設定日～2040年決算日 | 2040年決算日翌日～2060年決算日 | 2060年決算日翌日～    |
|-------------------|--------------|---------------------|----------------|
| 投資局面              | 資産育成期        | 資産形成期               | 資産安定期          |
| 運用戦略              | 基本配分戦略       | 基本配分戦略              | 基本配分戦略/機動的配分戦略 |
| 基準価額の変動リスクの目標値    | 年率6%程度       | 年率6%程度から年率2%程度へ月次で減 | 年率2%程度         |
| 資産配分のイメージ(基本配分比率) |              |                     |                |

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

## ■ 配分方針

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

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

## &lt; 商品分類 &gt;

## ・ 商品分類表

## 各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## ・ 商品分類定義

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

## &lt; 属性区分 &gt;

## ・属性区分表

## 各ファンド

| 投資対象資産<br>(実際の組入資産)  | 決算頻度                            | 投資対象地域   | 投資形態             | 為替ヘッジ         |
|--|---------------------------------|--|------------------|---------------|
| 株式<br>一般<br>大型株<br>中小型株  | 年1回<br><br>年2回<br><br>年4回       | グローバル<br>(日本を含む)<br><br>日本                       |                  |               |
| 債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>( )                      | 年6回<br>(隔月)<br><br>年12回<br>(毎月) | 北米<br><br>欧州<br><br>アジア<br><br>オセアニア             | ファミリー<br>ファンド    | あり<br>(一部ヘッジ) |
| 不動産投信<br><br>その他資産<br>(投資信託証券<br>(資産複合(債券、<br>株式、不動産投信)<br>資産配分変更型)) | 日々<br><br>その他<br>( )            | 中南米<br><br>アフリカ<br><br>中近東<br>(中東)<br><br>エマージング | ファンド・オブ・<br>ファンズ | なし            |
| 資産複合<br>( )<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型                                    |                                 |  |                  |               |

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

(注2) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

|   |  |
|---|--|
| その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型）） | 目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、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ことを旨の記載がないものをいう。 |
| 年1回                                     | 目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。   |
| グローバル（日本を含む）                            | 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。  |
| ファミリーファンド                               | 目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。  |
| 為替ヘッジあり                                 | 目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。  |

（注1）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

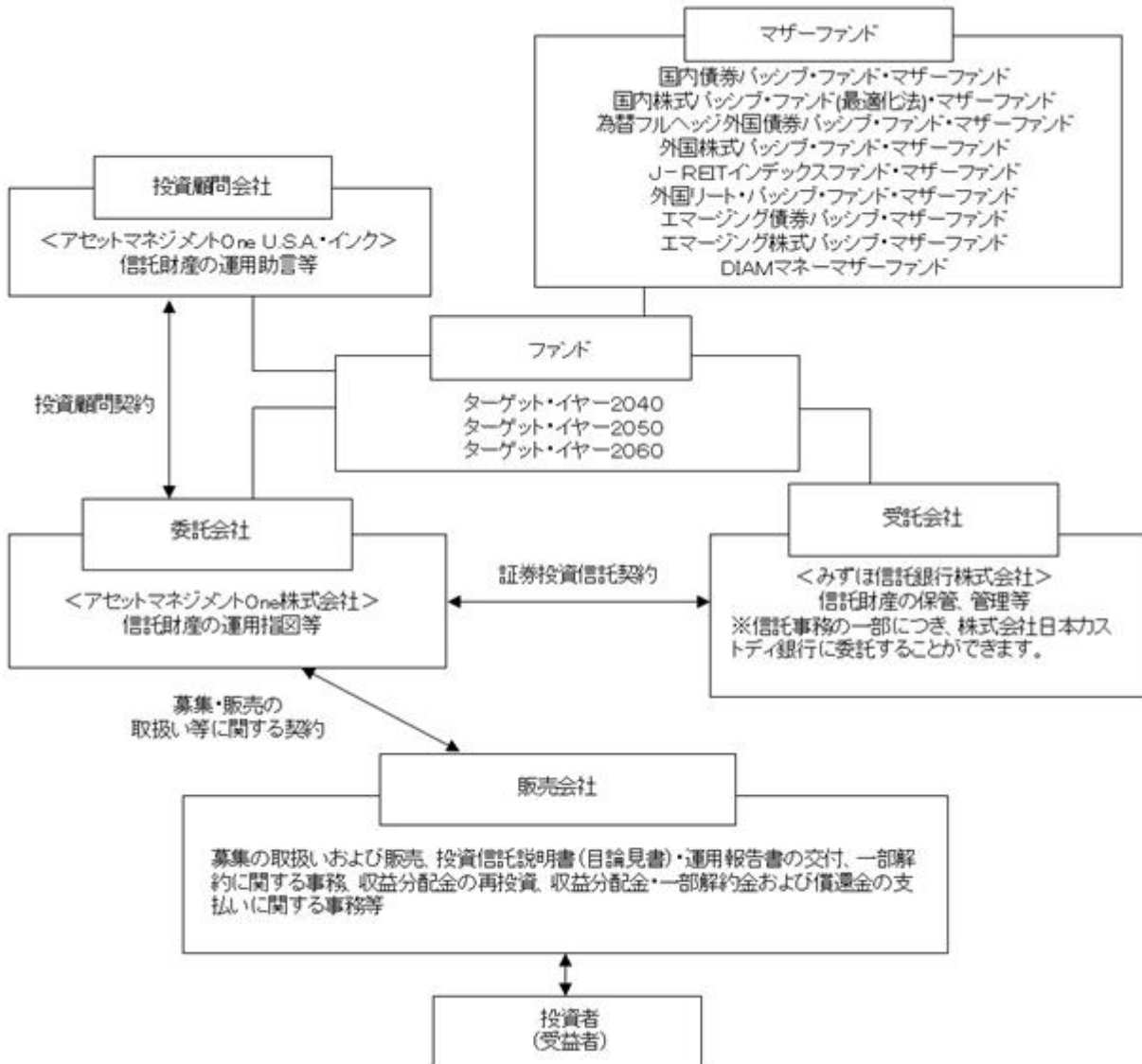
（注2）各ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

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

（2）【ファンドの沿革】

2019年3月18日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、各ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

## ・「投資顧問契約」の概要

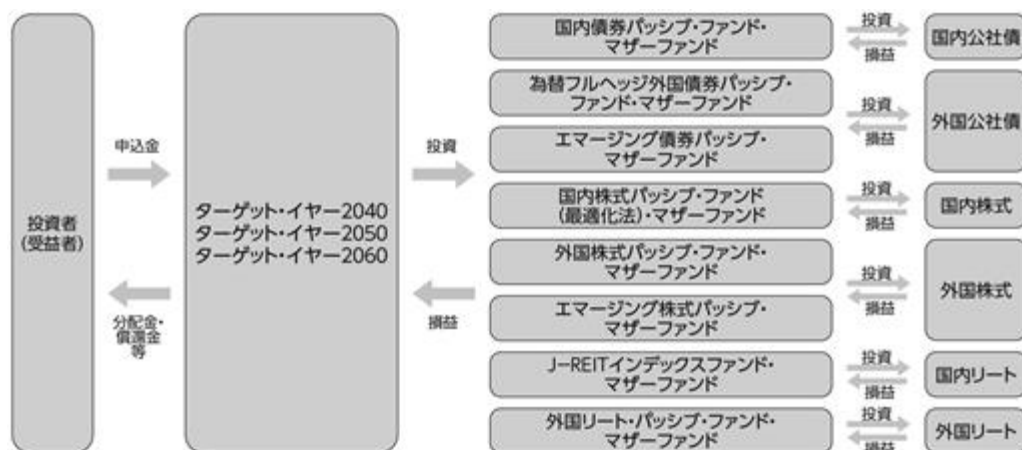
委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）との間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

### ファミリーファンド方式とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



各ファンドは、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および短期金融資産等に直接投資する場合があります。

投資対象とする資産については、将来の市況動向等によって見直す場合があります。

### 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

### 資本金の額

20億円（2024年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ルユ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。 |
| 2008年1月1日  | 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更  |
| 2016年10月1日 | D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更  |

## 大株主の状況

（2024年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 <sup>1</sup> | 70.0% <sup>2</sup> |
| 第一生命ホールディングス株式会社   | 東京都千代田区有楽町一丁目13番1号 | 12,000株              | 30.0% <sup>2</sup> |

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### <基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

#### <投資対象>

「国内債券パッシブ・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、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「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めざす上場している投資信託証券（ETF）、「D I A Mマネーマザーファンド」受益証券および短期金融資産等に直接投資する場合があります。

#### <投資態度>

投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

- ・主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。
  - ・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
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・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

（上記マザーファンドおよびDIAMマネーマザーファンドを以下「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。）

- ・外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ<sup>\*</sup>を行い、一部または全部の為替リスクの軽減をめざします。

\*一部の外貨建資産の通貨については、委託会社がその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクの軽減をめざします。

- ・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」受益証券および短期金融資産等へ直接投資する場合があります。

- ・投資対象とする資産については、将来の市況動向等によって見直す場合があります。

信託期間中、次に掲げる各期（資産育成期、資産形成期、資産安定期）に応じて、基準価額の目標変動リスク<sup>\*</sup>を変更しつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。

\*価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

|       | ターゲット・イヤー<br>2040                | ターゲット・イヤー<br>2050                | ターゲット・イヤー<br>2060                | 目標変動リスク                          |
|-------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
|       | 期 間                              |                                  |                                  |                                  |
| 資産育成期 | 設定日以降<br>2020年の決算日まで             | 設定日以降<br>2030年の決算日まで             | 設定日以降<br>2040年の決算日まで             | 年率6%程度                           |
| 資産形成期 | 2020年の決算日翌日<br>以降<br>2040年の決算日まで | 2030年の決算日翌日<br>以降<br>2050年の決算日まで | 2040年の決算日翌日<br>以降<br>2060年の決算日まで | 年率6%程度<br>から年率2%<br>程度へ月次で<br>逡減 |
| 資産安定期 | 2040年の決算日翌日<br>以降                | 2050年の決算日翌日<br>以降                | 2060年の決算日翌日<br>以降                | 年率2%程度                           |

上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は各ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、各ファンドの収益目標を意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

資産育成期および資産形成期においては、基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。

- ・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出し、ファンドの目標変動リスクを考慮したうえで、これらの各リスク要因からファンドが受ける

影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定し、各マザーファンド受益証券、および為替ヘッジ比率を決定します。

- ・基本配分戦略は月次で行います。

資産安定期においては、基本配分戦略に加え、機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

- ・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。
- ・機動的配分戦略は日次で行います。

ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

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

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

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
  8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
  9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。 )および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.~11.の証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。)
  15. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限り。)
  18. 預託証券または預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り。)
  21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  23. 外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

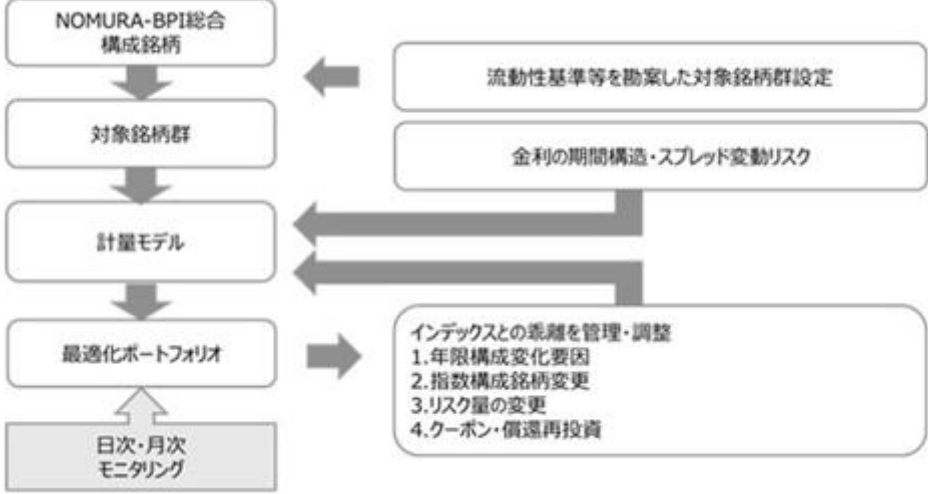
委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 )により運用することの指図をすることができます。

1. 預金

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

(参考)各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

| ファンド名  | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  |
|--------|--|
| 基本方針   | この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。   |
| 主な投資対象 | わが国の公社債を主要投資対象とします。  |
| 投資態度   | <ol style="list-style-type: none"> <li>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2.公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾動的に変更を行う場合があります。</li> <li>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 5px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&amp;コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&amp;コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div> |

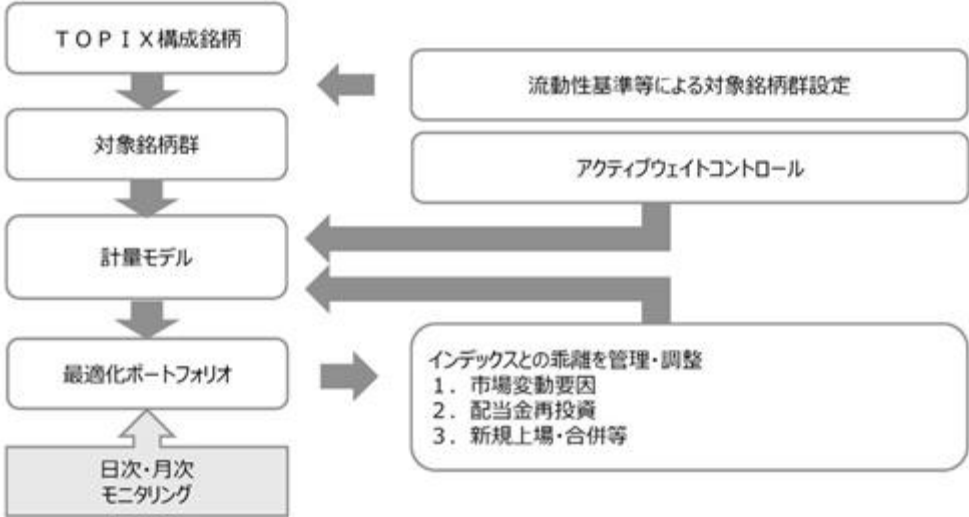
|        |   |
|--------|---|
| 運用プロセス | <p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定<br/>NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築<br/>1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因<br/>2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因<br/>1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理<br/>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、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。<br/>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。<br/>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。<br/>・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更<br/>・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資</p>  |
|--------|---|

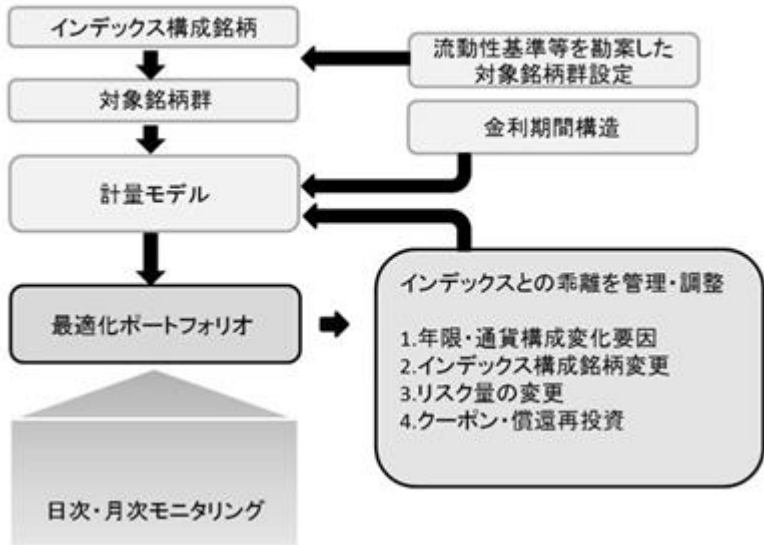
|        |   |
|--------|---|
| 主な投資制限 | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</li> <li>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>5.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

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

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



|        |   |
|--------|---|
| 運用プロセス | <p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定<br/> 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<br/> 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<br/> 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> <li>・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定</li> </ul>  |
| 主な投資制限 | <p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>   |

|        |  |
|--------|--|
| ファンド名  | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド   |
| 基本方針   | この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。  |
| 主な投資対象 | 海外の公社債を主要投資対象とします。   |
| 投資態度   | <p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <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。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p>   |
| 運用プロセス | <p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     D[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; C     E[金利期間構造] --&gt; C     C --&gt; F[最適化ポートフォリオ]     F --&gt; G[インデックスとの乖離を管理・調整]     G --&gt; H[日次・月次モニタリング]     G --&gt; C     </pre> <p>インデックスとの乖離を管理・調整</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1.年限・通貨構成変化要因</li> <li>2.インデックス構成銘柄変更</li> <li>3.リスク量の変更</li> <li>4.クーポン・償還再投資</li> </ol> <p>日次・月次モニタリング</p> |

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

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

|      |  |
|------|--|
| 投資態度 | <ol style="list-style-type: none"><li>1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</li></ol> |
|------|--|

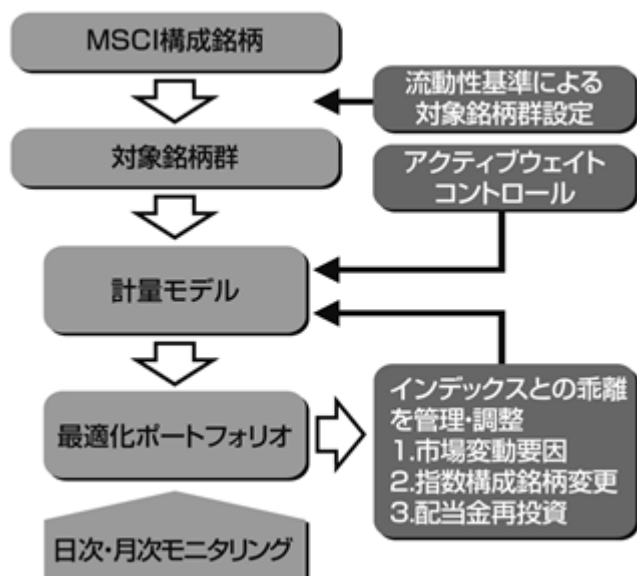
本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に限りなく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"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol> |
|--------|--|

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

## 投資態度

- 1.東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 2.不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3.但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

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

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

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

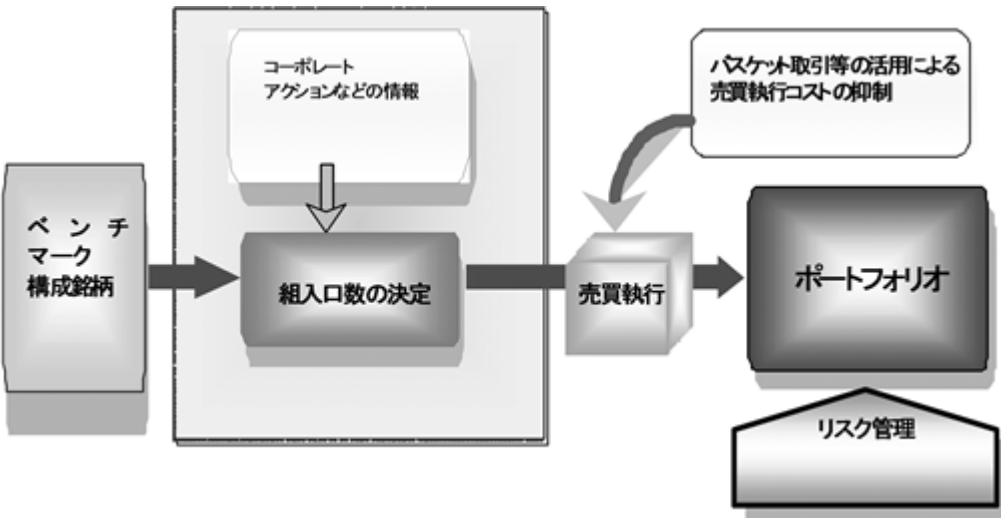
本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

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REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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



|        |   |
|--------|---|
| 運用プロセス | <ul style="list-style-type: none"> <li>・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</li> <li>・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</li> <li>・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</li> </ul>  |
|--------|---|

|        |  |
|--------|--|
| 主な投資制限 | <p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建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> |
|--------|--|

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

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

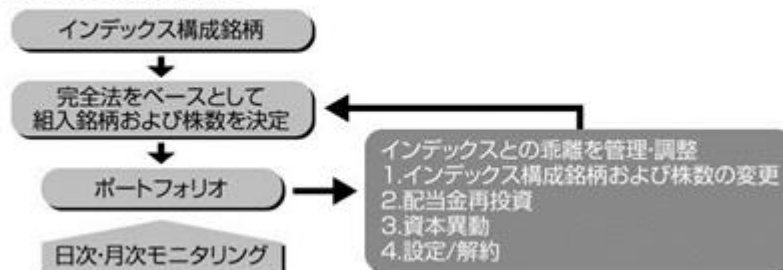
S & P 先進国 R E I TインデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これの使用ライセンスがアセットマネジメントOne株式会社(以下「アセットマネジメントOne」)に付与されています。S&P<sup>®</sup>、S&P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup>およびCDX<sup>®</sup>は、S&P Global, Inc.またはその関連会社(「S&P」)の商標です。Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow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

S&P DOW JONES INDICESまたは第三者ライセンサーは、S & P 先進国 R E I Tインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES

INDICESは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、アセットマネジメントOne、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られるべき結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、ライセンシーの商品の有価証券届出書、目論見書またはその他の募集資料を審査しておらず、いかなる部分も作成および/または証明しておらず、またS&P DOW JONES INDICESはそれらを管理していません。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESとアセットマネジメントOneとの間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

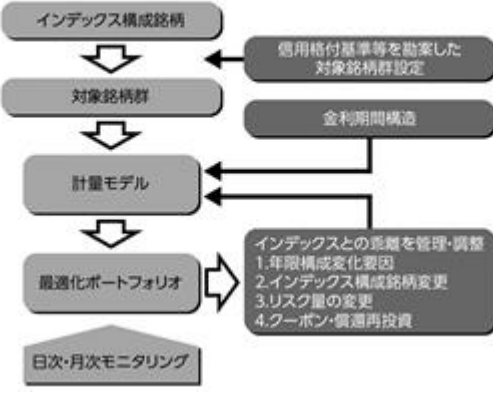
## 運用プロセス

ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。



|        |   |
|--------|---|
| 主な投資制限 | <ol style="list-style-type: none"> <li>1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>3.株式への直接投資は行いません。</li> <li>4.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S &amp; P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS &amp; P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の構成割合の範囲で組入れることができます。</li> <li>5.デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol> |
|--------|---|

|        |  |
|--------|--|
| ファンド名  | エマージング債券パッシブ・マザーファンド   |
| 基本方針   | この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。  |
| 主な投資対象 | 新興国の公社債を主要投資対象とします。  |
| 投資態度   | <ol style="list-style-type: none"> <li>1.主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</li> <li>3.組入債券は、当初組入時において、S &amp; PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。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。</li> <li>4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div> |

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

|        |   |
|--------|---|
| ファンド名  | エマージング株式パッシブ・マザーファンド  |
| 基本方針   | <p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式<sup>(*)</sup>に投資し、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。   |

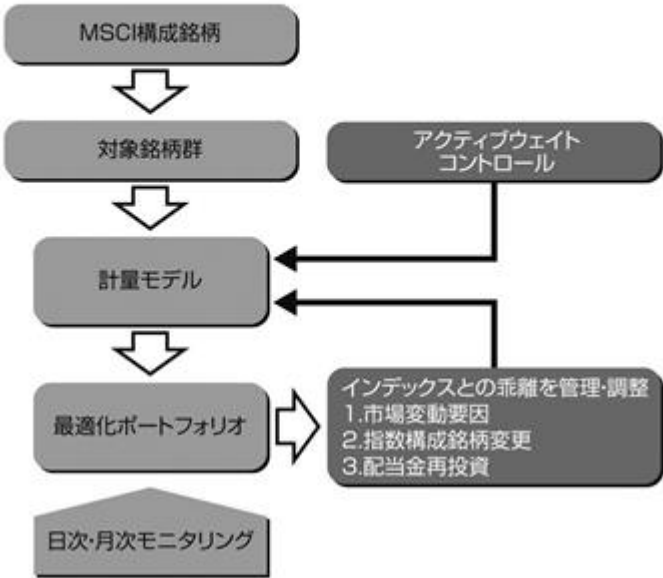
|      |  |
|------|--|
| 投資態度 | <ol style="list-style-type: none"><li>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージン・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</li><li>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li></ol> |
|------|--|

本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に限りなく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



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

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

|        |  |
|--------|--|
| 投資態度   | <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<sup>(*)</sup>の長期発行体格付(複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付)がA A -格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のC D、C Pを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R &amp; I、J C R、M o o d y ' s、S &amp; Pとします。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。

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

## 内部管理等のモニタリング

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

#### b. ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2024年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11日(休業日の場合は翌営業日))に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- (1) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
- (2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。
- (3) 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

#### 収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の支払い

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

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

#### (5)【投資制限】

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

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

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

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

1)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

## 信用取引の指図範囲（約款第22条）

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

## 先物取引等の運用指図（約款第23条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
  1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
  1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対

象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金を加えた額を限度とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引の運用指図(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第25条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えるこ



となった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第26条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第27条)

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

2) 上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

公社債の空売りの指図および範囲(約款第28条)

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

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

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

公社債の借入れの指図および範囲(約款第29条)

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

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

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第30条)

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

#### 外国為替予約取引の指図(約款第31条)

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

#### 資金の借入れ(約款第37条)

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

内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

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

各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。

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

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

## 不動産投資信託証券(リート)の価格変動リスク

リーートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

## 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

各ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない場合、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。

為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。なお、実質組入通貨の直接ヘッジのほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があります。その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、円と当該代替通貨との為替変動の影響を受ける可能性があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

## 信用リスク

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

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

## 流動性リスク

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

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

## カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

け、基準価額が下落する要因となります。各ファンドが実質的に投資を行う株式・債券や通貨の発行者が属する新興国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化等が株式・債券市場や為替市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制等の種々な規制の導入や政策の変更等の要因も株式・債券市場や為替市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、各ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、各ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。

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

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

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドの受益権口数が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。

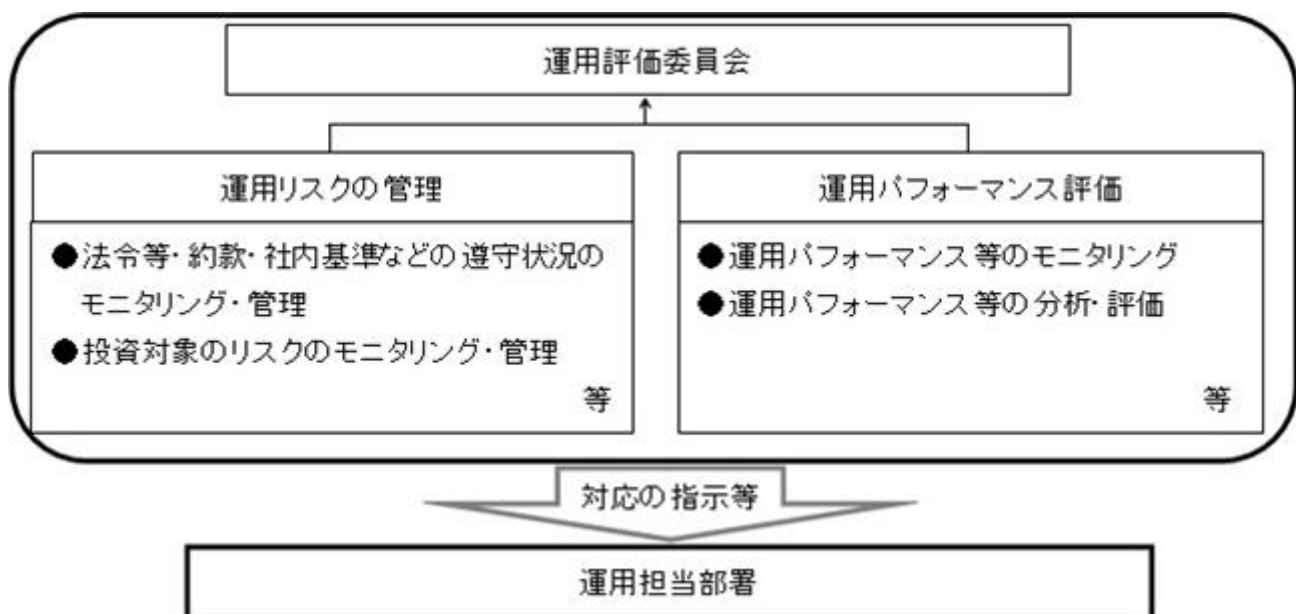
## 注意事項

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

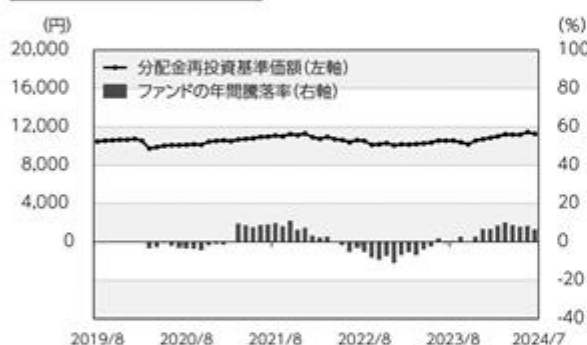
## <参考情報>

### 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

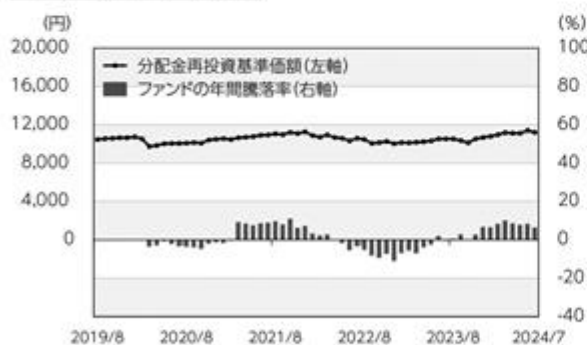
#### ターゲット・イヤー2040



#### ターゲット・イヤー2050



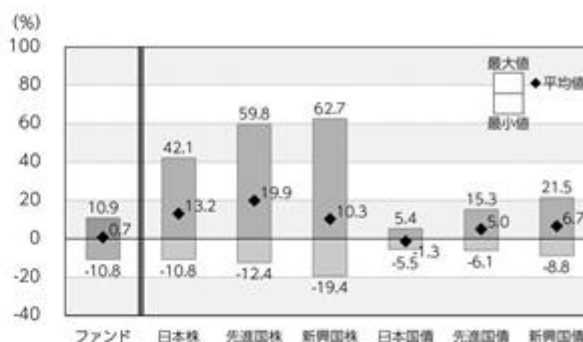
#### ターゲット・イヤー2060



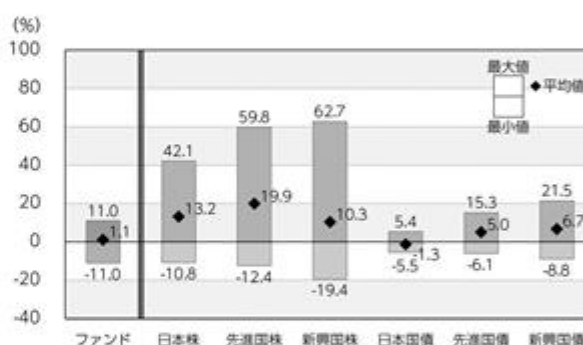
\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*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。

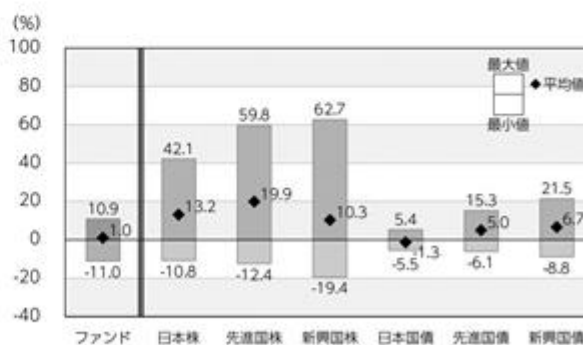
### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2020年3月～2024年7月  
代表的な資産クラス:2019年8月～2024年7月



ファンド:2020年3月～2024年7月  
代表的な資産クラス:2019年8月～2024年7月



ファンド:2020年3月～2024年7月  
代表的な資産クラス:2019年8月～2024年7月

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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

|      |  |   |
|------|--|---|
| 日本株  | 東証株価指数(TOPIX)<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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 | JPMorgan GBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)   | 「JPMorgan GBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。                                      |

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



#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額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が、2024年10月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.649%～年率0.913%（税抜0.59%～税抜0.83%）

[ターゲット・イヤー2040]

| 計算期間   | 運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜） |       |       |
|--|---------------------|-------|-------|
|  | 委託会社                | 販売会社  | 受託会社  |
| 第1計算期<br>（設定日から2020年決算日まで）                   | 0.40%               | 0.40% | 0.03% |
| 年率0.913%<br>（税抜0.83%）                        |                     |       |       |
| 第2計算期から第11計算期まで<br>（2020年決算日翌日から2030年決算日まで）  | 0.36%               | 0.36% | 0.03% |
| 年率0.825%<br>（税抜0.75%）                        |                     |       |       |
| 第12計算期から第21計算期まで<br>（2030年決算日翌日から2040年決算日まで） | 0.32%               | 0.32% | 0.03% |
| 年率0.737%<br>（税抜0.67%）                        |                     |       |       |
| 第22計算期から第36計算期まで<br>（2040年決算日翌日から償還日まで）      | 0.28%               | 0.28% | 0.03% |
| 年率0.649%<br>（税抜0.59%）                        |                     |       |       |



## [ターゲット・イヤー 2050]

| 計算期間   | 運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜） |       |       |
|--|---------------------|-------|-------|
|  | 委託会社                | 販売会社  | 受託会社  |
| 第1計算期から第11計算期まで<br>（設定日から2030年決算日まで）             | 0.40%               | 0.40% | 0.03% |
| 年率0.913%<br>（税抜0.83%）                            |                     |       |       |
| 第12計算期から第21計算期まで<br>（2030年決算日翌日から2040年決算<br>日まで） | 0.36%               | 0.36% | 0.03% |
| 年率0.825%<br>（税抜0.75%）                            |                     |       |       |
| 第22計算期から第31計算期まで<br>（2040年決算日翌日から2050年決算<br>日まで） | 0.32%               | 0.32% | 0.03% |
| 年率0.737%<br>（税抜0.67%）                            |                     |       |       |
| 第32計算期から第46計算期まで<br>（2050年決算日翌日から償還日ま<br>で）      | 0.28%               | 0.28% | 0.03% |
| 年率0.649%<br>（税抜0.59%）                            |                     |       |       |

## [ターゲット・イヤー 2060]

| 計算期間   | 運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜） |       |       |
|--|---------------------|-------|-------|
|  | 委託会社                | 販売会社  | 受託会社  |
| 第1計算期から第21計算期まで<br>（設定日から2040年決算日まで）             | 0.40%               | 0.40% | 0.03% |
| 年率0.913%<br>（税抜0.83%）                            |                     |       |       |
| 第22計算期から第31計算期まで<br>（2040年決算日翌日から2050年決算<br>日まで） | 0.36%               | 0.36% | 0.03% |
| 年率0.825%<br>（税抜0.75%）                            |                     |       |       |
| 第32計算期から第41計算期まで<br>（2050年決算日翌日から2060年決算<br>日まで） | 0.32%               | 0.32% | 0.03% |
| 年率0.737%<br>（税抜0.67%）                            |                     |       |       |

|   |       |       |       |
|---|-------|-------|-------|
| 第42計算期から第56計算期まで<br>(2060年決算日翌日から償還日まで) | 0.28% | 0.28% | 0.03% |
| 年率0.649%<br>(税抜0.59%)                   |       |       |       |

| 支払先  | 主な役務                                      |
|------|---|
| 委託会社 | 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 | 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 | 運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価             |

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社(アセットマネジメントOne U.S.A.・インク)に対する投資顧問報酬が含まれます。投資顧問報酬率は各計算期間における信託報酬率に応じて、以下の通りとします。

| 信託報酬率(年率)       | 投資顧問報酬率(年率) |
|-----------------|-------------|
| 0.913%(税抜0.83%) | 0.180%      |
| 0.825%(税抜0.75%) | 0.162%      |
| 0.737%(税抜0.67%) | 0.144%      |
| 0.649%(税抜0.59%) | 0.126%      |

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (4) 【その他の手数料等】

- ・ 信託財産留保額

ありません。

- ・ その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

#### (5)【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

各ファンドは、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。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2024年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 個別元本方式について

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

### < 個別元本について >

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

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

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

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

### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

--- (参考情報) ファンドの総経費率 ---

| ファンド名         | 総経費率(①+②) | 運用管理費用の比率① | その他費用の比率② |
|---------------|-----------|------------|-----------|
| ターゲット・イヤー2040 | 0.87%     | 0.83%      | 0.04%     |
| ターゲット・イヤー2050 | 0.97%     | 0.91%      | 0.06%     |
| ターゲット・イヤー2060 | 1.00%     | 0.91%      | 0.08%     |

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年1月12日~2024年1月11日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）

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             | 3,166,081,575 | 95.44   |
| 内 日本                  | 3,166,081,575 | 95.44   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 151,292,704   | 4.56    |
| 純資産総額                 | 3,317,374,279 | 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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）

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             | 1,618,380,548 | 98.20   |
| 内 日本                  | 1,618,380,548 | 98.20   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 29,606,767    | 1.80    |
| 純資産総額                 | 1,647,987,315 | 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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）

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             | 997,371,020   | 98.53   |
| 内 日本                  | 997,371,020   | 98.53   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 14,925,875    | 1.47    |
| 純資産総額                 | 1,012,296,895 | 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。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

| 資産の種類                 | 時価合計（円）         | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券                  | 237,143,236,859 | 94.26   |
| 内 アメリカ                | 111,581,327,957 | 44.35   |
| 内 中国                  | 24,249,165,706  | 9.64    |
| 内 フランス                | 18,188,226,652  | 7.23    |
| 内 イタリア                | 16,770,351,608  | 6.67    |
| 内 ドイツ                 | 14,554,302,861  | 5.79    |
| 内 イギリス                | 12,547,393,892  | 4.99    |
| 内 スペイン                | 11,050,923,160  | 4.39    |
| 内 カナダ                 | 4,723,380,350   | 1.88    |
| 内 ベルギー                | 3,870,137,587   | 1.54    |
| 内 オランダ                | 3,470,801,306   | 1.38    |
| 内 オーストラリア             | 3,022,338,326   | 1.20    |
| 内 オーストリア              | 2,779,652,099   | 1.10    |
| 内 メキシコ                | 1,795,958,048   | 0.71    |
| 内 ポーランド               | 1,327,173,590   | 0.53    |
| 内 フィンランド              | 1,276,914,736   | 0.51    |
| 内 アイルランド              | 1,187,827,585   | 0.47    |
| 内 マレーシア               | 1,150,147,071   | 0.46    |
| 内 シンガポール              | 956,863,648     | 0.38    |
| 内 イスラエル               | 714,062,797     | 0.28    |
| 内 デンマーク               | 611,578,886     | 0.24    |
| 内 ニュージーランド            | 562,825,038     | 0.22    |
| 内 スウェーデン              | 380,133,715     | 0.15    |
| 内 ノルウェー               | 371,750,241     | 0.15    |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 14,439,873,992  | 5.74    |
| 純資産総額                 | 251,583,110,851 | 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 パミュダ                | 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。

#### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

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

#### その他資産の投資状況

2024年7月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

| 資産の種類       | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|-------------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券    | 9,605,530,212  | 10.16   |
| 内 オーストラリア   | 6,704,395,154  | 7.09    |
| 内 シンガポール    | 2,855,411,422  | 3.02    |
| 内 香港        | 45,723,636     | 0.05    |
| 投資証券        | 84,159,271,381 | 88.98   |
| 内 アメリカ      | 73,677,503,198 | 77.90   |
| 内 イギリス      | 4,506,514,840  | 4.76    |
| 内 フランス      | 1,562,417,998  | 1.65    |
| 内 カナダ       | 1,322,595,786  | 1.40    |
| 内 ベルギー      | 943,882,712    | 1.00    |
| 内 香港        | 770,837,949    | 0.82    |
| 内 スペイン      | 427,729,241    | 0.45    |
| 内 ニューージーランド | 247,571,424    | 0.26    |
| 内 ガーンジー     | 210,718,278    | 0.22    |
| 内 韓国        | 168,652,518    | 0.18    |
| 内 オランダ      | 159,706,694    | 0.17    |
| 内 イスラエル     | 96,425,207     | 0.10    |
| 内 ドイツ       | 31,019,527     | 0.03    |
| 内 アイルランド    | 26,832,650     | 0.03    |

|                       |        |                |        |
|-----------------------|--------|----------------|--------|
|                       | 内 イタリア | 6,863,359      | 0.01   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） |        | 812,415,759    | 0.86   |
| 純資産総額                 |        | 94,577,217,352 | 100.00 |

## その他資産の投資状況

2024年7月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 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 ベルギー                | 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。

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

2024年7月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域                            | 種類                | 数量          | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)   | 評価単価<br>評価金額<br>(円)   | 利率<br>(%)<br>償還日 | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--|-------------------|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------------|
| 1  | 為替フルヘッジ外国債券<br>パッシブ・ファンド・マ<br>ザーファンド<br>日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 714,033,403 | 1.1682<br>834,141,382 | 1.1620<br>829,706,814 | -<br>-           | 25.01           |
| 2  | 外国株式パッシブ・ファン<br>ド・マザーファンド<br>日本            | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 71,300,164  | 8.1204<br>578,989,363 | 9.2177<br>657,223,521 | -<br>-           | 19.81           |
| 3  | 国内債券パッシブ・ファン<br>ド・マザーファンド<br>日本            | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 491,971,630 | 1.2455<br>612,777,530 | 1.2054<br>593,022,602 | -<br>-           | 17.88           |
| 4  | 国内株式パッシブ・ファン<br>ド（最適化法）・マザー<br>ファンド<br>日本  | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 100,203,962 | 4.5648<br>457,418,297 | 4.9330<br>494,306,144 | -<br>-           | 14.90           |
| 5  | エマージング債券パッシ<br>ブ・マザーファンド<br>日本             | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 101,307,204 | 2.2787<br>230,854,014 | 2.4273<br>245,902,976 | -<br>-           | 7.41            |
| 6  | エマージング株式パッシ<br>ブ・マザーファンド<br>日本             | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 119,563,852 | 1.7367<br>207,652,220 | 1.7742<br>212,130,186 | -<br>-           | 6.39            |
| 7  | 外国リート・パッシブ・<br>ファンド・マザーファンド<br>日本          | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 47,501,654  | 1.9611<br>93,159,531  | 2.1150<br>100,465,998 | -<br>-           | 3.03            |
| 8  | J-REITインデックス<br>ファンド・マザーファンド<br>日本         | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 14,537,708  | 2.3416<br>34,042,931  | 2.2922<br>33,323,334  | -<br>-           | 1.00            |

（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 | 95.44    |
| 合計        | 95.44    |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

2024年7月31日現在

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

|   |  |                   |             |                       |                       |        |       |
|---|--|-------------------|-------------|-----------------------|-----------------------|--------|-------|
| 1 | 為替フルヘッジ外国債券<br>パッシブ・ファンド・マ<br>ザーファンド<br>日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 371,771,089 | 1.1647<br>433,031,425 | 1.1620<br>431,998,005 | -<br>- | 26.21 |
| 2 | 外国株式パッシブ・ファン<br>ド・マザーファンド<br>日本            | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 34,569,089  | 8.0107<br>276,923,707 | 9.2177<br>318,647,491 | -<br>- | 19.34 |
| 3 | 国内株式パッシブ・ファン<br>ド(最適化法)・マザー<br>ファンド<br>日本  | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 49,831,283  | 4.4293<br>220,720,191 | 4.9330<br>245,817,719 | -<br>- | 14.92 |
| 4 | 国内債券パッシブ・ファン<br>ド・マザーファンド<br>日本            | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 197,064,625 | 1.2379<br>243,956,965 | 1.2054<br>237,541,698 | -<br>- | 14.41 |
| 5 | エマージング株式パッシ<br>ブ・マザーファンド<br>日本             | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 91,462,607  | 1.7243<br>157,716,107 | 1.7742<br>162,272,957 | -<br>- | 9.85  |
| 6 | エマージング債券パッシ<br>ブ・マザーファンド<br>日本             | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 50,374,105  | 2.3068<br>116,203,680 | 2.4273<br>122,273,065 | -<br>- | 7.42  |
| 7 | 外国リート・パッシブ・<br>ファンド・マザーファンド<br>日本          | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 39,368,536  | 1.9833<br>78,082,168  | 2.1150<br>83,264,453  | -<br>- | 5.05  |
| 8 | J-REITインデックス<br>ファンド・マザーファンド<br>日本         | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 7,226,752   | 2.3105<br>16,697,604  | 2.2922<br>16,565,160  | -<br>- | 1.01  |

(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 | 98.20   |
| 合計        | 98.20   |

(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。

#### 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

2024年7月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域                            | 種類                | 数量          | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)   | 評価単価<br>評価金額<br>(円)   | 利率<br>(%)<br>償還日 | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--|-------------------|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------------|
| 1  | 為替フルヘッジ外国債券<br>パッシブ・ファンド・マ<br>ザーファンド<br>日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 226,629,730 | 1.1648<br>263,986,101 | 1.1620<br>263,343,746 | -<br>-           | 26.01           |
| 2  | 外国株式パッシブ・ファン<br>ド・マザーファンド<br>日本            | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 21,294,197  | 8.0178<br>170,733,908 | 9.2177<br>196,283,519 | -<br>-           | 19.39           |

|   |                                   |                   |             |                       |                       |        |       |
|---|-----------------------------------|-------------------|-------------|-----------------------|-----------------------|--------|-------|
| 3 | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド<br>日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 30,704,039  | 4.4401<br>136,331,331 | 4.9330<br>151,463,024 | -<br>- | 14.96 |
| 4 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド<br>日本       | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 123,430,813 | 1.2375<br>152,749,345 | 1.2054<br>148,783,501 | -<br>- | 14.70 |
| 5 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド<br>日本        | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 56,330,749  | 1.7266<br>97,265,722  | 1.7742<br>99,942,014  | -<br>- | 9.87  |
| 6 | エマージング債券パッシブ・マザーファンド<br>日本        | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 31,025,175  | 2.3085<br>71,624,090  | 2.4273<br>75,307,407  | -<br>- | 7.44  |
| 7 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド<br>日本     | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 24,607,767  | 1.9841<br>48,825,889  | 2.1150<br>52,045,427  | -<br>- | 5.14  |
| 8 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド<br>日本    | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 4,450,913   | 2.3096<br>10,279,964  | 2.2922<br>10,202,382  | -<br>- | 1.01  |

（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 | 98.53   |
| 合計        | 98.53   |

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



|    |                            |      |               |                         |                         |                    |      |
|----|----------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|--------------------|------|
| 6  | 113回 利付国庫債券<br>(20年)<br>日本 | 国債証券 | 4,970,000,000 | 108.09<br>5,372,396,400 | 107.23<br>5,329,529,800 | 2.1<br>2029/9/20   | 0.97 |
| 7  | 153回 利付国庫債券<br>(5年)<br>日本  | 国債証券 | 5,210,000,000 | 99.41<br>5,179,677,800  | 98.63<br>5,138,831,400  | 0.005<br>2027/6/20 | 0.94 |
| 8  | 372回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 5,200,000,000 | 100.50<br>5,226,181,000 | 98.44<br>5,119,348,000  | 0.8<br>2033/9/20   | 0.93 |
| 9  | 151回 利付国庫債券<br>(5年)<br>日本  | 国債証券 | 5,000,000,000 | 99.15<br>4,957,928,000  | 98.79<br>4,939,500,000  | 0.005<br>2027/3/20 | 0.90 |
| 10 | 352回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,950,000,000 | 99.00<br>4,900,648,500  | 98.02<br>4,852,039,500  | 0.1<br>2028/9/20   | 0.88 |
| 11 | 345回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,890,000,000 | 99.90<br>4,885,110,000  | 99.16<br>4,848,972,900  | 0.1<br>2026/12/20  | 0.88 |
| 12 | 157回 利付国庫債券<br>(5年)<br>日本  | 国債証券 | 4,900,000,000 | 99.02<br>4,852,278,000  | 98.77<br>4,839,730,000  | 0.2<br>2028/3/20   | 0.88 |
| 13 | 141回 利付国庫債券<br>(20年)<br>日本 | 国債証券 | 4,460,000,000 | 107.01<br>4,772,777,800 | 106.36<br>4,743,745,200 | 1.7<br>2032/12/20  | 0.87 |
| 14 | 146回 利付国庫債券<br>(5年)<br>日本  | 国債証券 | 4,700,000,000 | 99.99<br>4,699,530,000  | 99.68<br>4,685,383,000  | 0.1<br>2025/12/20  | 0.85 |
| 15 | 453回 利付国庫債券<br>(2年)<br>日本  | 国債証券 | 4,700,000,000 | 99.77<br>4,689,425,000  | 99.68<br>4,684,960,000  | 0.005<br>2025/10/1 | 0.85 |
| 16 | 371回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,800,000,000 | 96.82<br>4,647,695,000  | 95.29<br>4,574,304,000  | 0.4<br>2033/6/20   | 0.83 |
| 17 | 148回 利付国庫債券<br>(5年)<br>日本  | 国債証券 | 4,610,000,000 | 99.68<br>4,595,515,900  | 99.20<br>4,573,350,500  | 0.005<br>2026/6/20 | 0.83 |
| 18 | 346回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,540,000,000 | 99.84<br>4,533,008,400  | 99.03<br>4,496,279,800  | 0.1<br>2027/3/20   | 0.82 |
| 19 | 368回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,750,000,000 | 96.37<br>4,577,860,000  | 94.62<br>4,494,497,500  | 0.2<br>2032/9/20   | 0.82 |
| 20 | 347回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,500,000,000 | 99.73<br>4,488,030,000  | 98.90<br>4,450,680,000  | 0.1<br>2027/6/20   | 0.81 |
| 21 | 461回 利付国庫債券<br>(2年)<br>日本  | 国債証券 | 4,400,000,000 | 100.12<br>4,405,305,000 | 99.96<br>4,398,372,000  | 0.4<br>2026/6/1    | 0.80 |
| 22 | 460回 利付国庫債券<br>(2年)<br>日本  | 国債証券 | 4,300,000,000 | 99.96<br>4,298,323,000  | 99.81<br>4,292,131,000  | 0.3<br>2026/5/1    | 0.78 |

|    |                            |      |               |                         |                         |                   |      |
|----|----------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|-------------------|------|
| 23 | 158回 利付国庫債券<br>(5年)<br>日本  | 国債証券 | 4,100,000,000 | 99.27<br>4,070,337,000  | 98.41<br>4,034,974,000  | 0.1<br>2028/3/20  | 0.74 |
| 24 | 365回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,230,000,000 | 96.31<br>4,073,981,000  | 94.85<br>4,012,281,900  | 0.1<br>2031/12/20 | 0.73 |
| 25 | 360回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,100,000,000 | 97.82<br>4,010,661,000  | 96.32<br>3,949,407,000  | 0.1<br>2030/9/20  | 0.72 |
| 26 | 144回 利付国庫債券<br>(20年)<br>日本 | 国債証券 | 3,750,000,000 | 105.18<br>3,944,467,500 | 104.72<br>3,927,075,000 | 1.5<br>2033/3/20  | 0.72 |
| 27 | 359回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,050,000,000 | 98.05<br>3,971,146,500  | 96.55<br>3,910,437,000  | 0.1<br>2030/6/20  | 0.71 |
| 28 | 154回 利付国庫債券<br>(5年)<br>日本  | 国債証券 | 3,900,000,000 | 99.43<br>3,878,084,000  | 98.74<br>3,851,211,000  | 0.1<br>2027/9/20  | 0.70 |
| 29 | 361回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 97.57<br>3,903,124,000  | 96.06<br>3,842,680,000  | 0.1<br>2030/12/20 | 0.70 |
| 30 | 362回 利付国庫債券<br>(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,010,000,000 | 97.32<br>3,902,532,000  | 95.80<br>3,841,660,200  | 0.1<br>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<br>発行体の国/地域         | 種類<br>業種    | 数量        | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)        | 評価単価<br>評価金額<br>(円)        | 利率<br>(%)<br>償還日 | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------------------------|-------------|-----------|----------------------------|----------------------------|------------------|-----------------|
| 1  | トヨタ自動車<br>日本            | 株式<br>輸送用機器 | 7,960,800 | 3,277.39<br>26,090,711,381 | 2,949.00<br>23,476,399,200 | -<br>-           | 3.85            |
| 2  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ<br>日本 | 株式<br>銀行業   | 8,982,700 | 1,410.79<br>12,672,736,268 | 1,750.00<br>15,719,725,000 | -<br>-           | 2.58            |

|    |                       |              |            |                             |                             |        |      |
|----|-----------------------|--------------|------------|-----------------------------|-----------------------------|--------|------|
| 3  | ソニーグループ<br>日本         | 株式<br>電気機器   | 1,048,800  | 14,229.36<br>14,923,756,514 | 13,530.00<br>14,190,264,000 | -<br>- | 2.33 |
| 4  | 日立製作所<br>日本           | 株式<br>電気機器   | 3,634,500  | 2,363.00<br>8,588,327,662   | 3,288.00<br>11,950,236,000  | -<br>- | 1.96 |
| 5  | 三井住友フィナンシャルグループ<br>日本 | 株式<br>銀行業    | 1,032,900  | 7,740.40<br>7,995,068,336   | 10,915.00<br>11,274,103,500 | -<br>- | 1.85 |
| 6  | キーエンス<br>日本           | 株式<br>電気機器   | 149,800    | 64,303.96<br>9,632,733,796  | 65,890.00<br>9,870,322,000  | -<br>- | 1.62 |
| 7  | 東京エレクトロン<br>日本        | 株式<br>電気機器   | 317,000    | 28,852.79<br>9,146,337,210  | 31,020.00<br>9,833,340,000  | -<br>- | 1.61 |
| 8  | リクルートホールディングス<br>日本   | 株式<br>サービス業  | 1,108,800  | 5,813.19<br>6,445,674,522   | 8,658.00<br>9,599,990,400   | -<br>- | 1.58 |
| 9  | 三菱商事<br>日本            | 株式<br>卸売業    | 3,042,500  | 2,816.79<br>8,570,094,402   | 3,144.00<br>9,565,620,000   | -<br>- | 1.57 |
| 10 | 信越化学工業<br>日本          | 株式<br>化学     | 1,345,200  | 5,840.31<br>7,856,387,409   | 6,748.00<br>9,077,409,600   | -<br>- | 1.49 |
| 11 | 東京海上ホールディングス<br>日本    | 株式<br>保険業    | 1,440,100  | 3,910.84<br>5,632,011,283   | 6,022.00<br>8,672,282,200   | -<br>- | 1.42 |
| 12 | 三井物産<br>日本            | 株式<br>卸売業    | 2,373,400  | 2,955.47<br>7,014,533,783   | 3,530.00<br>8,378,102,000   | -<br>- | 1.38 |
| 13 | 伊藤忠商事<br>日本           | 株式<br>卸売業    | 1,065,200  | 6,739.03<br>7,178,424,359   | 7,783.00<br>8,290,451,600   | -<br>- | 1.36 |
| 14 | 第一三共<br>日本            | 株式<br>医薬品    | 1,308,500  | 4,525.05<br>5,921,038,853   | 6,148.00<br>8,044,658,000   | -<br>- | 1.32 |
| 15 | 任天堂<br>日本             | 株式<br>その他製品  | 945,600    | 8,341.60<br>7,887,823,710   | 8,388.00<br>7,931,692,800   | -<br>- | 1.30 |
| 16 | 日本電信電話<br>日本          | 株式<br>情報・通信業 | 44,678,600 | 182.90<br>8,171,998,709     | 160.40<br>7,166,447,440     | -<br>- | 1.18 |
| 17 | みずほフィナンシャルグループ<br>日本  | 株式<br>銀行業    | 1,991,000  | 2,732.41<br>5,440,231,014   | 3,448.00<br>6,864,968,000   | -<br>- | 1.13 |
| 18 | ソフトバンクグループ<br>日本      | 株式<br>情報・通信業 | 741,000    | 6,697.29<br>4,962,696,056   | 9,162.00<br>6,789,042,000   | -<br>- | 1.11 |
| 19 | 本田技研工業<br>日本          | 株式<br>輸送用機器  | 3,548,500  | 1,715.78<br>6,088,456,979   | 1,647.00<br>5,844,379,500   | -<br>- | 0.96 |
| 20 | 武田薬品工業<br>日本          | 株式<br>医薬品    | 1,329,400  | 4,214.87<br>5,603,255,242   | 4,302.00<br>5,719,078,800   | -<br>- | 0.94 |
| 21 | HOYA<br>日本            | 株式<br>精密機器   | 294,900    | 18,371.67<br>5,417,807,769  | 18,940.00<br>5,585,406,000  | -<br>- | 0.92 |
| 22 | KDDI<br>日本            | 株式<br>情報・通信業 | 1,104,700  | 4,589.54<br>5,070,070,774   | 4,520.00<br>4,993,244,000   | -<br>- | 0.82 |
| 23 | 三菱重工業<br>日本           | 株式<br>機械     | 2,645,200  | 1,050.14<br>2,777,837,439   | 1,830.00<br>4,840,716,000   | -<br>- | 0.79 |

|    |               |                  |           |                            |                            |        |      |
|----|---------------|------------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------|------|
| 24 | ソフトバンク<br>日本  | 株式<br>情報・通<br>信業 | 2,399,800 | 1,943.19<br>4,663,288,557  | 1,965.00<br>4,715,607,000  | -<br>- | 0.77 |
| 25 | 村田製作所<br>日本   | 株式<br>電気機器       | 1,337,700 | 2,979.82<br>3,986,109,136  | 3,351.00<br>4,482,632,700  | -<br>- | 0.74 |
| 26 | 三菱電機<br>日本    | 株式<br>電気機器       | 1,656,800 | 2,033.97<br>3,369,884,148  | 2,601.00<br>4,309,336,800  | -<br>- | 0.71 |
| 27 | 日本たばこ産業<br>日本 | 株式<br>食料品        | 896,100   | 3,947.79<br>3,537,617,692  | 4,434.00<br>3,973,307,400  | -<br>- | 0.65 |
| 28 | ダイキン工業<br>日本  | 株式<br>機械         | 180,500   | 21,133.74<br>3,814,640,096 | 21,905.00<br>3,953,852,500 | -<br>- | 0.65 |
| 29 | 富士通<br>日本     | 株式<br>電気機器       | 1,391,900 | 2,306.64<br>3,210,616,734  | 2,732.50<br>3,803,366,750  | -<br>- | 0.62 |
| 30 | 丸紅<br>日本      | 株式<br>卸売業        | 1,314,400 | 2,398.68<br>3,152,830,415  | 2,860.50<br>3,759,841,200  | -<br>- | 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。

#### 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域                              | 種類   | 数量            | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)     | 評価単価<br>評価金額<br>(円)     | 利率<br>(%)<br>償還日    | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--|------|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------|-----------------|
| 1  | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.04 02/25/27<br>中国 | 国債証券 | 1,674,182,550 | 100.45<br>1,681,748,013 | 100.82<br>1,688,045,953 | 2.04<br>2027/2/25   | 0.67            |
| 2  | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.05 04/15/29<br>中国 | 国債証券 | 1,410,946,300 | 100.37<br>1,416,182,806 | 100.72<br>1,421,175,660 | 2.05<br>2029/4/15   | 0.56            |
| 3  | US T N/B 4.625 03/15/26<br>アメリカ              | 国債証券 | 1,300,618,080 | 99.69<br>1,296,655,251  | 100.19<br>1,303,132,940 | 4.625<br>2026/3/15  | 0.52            |
| 4  | CHINA GOVERNMENT BOND 2.8<br>03/25/30<br>中国  | 国債証券 | 1,221,416,200 | 103.66<br>1,266,228,006 | 104.33<br>1,274,382,180 | 2.8<br>2030/3/25    | 0.51            |
| 5  | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.35 02/25/34<br>中国 | 国債証券 | 1,231,945,650 | 100.65<br>1,239,969,681 | 101.64<br>1,252,156,457 | 2.35<br>2034/2/25   | 0.50            |
| 6  | US T N/B 4.5 11/15/33<br>アメリカ                | 国債証券 | 1,189,032,000 | 101.85<br>1,211,047,663 | 102.74<br>1,221,637,492 | 4.5<br>2033/11/15   | 0.49            |
| 7  | US T N/B 4.125 11/15/32<br>アメリカ              | 国債証券 | 1,173,788,000 | 99.11<br>1,163,356,873  | 100.12<br>1,175,278,158 | 4.125<br>2032/11/15 | 0.47            |
| 8  | US T N/B 2.875 05/15/32<br>アメリカ              | 国債証券 | 1,250,008,000 | 90.71<br>1,133,883,743  | 91.87<br>1,148,396,023  | 2.875<br>2032/5/15  | 0.46            |
| 9  | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.37 01/15/29<br>中国 | 国債証券 | 1,052,945,000 | 101.53<br>1,069,063,376 | 102.09<br>1,075,016,411 | 2.37<br>2029/1/15   | 0.43            |
| 10 | CHINA GOVERNMENT BOND<br>1.99 03/15/26<br>中国 | 国債証券 | 1,052,945,000 | 100.44<br>1,057,683,252 | 100.76<br>1,060,959,280 | 1.99<br>2026/3/15   | 0.42            |
| 11 | US T N/B 2.75 08/15/32<br>アメリカ               | 国債証券 | 1,155,495,200 | 89.71<br>1,036,673,281  | 90.76<br>1,048,747,304  | 2.75<br>2032/8/15   | 0.42            |
| 12 | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.18 08/15/26<br>中国 | 国債証券 | 1,021,356,650 | 100.79<br>1,029,454,782 | 101.09<br>1,032,501,693 | 2.18<br>2026/8/15   | 0.41            |
| 13 | US T N/B 3.875 08/15/33<br>アメリカ              | 国債証券 | 1,051,836,000 | 96.90<br>1,019,246,315  | 98.00<br>1,030,860,905  | 3.875<br>2033/8/15  | 0.41            |

|    |  |      |               |                       |                        |                     |      |
|----|--|------|---------------|-----------------------|------------------------|---------------------|------|
| 14 | US T N/B 2.375 04/30/26<br>アメリカ              | 国債証券 | 1,036,592,000 | 95.82<br>993,265,687  | 96.53<br>1,000,675,703 | 2.375<br>2026/4/30  | 0.40 |
| 15 | US T N/B 4.0 02/15/34<br>アメリカ                | 国債証券 | 975,616,000   | 97.99<br>956,027,463  | 98.86<br>964,564,103   | 4<br>2034/2/15      | 0.38 |
| 16 | US T N/B 0.75 03/31/26<br>アメリカ               | 国債証券 | 995,433,200   | 93.25<br>928,241,459  | 94.05<br>936,271,030   | 0.75<br>2026/3/31   | 0.37 |
| 17 | CHINA GOVERNMENT BOND 2.3<br>05/15/26<br>中国  | 国債証券 | 895,003,250   | 101.00<br>903,973,241 | 101.28<br>906,491,690  | 2.3<br>2026/5/15    | 0.36 |
| 18 | US T N/B 2.25 03/31/26<br>アメリカ               | 国債証券 | 914,640,000   | 95.75<br>875,803,525  | 96.44<br>882,163,136   | 2.25<br>2026/3/31   | 0.35 |
| 19 | US T N/B 3.375 05/15/33<br>アメリカ              | 国債証券 | 929,884,000   | 93.50<br>869,493,272  | 94.45<br>878,358,978   | 3.375<br>2033/5/15  | 0.35 |
| 20 | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.03 03/11/26<br>中国 | 国債証券 | 846,567,780   | 102.29<br>866,016,912 | 102.43<br>867,216,160  | 3.03<br>2026/3/11   | 0.34 |
| 21 | US T N/B 0.875 11/15/30<br>アメリカ              | 国債証券 | 1,050,311,600 | 81.31<br>854,034,619  | 82.52<br>866,794,265   | 0.875<br>2030/11/15 | 0.34 |
| 22 | US T N/B 1.875 02/15/32<br>アメリカ              | 国債証券 | 987,811,200   | 84.58<br>835,568,660  | 85.67<br>846,314,959   | 1.875<br>2032/2/15  | 0.34 |
| 23 | US T N/B 1.125 02/15/31<br>アメリカ              | 国債証券 | 990,860,000   | 82.19<br>814,477,160  | 83.39<br>826,342,398   | 1.125<br>2031/2/15  | 0.33 |
| 24 | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.69 08/12/26<br>中国 | 国債証券 | 800,238,200   | 101.92<br>815,642,945 | 102.17<br>817,675,790  | 2.69<br>2026/8/12   | 0.33 |
| 25 | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.68 05/21/30<br>中国 | 国債証券 | 768,649,850   | 103.02<br>791,923,438 | 103.69<br>797,081,746  | 2.68<br>2030/5/21   | 0.32 |
| 26 | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.86 07/22/49<br>中国 | 国債証券 | 621,237,550   | 125.05<br>776,908,746 | 127.59<br>792,650,098  | 3.86<br>2049/7/22   | 0.32 |
| 27 | US T N/B 1.625 05/15/26<br>アメリカ              | 国債証券 | 826,529,680   | 94.41<br>780,392,535  | 95.18<br>786,752,939   | 1.625<br>2026/5/15  | 0.31 |
| 28 | US T N/B 3.5 02/15/33<br>アメリカ                | 国債証券 | 823,176,000   | 94.52<br>778,110,332  | 95.49<br>786,117,002   | 3.5<br>2033/2/15    | 0.31 |
| 29 | US T N/B 2.875 08/15/28<br>アメリカ              | 国債証券 | 823,176,000   | 94.42<br>777,322,528  | 95.49<br>786,100,925   | 2.875<br>2028/8/15  | 0.31 |
| 30 | US T N/B 4.75 11/15/53<br>アメリカ               | 国債証券 | 736,285,200   | 105.93<br>780,002,133 | 105.74<br>778,564,080  | 4.75<br>2053/11/15  | 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 | 94.26   |
| 合計   | 94.26   |

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

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



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

#### J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域    | 種類   | 数量     | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)          | 評価単価<br>評価金額<br>(円)          | 利率<br>(%)<br>償還日 | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------------------|------|--------|------------------------------|------------------------------|------------------|-----------------|
| 1  | 日本ビルファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 19,399 | 586,578.78<br>11,379,041,794 | 579,000.00<br>11,232,021,000 | -<br>-           | 6.59            |

|    |                               |          |        |                             |                             |        |      |
|----|-------------------------------|----------|--------|-----------------------------|-----------------------------|--------|------|
| 2  | ジャパンリアルエステイト<br>投資法人<br>日本    | 投資証<br>券 | 17,081 | 520,798.80<br>8,895,764,315 | 520,000.00<br>8,882,120,000 | -<br>- | 5.21 |
| 3  | 野村不動産マスターファン<br>ド投資法人<br>日本   | 投資証<br>券 | 53,775 | 141,248.16<br>7,595,620,105 | 147,700.00<br>7,942,567,500 | -<br>- | 4.66 |
| 4  | 日本都市ファンド投資法人<br>日本            | 投資証<br>券 | 83,777 | 90,746.56<br>7,602,475,218  | 93,600.00<br>7,841,527,200  | -<br>- | 4.60 |
| 5  | G L P 投資法人<br>日本              | 投資証<br>券 | 55,857 | 132,853.31<br>7,420,787,755 | 131,400.00<br>7,339,609,800 | -<br>- | 4.31 |
| 6  | K D X 不動産投資法人<br>日本           | 投資証<br>券 | 46,523 | 152,539.56<br>7,096,598,327 | 154,600.00<br>7,192,455,800 | -<br>- | 4.22 |
| 7  | 日本プロロジスリート投資<br>法人<br>日本      | 投資証<br>券 | 28,969 | 249,204.21<br>7,219,196,831 | 247,100.00<br>7,158,239,900 | -<br>- | 4.20 |
| 8  | インヴィンシブル投資法人<br>日本            | 投資証<br>券 | 91,623 | 68,066.17<br>6,236,427,089  | 68,100.00<br>6,239,526,300  | -<br>- | 3.66 |
| 9  | 大和ハウスリート投資法人<br>日本            | 投資証<br>券 | 25,066 | 253,205.71<br>6,346,854,574 | 242,100.00<br>6,068,478,600 | -<br>- | 3.56 |
| 10 | ユナイテッド・アーバン投<br>資法人<br>日本     | 投資証<br>券 | 37,198 | 141,833.41<br>5,275,919,535 | 143,400.00<br>5,334,193,200 | -<br>- | 3.13 |
| 11 | オリックス不動産投資法人<br>日本            | 投資証<br>券 | 33,134 | 159,857.78<br>5,296,727,767 | 156,100.00<br>5,172,217,400 | -<br>- | 3.04 |
| 12 | アドバンス・レジデンス投<br>資法人<br>日本     | 投資証<br>券 | 16,343 | 327,868.83<br>5,358,360,360 | 315,000.00<br>5,148,045,000 | -<br>- | 3.02 |
| 13 | ジャパン・ホテル・リート<br>投資法人<br>日本    | 投資証<br>券 | 61,089 | 78,915.43<br>4,820,864,810  | 76,800.00<br>4,691,635,200  | -<br>- | 2.75 |
| 14 | 積水ハウス・リート投資法<br>人<br>日本       | 投資証<br>券 | 49,969 | 80,081.82<br>4,001,608,583  | 79,300.00<br>3,962,541,700  | -<br>- | 2.33 |
| 15 | 産業ファンド投資法人<br>日本              | 投資証<br>券 | 30,447 | 125,303.51<br>3,815,116,092 | 123,600.00<br>3,763,249,200 | -<br>- | 2.21 |
| 16 | 日本プライムリアルティ投<br>資法人<br>日本     | 投資証<br>券 | 11,373 | 331,332.48<br>3,768,244,300 | 326,500.00<br>3,713,284,500 | -<br>- | 2.18 |
| 17 | 日本アコモデーションファ<br>ンド投資法人<br>日本  | 投資証<br>券 | 5,742  | 649,665.38<br>3,730,378,655 | 642,000.00<br>3,686,364,000 | -<br>- | 2.16 |
| 18 | ラサールロジポート投資法<br>人<br>日本       | 投資証<br>券 | 21,304 | 151,000.17<br>3,216,907,754 | 148,200.00<br>3,157,252,800 | -<br>- | 1.85 |
| 19 | 三井不動産ロジスティクス<br>パーク投資法人<br>日本 | 投資証<br>券 | 6,934  | 442,713.15<br>3,069,773,040 | 422,500.00<br>2,929,615,000 | -<br>- | 1.72 |
| 20 | 日本ロジスティクスファン<br>ド投資法人<br>日本   | 投資証<br>券 | 11,173 | 272,667.95<br>3,046,519,007 | 256,200.00<br>2,862,522,600 | -<br>- | 1.68 |

|    |                              |          |        |                             |                             |        |      |
|----|------------------------------|----------|--------|-----------------------------|-----------------------------|--------|------|
| 21 | アクティビア・プロパ<br>ティーズ投資法人<br>日本 | 投資証<br>券 | 8,083  | 375,267.99<br>3,033,291,178 | 353,500.00<br>2,857,340,500 | -<br>- | 1.68 |
| 22 | フロンティア不動産投資法<br>人<br>日本      | 投資証<br>券 | 6,170  | 452,628.99<br>2,792,720,880 | 434,500.00<br>2,680,865,000 | -<br>- | 1.57 |
| 23 | イオンリート投資法人<br>日本             | 投資証<br>券 | 20,398 | 133,773.92<br>2,728,720,582 | 129,600.00<br>2,643,580,800 | -<br>- | 1.55 |
| 24 | コンフォリア・レジデン<br>シャル投資法人<br>日本 | 投資証<br>券 | 8,188  | 323,269.56<br>2,646,931,229 | 311,500.00<br>2,550,562,000 | -<br>- | 1.50 |
| 25 | 森ヒルズリート投資法人<br>日本            | 投資証<br>券 | 19,555 | 130,416.51<br>2,550,294,938 | 128,600.00<br>2,514,773,000 | -<br>- | 1.48 |
| 26 | 大和証券リビング投資法人<br>日本           | 投資証<br>券 | 24,560 | 104,067.85<br>2,555,906,592 | 101,900.00<br>2,502,664,000 | -<br>- | 1.47 |
| 27 | 森トラストリート投資法人<br>日本           | 投資証<br>券 | 32,053 | 70,374.87<br>2,255,726,026  | 69,800.00<br>2,237,299,400  | -<br>- | 1.31 |
| 28 | 三菱地所物流リート投資法<br>人<br>日本      | 投資証<br>券 | 5,742  | 386,801.73<br>2,221,015,590 | 378,500.00<br>2,173,347,000 | -<br>- | 1.28 |
| 29 | ヒューリックリート投資法<br>人<br>日本      | 投資証<br>券 | 14,694 | 146,742.53<br>2,156,234,848 | 142,700.00<br>2,096,833,800 | -<br>- | 1.23 |
| 30 | 大和証券オフィス投資法人<br>日本           | 投資証<br>券 | 6,890  | 281,047.94<br>1,936,420,324 | 293,400.00<br>2,021,526,000 | -<br>- | 1.19 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年7月31日現在

| 種類   | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 投資証券 | 97.06    |
| 合計   | 97.06    |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域            | 種類       | 数量      | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)         | 評価単価<br>評価金額<br>(円)         | 利率<br>(%)<br>償還日 | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------------------------|----------|---------|-----------------------------|-----------------------------|------------------|-----------------|
| 1  | PROLOGIS INC<br>アメリカ       | 投資証<br>券 | 398,189 | 16,777.02<br>6,680,426,690  | 19,221.15<br>7,653,654,319  | -<br>-           | 8.09            |
| 2  | EQUINIX INC<br>アメリカ        | 投資証<br>券 | 40,775  | 116,621.53<br>4,755,243,065 | 117,191.29<br>4,778,475,208 | -<br>-           | 5.05            |
| 3  | WELLTOWER INC<br>アメリカ      | 投資証<br>券 | 256,899 | 15,658.54<br>4,022,664,686  | 17,109.86<br>4,395,507,362  | -<br>-           | 4.65            |
| 4  | REALTY INCOME CORP<br>アメリカ | 投資証<br>券 | 374,194 | 8,124.58<br>3,040,169,437   | 8,897.92<br>3,329,549,324   | -<br>-           | 3.52            |

|    |  |          |         |                            |                            |        |      |
|----|--|----------|---------|----------------------------|----------------------------|--------|------|
| 5  | SIMON PROPERTY GROUP INC<br>アメリカ             | 投資証券     | 140,066 | 22,326.21<br>3,127,143,347 | 23,599.23<br>3,305,450,645 | -<br>- | 3.49 |
| 6  | PUBLIC STORAGE<br>アメリカ                       | 投資証券     | 67,966  | 44,391.09<br>3,017,084,992 | 46,398.16<br>3,153,497,532 | -<br>- | 3.33 |
| 7  | DIGITAL REALTY TRUST INC<br>アメリカ             | 投資証券     | 139,451 | 22,628.32<br>3,155,542,712 | 22,109.89<br>3,083,247,330 | -<br>- | 3.26 |
| 8  | GOODMAN GROUP<br>オーストラリア                     | 投資信託受益証券 | 742,819 | 3,566.54<br>2,649,299,309  | 3,492.73<br>2,594,468,062  | -<br>- | 2.74 |
| 9  | EXTRA SPACE STORAGE INC<br>アメリカ              | 投資証券     | 91,013  | 24,227.53<br>2,205,020,240 | 24,862.96<br>2,262,852,942 | -<br>- | 2.39 |
| 10 | VICI PROPERTIES INC<br>アメリカ                  | 投資証券     | 448,461 | 4,296.64<br>1,926,876,921  | 4,789.66<br>2,147,977,865  | -<br>- | 2.27 |
| 11 | IRON MOUNTAIN INC<br>アメリカ                    | 投資証券     | 126,034 | 13,610.76<br>1,715,419,524 | 15,440.64<br>1,946,046,579 | -<br>- | 2.06 |
| 12 | AVALONBAY COMMUNITIES INC<br>アメリカ            | 投資証券     | 61,049  | 31,097.22<br>1,898,454,512 | 31,423.98<br>1,918,402,652 | -<br>- | 2.03 |
| 13 | EQUITY RESIDENTIAL<br>アメリカ                   | 投資証券     | 148,309 | 10,426.75<br>1,546,381,639 | 10,605.25<br>1,572,854,140 | -<br>- | 1.66 |
| 14 | VENTAS INC<br>アメリカ                           | 投資証券     | 174,102 | 7,711.95<br>1,342,667,376  | 8,362.85<br>1,455,990,373  | -<br>- | 1.54 |
| 15 | INVITATION HOMES INC<br>アメリカ                 | 投資証券     | 247,708 | 5,396.08<br>1,336,653,845  | 5,333.87<br>1,321,243,657  | -<br>- | 1.40 |
| 16 | ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>EQUIT<br>アメリカ      | 投資証券     | 67,719  | 17,791.26<br>1,204,806,754 | 18,143.40<br>1,228,653,500 | -<br>- | 1.30 |
| 17 | ESSEX PROPERTY TRUST INC<br>アメリカ             | 投資証券     | 27,626  | 42,424.31<br>1,172,014,223 | 42,805.15<br>1,182,535,129 | -<br>- | 1.25 |
| 18 | MID AMERICA<br>アメリカ                          | 投資証券     | 50,275  | 21,497.01<br>1,080,762,275 | 21,541.29<br>1,082,988,676 | -<br>- | 1.15 |
| 19 | SUN COMMUNITIES INC<br>アメリカ                  | 投資証券     | 53,644  | 17,960.24<br>963,459,535   | 19,396.46<br>1,040,504,000 | -<br>- | 1.10 |
| 20 | SEGRO PLC<br>イギリス                            | 投資証券     | 575,957 | 1,749.37<br>1,007,564,898  | 1,787.28<br>1,029,401,495  | -<br>- | 1.09 |
| 21 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC<br>アメリカ            | 投資証券     | 302,944 | 2,949.67<br>893,585,622    | 3,329.28<br>1,008,588,308  | -<br>- | 1.07 |
| 22 | KIMCO REALTY<br>アメリカ                         | 投資証券     | 287,311 | 2,908.68<br>835,696,863    | 3,358.25<br>964,863,085    | -<br>- | 1.02 |
| 23 | GAMING AND LEISURE<br>PROPERTIES INC<br>アメリカ | 投資証券     | 116,896 | 6,790.60<br>793,794,810    | 7,660.10<br>895,436,218    | -<br>- | 0.95 |
| 24 | WP CAREY INC<br>アメリカ                         | 投資証券     | 94,222  | 8,434.34<br>794,701,052    | 9,268.35<br>873,282,662    | -<br>- | 0.92 |
| 25 | EQUITY LIFESTYLE<br>PROPERTIES<br>アメリカ       | 投資証券     | 80,313  | 9,822.68<br>788,889,096    | 10,449.76<br>839,251,735   | -<br>- | 0.89 |
| 26 | HOST HOTELS & RESORTS INC<br>アメリカ            | 投資証券     | 303,636 | 2,785.76<br>845,857,347    | 2,713.43<br>823,895,638    | -<br>- | 0.87 |
| 27 | UDR INC<br>アメリカ                              | 投資証券     | 130,468 | 6,211.87<br>810,450,386    | 6,227.17<br>812,446,937    | -<br>- | 0.86 |

|    |                               |          |           |                          |                          |        |      |
|----|-------------------------------|----------|-----------|--------------------------|--------------------------|--------|------|
| 28 | CAMDEN PROPERTY TRUST<br>アメリカ | 投資証券     | 45,884    | 16,735.81<br>767,906,355 | 17,041.26<br>781,921,522 | -<br>- | 0.83 |
| 29 | AMERICAN HOMES 4 RENT<br>アメリカ | 投資証券     | 138,621   | 5,541.23<br>768,131,115  | 5,509.18<br>763,688,262  | -<br>- | 0.81 |
| 30 | SCENTRE GROUP<br>オーストラリア      | 投資信託受益証券 | 2,237,692 | 318.43<br>712,553,820    | 338.80<br>758,152,426    | -<br>- | 0.80 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年7月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

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

|    |   |      |               |                        |                        |                  |      |
|----|---|------|---------------|------------------------|------------------------|------------------|------|
| 30 | REPUBLIC OF POLAND 5.5<br>03/18/54<br>ポーランド | 国債証券 | 1,371,960,000 | 95.83<br>1,314,845,305 | 97.81<br>1,341,985,417 | 5.5<br>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<br>発行体の国/地域                     | 種類<br>業種                                       | 数量        | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)       | 評価単価<br>評価金額<br>(円)       | 利率<br>(％)<br>償還日 | 投資<br>比率<br>(％) |
|----|-------------------------------------|--|-----------|---------------------------|---------------------------|------------------|-----------------|
| 1  | TAIWAN SEMICONDUCTOR<br>台湾          | 株式<br>半導体・<br>半導体製<br>造装置                      | 1,989,940 | 3,730.61<br>7,423,702,680 | 4,359.15<br>8,674,458,890 | -<br>-           | 8.96            |
| 2  | TENCENT HOLDINGS LTD<br>ケイマン諸島      | 株式<br>インタラ<br>クティブ<br>・メ<br>ディアお<br>よびサー<br>ビス | 534,100   | 5,898.76<br>3,150,530,542 | 6,898.73<br>3,684,614,897 | -<br>-           | 3.81            |
| 3  | SAMSUNG ELECTRONICS CO<br>LTD<br>韓国 | 株式<br>コン<br>ピュー<br>タ・周辺<br>機器                  | 385,943   | 8,702.37<br>3,358,621,594 | 8,950.49<br>3,454,382,821 | -<br>-           | 3.57            |
| 4  | ALIBABA GROUP HOLDING LTD<br>ケイマン諸島 | 株式<br>大規模小<br>売り                               | 1,258,968 | 1,326.67<br>1,670,247,666 | 1,486.66<br>1,871,659,884 | -<br>-           | 1.93            |
| 5  | RELIANCE INDUSTRIES LTD<br>インド      | 株式<br>石油・ガ<br>ス・消耗<br>燃料                       | 245,849   | 5,361.26<br>1,318,061,811 | 5,538.12<br>1,361,543,476 | -<br>-           | 1.41            |
| 6  | ICICI BANK LTD<br>インド               | 株式<br>銀行                                       | 419,311   | 1,955.66<br>820,031,487   | 2,213.29<br>928,058,310   | -<br>-           | 0.96            |
| 7  | INFOSYS LTD<br>インド                  | 株式<br>情報技術<br>サービス                             | 268,642   | 2,588.31<br>695,331,001   | 3,435.18<br>922,834,834   | -<br>-           | 0.95            |



|    |   |                                  |           |                          |                          |        |      |
|----|---|----------------------------------|-----------|--------------------------|--------------------------|--------|------|
| 8  | SK HYNIX INC<br>韓国                      | 株式<br>半導体・<br>半導体製<br>造装置        | 44,109    | 19,775.73<br>872,287,720 | 20,873.44<br>920,707,006 | -<br>- | 0.95 |
| 9  | HON HAI PRECISION<br>INDUSTRY<br>台湾     | 株式<br>電子装<br>置・機<br>器・部品         | 1,008,195 | 682.32<br>687,915,224    | 908.93<br>916,379,084    | -<br>- | 0.95 |
| 10 | PDD HOLDINGS INC ADR<br>ケイマン諸島          | 株式<br>大規模小<br>売り                 | 48,325    | 17,437.01<br>842,643,731 | 18,774.51<br>907,278,215 | -<br>- | 0.94 |
| 11 | MEITUAN<br>ケイマン諸島                       | 株式<br>ホテル・<br>レストラ<br>ン・レ<br>ジャー | 410,610   | 1,906.98<br>783,028,452  | 2,075.86<br>852,370,517  | -<br>- | 0.88 |
| 12 | CHINA CONSTRUCTION BANK<br>中国           | 株式<br>銀行                         | 7,748,530 | 93.69<br>725,988,665     | 105.93<br>820,873,844    | -<br>- | 0.85 |
| 13 | MEDIATEK INC<br>台湾                      | 株式<br>半導体・<br>半導体製<br>造装置        | 122,945   | 4,890.72<br>601,289,837  | 5,819.93<br>715,532,154  | -<br>- | 0.74 |
| 14 | HDFC BANK LTD<br>インド                    | 株式<br>銀行                         | 226,901   | 2,762.64<br>626,847,837  | 2,956.45<br>670,822,936  | -<br>- | 0.69 |
| 15 | TATA CONSULTANCY SERVICES<br>LTD<br>インド | 株式<br>情報技術<br>サービス               | 73,032    | 7,080.72<br>517,119,550  | 7,988.59<br>583,422,741  | -<br>- | 0.60 |
| 16 | AL RAJHI BANK<br>サウジアラビア                | 株式<br>銀行                         | 158,927   | 3,269.43<br>519,601,741  | 3,459.49<br>549,807,956  | -<br>- | 0.57 |
| 17 | BHARTI AIRTEL LTD<br>インド                | 株式<br>無線通信<br>サービス               | 183,172   | 2,239.66<br>410,243,488  | 2,690.74<br>492,868,318  | -<br>- | 0.51 |
| 18 | SAMSUNG ELECTRONICS-PFD<br>韓国           | 株式<br>コン<br>ピュー<br>タ・周辺<br>機器    | 66,036    | 7,307.56<br>482,562,658  | 6,961.50<br>459,709,614  | -<br>- | 0.48 |
| 19 | VALE SA<br>ブラジル                         | 株式<br>金属・鉄<br>業                  | 275,289   | 1,686.39<br>464,246,184  | 1,634.25<br>449,891,147  | -<br>- | 0.46 |
| 20 | IND & COMM BK OF CHINA -<br>H<br>中国     | 株式<br>銀行                         | 5,252,235 | 78.64<br>413,087,024     | 84.28<br>442,675,172     | -<br>- | 0.46 |
| 21 | NETEASE INC<br>ケイマン諸島                   | 株式<br>娯楽                         | 156,600   | 2,751.23<br>430,843,192  | 2,782.12<br>435,680,931  | -<br>- | 0.45 |
| 22 | BANK OF CHINA LTD<br>中国                 | 株式<br>銀行                         | 6,371,200 | 64.24<br>409,291,123     | 67.11<br>427,599,265     | -<br>- | 0.44 |
| 23 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT<br>インドネシア      | 株式<br>銀行                         | 4,463,000 | 89.45<br>399,240,490     | 95.64<br>426,863,635     | -<br>- | 0.44 |

|    |                                |                               |           |                          |                          |        |      |
|----|--------------------------------|-------------------------------|-----------|--------------------------|--------------------------|--------|------|
| 24 | NASPERS LTD<br>南アフリカ           | 株式<br>大規模小<br>売り              | 14,368    | 26,636.14<br>382,708,162 | 28,874.31<br>414,866,091 | -<br>- | 0.43 |
| 25 | MAHINDRA & MAHINDRA LTD<br>インド | 株式<br>自動車                     | 75,480    | 3,737.67<br>282,119,666  | 5,347.44<br>403,624,997  | -<br>- | 0.42 |
| 26 | AXIS BANK LTD<br>インド           | 株式<br>銀行                      | 184,556   | 1,931.32<br>356,437,209  | 2,141.09<br>395,152,851  | -<br>- | 0.41 |
| 27 | XIAOMI CORP<br>ケイマン諸島          | 株式<br>コン<br>ピュー<br>タ・周辺<br>機器 | 1,238,800 | 318.05<br>394,003,927    | 318.40<br>394,437,884    | -<br>- | 0.41 |
| 28 | PETROLEO BRASILEIRO SA<br>ブラジル | 株式<br>石油・ガ<br>ス・消耗<br>燃料      | 384,212   | 1,079.13<br>414,617,176  | 994.60<br>382,140,213    | -<br>- | 0.39 |
| 29 | LARSEN & TOUBRO LTD<br>インド     | 株式<br>建設・土<br>木               | 54,568    | 6,489.51<br>354,120,113  | 6,925.90<br>377,933,029  | -<br>- | 0.39 |
| 30 | JD.COM INC<br>ケイマン諸島           | 株式<br>大規模小<br>売り              | 188,535   | 1,931.98<br>364,247,135  | 1,993.92<br>375,924,084  | -<br>- | 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。

**【投資不動産物件】**

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)

該当事項はありません。

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)

該当事項はありません。

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

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。

**【その他投資資産の主要なもの】**

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)

該当事項はありません。

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)

該当事項はありません。

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

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/<br>売建 | 数量  | 簿価金額<br>(円)    | 評価金額<br>(円)    | 投資比率<br>(%) |
|--------------|-------|-------------------|-----------|-----|----------------|----------------|-------------|
| 株価指数先物<br>取引 | 大阪取引所 | TOPIX<br>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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・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/<br>売建 | 数量  | 簿価金額<br>(円)    | 評価金額<br>(円)    | 投資比率<br>(%) |
|--------------|-------------------------------|--------------------------------|-----------|-----|----------------|----------------|-------------|
| 株価指数先物<br>取引 | シカゴ商品<br>取引所                  | S&P500 EMINI FUT<br>Sep24      | 買建        | 646 | 27,439,247,637 | 26,945,561,170 | 1.71        |
|              | EUREX<br>取引所                  | DJ EURO STOXX 50<br>Sep24      | 買建        | 584 | 4,759,226,665  | 4,691,529,427  | 0.30        |
|              | ICE-EU                        | FTSE 100 INDEX<br>FUTURE Sep24 | 買建        | 88  | 1,417,912,192  | 1,427,505,411  | 0.09        |
|              | モン<br>トリ<br>オール<br>取引<br>所    | S&P/TSE 60 IX FUT<br>Sep24     | 買建        | 37  | 1,087,877,613  | 1,115,077,029  | 0.07        |
|              | シド<br>ニー<br>先<br>物<br>取引<br>所 | SPI 200 FUTURES<br>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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

| 種類              | 取引所          | 資産の名称                      | 買建/<br>売建 | 数量  | 簿価金額<br>(円) | 評価金額<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|-----------------|--------------|----------------------------|-----------|-----|-------------|-------------|-------------|
| 不動産投信指<br>数先物取引 | シカゴ商品<br>取引所 | DJ US REAL ESTATE<br>Sep24 | 買建        | 152 | 801,480,739 | 843,188,323 | 0.89        |

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

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

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/<br>売建 | 数量  | 簿価金額<br>(円)   | 評価金額<br>(円)   | 投資比率<br>(%) |
|--------------|----------------|----------------------------|-----------|-----|---------------|---------------|-------------|
| 株価指数先物<br>取引 | I C E - U<br>S | MINI MSCI EMG MKT<br>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。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）

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<br>(分配落)<br>(百万円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(百万円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2020年1月14日) | 17                      | 17                      | 1.0702                     | 1.0702                     |
| 第2計算期間末<br>(2021年1月12日) | 181                     | 181                     | 1.0566                     | 1.0566                     |
| 第3計算期間末<br>(2022年1月11日) | 908                     | 908                     | 1.1159                     | 1.1159                     |
| 第4計算期間末<br>(2023年1月11日) | 1,992                   | 1,992                   | 1.0115                     | 1.0115                     |
| 第5計算期間末<br>(2024年1月11日) | 2,809                   | 2,809                   | 1.0688                     | 1.0688                     |
| 2023年7月末日               | 2,464                   | -                       | 1.0511                     | -                          |
| 8月末日                    | 2,516                   | -                       | 1.0491                     | -                          |
| 9月末日                    | 2,521                   | -                       | 1.0308                     | -                          |
| 10月末日                   | 2,569                   | -                       | 1.0103                     | -                          |
| 11月末日                   | 2,713                   | -                       | 1.0472                     | -                          |
| 12月末日                   | 2,787                   | -                       | 1.0648                     | -                          |
| 2024年1月末日               | 2,838                   | -                       | 1.0737                     | -                          |
| 2月末日                    | 2,911                   | -                       | 1.0839                     | -                          |
| 3月末日                    | 3,046                   | -                       | 1.1028                     | -                          |
| 4月末日                    | 3,047                   | -                       | 1.0903                     | -                          |
| 5月末日                    | 3,098                   | -                       | 1.0865                     | -                          |
| 6月末日                    | 3,247                   | -                       | 1.1070                     | -                          |
| 7月末日                    | 3,317                   | -                       | 1.0960                     | -                          |

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）

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<br>(分配落)<br>(百万円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(百万円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2020年1月14日) | 14                      | 14                      | 1.0698                     | 1.0698                     |

|                         |       |       |        |        |
|-------------------------|-------|-------|--------|--------|
| 第2計算期間末<br>(2021年1月12日) | 97    | 97    | 1.0590 | 1.0590 |
| 第3計算期間末<br>(2022年1月11日) | 376   | 376   | 1.1173 | 1.1173 |
| 第4計算期間末<br>(2023年1月11日) | 880   | 880   | 1.0111 | 1.0111 |
| 第5計算期間末<br>(2024年1月11日) | 1,337 | 1,337 | 1.0787 | 1.0787 |
| 2023年7月末日               | 1,149 | -     | 1.0571 | -      |
| 8月末日                    | 1,176 | -     | 1.0566 | -      |
| 9月末日                    | 1,185 | -     | 1.0381 | -      |
| 10月末日                   | 1,199 | -     | 1.0164 | -      |
| 11月末日                   | 1,269 | -     | 1.0567 | -      |
| 12月末日                   | 1,324 | -     | 1.0720 | -      |
| 2024年1月末日               | 1,357 | -     | 1.0845 | -      |
| 2月末日                    | 1,411 | -     | 1.1002 | -      |
| 3月末日                    | 1,476 | -     | 1.1220 | -      |
| 4月末日                    | 1,484 | -     | 1.1164 | -      |
| 5月末日                    | 1,528 | -     | 1.1167 | -      |
| 6月末日                    | 1,627 | -     | 1.1437 | -      |
| 7月末日                    | 1,647 | -     | 1.1255 | -      |

## 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）

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<br>(分配落)<br>(百万円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(百万円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2020年1月14日) | 14                      | 14                      | 1.0699                     | 1.0699                     |
| 第2計算期間末<br>(2021年1月12日) | 96                      | 96                      | 1.0560                     | 1.0560                     |
| 第3計算期間末<br>(2022年1月11日) | 324                     | 324                     | 1.1141                     | 1.1141                     |
| 第4計算期間末<br>(2023年1月11日) | 543                     | 543                     | 1.0083                     | 1.0083                     |
| 第5計算期間末<br>(2024年1月11日) | 815                     | 815                     | 1.0751                     | 1.0751                     |
| 2023年7月末日               | 712                     | -                       | 1.0540                     | -                          |
| 8月末日                    | 722                     | -                       | 1.0536                     | -                          |
| 9月末日                    | 725                     | -                       | 1.0351                     | -                          |
| 10月末日                   | 726                     | -                       | 1.0131                     | -                          |
| 11月末日                   | 781                     | -                       | 1.0532                     | -                          |
| 12月末日                   | 807                     | -                       | 1.0686                     | -                          |
| 2024年1月末日               | 834                     | -                       | 1.0809                     | -                          |
| 2月末日                    | 859                     | -                       | 1.0966                     | -                          |
| 3月末日                    | 915                     | -                       | 1.1184                     | -                          |
| 4月末日                    | 912                     | -                       | 1.1129                     | -                          |
| 5月末日                    | 949                     | -                       | 1.1132                     | -                          |
| 6月末日                    | 1,024                   | -                       | 1.1401                     | -                          |

|      |       |   |        |   |
|------|-------|---|--------|---|
| 7月末日 | 1,012 | - | 1.1216 | - |
|------|-------|---|--------|---|

## 【分配の推移】

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)

|                       | 1口当たりの分配金(円) |
|-----------------------|--------------|
| 第1計算期間                | 0.0000       |
| 第2計算期間                | 0.0000       |
| 第3計算期間                | 0.0000       |
| 第4計算期間                | 0.0000       |
| 第5計算期間                | 0.0000       |
| 2024年1月12日～2024年7月11日 | -            |

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)

|                       | 1口当たりの分配金(円) |
|-----------------------|--------------|
| 第1計算期間                | 0.0000       |
| 第2計算期間                | 0.0000       |
| 第3計算期間                | 0.0000       |
| 第4計算期間                | 0.0000       |
| 第5計算期間                | 0.0000       |
| 2024年1月12日～2024年7月11日 | -            |

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

|                       | 1口当たりの分配金(円) |
|-----------------------|--------------|
| 第1計算期間                | 0.0000       |
| 第2計算期間                | 0.0000       |
| 第3計算期間                | 0.0000       |
| 第4計算期間                | 0.0000       |
| 第5計算期間                | 0.0000       |
| 2024年1月12日～2024年7月11日 | -            |

## 【収益率の推移】

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)

|                       | 収益率(%) |
|-----------------------|--------|
| 第1計算期間                | 7.0    |
| 第2計算期間                | 1.3    |
| 第3計算期間                | 5.6    |
| 第4計算期間                | 9.4    |
| 第5計算期間                | 5.7    |
| 2024年1月12日～2024年7月11日 | 4.8    |

(注) 収益率は期間騰落率です。

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)

|                       | 収益率(%) |
|-----------------------|--------|
| 第1計算期間                | 7.0    |
| 第2計算期間                | 1.0    |
| 第3計算期間                | 5.5    |
| 第4計算期間                | 9.5    |
| 第5計算期間                | 6.7    |
| 2024年1月12日～2024年7月11日 | 7.7    |

(注) 収益率は期間騰落率です。



## 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

|                       | 収益率(%) |
|-----------------------|--------|
| 第1計算期間                | 7.0    |
| 第2計算期間                | 1.3    |
| 第3計算期間                | 5.5    |
| 第4計算期間                | 9.5    |
| 第5計算期間                | 6.6    |
| 2024年1月12日～2024年7月11日 | 7.8    |

(注) 収益率は期間騰落率です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

## 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)

|                           | 設定口数          | 解約口数        |
|---------------------------|---------------|-------------|
| 第1計算期間                    | 15,978,994    | 0           |
| 第2計算期間                    | 166,986,041   | 10,985,689  |
| 第3計算期間                    | 681,883,755   | 39,784,704  |
| 第4計算期間                    | 1,284,576,861 | 129,179,109 |
| 第5計算期間                    | 937,776,215   | 278,644,446 |
| 2024年1月12日～<br>2024年7月11日 | 562,810,865   | 224,193,143 |

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)

|                           | 設定口数        | 解約口数        |
|---------------------------|-------------|-------------|
| 第1計算期間                    | 13,549,161  | 0           |
| 第2計算期間                    | 88,254,390  | 9,900,540   |
| 第3計算期間                    | 276,898,986 | 31,426,491  |
| 第4計算期間                    | 603,241,361 | 69,560,474  |
| 第5計算期間                    | 493,442,158 | 124,536,569 |
| 2024年1月12日～<br>2024年7月11日 | 292,691,276 | 99,480,821  |

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

|                           | 設定口数        | 解約口数        |
|---------------------------|-------------|-------------|
| 第1計算期間                    | 13,529,038  | 0           |
| 第2計算期間                    | 93,411,729  | 15,869,764  |
| 第3計算期間                    | 269,230,751 | 69,224,021  |
| 第4計算期間                    | 327,388,419 | 79,755,585  |
| 第5計算期間                    | 324,667,141 | 104,793,245 |
| 2024年1月12日～<br>2024年7月11日 | 212,269,021 | 80,911,057  |

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

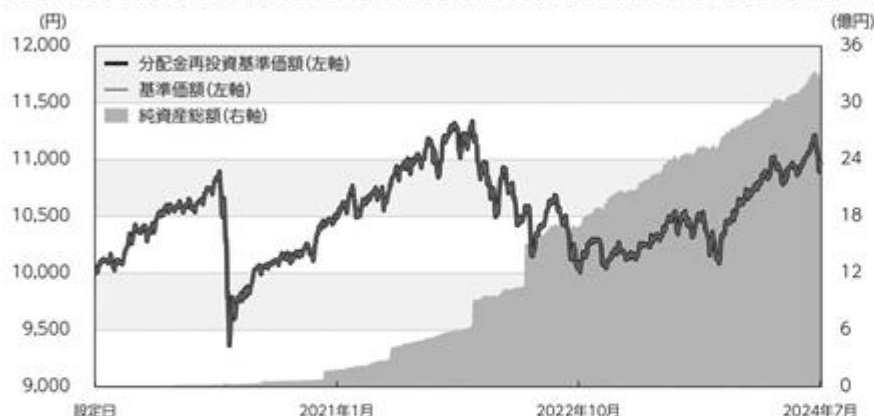
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2024年7月31日

## ターゲット・イヤー2040

## 基準価額・純資産の推移 (2019年3月18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、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:2019年3月18日)

## 分配の推移(税引前)

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

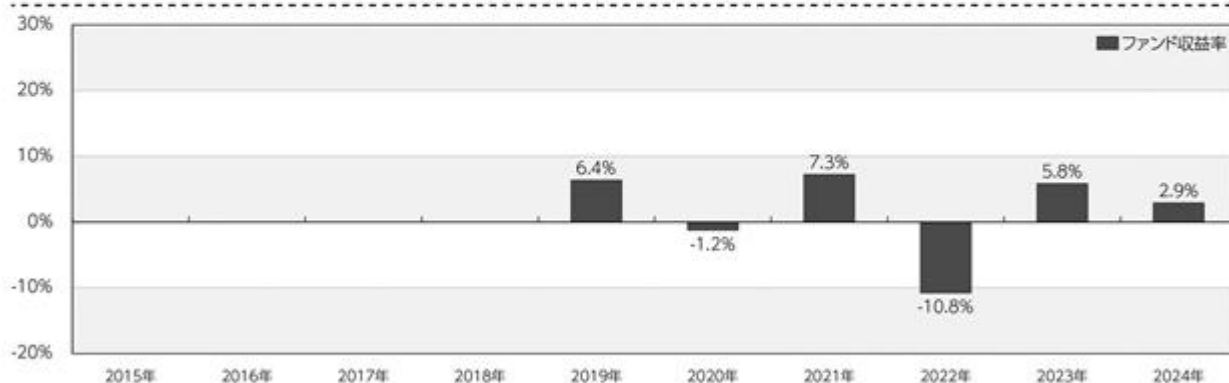
※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

| 順位 | 銘柄名                          | 比率(%) |
|----|------------------------------|-------|
| 1  | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 25.01 |
| 2  | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 19.81 |
| 3  | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 17.88 |
| 4  | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド  | 14.90 |
| 5  | エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 7.41  |
| 6  | エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 6.39  |
| 7  | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド      | 3.03  |
| 8  | J-REITインデックスファンド・マザーファンド     | 1.00  |

## 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。

※2019年は設定日から年末までの収益率、および2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

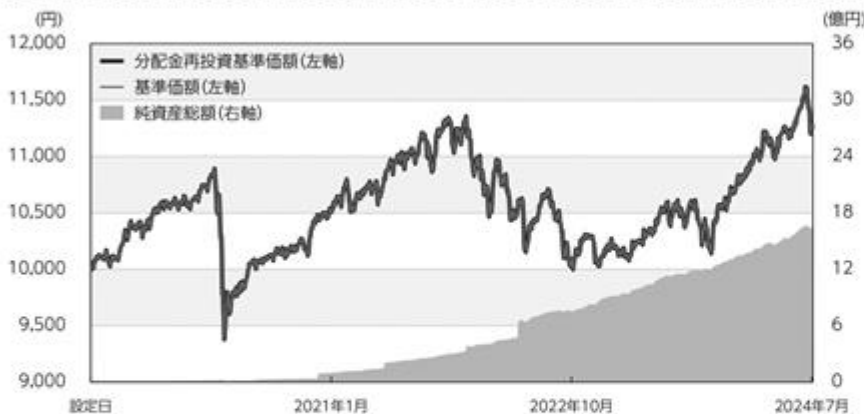
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2024年7月31日

ターゲット・イヤー2050

## 基準価額・純資産の推移（2019年3月18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、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:2019年3月18日)

## 分配の推移(税引前)

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

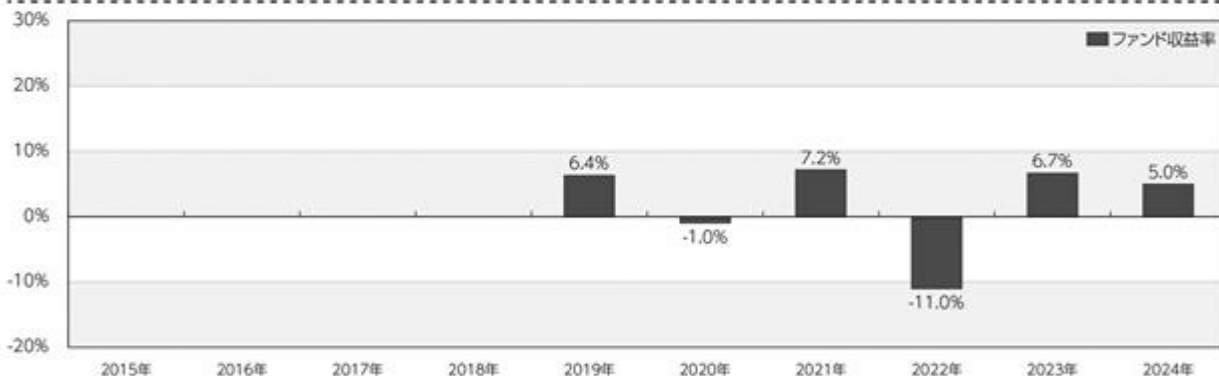
※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

| 順位 | 銘柄名                          | 比率(%) |
|----|------------------------------|-------|
| 1  | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 26.21 |
| 2  | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 19.34 |
| 3  | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド  | 14.92 |
| 4  | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 14.41 |
| 5  | エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 9.85  |
| 6  | エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 7.42  |
| 7  | 外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド       | 5.05  |
| 8  | J-REITインデックスファンド・マザーファンド     | 1.01  |

## 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。

※2019年は設定日から年末までの収益率、および2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

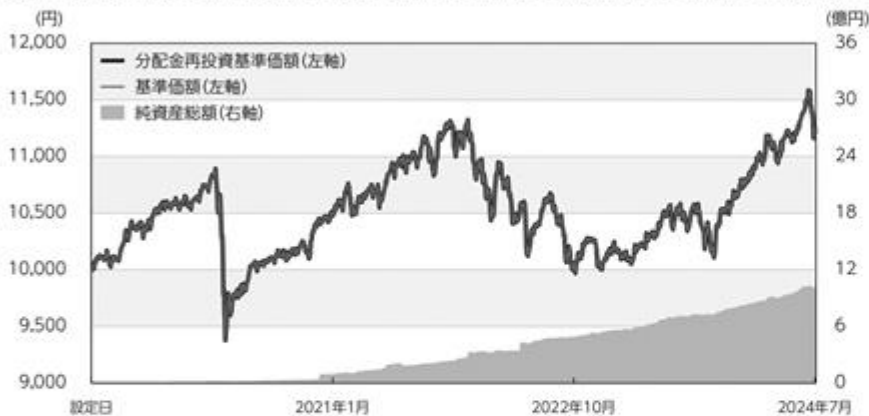
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2024年7月31日

## ターゲット・イヤー2060

## 基準価額・純資産の推移（2019年3月18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、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:2019年3月18日)

## 分配の推移(税引前)

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

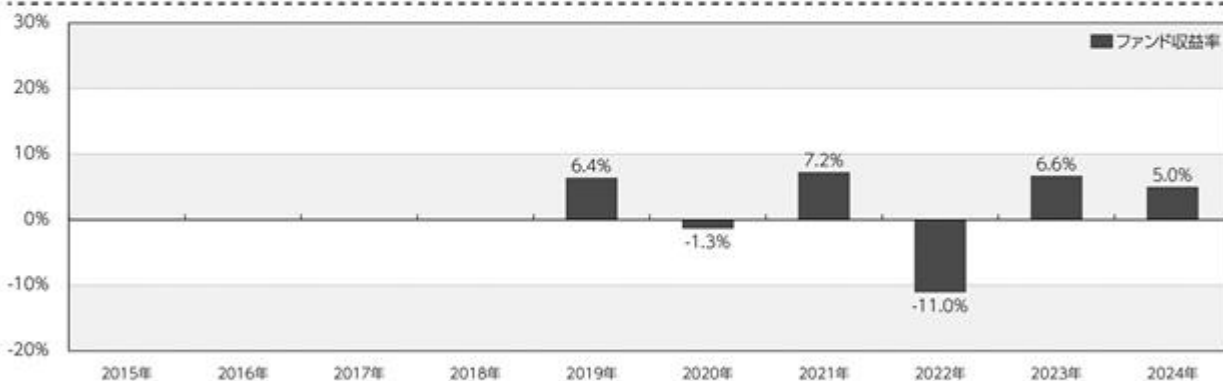
※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

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

| 順位 | 銘柄名                          | 比率(%) |
|----|------------------------------|-------|
| 1  | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 26.01 |
| 2  | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 19.39 |
| 3  | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド  | 14.96 |
| 4  | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 14.70 |
| 5  | エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 9.87  |
| 6  | エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 7.44  |
| 7  | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド      | 5.14  |
| 8  | J-REITインデックスファンド・マザーファンド     | 1.01  |

## 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。

※2019年は設定日から年末までの収益率、および2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2024年7月31日

## 主要な資産の状況

## ■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  |

## ■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名                                 | 種類   | 国/地域 | 利率(%) | 償還日       | 比率(%) |
|----|-------------------------------------|------|------|-------|-----------|-------|
| 1  | CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27 | 国債証券 | 中国   | 2.04  | 2027/2/25 | 0.67  |
| 2  | CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29 | 国債証券 | 中国   | 2.05  | 2029/4/15 | 0.56  |
| 3  | US T N/B 4.625 03/15/26             | 国債証券 | アメリカ | 4.625 | 2026/3/15 | 0.52  |
| 4  | CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30  | 国債証券 | 中国   | 2.8   | 2030/3/25 | 0.51  |
| 5  | CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34 | 国債証券 | 中国   | 2.35  | 2034/2/25 | 0.50  |

## ■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  |

## ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

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

○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

### ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

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

### ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名                                     | 種類   | 国/地域    | 利率(%) | 償還日        | 比率(%) |
|----|---|------|---------|-------|------------|-------|
| 1  | SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32   | 国債証券 | サウジアラビア | 5.5   | 2032/10/25 | 1.78  |
| 2  | SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 | 国債証券 | サウジアラビア | 4.375 | 2029/4/16  | 1.69  |
| 3  | HUNGARY 5.25 06/16/29                   | 国債証券 | ハンガリー   | 5.25  | 2029/6/16  | 1.59  |
| 4  | ROMANIA 7.125 01/17/33                  | 国債証券 | ルーマニア   | 7.125 | 2033/1/17  | 1.58  |
| 5  | HUNGARY 6.25 09/22/32                   | 国債証券 | ハンガリー   | 6.25  | 2032/9/22  | 1.53  |

### ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名                        | 種類 | 国/地域   | 業種                   | 比率(%) |
|----|----------------------------|----|--------|----------------------|-------|
| 1  | TAIWAN SEMICONDUCTOR       | 株式 | 台湾     | 半導体・半導体製造装置          | 8.96  |
| 2  | TENCENT HOLDINGS LTD       | 株式 | ケイマン諸島 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 3.81  |
| 3  | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 株式 | 韓国     | コンピュータ・周辺機器          | 3.57  |
| 4  | ALIBABA GROUP HOLDING LTD  | 株式 | ケイマン諸島 | 大規模小売り               | 1.93  |
| 5  | RELIANCE INDUSTRIES LTD    | 株式 | インド    | 石油・ガス・消耗燃料           | 1.41  |

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

各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、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2024年10月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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



海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

## &lt;主な投資対象の時価評価方法の原則&gt;

| 投資対象            | 評価方法   |
|-----------------|--|
| マザーファンド<br>受益証券 | 計算日の基準価額   |
| 公社債等            | 計算日 における以下のいずれかの価額<br>・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）<br>・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。）<br>・価格情報会社の提供する価額 |
| 株式              | 計算日 における金融商品取引所等の最終相場  |
| 不動産投資信託<br>証券   | 計算日 における金融商品取引所等の最終相場  |
| 外貨建資産の<br>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<br>円換算  | 計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値   |

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

## （2）【保管】

該当事項はありません。

## （3）【信託期間】

ターゲット・イヤー2040：2019年3月18日（設定日）から原則として2055年1月8日までです。

ターゲット・イヤー2050：2019年3月18日（設定日）から原則として2065年1月9日までです。

ターゲット・イヤー2060：2019年3月18日（設定日）から原則として2075年1月11日までです。

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

## (4) 【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## (5) 【その他】

## イ.償還規定

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

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

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

#### ロ. 信託約款の変更等

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

## 八. 関係法人との契約の更改

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

また、投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）の間の当該契約は、原則として期間満了の90日前までにいずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、各ファンドの信託終了まで存続します。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（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

（URL <https://www.am-one.co.jp/>）

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

### (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2023年1月12日から2024年1月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第4期<br>2023年1月11日現在 | 第5期<br>2024年1月11日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 36,634,494          | 78,568,234          |
| 親投資信託受益証券       | 1,955,741,218       | 2,748,421,879       |
| 派生商品評価勘定        | 7,763,837           | 783,617             |
| 流動資産合計          | 2,000,139,549       | 2,827,773,730       |
| 資産合計            | 2,000,139,549       | 2,827,773,730       |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 派生商品評価勘定        | 678,282             | 4,419,615           |
| 未払解約金           | 30,777              | 2,997,253           |
| 未払受託者報酬         | 292,302             | 429,007             |
| 未払委託者報酬         | 7,016,085           | 10,297,261          |
| その他未払費用         | 34,604              | 50,822              |
| 流動負債合計          | 8,052,050           | 18,193,958          |
| 負債合計            | 8,052,050           | 18,193,958          |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1,969,476,149       | 2,628,607,918       |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 22,611,350          | 180,971,854         |
| (分配準備積立金)       | 36,201,535          | 77,585,568          |
| 元本等合計           | 1,992,087,499       | 2,809,579,772       |
| 純資産合計           | 1,992,087,499       | 2,809,579,772       |
| 負債純資産合計         | 2,000,139,549       | 2,827,773,730       |



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 第4期<br>自 2022年1月12日<br>至 2023年1月11日 | 第5期<br>自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日 |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|
| <b>営業収益</b>                               |                                     |                                     |
| 受取利息                                      | 318                                 | 671                                 |
| 有価証券売買等損益                                 | 101,957,709                         | 210,780,661                         |
| 為替差損益                                     | 9,098,284                           | 53,490,864                          |
| <b>営業収益合計</b>                             | <b>111,055,675</b>                  | <b>157,290,468</b>                  |
| <b>営業費用</b>                               |                                     |                                     |
| 支払利息                                      | 16,624                              | 30,381                              |
| 受託者報酬                                     | 474,299                             | 786,116                             |
| 委託者報酬                                     | 11,385,083                          | 18,869,039                          |
| その他費用                                     | 56,115                              | 459,290                             |
| <b>営業費用合計</b>                             | <b>11,932,121</b>                   | <b>20,144,826</b>                   |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 122,987,796                         | 137,145,642                         |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 122,987,796                         | 137,145,642                         |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 122,987,796                         | 137,145,642                         |
| 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（ ） | 6,138,732                           | 6,109,098                           |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 94,316,540                          | 22,611,350                          |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 56,950,377                          | 31,537,900                          |
| 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                   | 56,950,377                          | 31,537,900                          |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 11,806,503                          | 4,213,940                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 11,806,503                          | 4,213,940                           |
| 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（ ）                           | 22,611,350                          | 180,971,854                         |

## (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5期   |              |
|-----------------------|---|--------------|
|                       | 自 2023年1月12日  | 至 2024年1月11日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |              |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>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。                            |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目        | 第4期            | 第5期            |
|-----------|----------------|----------------|
|           | 2023年1月11日現在   | 2024年1月11日現在   |
| 1. 期首元本額  | 814,078,397円   | 1,969,476,149円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,284,576,861円 | 937,776,215円   |
| 期中一部解約元本額 | 129,179,109円   | 278,644,446円   |
| 2. 受益権の総数 | 1,969,476,149口 | 2,628,607,918口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目          | 第4期   | 第5期   |
|-------------|---|---|
|             | 自 2022年1月12日<br>至 2023年1月11日  | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日  |
| 1. 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,503,952円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(163,936,975円)及び分配準備積立金(17,697,583円)より分配対象収益は200,138,510円(1万口当たり1,016.20円)であります。分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(45,477,193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(235,800,180円)及び分配準備積立金(32,108,375円)より分配対象収益は313,385,748円(1万口当たり1,192.21円)であります。分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目              | 第4期   | 第5期                          |
|-----------------|---|------------------------------|
|                 | 自 2022年1月12日<br>至 2023年1月11日  | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左                           |

|                          |  |    |
|--------------------------|--|----|
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。<br>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。   | 同左 |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                   | 第4期<br>2023年1月11日現在  | 第5期<br>2024年1月11日現在 |
|----------------------|--|---------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   | 同左                  |
| 2. 時価の算定方法           | (1)有価証券<br>「（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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |
|----------------------------|---|----|

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第4期<br>2023年1月11日現在       | 第5期<br>2024年1月11日現在       |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
|           | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 71,799,913                | 169,069,089               |
| 合計        | 71,799,913                | 169,069,089               |

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

| 種類                  | 第4期<br>2023年1月11日現在 |           |             |           |
|---------------------|---------------------|-----------|-------------|-----------|
|                     | 契約額等（円）             |           | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|                     |                     | うち<br>1年超 |             |           |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                     |           |             |           |
| 売建                  | 395,728,328         | -         | 389,240,337 | 6,487,991 |
| イギリス・ポンド            | 162,235,356         | -         | 158,783,314 | 3,452,042 |
| オーストラリア・ドル          | 62,600,089          | -         | 61,765,567  | 834,522   |
| カナダ・ドル              | 23,712,234          | -         | 22,481,583  | 1,230,651 |
| ユーロ                 | 147,180,649         | -         | 146,209,873 | 970,776   |
| 買建                  | 80,923,961          | -         | 81,521,525  | 597,564   |
| イギリス・ポンド            | 10,237,090          | -         | 10,197,534  | 39,556    |
| オーストラリア・ドル          | 12,106,299          | -         | 12,176,562  | 70,263    |
| カナダ・ドル              | 12,662,381          | -         | 12,629,331  | 33,050    |
| ユーロ                 | 45,918,191          | -         | 46,518,098  | 599,907   |
| 合計                  | 476,652,289         | -         | 470,761,862 | 7,085,555 |

| 種類                  | 第5期<br>2024年1月11日現在 |           |             |           |
|---------------------|---------------------|-----------|-------------|-----------|
|                     | 契約額等（円）             |           | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|                     |                     | うち<br>1年超 |             |           |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                     |           |             |           |
| 売建                  | 619,552,428         | -         | 623,479,077 | 3,926,649 |
| アメリカ・ドル             | 55,177,357          | -         | 55,108,650  | 68,707    |
| イギリス・ポンド            | 223,929,152         | -         | 226,315,249 | 2,386,097 |

|            |             |   |             |           |
|------------|-------------|---|-------------|-----------|
| オーストラリア・ドル | 84,955,356  | - | 86,184,142  | 1,228,786 |
| カナダ・ドル     | 40,762,506  | - | 40,960,819  | 198,313   |
| ユーロ        | 214,728,057 | - | 214,910,217 | 182,160   |
| 買建         | 74,348,035  | - | 74,638,686  | 290,651   |
| アメリカ・ドル    | 13,116,098  | - | 13,005,931  | 110,167   |
| イギリス・ポンド   | 28,915,731  | - | 29,194,224  | 278,493   |
| オーストラリア・ドル | 1,538,833   | - | 1,546,645   | 7,812     |
| カナダ・ドル     | 27,490,485  | - | 27,581,658  | 91,173    |
| ユーロ        | 3,286,888   | - | 3,310,228   | 23,340    |
| 合計         | 693,900,463 | - | 698,117,763 | 3,635,998 |

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

|                           | 第4期<br>2023年1月11日現在  | 第5期<br>2024年1月11日現在  |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.0115円<br>(10,115円) | 1.0688円<br>(10,688円) |

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

| 種類        | 銘柄                              | 券面総額<br>(円) | 評価額<br>(円)  | 備考 |
|-----------|---------------------------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 国内株式パッシブ・ファンド<br>(最適化法)・マザーファンド | 82,849,615  | 359,012,236 |    |
|           | 国内債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド       | 673,740,560 | 841,704,081 |    |
|           | J-REITインデックスファ<br>ンド・マザーファンド    | 47,570,480  | 112,275,846 |    |
|           | 外国株式パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド       | 65,268,596  | 510,863,827 |    |

|           |                              |               |               |  |
|-----------|------------------------------|---------------|---------------|--|
|           | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド      | 43,907,830    | 83,868,346    |  |
|           | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 485,528,953   | 571,661,789   |  |
|           | エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 36,543,639    | 56,302,784    |  |
|           | エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 94,125,468    | 212,732,970   |  |
| 親投資信託受益証券 | 合計                           | 1,529,535,141 | 2,748,421,879 |  |
|           | 合計                           |               | 2,748,421,879 |  |

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第4期<br>2023年1月11日現在 | 第5期<br>2024年1月11日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 18,643,703          | 31,531,881          |
| 親投資信託受益証券       | 861,887,937         | 1,312,956,319       |
| 派生商品評価勘定        | 4,275,687           | 425,372             |
| 流動資産合計          | 884,807,327         | 1,344,913,572       |
| 資産合計            | 884,807,327         | 1,344,913,572       |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 派生商品評価勘定        | 528,334             | 1,437,625           |
| 未払解約金           | 30,692              | 374,925             |
| 未払受託者報酬         | 127,976             | 201,197             |
| 未払委託者報酬         | 3,413,913           | 5,366,508           |
| その他未払費用         | 15,099              | 23,786              |
| 流動負債合計          | 4,116,014           | 7,404,041           |
| 負債合計            | 4,116,014           | 7,404,041           |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 871,056,393         | 1,239,961,982       |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 9,634,920           | 97,547,549          |
| (分配準備積立金)       | 16,832,735          | 35,992,645          |
| 元本等合計           | 880,691,313         | 1,337,509,531       |
| 純資産合計           | 880,691,313         | 1,337,509,531       |
| 負債純資産合計         | 884,807,327         | 1,344,913,572       |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

|   | 第4期<br>自 2022年1月12日<br>至 2023年1月11日 | 第5期<br>自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日 |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|
| <b>営業収益</b>                               |                                     |                                     |
| 受取利息                                      | 160                                 | 296                                 |
| 有価証券売買等損益                                 | 47,119,811                          | 104,888,382                         |
| 為替差損益                                     | 2,193,132                           | 20,399,083                          |
| <b>営業収益合計</b>                             | <b>49,312,783</b>                   | <b>84,489,595</b>                   |
| <b>営業費用</b>                               |                                     |                                     |
| 支払利息                                      | 8,446                               | 14,541                              |
| 受託者報酬                                     | 205,975                             | 363,361                             |
| 委託者報酬                                     | 5,495,104                           | 9,692,014                           |
| その他費用                                     | 24,277                              | 434,155                             |
| <b>営業費用合計</b>                             | <b>5,733,802</b>                    | <b>10,504,071</b>                   |
| 営業利益又は営業損失( )                             | 55,046,585                          | 73,985,524                          |
| 経常利益又は経常損失( )                             | 55,046,585                          | 73,985,524                          |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           | 55,046,585                          | 73,985,524                          |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( ) | 3,499,539                           | 3,540,899                           |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           | 39,564,091                          | 9,634,920                           |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 27,878,770                          | 19,468,136                          |
| 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                   | 27,878,770                          | 19,468,136                          |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 6,260,895                           | 2,000,132                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 6,260,895                           | 2,000,132                           |
| 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( )                           | 9,634,920                           | 97,547,549                          |



## (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5期   |              |
|-----------------------|---|--------------|
|                       | 自 2023年1月12日  | 至 2024年1月11日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |              |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>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。                            |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目        | 第4期          | 第5期            |
|-----------|--------------|----------------|
|           | 2023年1月11日現在 | 2024年1月11日現在   |
| 1. 期首元本額  | 337,375,506円 | 871,056,393円   |
| 期中追加設定元本額 | 603,241,361円 | 493,442,158円   |
| 期中一部解約元本額 | 69,560,474円  | 124,536,569円   |
| 2. 受益権の総数 | 871,056,393口 | 1,239,961,982口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目          | 第4期   | 第5期   |
|-------------|---|---|
|             | 自 2022年1月12日<br>至 2023年1月11日  | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日  |
| 1. 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,648,655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(79,736,900円)及び分配準備積立金(9,184,080円)より分配対象収益は96,569,635円(1万口当たり1,108.64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(20,994,603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(122,887,367円)及び分配準備積立金(14,998,042円)より分配対象収益は158,880,012円(1万口当たり1,281.32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4期   | 第5期                          |
|-----------------|---|------------------------------|
|                 | 自 2022年1月12日<br>至 2023年1月11日  | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左                           |

|                          |  |    |
|--------------------------|--|----|
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。<br>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。   | 同左 |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                   | 第4期<br>2023年1月11日現在  | 第5期<br>2024年1月11日現在 |
|----------------------|--|---------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   | 同左                  |
| 2. 時価の算定方法           | (1)有価証券<br>「（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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |
|----------------------------|---|----|

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第4期<br>2023年1月11日現在       | 第5期<br>2024年1月11日現在       |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
|           | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 32,149,207                | 89,222,009                |
| 合計        | 32,149,207                | 89,222,009                |

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

| 種類                  | 第4期<br>2023年1月11日現在 |           |             |           |
|---------------------|---------------------|-----------|-------------|-----------|
|                     | 契約額等（円）             |           | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|                     |                     | うち<br>1年超 |             |           |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                     |           |             |           |
| 売建                  | 190,727,761         | -         | 187,223,398 | 3,504,363 |
| アメリカ・ドル             | 3,758,032           | -         | 3,530,862   | 227,170   |
| イギリス・ポンド            | 78,584,690          | -         | 76,898,390  | 1,686,300 |
| オーストラリア・ドル          | 28,842,471          | -         | 28,484,782  | 357,689   |
| カナダ・ドル              | 14,586,369          | -         | 13,797,078  | 789,291   |
| ユーロ                 | 64,956,199          | -         | 64,512,286  | 443,913   |
| 買建                  | 60,878,266          | -         | 61,121,256  | 242,990   |
| アメリカ・ドル             | 3,635,942           | -         | 3,530,862   | 105,080   |
| イギリス・ポンド            | 15,996,547          | -         | 16,146,097  | 149,550   |
| オーストラリア・ドル          | 6,750,206           | -         | 6,761,723   | 11,517    |
| カナダ・ドル              | 9,617,381           | -         | 9,479,358   | 138,023   |
| ユーロ                 | 24,878,190          | -         | 25,203,216  | 325,026   |
| 合計                  | 251,606,027         | -         | 248,344,654 | 3,747,353 |

| 種類                        | 第5期<br>2024年1月11日現在 |           |             |           |
|---------------------------|---------------------|-----------|-------------|-----------|
|                           | 契約額等（円）             |           | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|                           |                     | うち<br>1年超 |             |           |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引<br>売建 | 198,380,634         | -         | 199,591,076 | 1,210,442 |

|            |             |   |             |           |
|------------|-------------|---|-------------|-----------|
| アメリカ・ドル    | 19,042,472  | - | 18,973,017  | 69,455    |
| イギリス・ポンド   | 76,803,043  | - | 77,426,553  | 623,510   |
| オーストラリア・ドル | 38,710,906  | - | 39,269,230  | 558,324   |
| カナダ・ドル     | 12,468,757  | - | 12,534,162  | 65,405    |
| ユーロ        | 51,355,456  | - | 51,388,114  | 32,658    |
| 買建         | 52,666,210  | - | 52,864,399  | 198,189   |
| アメリカ・ドル    | 6,134,478   | - | 6,082,952   | 51,526    |
| イギリス・ポンド   | 17,100,701  | - | 17,265,401  | 164,700   |
| オーストラリア・ドル | 5,748,850   | - | 5,778,034   | 29,184    |
| カナダ・ドル     | 12,492,328  | - | 12,534,162  | 41,834    |
| ユーロ        | 11,189,853  | - | 11,203,850  | 13,997    |
| 合計         | 251,046,844 | - | 252,455,475 | 1,012,253 |

## (注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

|                           | 第4期<br>2023年1月11日現在  | 第5期<br>2024年1月11日現在  |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.0111円<br>(10,111円) | 1.0787円<br>(10,787円) |

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

| 種類        | 銘柄                              | 券面総額<br>(円) | 評価額<br>(円)  | 備考 |
|-----------|---------------------------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 国内株式パッシブ・ファンド<br>(最適化法)・マザーファンド | 40,123,918  | 173,868,973 |    |
|           | 国内債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド       | 281,249,865 | 351,365,456 |    |
|           | J-REITインデックスファ<br>ンド・マザーファンド    | 25,369,162  | 59,876,296  |    |

|                              |             |               |  |
|------------------------------|-------------|---------------|--|
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 31,844,529  | 249,250,312   |  |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド      | 24,586,973  | 46,963,577    |  |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 264,218,089 | 311,090,377   |  |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 26,045,312  | 40,128,012    |  |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 35,579,539  | 80,413,316    |  |
| 親投資信託受益証券 合計                 | 729,017,387 | 1,312,956,319 |  |
| 合計                           |             | 1,312,956,319 |  |

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第4期<br>2023年1月11日現在 | 第5期<br>2024年1月11日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 9,538,105           | 22,581,594          |
| 親投資信託受益証券       | 533,480,601         | 799,863,567         |
| 派生商品評価勘定        | 2,715,018           | 299,742             |
| 流動資産合計          | 545,733,724         | 822,744,903         |
| 資産合計            | 545,733,724         | 822,744,903         |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 派生商品評価勘定        | 240,478             | 982,083             |
| 未払解約金           | 30,689              | 2,761,658           |
| 未払受託者報酬         | 81,976              | 123,024             |
| 未払委託者報酬         | 2,187,333           | 3,281,733           |
| その他未払費用         | 9,643               | 14,506              |
| 流動負債合計          | 2,550,119           | 7,163,004           |
| 負債合計            | 2,550,119           | 7,163,004           |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 538,710,567         | 758,584,463         |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 4,473,038           | 56,997,436          |
| (分配準備積立金)       | 11,995,373          | 22,954,931          |
| 元本等合計           | 543,183,605         | 815,581,899         |
| 純資産合計           | 543,183,605         | 815,581,899         |
| 負債純資産合計         | 545,733,724         | 822,744,903         |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

|   | 第4期 |                          | 第5期 |                          |
|---|-----|--------------------------|-----|--------------------------|
|   | 自   | 2022年1月12日<br>2023年1月11日 | 自   | 2023年1月12日<br>2024年1月11日 |
| <b>営業収益</b>                               |     |                          |     |                          |
| 受取利息                                      |     | 92                       |     | 166                      |
| 有価証券売買等損益                                 |     | 33,628,507               |     | 63,682,966               |
| 為替差損益                                     |     | 1,642,186                |     | 12,423,992               |
| 営業収益合計                                    |     | 35,270,601               |     | 51,259,140               |
| <b>営業費用</b>                               |     |                          |     |                          |
| 支払利息                                      |     | 5,058                    |     | 8,520                    |
| 受託者報酬                                     |     | 140,255                  |     | 221,615                  |
| 委託者報酬                                     |     | 3,742,538                |     | 5,911,930                |
| その他費用                                     |     | 16,459                   |     | 417,327                  |
| 営業費用合計                                    |     | 3,904,310                |     | 6,559,392                |
| 営業利益又は営業損失( )                             |     | 39,174,911               |     | 44,699,748               |
| 経常利益又は経常損失( )                             |     | 39,174,911               |     | 44,699,748               |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           |     | 39,174,911               |     | 44,699,748               |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( ) |     | 3,922,256                |     | 2,844,293                |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           |     | 33,217,663               |     | 4,473,038                |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |     | 14,206,018               |     | 12,098,615               |
| 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                   |     | 14,206,018               |     | 12,098,615               |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |     | 7,697,988                |     | 1,429,672                |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |     | 7,697,988                |     | 1,429,672                |
| 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( )                           |     | 4,473,038                |     | 56,997,436               |

## (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5期   |              |
|-----------------------|---|--------------|
|                       | 自 2023年1月12日  | 至 2024年1月11日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |              |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>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。                            |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目        | 第4期          | 第5期          |
|-----------|--------------|--------------|
|           | 2023年1月11日現在 | 2024年1月11日現在 |
| 1. 期首元本額  | 291,077,733円 | 538,710,567円 |
| 期中追加設定元本額 | 327,388,419円 | 324,667,141円 |
| 期中一部解約元本額 | 79,755,585円  | 104,793,245円 |
| 2. 受益権の総数 | 538,710,567口 | 758,584,463口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目          | 第4期   | 第5期   |
|-------------|---|---|
|             | 自 2022年1月12日<br>至 2023年1月11日  | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日  |
| 1. 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,240,788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(46,663,508円)及び分配準備積立金(6,754,585円)より分配対象収益は58,658,881円(1万口当たり1,088.87円)であります。分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,736,464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(72,650,579円)及び分配準備積立金(10,218,467円)より分配対象収益は95,605,510円(1万口当たり1,260.31円)であります。分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目              | 第4期   | 第5期                          |
|-----------------|---|------------------------------|
|                 | 自 2022年1月12日<br>至 2023年1月11日  | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左                           |



|                          |   |    |
|--------------------------|---|----|
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>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。</p> <p>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。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>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。</p>   | 同左 |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                   | 第4期<br>2023年1月11日現在  | 第5期<br>2024年1月11日現在 |
|----------------------|--|---------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>  | 同左                  |
| 2. 時価の算定方法           | <p>(1)有価証券<br/>「（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<br/>「（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<br/>上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 同左                  |

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第4期<br>2023年1月11日現在       | 第5期<br>2024年1月11日現在       |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
|           | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 21,448,856                | 53,860,366                |
| 合計        | 21,448,856                | 53,860,366                |

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

| 種類                  | 第4期<br>2023年1月11日現在 |           |             |           |
|---------------------|---------------------|-----------|-------------|-----------|
|                     | 契約額等（円）             |           | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|                     |                     | うち<br>1年超 |             |           |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                     |           |             |           |
| 売建                  | 116,331,096         | -         | 113,968,568 | 2,362,528 |
| アメリカ・ドル             | 2,425,894           | -         | 2,279,250   | 146,644   |
| イギリス・ポンド            | 47,250,169          | -         | 46,129,414  | 1,120,755 |
| オーストラリア・ドル          | 17,690,570          | -         | 17,427,590  | 262,980   |
| カナダ・ドル              | 9,112,362           | -         | 8,596,188   | 516,174   |
| ユーロ                 | 39,852,101          | -         | 39,536,126  | 315,975   |
| 買建                  | 35,380,323          | -         | 35,492,335  | 112,012   |
| アメリカ・ドル             | 2,347,082           | -         | 2,279,250   | 67,832    |
| イギリス・ポンド            | 8,244,496           | -         | 8,321,573   | 77,077    |
| オーストラリア・ドル          | 3,913,137           | -         | 3,913,244   | 107       |
| カナダ・ドル              | 5,999,123           | -         | 5,907,426   | 91,697    |
| ユーロ                 | 14,876,485          | -         | 15,070,842  | 194,357   |
| 合計                  | 151,711,419         | -         | 149,460,903 | 2,474,540 |

| 種類                  | 第5期<br>2024年1月11日現在 |           |             |         |
|---------------------|---------------------|-----------|-------------|---------|
|                     | 契約額等（円）             |           | 時価（円）       | 評価損益（円） |
|                     |                     | うち<br>1年超 |             |         |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                     |           |             |         |
| 売建                  | 125,553,048         | -         | 126,398,490 | 845,442 |

|            |             |   |             |         |
|------------|-------------|---|-------------|---------|
| アメリカ・ドル    | 11,613,981  | - | 11,572,092  | 41,889  |
| イギリス・ポンド   | 49,278,761  | - | 49,709,582  | 430,821 |
| オーストラリア・ドル | 24,759,100  | - | 25,125,691  | 366,591 |
| カナダ・ドル     | 7,565,313   | - | 7,604,997   | 39,684  |
| ユーロ        | 32,335,893  | - | 32,386,128  | 50,235  |
| 買建         | 36,783,255  | - | 36,946,356  | 163,101 |
| アメリカ・ドル    | 3,724,504   | - | 3,693,221   | 31,283  |
| イギリス・ポンド   | 12,912,401  | - | 13,036,763  | 124,362 |
| オーストラリア・ドル | 4,693,927   | - | 4,717,755   | 23,828  |
| カナダ・ドル     | 7,579,619   | - | 7,604,996   | 25,377  |
| ユーロ        | 7,872,804   | - | 7,893,621   | 20,817  |
| 合計         | 162,336,303 | - | 163,344,846 | 682,341 |

## (注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

|                           | 第4期<br>2023年1月11日現在  | 第5期<br>2024年1月11日現在  |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.0083円<br>(10,083円) | 1.0751円<br>(10,751円) |

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

| 種類        | 銘柄                              | 券面総額<br>(円) | 評価額<br>(円)  | 備考 |
|-----------|---------------------------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 国内株式パッシブ・ファンド<br>(最適化法)・マザーファンド | 24,412,885  | 105,788,354 |    |
|           | 国内債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド       | 171,621,194 | 214,406,357 |    |
|           | J-REITインデックスファ<br>ンド・マザーファンド    | 15,229,494  | 35,944,651  |    |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 19,420,783  | 152,008,410 |  |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド      | 14,995,943  | 28,643,750  |  |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 161,126,288 | 189,710,091 |  |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 15,752,589  | 24,270,013  |  |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 21,721,137  | 49,091,941  |  |
| 親投資信託受益証券 合計                 | 444,280,313 | 799,863,567 |  |
| 合計                           |             | 799,863,567 |  |

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

### (参考)

「投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)」、「投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)」、「投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)」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、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「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1月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

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

|  |                  |
|--|------------------|
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) | 39,280,280円      |
| AMOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)      | 465,443,530円     |
| DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)        | 145,318,158円     |
| DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)        | 92,745,141円      |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)          | 21,136,550円      |
| DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)          | 55,261,491円      |
| DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)          | 29,706,177円      |
| DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)          | 368,250円         |
| DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)            | 7,014,557円       |
| DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)            | 96,147,081円      |
| DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)              | 2,671,243,954円   |
| DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)            | 2,093,866,159円   |
| DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)              | 4,262,166,282円   |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)         | 57,201,783円      |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)        | 129,853,208円     |
| DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)   | 1,579,643,015円   |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)          | 102,060,284円     |
| DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)            | 561,767円         |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)         | 1,550,657,363円   |
| DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)        | 29,788,301円      |
| DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)        | 271,448,835円     |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)         | 474,252,724円     |
| DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)         | 784,664,877円     |
| DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)                | 202,682,917円     |
| DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)                | 58,249,238円      |
| コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)                 | 387,569,601円     |
| 動的パッケージファンド<DC年金>                        | 206,780,526円     |
| コア資産形成ファンド                               | 109,306,062円     |
| たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>                     | 21,833,980,218円  |
| MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]               | 24,275,836,139円  |
| MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]              | 18,503,617,489円  |
| MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]            | 117,422,889円     |
| 計  | 428,394,158,975円 |
| 2. 受益権の総数                                | 428,394,158,975口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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



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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 2024年1月11日現在  |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>(1)有価証券<br/>「（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<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品<br/>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1月11日現在      |             |
|-------|-------------------|-------------|
|       | 当期の損益に含まれた評価差額（円） |             |
| 国債証券  |                   | 184,459,550 |
| 地方債証券 |                   | 187,451,893 |
| 特殊債券  |                   | 55,052,587  |
| 社債券   |                   | 147,605,800 |
| 合計    |                   | 574,569,830 |

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

|           | 2024年1月11日現在 |         |
|-----------|--------------|---------|
| 1口当たり純資産額 |              | 1.2493円 |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

|                         |             |             |  |
|-------------------------|-------------|-------------|--|
| 9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 45,452,000  | 44,931,574  |  |
| 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 51,168,000  | 50,940,302  |  |
| 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 53,028,000  | 53,104,360  |  |
| 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 201,015,000 | 193,748,307 |  |
| 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 68,188,000  | 66,068,716  |  |
| 1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 67,697,000  | 65,681,660  |  |
| 1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 68,085,000  | 65,989,343  |  |
| 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 212,925,000 | 205,255,441 |  |
| 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 212,475,000 | 204,704,789 |  |
| 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 145,020,000 | 139,668,762 |  |
| 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 217,236,000 | 208,700,797 |  |
| 1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 215,403,000 | 207,013,053 |  |
| 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 375,415,000 | 361,821,222 |  |
| 1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 74,797,000  | 72,024,275  |  |
| 1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 77,196,000  | 73,485,188  |  |
| 1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 249,324,000 | 236,030,044 |  |
| 1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 332,308,000 | 315,496,538 |  |
| 1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 255,960,000 | 242,982,828 |  |
| 1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 261,657,000 | 248,503,502 |  |
| 1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 797,535,000 | 756,087,106 |  |
| 6 回 沖縄振興開発金融公庫債券        | 400,000,000 | 411,088,000 |  |
| 2 1 回 沖縄振興開発金融公庫債券      | 100,000,000 | 100,727,000 |  |
| い第843号 利付商工債            | 100,000,000 | 99,872,000  |  |
| い第851号 利付商工債            | 300,000,000 | 298,833,000 |  |
| い第854号 利付商工債            | 300,000,000 | 298,500,000 |  |
| い第855号 利付商工債            | 200,000,000 | 198,976,000 |  |
| 3 6 9 回 利附信金中金債(5年)     | 400,000,000 | 399,420,000 |  |

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

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

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



|        |                   |                |                 |  |
|--------|-------------------|----------------|-----------------|--|
|        | 7 5 回 電源開発社債      | 200,000,000    | 190,932,000     |  |
|        | 4 1 回 東京瓦斯社債      | 200,000,000    | 184,816,000     |  |
|        | 5 2 回 東京瓦斯社債      | 100,000,000    | 87,349,000      |  |
|        | 5 5 回 東京瓦斯社債      | 100,000,000    | 83,940,000      |  |
|        | 5 7 回 東京瓦斯社債      | 300,000,000    | 198,666,000     |  |
|        | 7 回 ファーストリテイリング社債 | 200,000,000    | 199,334,000     |  |
|        | 8 回 ファーストリテイリング社債 | 200,000,000    | 184,612,000     |  |
| 社債券 合計 |                   | 24,520,000,000 | 23,776,995,600  |  |
| 合計     |                   |                | 532,277,360,428 |  |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年1月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                    | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日   |
|-----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式<br>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<br>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<br>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  |

(貸借対照表に関する注記)

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

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

|   |                  |
|---|------------------|
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定) | 115,794,474円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定)  | 390,113,412円     |
| 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)                                   | 288,392,944円     |
| AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)           | 15,058,662円      |
| DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)                             | 23,908,469円      |
| 日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)               | 32,239,836円      |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)                          | 616,887円         |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)                | 3,912,053円       |
| DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)                       | 36,475,117円      |
| DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                       | 69,881,100円      |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)                         | 2,726,404円       |
| DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                         | 11,128,260円      |
| DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)                         | 3,576,905円       |
| DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                         | 83,214円          |
| DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)                           | 1,407,965円       |
| DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                           | 19,298,214円      |
| DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)                             | 301,801,170円     |
| DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)                           | 420,310,830円     |
| DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                             | 1,283,661,090円   |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)                        | 11,479,024円      |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)                       | 15,644,932円      |
| DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)                  | 158,219,192円     |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)                         | 30,740,567円      |
| DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)                           | 56,133円          |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)                        | 175,102,930円     |
| DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)                       | 8,974,818円       |
| DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)                       | 40,798,723円      |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)                        | 107,113,442円     |
| DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)                        | 141,755,804円     |
| DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)                               | 18,506,740円      |
| DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)                               | 7,518,073円       |
| 動的パッケージファンド<DC年金>                                       | 28,430,300円      |
| コア資産形成ファンド  | 15,497,741円      |
| MHAMトピックスファンド   | 790,301,108円     |
| MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)                             | 44,692,487円      |
| MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]                              | 3,260,862,552円   |
| MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]                             | 1,894,014,980円   |
| 計   | 122,361,611,329円 |
| 2. 受益権の総数   | 122,361,611,329口 |

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

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

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年1月11日現在

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年1月11日現在

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 資産の部        |                 |
| 流動資産        |                 |
| 預金          | 1,801,170,263   |
| コール・ローン     | 1,512,136,281   |
| 国債証券        | 241,252,263,833 |
| 派生商品評価勘定    | 29,097,786      |
| 未収利息        | 1,357,588,205   |
| 前払費用        | 645,156,799     |
| 流動資産合計      | 246,597,413,167 |
| 資産合計        | 246,597,413,167 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 7,110,717,670   |
| 未払金         | 3,042,659,985   |
| 未払解約金       | 5,858,000       |
| 流動負債合計      | 10,159,235,655  |
| 負債合計        | 10,159,235,655  |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 200,817,570,221 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 35,620,607,291  |
| 元本等合計       | 236,438,177,512 |
| 純資産合計       | 236,438,177,512 |
| 負債純資産合計     | 246,597,413,167 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                      | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1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1月11日現在     |
|---------------------------------------|------------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 209,096,112,873円 |
| 同期中追加設定元本額                            | 663,458,245,640円 |
| 同期中一部解約元本額                            | 671,736,788,292円 |
| 元本の内訳                                 |                  |
| ファンド名                                 |                  |
| たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>               | 12,755,621,171円  |
| たわらノーロード バランス(堅実型)                    | 1,500,689,421円   |
| たわらノーロード バランス(標準型)                    | 4,337,101,269円   |
| たわらノーロード バランス(積極型)                    | 2,207,977,445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)           | 42,401,500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)           | 1,478,309,721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)         | 1,468,800,487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)           | 152,021,363円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)           | 173,393円         |
| たわらノーロード 最適化バランス(保守型)                 | 2,260,317円       |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型)                 | 15,025,929円      |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)               | 153,451,914円     |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型)                 | 4,796,301円       |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型)                 | 91,804円          |
| 投資のソムリエ                               | 81,347,761,945円  |
| 投資のソムリエ<DC年金>                         | 7,827,029,487円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                   | 7,082,847,538円   |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                    | 23,579,470,866円  |
| ワールドアセットバランス(基本コース)                   | 1,843,203,229円   |
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)                | 4,568,497,830円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)                | 482,502,659円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)                | 243,560,071円     |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)                | 60,529,780円      |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)                | 1,217,635,152円   |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                   | 9,080,229,659円   |

|  |                  |
|--|------------------|
| 9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>                    | 6,430,966,499円   |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）                   | 485,528,953円     |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）                   | 264,218,089円     |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）                   | 161,126,288円     |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）                   | 38,100,439円      |
| Oneグローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>              | 9,938,916円       |
| 外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）        | 21,355,170,992円  |
| 先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）        | 5,889,766,521円   |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）                    | 2,544,262,421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） | 35,299,622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）         | 403,366,467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）        | 30,999,487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）        | 282,963,554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）         | 617,105,675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）         | 816,766,047円     |
| 計  | 200,817,570,221円 |
| 2. 受益権の総数                                | 200,817,570,221口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2024年1月11日現在 |
|----|--------------|
|----|--------------|

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類   | 2024年1月11日現在              |  |
|------|---------------------------|--|
|      | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) |  |
| 国債証券 | 4,412,015,670             |  |
| 合計   | 4,412,015,670             |  |

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年6月23日から2024年1月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

| 種類                  | 2024年1月11日現在    |     |                 |               |         |
|---------------------|-----------------|-----|-----------------|---------------|---------|
|                     | 契約額等(円)         | うち  |                 | 時価(円)         | 評価損益(円) |
|                     |                 | 1年超 |                 |               |         |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                 |     |                 |               |         |
| 売建                  | 239,784,380,306 | -   | 246,891,070,094 | 7,106,689,788 |         |
| アメリカ・ドル             | 112,154,091,759 | -   | 115,948,939,313 | 3,794,847,554 |         |
| イギリス・ポンド            | 12,775,540,069  | -   | 13,208,201,389  | 432,661,320   |         |
| イスラエル・シケル           | 764,139,320     | -   | 760,119,360     | 4,019,960     |         |
| オーストラリア・ドル          | 3,393,838,311   | -   | 3,448,995,940   | 55,157,629    |         |
| オフショア・人民元           | 20,104,000,762  | -   | 20,564,582,226  | 460,581,464   |         |
| カナダ・ドル              | 4,902,657,835   | -   | 4,997,024,793   | 94,366,958    |         |
| シンガポール・ドル           | 1,003,491,052   | -   | 1,028,025,940   | 24,534,888    |         |
| スウェーデン・クローナ         | 499,298,562     | -   | 508,719,222     | 9,420,660     |         |
| デンマーク・クローネ          | 657,857,879     | -   | 675,123,454     | 17,265,575    |         |
| ニュージーランド・ドル         | 588,630,649     | -   | 599,580,776     | 10,950,127    |         |
| ノルウェー・クローネ          | 429,155,650     | -   | 435,348,529     | 6,192,879     |         |
| ポーランド・ズロチ           | 1,250,336,657   | -   | 1,287,581,637   | 37,244,980    |         |
| マレーシア・リンギット         | 1,229,900,230   | -   | 1,247,673,804   | 17,773,574    |         |
| メキシコ・ペソ             | 2,052,019,307   | -   | 2,118,554,184   | 66,534,877    |         |

|            |                 |   |                 |               |
|------------|-----------------|---|-----------------|---------------|
| ユーロ        | 77,979,422,264  | - | 80,062,599,527  | 2,083,177,263 |
| 買建         | 2,636,415,988   | - | 2,661,485,892   | 25,069,904    |
| アメリカ・ドル    | 1,413,405,892   | - | 1,425,503,467   | 12,097,575    |
| イギリス・ポンド   | 122,707,887     | - | 124,380,006     | 1,672,119     |
| オーストラリア・ドル | 36,423,823      | - | 36,420,055      | 3,768         |
| オフショア・人民元  | 94,932,337      | - | 95,797,485      | 865,148       |
| カナダ・ドル     | 43,768,870      | - | 44,203,047      | 434,177       |
| ユーロ        | 925,177,179     | - | 935,181,832     | 10,004,653    |
| 合計         | 242,420,796,294 | - | 249,552,555,986 | 7,081,619,884 |

(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1月11日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.1774円      |
| (1万口当たり純資産額) | (11,774円)    |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

| 種類   | 通貨      | 銘柄                      | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|------|---------|-------------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | US T N/B 0.25 05/31/25  | 3,500,000.000 | 3,297,109.370 |    |
|      |         | US T N/B 0.25 06/30/25  | 3,000,000.000 | 2,817,890.640 |    |
|      |         | US T N/B 0.25 07/31/25  | 3,000,000.000 | 2,809,335.930 |    |
|      |         | US T N/B 0.25 08/31/25  | 2,000,000.000 | 1,867,421.880 |    |
|      |         | US T N/B 0.25 09/30/25  | 3,300,000.000 | 3,072,673.820 |    |
|      |         | US T N/B 0.25 10/31/25  | 4,500,000.000 | 4,177,792.980 |    |
|      |         | US T N/B 0.375 01/31/26 | 2,500,000.000 | 2,307,324.220 |    |
|      |         | US T N/B 0.375 04/30/25 | 3,970,000.000 | 3,757,698.050 |    |
|      |         | US T N/B 0.375 07/31/27 | 2,100,000.000 | 1,846,400.380 |    |
|      |         | US T N/B 0.375 09/30/27 | 4,200,000.000 | 3,671,964.820 |    |



|                         |               |               |  |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| US T N/B 0.375 11/30/25 | 4,500,000.000 | 4,176,298.840 |  |
| US T N/B 0.375 12/31/25 | 4,400,000.000 | 4,073,781.270 |  |
| US T N/B 0.5 02/28/26   | 3,900,000.000 | 3,600,263.660 |  |
| US T N/B 0.5 03/31/25   | 2,500,000.000 | 2,377,929.700 |  |
| US T N/B 0.5 04/30/27   | 2,200,000.000 | 1,958,859.360 |  |
| US T N/B 0.5 05/31/27   | 1,600,000.000 | 1,420,437.500 |  |
| US T N/B 0.5 06/30/27   | 3,500,000.000 | 3,099,414.080 |  |
| US T N/B 0.5 08/31/27   | 3,400,000.000 | 2,995,054.690 |  |
| US T N/B 0.5 10/31/27   | 4,600,000.000 | 4,030,480.480 |  |
| US T N/B 0.625 03/31/27 | 1,200,000.000 | 1,075,687.500 |  |
| US T N/B 0.625 05/15/30 | 5,990,000.000 | 4,861,844.350 |  |
| US T N/B 0.625 07/31/26 | 3,800,000.000 | 3,474,773.420 |  |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | 8,090,000.000 | 6,512,291.980 |  |
| US T N/B 0.625 11/30/27 | 4,000,000.000 | 3,512,734.350 |  |
| US T N/B 0.625 12/31/27 | 4,660,000.000 | 4,082,505.860 |  |
| US T N/B 0.75 01/31/28  | 5,070,000.000 | 4,452,786.920 |  |
| US T N/B 0.75 03/31/26  | 3,140,000.000 | 2,909,712.900 |  |
| US T N/B 0.75 04/30/26  | 6,062,000.000 | 5,601,430.080 |  |
| US T N/B 0.75 05/31/26  | 3,800,000.000 | 3,502,531.250 |  |
| US T N/B 0.75 08/31/26  | 6,200,000.000 | 5,674,453.150 |  |
| US T N/B 0.875 06/30/26 | 5,216,000.000 | 4,815,529.380 |  |
| US T N/B 0.875 09/30/26 | 3,680,000.000 | 3,374,603.120 |  |
| US T N/B 0.875 11/15/30 | 9,990,000.000 | 8,146,532.810 |  |
| US T N/B 1.0 07/31/28   | 5,070,000.000 | 4,440,309.950 |  |
| US T N/B 1.125 02/15/31 | 6,300,000.000 | 5,212,511.690 |  |
| US T N/B 1.125 02/28/25 | 4,820,000.000 | 4,630,212.500 |  |
| US T N/B 1.125 02/28/27 | 1,000,000.000 | 913,710.940   |  |
| US T N/B 1.125 02/29/28 | 5,420,000.000 | 4,826,234.760 |  |
| US T N/B 1.125 05/15/40 | 1,500,000.000 | 945,527.340   |  |
| US T N/B 1.125 08/15/40 | 4,760,000.000 | 2,970,072.630 |  |
| US T N/B 1.125 08/31/28 | 3,770,000.000 | 3,313,402.920 |  |
| US T N/B 1.125 10/31/26 | 5,300,000.000 | 4,880,451.140 |  |
| US T N/B 1.25 03/31/28  | 4,800,000.000 | 4,287,468.760 |  |
| US T N/B 1.25 04/30/28  | 4,200,000.000 | 3,743,578.090 |  |
| US T N/B 1.25 05/15/50  | 4,600,000.000 | 2,393,976.560 |  |
| US T N/B 1.25 05/31/28  | 4,640,000.000 | 4,127,243.750 |  |
| US T N/B 1.25 06/30/28  | 4,870,000.000 | 4,323,932.200 |  |
| US T N/B 1.25 08/15/31  | 7,000,000.000 | 5,740,546.830 |  |
| US T N/B 1.25 09/30/28  | 5,200,000.000 | 4,587,882.830 |  |
| US T N/B 1.25 11/30/26  | 2,500,000.000 | 2,306,103.520 |  |
| US T N/B 1.25 12/31/26  | 3,000,000.000 | 2,763,281.250 |  |
| US T N/B 1.375 08/15/50 | 3,500,000.000 | 1,883,369.140 |  |
| US T N/B 1.375 08/31/26 | 1,250,000.000 | 1,163,281.250 |  |
| US T N/B 1.375 10/31/28 | 4,600,000.000 | 4,075,402.330 |  |
| US T N/B 1.375 11/15/31 | 9,800,000.000 | 8,063,179.710 |  |
| US T N/B 1.375 11/15/40 | 4,330,000.000 | 2,808,833.800 |  |
| US T N/B 1.375 12/31/28 | 4,900,000.000 | 4,325,111.320 |  |
| US T N/B 1.5 01/31/27   | 6,090,000.000 | 5,638,245.660 |  |
| US T N/B 1.5 02/15/30   | 5,100,000.000 | 4,411,998.060 |  |

|                         |               |               |  |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| US T N/B 1.5 08/15/26   | 5,900,000.000 | 5,512,582.030 |  |
| US T N/B 1.5 11/30/28   | 2,840,000.000 | 2,526,878.890 |  |
| US T N/B 1.625 02/15/26 | 3,300,000.000 | 3,123,076.170 |  |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | 4,922,000.000 | 4,637,639.110 |  |
| US T N/B 1.625 05/15/31 | 8,800,000.000 | 7,479,484.400 |  |
| US T N/B 1.625 08/15/29 | 3,800,000.000 | 3,359,882.820 |  |
| US T N/B 1.625 09/30/26 | 800,000.000   | 748,656.240   |  |
| US T N/B 1.625 10/31/26 | 3,000,000.000 | 2,801,835.930 |  |
| US T N/B 1.625 11/15/50 | 5,200,000.000 | 2,994,062.490 |  |
| US T N/B 1.625 11/30/26 | 2,100,000.000 | 1,958,085.940 |  |
| US T N/B 1.75 01/31/29  | 3,600,000.000 | 3,230,789.070 |  |
| US T N/B 1.75 08/15/41  | 4,400,000.000 | 2,993,031.270 |  |
| US T N/B 1.75 11/15/29  | 3,500,000.000 | 3,102,832.040 |  |
| US T N/B 1.875 02/15/32 | 8,500,000.000 | 7,240,439.470 |  |
| US T N/B 1.875 02/15/41 | 5,300,000.000 | 3,729,253.880 |  |
| US T N/B 1.875 02/15/51 | 4,950,000.000 | 3,039,802.720 |  |
| US T N/B 1.875 02/28/27 | 4,800,000.000 | 4,487,718.760 |  |
| US T N/B 1.875 02/28/29 | 2,600,000.000 | 2,344,875.000 |  |
| US T N/B 1.875 06/30/26 | 1,000,000.000 | 946,503.910   |  |
| US T N/B 1.875 07/31/26 | 1,000,000.000 | 944,296.880   |  |
| US T N/B 1.875 11/15/51 | 5,700,000.000 | 3,487,464.850 |  |
| US T N/B 2.0 02/15/50   | 2,800,000.000 | 1,784,945.310 |  |
| US T N/B 2.0 08/15/25   | 3,800,000.000 | 3,655,199.210 |  |
| US T N/B 2.0 08/15/51   | 4,900,000.000 | 3,098,484.370 |  |
| US T N/B 2.0 11/15/26   | 2,700,000.000 | 2,546,226.570 |  |
| US T N/B 2.0 11/15/41   | 5,500,000.000 | 3,894,687.500 |  |
| US T N/B 2.125 05/15/25 | 3,600,000.000 | 3,484,054.690 |  |
| US T N/B 2.125 05/31/26 | 4,700,000.000 | 4,479,320.330 |  |
| US T N/B 2.25 02/15/27  | 3,200,000.000 | 3,029,187.480 |  |
| US T N/B 2.25 02/15/52  | 5,020,000.000 | 3,370,949.620 |  |
| US T N/B 2.25 03/31/26  | 1,000,000.000 | 957,812.500   |  |
| US T N/B 2.25 05/15/41  | 4,900,000.000 | 3,655,093.750 |  |
| US T N/B 2.25 08/15/27  | 4,100,000.000 | 3,853,119.150 |  |
| US T N/B 2.25 08/15/46  | 2,300,000.000 | 1,594,097.660 |  |
| US T N/B 2.25 08/15/49  | 3,440,000.000 | 2,332,615.630 |  |
| US T N/B 2.25 11/15/25  | 5,500,000.000 | 5,291,386.700 |  |
| US T N/B 2.25 11/15/27  | 2,840,000.000 | 2,660,114.850 |  |
| US T N/B 2.375 02/15/42 | 4,100,000.000 | 3,080,445.290 |  |
| US T N/B 2.375 03/31/29 | 2,300,000.000 | 2,123,771.490 |  |
| US T N/B 2.375 04/30/26 | 3,002,000.000 | 2,879,809.230 |  |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | 5,100,000.000 | 4,829,660.160 |  |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 3,520,000.000 | 3,244,037.480 |  |
| US T N/B 2.375 05/15/51 | 5,800,000.000 | 4,012,308.570 |  |
| US T N/B 2.375 11/15/49 | 4,600,000.000 | 3,204,457.010 |  |
| US T N/B 2.5 02/15/45   | 2,110,000.000 | 1,562,430.270 |  |
| US T N/B 2.5 02/15/46   | 2,000,000.000 | 1,464,414.050 |  |
| US T N/B 2.5 02/28/26   | 2,420,000.000 | 2,331,896.870 |  |
| US T N/B 2.5 03/31/27   | 3,300,000.000 | 3,144,152.350 |  |
| US T N/B 2.5 05/15/46   | 1,300,000.000 | 949,431.630   |  |

|                         |               |               |  |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| US T N/B 2.625 01/31/26 | 2,280,000.000 | 2,204,608.580 |  |
| US T N/B 2.625 02/15/29 | 5,000,000.000 | 4,681,445.290 |  |
| US T N/B 2.625 03/31/25 | 200,000.000   | 195,234.370   |  |
| US T N/B 2.625 04/15/25 | 3,900,000.000 | 3,803,185.540 |  |
| US T N/B 2.625 05/31/27 | 5,100,000.000 | 4,866,416.020 |  |
| US T N/B 2.625 07/31/29 | 3,900,000.000 | 3,630,732.410 |  |
| US T N/B 2.625 12/31/25 | 1,400,000.000 | 1,355,101.560 |  |
| US T N/B 2.75 02/15/28  | 3,900,000.000 | 3,711,322.240 |  |
| US T N/B 2.75 02/28/25  | 3,010,000.000 | 2,944,979.300 |  |
| US T N/B 2.75 04/30/27  | 4,740,000.000 | 4,545,030.470 |  |
| US T N/B 2.75 05/15/25  | 5,500,000.000 | 5,366,367.160 |  |
| US T N/B 2.75 05/31/29  | 3,900,000.000 | 3,662,267.570 |  |
| US T N/B 2.75 06/30/25  | 4,000,000.000 | 3,900,078.120 |  |
| US T N/B 2.75 07/31/27  | 3,150,000.000 | 3,012,864.240 |  |
| US T N/B 2.75 08/15/32  | 5,580,000.000 | 5,058,618.750 |  |
| US T N/B 2.75 08/15/42  | 480,000.000   | 381,534.370   |  |
| US T N/B 2.75 08/15/47  | 1,500,000.000 | 1,138,300.780 |  |
| US T N/B 2.75 08/31/25  | 3,000,000.000 | 2,917,968.750 |  |
| US T N/B 2.75 11/15/42  | 1,130,000.000 | 895,525.000   |  |
| US T N/B 2.75 11/15/47  | 1,900,000.000 | 1,440,623.040 |  |
| US T N/B 2.875 04/30/25 | 3,920,000.000 | 3,832,795.320 |  |
| US T N/B 2.875 04/30/29 | 3,200,000.000 | 3,027,062.480 |  |
| US T N/B 2.875 05/15/28 | 2,340,000.000 | 2,233,237.500 |  |
| US T N/B 2.875 05/15/32 | 8,900,000.000 | 8,168,531.250 |  |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 1,790,000.000 | 1,440,740.220 |  |
| US T N/B 2.875 05/15/49 | 3,300,000.000 | 2,551,183.590 |  |
| US T N/B 2.875 05/15/52 | 3,900,000.000 | 3,012,292.950 |  |
| US T N/B 2.875 05/31/25 | 2,300,000.000 | 2,246,453.120 |  |
| US T N/B 2.875 06/15/25 | 2,000,000.000 | 1,953,476.560 |  |
| US T N/B 2.875 07/31/25 | 3,270,000.000 | 3,189,846.670 |  |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 4,400,000.000 | 4,190,484.360 |  |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 2,000,000.000 | 1,577,031.240 |  |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 1,000,000.000 | 781,132.810   |  |
| US T N/B 2.875 11/30/25 | 2,640,000.000 | 2,568,276.550 |  |
| US T N/B 3.0 02/15/47   | 2,590,000.000 | 2,065,221.470 |  |
| US T N/B 3.0 02/15/48   | 3,100,000.000 | 2,460,927.740 |  |
| US T N/B 3.0 02/15/49   | 6,500,000.000 | 5,148,203.120 |  |
| US T N/B 3.0 05/15/42   | 1,000,000.000 | 829,824.220   |  |
| US T N/B 3.0 05/15/45   | 2,600,000.000 | 2,099,144.520 |  |
| US T N/B 3.0 05/15/47   | 1,300,000.000 | 1,035,328.120 |  |
| US T N/B 3.0 07/15/25   | 3,000,000.000 | 2,933,789.070 |  |
| US T N/B 3.0 08/15/48   | 3,410,000.000 | 2,703,890.240 |  |
| US T N/B 3.0 08/15/52   | 4,140,000.000 | 3,284,507.830 |  |
| US T N/B 3.0 09/30/25   | 2,000,000.000 | 1,952,109.380 |  |
| US T N/B 3.0 10/31/25   | 2,000,000.000 | 1,950,976.560 |  |
| US T N/B 3.0 11/15/44   | 1,500,000.000 | 1,215,908.200 |  |
| US T N/B 3.0 11/15/45   | 870,000.000   | 699,891.210   |  |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 500,000.000   | 424,794.920   |  |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 1,260,000.000 | 1,056,332.810 |  |

|                         |               |               |  |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| US T N/B 3.125 05/15/48 | 2,520,000.000 | 2,045,678.890 |  |
| US T N/B 3.125 08/15/25 | 3,000,000.000 | 2,937,480.480 |  |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 2,500,000.000 | 2,074,072.270 |  |
| US T N/B 3.125 08/31/27 | 4,100,000.000 | 3,969,632.790 |  |
| US T N/B 3.125 08/31/29 | 2,500,000.000 | 2,386,914.050 |  |
| US T N/B 3.125 11/15/28 | 4,900,000.000 | 4,709,455.070 |  |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 580,000.000   | 494,098.820   |  |
| US T N/B 3.25 05/15/42  | 2,650,000.000 | 2,278,534.180 |  |
| US T N/B 3.25 06/30/27  | 3,890,000.000 | 3,788,267.390 |  |
| US T N/B 3.25 06/30/29  | 2,500,000.000 | 2,406,152.350 |  |
| US T N/B 3.375 05/15/33 | 6,000,000.000 | 5,690,625.000 |  |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | 1,400,000.000 | 1,209,988.270 |  |
| US T N/B 3.375 08/15/42 | 2,300,000.000 | 2,010,927.730 |  |
| US T N/B 3.375 11/15/48 | 3,450,000.000 | 2,928,052.740 |  |
| US T N/B 3.5 01/31/28   | 2,900,000.000 | 2,842,000.000 |  |
| US T N/B 3.5 01/31/30   | 2,300,000.000 | 2,234,324.200 |  |
| US T N/B 3.5 02/15/33   | 6,500,000.000 | 6,232,890.620 |  |
| US T N/B 3.5 02/15/39   | 1,640,000.000 | 1,522,701.550 |  |
| US T N/B 3.5 04/30/28   | 3,300,000.000 | 3,232,582.020 |  |
| US T N/B 3.5 04/30/30   | 2,500,000.000 | 2,426,416.020 |  |
| US T N/B 3.5 09/15/25   | 2,500,000.000 | 2,460,742.200 |  |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 1,700,000.000 | 1,528,240.220 |  |
| US T N/B 3.625 02/15/53 | 4,700,000.000 | 4,216,414.080 |  |
| US T N/B 3.625 03/31/28 | 3,500,000.000 | 3,446,064.440 |  |
| US T N/B 3.625 03/31/30 | 2,500,000.000 | 2,443,652.350 |  |
| US T N/B 3.625 05/15/26 | 4,800,000.000 | 4,734,750.000 |  |
| US T N/B 3.625 05/15/53 | 3,950,000.000 | 3,547,285.170 |  |
| US T N/B 3.625 05/31/28 | 3,150,000.000 | 3,101,704.090 |  |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 800,000.000   | 721,531.240   |  |
| US T N/B 3.75 04/15/26  | 2,600,000.000 | 2,571,511.720 |  |
| US T N/B 3.75 05/31/30  | 3,000,000.000 | 2,952,070.320 |  |
| US T N/B 3.75 06/30/30  | 1,500,000.000 | 1,475,976.570 |  |
| US T N/B 3.75 08/15/41  | 1,000,000.000 | 933,144.530   |  |
| US T N/B 3.75 11/15/43  | 1,500,000.000 | 1,375,224.610 |  |
| US T N/B 3.875 01/15/26 | 2,600,000.000 | 2,577,046.880 |  |
| US T N/B 3.875 02/15/43 | 3,500,000.000 | 3,275,234.370 |  |
| US T N/B 3.875 03/31/25 | 2,000,000.000 | 1,981,054.680 |  |
| US T N/B 3.875 04/30/25 | 3,900,000.000 | 3,861,761.700 |  |
| US T N/B 3.875 05/15/43 | 3,200,000.000 | 2,992,499.990 |  |
| US T N/B 3.875 08/15/33 | 6,800,000.000 | 6,709,687.490 |  |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 700,000.000   | 669,115.230   |  |
| US T N/B 3.875 09/30/29 | 3,000,000.000 | 2,975,859.350 |  |
| US T N/B 3.875 11/30/27 | 2,100,000.000 | 2,086,464.840 |  |
| US T N/B 3.875 11/30/29 | 2,500,000.000 | 2,479,199.220 |  |
| US T N/B 3.875 12/31/27 | 2,600,000.000 | 2,584,664.050 |  |
| US T N/B 3.875 12/31/29 | 2,700,000.000 | 2,677,376.940 |  |
| US T N/B 4.0 02/15/26   | 2,800,000.000 | 2,782,281.260 |  |
| US T N/B 4.0 02/28/30   | 3,500,000.000 | 3,493,164.080 |  |
| US T N/B 4.0 02/29/28   | 3,700,000.000 | 3,695,519.520 |  |

|                         |               |               |  |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| US T N/B 4.0 06/30/28   | 2,600,000.000 | 2,599,238.270 |  |
| US T N/B 4.0 07/31/30   | 1,500,000.000 | 1,497,187.500 |  |
| US T N/B 4.0 10/31/29   | 2,200,000.000 | 2,196,218.750 |  |
| US T N/B 4.0 11/15/42   | 4,000,000.000 | 3,817,421.880 |  |
| US T N/B 4.0 11/15/52   | 3,770,000.000 | 3,616,843.750 |  |
| US T N/B 4.0 12/15/25   | 3,900,000.000 | 3,873,339.830 |  |
| US T N/B 4.125 06/15/26 | 1,500,000.000 | 1,496,572.260 |  |
| US T N/B 4.125 07/31/28 | 2,500,000.000 | 2,512,646.470 |  |
| US T N/B 4.125 08/15/53 | 5,000,000.000 | 4,911,718.750 |  |
| US T N/B 4.125 08/31/30 | 3,000,000.000 | 3,015,000.000 |  |
| US T N/B 4.125 09/30/27 | 3,000,000.000 | 3,006,972.660 |  |
| US T N/B 4.125 10/31/27 | 4,000,000.000 | 4,008,593.760 |  |
| US T N/B 4.125 11/15/32 | 8,300,000.000 | 8,348,308.560 |  |
| US T N/B 4.25 05/15/39  | 850,000.000   | 858,533.190   |  |
| US T N/B 4.25 05/31/25  | 3,500,000.000 | 3,483,251.940 |  |
| US T N/B 4.25 10/15/25  | 4,070,000.000 | 4,056,963.300 |  |
| US T N/B 4.25 11/15/40  | 800,000.000   | 799,578.120   |  |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 600,000.000   | 619,113.270   |  |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | 800,000.000   | 814,546.870   |  |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 870,000.000   | 879,974.410   |  |
| US T N/B 4.375 08/15/26 | 4,200,000.000 | 4,217,800.770 |  |
| US T N/B 4.375 08/15/43 | 3,700,000.000 | 3,704,914.040 |  |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 700,000.000   | 714,970.700   |  |
| US T N/B 4.375 11/30/28 | 4,800,000.000 | 4,883,250.000 |  |
| US T N/B 4.375 12/15/26 | 2,500,000.000 | 2,516,796.870 |  |
| US T N/B 4.5 02/15/36   | 750,000.000   | 788,056.620   |  |
| US T N/B 4.5 05/15/38   | 600,000.000   | 625,992.180   |  |
| US T N/B 4.5 07/15/26   | 3,900,000.000 | 3,926,431.620 |  |
| US T N/B 4.5 08/15/39   | 1,030,000.000 | 1,068,806.050 |  |
| US T N/B 4.5 11/15/25   | 4,200,000.000 | 4,207,464.820 |  |
| US T N/B 4.5 11/15/33   | 6,500,000.000 | 6,740,195.280 |  |
| US T N/B 4.625 02/15/40 | 1,000,000.000 | 1,050,000.000 |  |
| US T N/B 4.625 02/28/25 | 6,300,000.000 | 6,292,494.110 |  |
| US T N/B 4.625 03/15/26 | 4,732,000.000 | 4,763,700.700 |  |
| US T N/B 4.625 06/30/25 | 3,000,000.000 | 3,003,281.250 |  |
| US T N/B 4.625 09/15/26 | 4,000,000.000 | 4,044,843.760 |  |
| US T N/B 4.625 09/30/30 | 3,500,000.000 | 3,621,132.830 |  |
| US T N/B 4.625 10/15/26 | 5,000,000.000 | 5,058,984.400 |  |
| US T N/B 4.625 11/15/26 | 1,300,000.000 | 1,316,402.340 |  |
| US T N/B 4.75 02/15/41  | 1,020,000.000 | 1,082,016.790 |  |
| US T N/B 4.75 07/31/25  | 2,900,000.000 | 2,909,855.470 |  |
| US T N/B 4.875 10/31/28 | 4,500,000.000 | 4,670,859.370 |  |
| US T N/B 5.0 09/30/25   | 2,500,000.000 | 2,521,875.000 |  |
| US T N/B 5.0 10/31/25   | 8,000,000.000 | 8,077,500.000 |  |
| US T N/B 5.25 11/15/28  | 800,000.000   | 843,781.240   |  |
| US T N/B 5.375 02/15/31 | 500,000.000   | 544,023.440   |  |
| US T N/B 6.0 02/15/26   | 1,810,000.000 | 1,869,107.800 |  |
| US T N/B 6.125 11/15/27 | 1,000,000.000 | 1,073,750.000 |  |
| US T N/B 6.25 05/15/30  | 1,000,000.000 | 1,122,968.750 |  |

|                               |                               |                                      |                                      |  |
|-------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--|
| アメリカ・ドル                       | 小計                            | 868,784,000.000<br>(126,538,389,600) | 783,123,632.170<br>(114,061,957,028) |  |
| イギリス・ポンド                      | UK TREASURY 0.125<br>01/30/26 | 1,010,000.000                        | 935,985.180                          |  |
|                               | UK TREASURY 0.125<br>01/31/28 | 1,280,000.000                        | 1,110,734.590                        |  |
|                               | UK TREASURY 0.25<br>07/31/31  | 2,000,000.000                        | 1,549,615.200                        |  |
|                               | UK TREASURY 0.375<br>10/22/26 | 2,750,000.000                        | 2,502,230.500                        |  |
|                               | UK TREASURY 0.375<br>10/22/30 | 1,800,000.000                        | 1,449,014.400                        |  |
|                               | UK TREASURY 0.5 01/31/29      | 1,550,000.000                        | 1,326,025.000                        |  |
|                               | UK TREASURY 0.5 10/22/61      | 1,480,000.000                        | 459,658.990                          |  |
|                               | UK TREASURY 0.625<br>06/07/25 | 1,400,000.000                        | 1,331,470.000                        |  |
|                               | UK TREASURY 0.625<br>07/31/35 | 1,250,000.000                        | 866,625.000                          |  |
|                               | UK TREASURY 0.625<br>10/22/50 | 1,000,000.000                        | 415,762.000                          |  |
|                               | UK TREASURY 0.875<br>01/31/46 | 1,810,000.000                        | 923,302.350                          |  |
|                               | UK TREASURY 0.875<br>07/31/33 | 2,200,000.000                        | 1,684,154.560                        |  |
|                               | UK TREASURY 0.875<br>10/22/29 | 1,050,000.000                        | 900,875.220                          |  |
|                               | UK TREASURY 1.0 01/31/32      | 2,900,000.000                        | 2,352,561.200                        |  |
|                               | UK TREASURY 1.125<br>01/31/39 | 1,600,000.000                        | 1,054,387.200                        |  |
|                               | UK TREASURY 1.125<br>10/22/73 | 570,000.000                          | 218,587.020                          |  |
|                               | UK TREASURY 1.25<br>07/22/27  | 1,210,000.000                        | 1,112,232.000                        |  |
|                               | UK TREASURY 1.25<br>07/31/51  | 1,680,000.000                        | 847,728.000                          |  |
|                               | UK TREASURY 1.25<br>10/22/41  | 2,030,000.000                        | 1,270,577.000                        |  |
|                               | UK TREASURY 1.5 07/22/26      | 2,190,000.000                        | 2,070,907.800                        |  |
|                               | UK TREASURY 1.5 07/22/47      | 1,700,000.000                        | 985,488.640                          |  |
|                               | UK TREASURY 1.5 07/31/53      | 890,000.000                          | 469,564.000                          |  |
|                               | UK TREASURY 1.625<br>10/22/28 | 1,020,000.000                        | 931,739.400                          |  |
| UK TREASURY 1.625<br>10/22/54 | 1,000,000.000                 | 540,300.000                          |                                      |  |
| UK TREASURY 1.625<br>10/22/71 | 750,000.000                   | 361,257.300                          |                                      |  |
| UK TREASURY 1.75<br>01/22/49  | 760,000.000                   | 458,736.000                          |                                      |  |
| UK TREASURY 1.75<br>07/22/57  | 1,300,000.000                 | 714,308.400                          |                                      |  |

|                               |                                    |                                    |  |
|-------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--|
| UK TREASURY 1.75<br>09/07/37  | 1,900,000.000                      | 1,435,260.000                      |  |
| UK TREASURY 2.0 09/07/25      | 1,470,000.000                      | 1,420,648.420                      |  |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65      | 900,000.000                        | 592,915.680                        |  |
| UK TREASURY 3.25<br>01/22/44  | 1,300,000.000                      | 1,106,690.000                      |  |
| UK TREASURY 3.25<br>01/31/33  | 2,060,000.000                      | 1,973,789.000                      |  |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45      | 1,220,000.000                      | 1,072,990.000                      |  |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68      | 1,770,000.000                      | 1,503,261.000                      |  |
| UK TREASURY 3.5 10/22/25      | 3,750,000.000                      | 3,705,484.500                      |  |
| UK TREASURY 3.75<br>01/29/38  | 1,250,000.000                      | 1,196,370.000                      |  |
| UK TREASURY 3.75<br>07/22/52  | 1,270,000.000                      | 1,140,460.000                      |  |
| UK TREASURY 3.75<br>10/22/53  | 1,900,000.000                      | 1,697,270.000                      |  |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60      | 1,040,000.000                      | 978,224.000                        |  |
| UK TREASURY 4.0 10/22/63      | 1,250,000.000                      | 1,173,500.000                      |  |
| UK TREASURY 4.125<br>01/29/27 | 2,600,000.000                      | 2,620,124.000                      |  |
| UK TREASURY 4.25<br>03/07/36  | 1,150,000.000                      | 1,179,336.500                      |  |
| UK TREASURY 4.25<br>06/07/32  | 1,800,000.000                      | 1,869,210.000                      |  |
| UK TREASURY 4.25<br>09/07/39  | 1,270,000.000                      | 1,274,130.040                      |  |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/27  | 1,050,000.000                      | 1,070,372.520                      |  |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/40  | 1,000,000.000                      | 998,000.000                        |  |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/46  | 1,090,000.000                      | 1,067,655.000                      |  |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/49  | 550,000.000                        | 537,437.010                        |  |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/55  | 1,130,000.000                      | 1,105,280.790                      |  |
| UK TREASURY 4.5 06/07/28      | 1,300,000.000                      | 1,340,492.660                      |  |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34      | 1,000,000.000                      | 1,051,800.000                      |  |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42      | 1,820,000.000                      | 1,862,406.000                      |  |
| UK TREASURY 4.625<br>01/31/34 | 700,000.000                        | 743,175.720                        |  |
| UK TREASURY 4.75<br>12/07/30  | 1,800,000.000                      | 1,919,115.000                      |  |
| UK TREASURY 4.75<br>12/07/38  | 1,310,000.000                      | 1,393,054.000                      |  |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28      | 800,000.000                        | 882,947.360                        |  |
| イギリス・ポンド 小計                   | 81,630,000.000<br>(15,156,242,100) | 68,755,226.150<br>(12,765,782,839) |  |

|                          |                                    |                                 |                                 |  |
|--------------------------|------------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--|
| イスラエル・<br>シュケル           | ISRAEL FIXED BOND 0.5<br>02/27/26  | 2,100,000.000                   | 1,961,114.400                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 0.5<br>04/30/25  | 1,830,000.000                   | 1,754,858.370                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND<br>02/28/29      | 500,000.000                     | 498,226.500                     |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 1.0<br>03/31/30  | 3,310,000.000                   | 2,781,846.470                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 1.3<br>04/30/32  | 1,380,000.000                   | 1,111,102.860                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 1.5<br>05/31/37  | 1,785,000.000                   | 1,263,747.870                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 1.75<br>08/31/25 | 1,730,000.000                   | 1,674,994.650                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND<br>11/29/52      | 850,000.000                     | 597,389.350                     |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 2.0<br>03/31/27  | 1,700,000.000                   | 1,611,436.800                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 2.25<br>09/28/28 | 1,440,000.000                   | 1,345,402.080                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 3.75<br>03/31/47 | 1,650,000.000                   | 1,448,574.600                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 5.5<br>01/31/42  | 1,675,000.000                   | 1,878,752.020                   |  |
|                          | ISRAEL FIXED BOND 6.25<br>10/30/26 | 930,000.000                     | 991,035.900                     |  |
|                          | イスラエル・シュケル 小計                      | 20,880,000.000<br>(812,511,792) | 18,918,481.870<br>(736,182,452) |  |
| オーストラリ<br>ア・ドル           | AUSTRALIAN 0.25 11/21/25           | 1,600,000.000                   | 1,497,338.410                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 0.5 09/21/26            | 2,320,000.000                   | 2,128,655.700                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 1.0 11/21/31            | 2,770,000.000                   | 2,210,320.460                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 1.0 12/21/30            | 1,210,000.000                   | 994,916.350                     |  |
|                          | AUSTRALIAN 1.25 05/21/32           | 2,350,000.000                   | 1,886,392.090                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 1.5 06/21/31            | 1,870,000.000                   | 1,572,569.780                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 1.75 06/21/51           | 1,350,000.000                   | 770,010.020                     |  |
|                          | AUSTRALIAN 1.75 11/21/32           | 1,800,000.000                   | 1,489,582.760                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 2.25 05/21/28           | 800,000.000                     | 751,815.300                     |  |
|                          | AUSTRALIAN 2.5 05/21/30            | 2,140,000.000                   | 1,971,986.830                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 2.75 05/21/41           | 1,050,000.000                   | 839,317.240                     |  |
|                          | AUSTRALIAN 2.75 06/21/35           | 1,100,000.000                   | 958,870.040                     |  |
|                          | AUSTRALIAN 2.75 11/21/27           | 1,420,000.000                   | 1,369,714.610                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 2.75 11/21/28           | 1,000,000.000                   | 954,401.080                     |  |
|                          | AUSTRALIAN 2.75 11/21/29           | 1,010,000.000                   | 951,372.010                     |  |
|                          | AUSTRALIAN 3.0 03/21/47            | 1,110,000.000                   | 873,216.790                     |  |
|                          | AUSTRALIAN 3.0 11/21/33            | 1,650,000.000                   | 1,501,864.790                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 3.25 04/21/25           | 1,140,000.000                   | 1,129,469.640                   |  |
|                          | AUSTRALIAN 3.25 04/21/29           | 1,800,000.000                   | 1,751,145.300                   |  |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 630,000.000                        | 553,329.020                     |                                 |  |
| AUSTRALIAN 3.5 12/21/34  | 1,380,000.000                      | 1,301,760.720                   |                                 |  |



|            |  |                                   |                                   |  |
|------------|--|-----------------------------------|-----------------------------------|--|
|            | AUSTRALIAN 3.75 04/21/37               | 630,000.000                       | 598,725.670                       |  |
|            | AUSTRALIAN 3.75 05/21/34               | 1,600,000.000                     | 1,549,318.670                     |  |
|            | AUSTRALIAN 4.25 04/21/26               | 1,030,000.000                     | 1,040,245.510                     |  |
|            | AUSTRALIAN 4.5 04/21/33                | 1,510,000.000                     | 1,555,919.550                     |  |
|            | AUSTRALIAN 4.75 04/21/27               | 1,770,000.000                     | 1,824,594.230                     |  |
|            | AUSTRALIAN 4.75 06/21/54               | 600,000.000                       | 628,366.980                       |  |
| オーストラリア・ドル | 小計                                     | 38,640,000.000<br>(3,775,128,000) | 34,655,219.550<br>(3,385,814,950) |  |
| オフショア・人民元  | CHINA GOVERNMENT BOND<br>1.99 04/09/25 | 38,500,000.000                    | 38,380,417.840                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.18 08/15/26 | 12,500,000.000                    | 12,457,917.250                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.28 11/25/25 | 4,500,000.000                     | 4,501,856.250                     |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.3 05/15/26  | 12,500,000.000                    | 12,502,588.750                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.37 01/20/27 | 9,000,000.000                     | 9,004,672.800                     |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.4 07/15/28  | 33,500,000.000                    | 33,482,752.520                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.46 02/15/26 | 49,000,000.000                    | 49,146,706.000                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.48 04/15/27 | 4,400,000.000                     | 4,415,997.080                     |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.48 09/25/28 | 8,000,000.000                     | 8,023,868.000                     |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.5 07/25/27  | 10,500,000.000                    | 10,538,179.050                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.6 09/01/32  | 11,000,000.000                    | 11,003,329.700                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.6 09/15/30  | 34,000,000.000                    | 34,209,399.200                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.62 04/15/28 | 33,000,000.000                    | 33,310,800.600                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.62 06/25/30 | 10,000,000.000                    | 10,071,460.000                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.62 09/25/29 | 12,000,000.000                    | 12,073,489.200                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.64 01/15/28 | 19,000,000.000                    | 19,173,473.800                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.68 05/21/30 | 29,500,000.000                    | 29,737,687.400                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.69 08/12/26 | 26,000,000.000                    | 26,245,044.800                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.69 08/15/32 | 14,500,000.000                    | 14,647,157.600                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.75 02/17/32 | 22,000,000.000                    | 22,250,487.600                    |  |
|            | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.75 06/15/29 | 6,100,000.000                     | 6,181,886.400                     |  |

|        |  |                                     |                                     |  |
|--------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|--|
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.76 05/15/32 | 43,000,000.000                      | 43,663,760.900                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.79 12/15/29 | 39,000,000.000                      | 39,582,488.400                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.8 03/25/30  | 17,000,000.000                      | 17,254,323.400                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.8 11/15/32  | 20,500,000.000                      | 20,843,946.950                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.85 06/04/27 | 36,000,000.000                      | 36,539,272.800                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.88 02/25/33 | 13,000,000.000                      | 13,353,143.700                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.89 11/18/31 | 7,000,000.000                       | 7,152,518.100                       |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.91 10/14/28 | 7,500,000.000                       | 7,666,023.750                       |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.01 05/13/28 | 35,000,000.000                      | 35,912,628.500                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.02 05/27/31 | 9,500,000.000                       | 9,796,459.850                       |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.02 10/22/25 | 55,500,000.000                      | 56,312,631.000                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.03 03/11/26 | 94,200,000.000                      | 95,784,943.260                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.25 06/06/26 | 6,700,000.000                       | 6,862,221.070                       |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.27 11/19/30 | 10,000,000.000                      | 10,501,433.000                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.28 12/03/27 | 16,500,000.000                      | 17,103,801.000                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.32 04/15/52 | 16,600,000.000                      | 17,939,029.040                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.39 03/16/50 | 28,600,000.000                      | 31,476,768.180                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.72 04/12/51 | 2,000,000.000                       | 2,335,805.200                       |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.81 09/14/50 | 36,500,000.000                      | 43,148,215.850                      |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>3.86 07/22/49 | 3,400,000.000                       | 4,032,176.960                       |  |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND<br>4.08 10/22/48 | 10,000,000.000                      | 12,136,736.000                      |  |
|        | オフショア・人民元 小計                           | 907,000,000.000<br>(18,390,966,900) | 930,757,498.750<br>(18,872,690,575) |  |
| カナダ・ドル | CANADA 0.25 03/01/26                   | 2,000,000.000                       | 1,856,398.430                       |  |
|        | CANADA 0.5 09/01/25                    | 1,250,000.000                       | 1,179,511.910                       |  |
|        | CANADA 0.5 12/01/30                    | 3,000,000.000                       | 2,492,313.250                       |  |
|        | CANADA 1.0 06/01/27                    | 710,000.000                         | 654,820.980                         |  |
|        | CANADA 1.0 09/01/26                    | 1,560,000.000                       | 1,457,717.330                       |  |
|        | CANADA 1.25 03/01/25                   | 700,000.000                         | 675,826.430                         |  |

|                      |                                   |                                   |             |
|----------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------|
| CANADA 1.25 03/01/27 | 1,050,000.000                     | 978,554.200                       |             |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 1,590,000.000                     | 1,405,585.120                     |             |
| CANADA 1.5 04/01/25  | 830,000.000                       | 801,614.910                       |             |
| CANADA 1.5 06/01/26  | 800,000.000                       | 760,003.300                       |             |
| CANADA 1.5 06/01/31  | 2,650,000.000                     | 2,341,881.050                     |             |
| CANADA 1.5 12/01/31  | 2,850,000.000                     | 2,499,451.300                     |             |
| CANADA 1.75 12/01/53 | 2,090,000.000                     | 1,515,761.040                     |             |
| CANADA 2.0 06/01/28  | 500,000.000                       | 473,224.300                       |             |
| CANADA 2.0 06/01/32  | 1,700,000.000                     | 1,542,069.570                     |             |
| CANADA 2.0 12/01/51  | 2,960,000.000                     | 2,305,375.380                     |             |
| CANADA 2.25 06/01/25 | 560,000.000                       | 545,173.360                       |             |
| CANADA 2.25 06/01/29 | 460,000.000                       | 437,608.860                       |             |
| CANADA 2.25 12/01/29 | 500,000.000                       | 474,084.050                       |             |
| CANADA 2.5 12/01/32  | 1,620,000.000                     | 1,523,953.790                     |             |
| CANADA 2.75 06/01/33 | 1,060,000.000                     | 1,015,744.220                     |             |
| CANADA 2.75 09/01/27 | 1,000,000.000                     | 974,957.790                       |             |
| CANADA 2.75 12/01/48 | 1,000,000.000                     | 921,444.580                       |             |
| CANADA 2.75 12/01/55 | 1,000,000.000                     | 912,130.690                       |             |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 580,000.000                       | 529,358.820                       |             |
| CANADA 3.0 04/01/26  | 750,000.000                       | 737,109.420                       |             |
| CANADA 3.0 10/01/25  | 600,000.000                       | 589,160.310                       |             |
| CANADA 3.25 09/01/28 | 1,800,000.000                     | 1,791,608.520                     |             |
| CANADA 3.25 12/01/33 | 1,300,000.000                     | 1,297,721.100                     |             |
| CANADA 3.5 03/01/28  | 800,000.000                       | 802,554.870                       |             |
| CANADA 3.5 08/01/25  | 1,000,000.000                     | 989,594.220                       |             |
| CANADA 3.5 12/01/45  | 460,000.000                       | 478,889.710                       |             |
| CANADA 3.75 02/01/25 | 2,000,000.000                     | 1,982,657.560                     |             |
| CANADA 3.75 05/01/25 | 1,000,000.000                     | 992,626.790                       |             |
| CANADA 4.0 06/01/41  | 420,000.000                       | 461,176.200                       |             |
| CANADA 4.5 11/01/25  | 2,000,000.000                     | 2,015,823.760                     |             |
| CANADA 5.0 06/01/37  | 390,000.000                       | 461,348.470                       |             |
| CANADA 5.75 06/01/29 | 1,250,000.000                     | 1,402,017.780                     |             |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 670,000.000                       | 802,671.850                       |             |
| カナダ・ドル 小計            | 48,460,000.000<br>(5,276,809,400) | 45,079,525.220<br>(4,908,709,501) |             |
| シンガポール・ドル            | SINGAPORE 0.5 11/01/25            | 440,000.000                       | 418,860.200 |
|                      | SINGAPORE 1.25 11/01/26           | 400,000.000                       | 382,120.000 |
|                      | SINGAPORE 1.625 07/01/31          | 490,000.000                       | 451,045.000 |
|                      | SINGAPORE 1.875 03/01/50          | 660,000.000                       | 541,860.000 |
|                      | SINGAPORE 1.875 10/01/51          | 320,000.000                       | 262,918.400 |
|                      | SINGAPORE 2.125 06/01/26          | 560,000.000                       | 547,680.000 |
|                      | SINGAPORE 2.25 08/01/36           | 530,000.000                       | 497,511.000 |
|                      | SINGAPORE 2.375 06/01/25          | 648,000.000                       | 638,668.800 |
|                      | SINGAPORE 2.375 07/01/39          | 340,000.000                       | 319,091.700 |
|                      | SINGAPORE 2.625 05/01/28          | 520,000.000                       | 518,596.000 |
|                      | SINGAPORE 2.625 08/01/32          | 330,000.000                       | 325,050.000 |
|                      | SINGAPORE 2.75 03/01/46           | 540,000.000                       | 527,580.000 |
|                      | SINGAPORE 2.75 04/01/42           | 395,000.000                       | 388,302.770 |

|                 |                              |                                  |                                  |  |
|-----------------|------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|--|
|                 | SINGAPORE 2.875 07/01/29     | 550,000.000                      | 553,465.000                      |  |
|                 | SINGAPORE 2.875 08/01/28     | 230,000.000                      | 231,613.450                      |  |
|                 | SINGAPORE 2.875 09/01/27     | 200,000.000                      | 201,000.000                      |  |
|                 | SINGAPORE 2.875 09/01/30     | 700,000.000                      | 703,500.000                      |  |
|                 | SINGAPORE 3.0 08/01/72       | 325,000.000                      | 341,250.000                      |  |
|                 | SINGAPORE 3.375 09/01/33     | 650,000.000                      | 679,126.500                      |  |
|                 | SINGAPORE 3.5 03/01/27       | 670,000.000                      | 683,065.000                      |  |
| シンガポール・ドル 小計    |                              | 9,498,000.000<br>(1,039,556,100) | 9,212,303.820<br>(1,008,286,653) |  |
| スウェーデン・<br>クローナ | SWEDEN 0.125 05/12/31        | 4,100,000.000                    | 3,535,175.800                    |  |
|                 | SWEDEN 0.75 05/12/28         | 5,380,000.000                    | 5,053,317.950                    |  |
|                 | SWEDEN 0.75 11/12/29         | 5,300,000.000                    | 4,896,141.480                    |  |
|                 | SWEDEN 1.0 11/12/26          | 4,700,000.000                    | 4,516,415.080                    |  |
|                 | SWEDEN 1.75 11/11/33         | 3,220,000.000                    | 3,082,238.500                    |  |
|                 | SWEDEN 2.25 06/01/32         | 4,000,000.000                    | 4,014,312.400                    |  |
|                 | SWEDEN 2.5 05/12/25          | 6,550,000.000                    | 6,503,326.660                    |  |
|                 | SWEDEN 3.5 03/30/39          | 2,980,000.000                    | 3,384,892.600                    |  |
| スウェーデン・クローナ 小計  |                              | 36,230,000.000<br>(515,915,200)  | 34,985,820.470<br>(498,198,083)  |  |
| デンマーク・ク<br>ローネ  | DENMARK 0.0 11/15/31         | 5,410,000.000                    | 4,527,899.500                    |  |
|                 | DENMARK 0.25 11/15/52        | 4,300,000.000                    | 2,337,015.600                    |  |
|                 | DENMARK 0.5 11/15/27         | 4,580,000.000                    | 4,281,096.830                    |  |
|                 | DENMARK 0.5 11/15/29         | 4,570,000.000                    | 4,133,853.360                    |  |
|                 | DENMARK 1.75 11/15/25        | 4,370,000.000                    | 4,298,731.410                    |  |
|                 | DENMARK 2.25 11/15/33        | 2,350,000.000                    | 2,318,890.700                    |  |
|                 | DENMARK 4.5 11/15/39         | 7,290,000.000                    | 9,154,082.160                    |  |
| デンマーク・クローネ 小計   |                              | 32,870,000.000<br>(704,404,100)  | 31,051,569.560<br>(665,435,136)  |  |
| ニュージーラン<br>ド・ドル | NEW ZEALAND 0.25<br>05/15/28 | 920,000.000                      | 770,825.570                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 0.5 05/15/26     | 1,080,000.000                    | 982,699.720                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 1.5 05/15/31     | 560,000.000                      | 454,272.000                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 1.75<br>05/15/41 | 570,000.000                      | 358,435.150                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 2.0 05/15/32     | 910,000.000                      | 748,815.900                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 2.75<br>04/15/25 | 120,000.000                      | 116,636.150                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 2.75<br>04/15/37 | 340,000.000                      | 270,049.600                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 2.75<br>05/15/51 | 350,000.000                      | 235,669.070                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 3.0 04/20/29     | 710,000.000                      | 664,353.090                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 3.5 04/14/33     | 590,000.000                      | 540,462.650                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 4.25<br>05/15/34 | 420,000.000                      | 404,890.090                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 4.5 04/15/27     | 550,000.000                      | 550,445.610                      |  |
|                 | NEW ZEALAND 4.5 05/15/30     | 340,000.000                      | 340,845.880                      |  |
| ニュージーランド・ドル 小計  |                              | 7,460,000.000                    | 6,438,400.480                    |  |

|                         |                         |                                   |                                   |  |
|-------------------------|-------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|
|                         |                         | (677,591,800)                     | (584,799,916)                     |  |
| ノルウェー・クローネ              | NORWAY 1.25 09/17/31    | 1,890,000.000                     | 1,614,995.550                     |  |
|                         | NORWAY 1.375 08/19/30   | 3,610,000.000                     | 3,182,485.750                     |  |
|                         | NORWAY 1.5 02/19/26     | 6,800,000.000                     | 6,512,516.400                     |  |
|                         | NORWAY 1.75 02/17/27    | 3,950,000.000                     | 3,755,383.500                     |  |
|                         | NORWAY 1.75 03/13/25    | 1,480,000.000                     | 1,443,896.580                     |  |
|                         | NORWAY 1.75 09/06/29    | 2,720,000.000                     | 2,494,321.600                     |  |
|                         | NORWAY 2.0 04/26/28     | 3,060,000.000                     | 2,901,553.200                     |  |
|                         | NORWAY 2.125 05/18/32   | 2,650,000.000                     | 2,397,237.700                     |  |
|                         | NORWAY 3.0 08/15/33     | 4,790,000.000                     | 4,613,680.100                     |  |
|                         | NORWAY 3.5 10/06/42     | 1,300,000.000                     | 1,334,208.200                     |  |
| ノルウェー・クローネ 小計           |                         | 32,250,000.000<br>(453,757,500)   | 30,250,278.580<br>(425,621,420)   |  |
| ポーランド・ズロチ               | POLAND 0.25 10/25/26    | 3,100,000.000                     | 2,738,865.500                     |  |
|                         | POLAND 0.75 04/25/25    | 2,150,000.000                     | 2,042,091.500                     |  |
|                         | POLAND 1.25 10/25/30    | 3,400,000.000                     | 2,701,745.400                     |  |
|                         | POLAND 1.75 04/25/32    | 2,350,000.000                     | 1,835,241.900                     |  |
|                         | POLAND 10/25/25         | 1,000,000.000                     | 920,516.000                       |  |
|                         | POLAND 2.5 07/25/26     | 4,480,000.000                     | 4,233,591.040                     |  |
|                         | POLAND 2.5 07/25/27     | 3,900,000.000                     | 3,614,832.000                     |  |
|                         | POLAND 2.75 04/25/28    | 1,810,000.000                     | 1,668,610.040                     |  |
|                         | POLAND 2.75 10/25/29    | 2,500,000.000                     | 2,240,197.500                     |  |
|                         | POLAND 3.25 07/25/25    | 1,700,000.000                     | 1,660,259.100                     |  |
|                         | POLAND 3.75 05/25/27    | 1,770,000.000                     | 1,711,331.580                     |  |
|                         | POLAND 5.75 04/25/29    | 1,950,000.000                     | 2,022,263.100                     |  |
|                         | POLAND 6.0 10/25/33     | 2,670,000.000                     | 2,841,974.700                     |  |
|                         | POLAND 7.5 07/25/28     | 3,700,000.000                     | 4,083,687.780                     |  |
| ポーランド・ズロチ 小計            |                         | 36,480,000.000<br>(1,345,513,728) | 34,315,207.140<br>(1,265,668,374) |  |
| マレーシア・リングgit            | MALAYSIA 2.632 04/15/31 | 2,300,000.000                     | 2,129,297.050                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.502 05/31/27 | 1,200,000.000                     | 1,196,648.760                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.519 04/20/28 | 2,100,000.000                     | 2,093,641.110                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.582 07/15/32 | 1,100,000.000                     | 1,078,876.190                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.733 06/15/28 | 1,100,000.000                     | 1,103,700.400                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.757 05/22/40 | 2,300,000.000                     | 2,201,721.320                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.828 07/05/34 | 1,300,000.000                     | 1,288,667.510                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 2,110,000.000                     | 2,101,566.750                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.885 08/15/29 | 1,230,000.000                     | 1,241,221.160                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.892 03/15/27 | 370,000.000                       | 373,525.980                       |  |
|                         | MALAYSIA 3.899 11/16/27 | 1,400,000.000                     | 1,415,148.840                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.9 11/30/26   | 1,390,000.000                     | 1,405,295.420                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.906 07/15/26 | 1,570,000.000                     | 1,587,630.940                     |  |
|                         | MALAYSIA 3.955 09/15/25 | 2,000,000.000                     | 2,016,160.000                     |  |
|                         | MALAYSIA 4.065 06/15/50 | 2,110,000.000                     | 2,029,838.220                     |  |
|                         | MALAYSIA 4.232 06/30/31 | 800,000.000                       | 820,015.680                       |  |
| MALAYSIA 4.254 05/31/35 | 950,000.000             | 968,282.840                       |                                   |  |

|                               |                                |                                    |                                    |  |
|-------------------------------|--------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--|
|                               | MALAYSIA 4.392 04/15/26        | 1,500,000.000                      | 1,528,472.250                      |  |
|                               | MALAYSIA 4.457 03/31/53        | 1,320,000.000                      | 1,356,441.100                      |  |
|                               | MALAYSIA 4.498 04/15/30        | 2,500,000.000                      | 2,600,513.750                      |  |
|                               | MALAYSIA 4.504 04/30/29        | 720,000.000                        | 746,660.730                        |  |
|                               | MALAYSIA 4.642 11/07/33        | 740,000.000                        | 789,390.480                        |  |
|                               | MALAYSIA 4.696 10/15/42        | 1,300,000.000                      | 1,398,865.910                      |  |
|                               | MALAYSIA 4.736 03/15/46        | 700,000.000                        | 746,710.020                        |  |
|                               | MALAYSIA 4.762 04/07/37        | 1,200,000.000                      | 1,288,956.000                      |  |
|                               | MALAYSIA 4.893 06/08/38        | 2,230,000.000                      | 2,448,968.380                      |  |
|                               | MALAYSIA 4.921 07/06/48        | 1,700,000.000                      | 1,866,730.900                      |  |
|                               | MALAYSIA 4.935 09/30/43        | 620,000.000                        | 680,278.500                        |  |
| マレーシア・リングギット 小計               |                                | 39,860,000.000<br>(1,250,762,954)  | 40,503,226.190<br>(1,270,946,684)  |  |
| メキシコ・ペソ                       | MEXICAN BONDS 03/01/29         | 2,000,000.000                      | 1,938,940.000                      |  |
|                               | MEXICAN BONDS 03/04/27         | 31,200,000.000                     | 27,949,896.000                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 03/06/25         | 13,340,000.000                     | 12,654,991.000                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 05/24/35         | 2,000,000.000                      | 1,842,966.980                      |  |
|                               | MEXICAN BONDS 05/26/33         | 21,330,000.000                     | 19,169,484.300                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 07/31/53         | 12,750,000.000                     | 11,219,490.000                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 09/03/26         | 12,500,000.000                     | 11,736,250.000                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 10.0<br>11/20/36 | 4,700,000.000                      | 5,031,350.000                      |  |
|                               | MEXICAN BONDS 5.75<br>03/05/26 | 24,100,000.000                     | 22,231,539.290                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 7.5<br>06/03/27  | 19,500,000.000                     | 18,441,345.000                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 7.75<br>05/29/31 | 30,370,000.000                     | 28,145,701.200                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 7.75<br>11/13/42 | 24,700,000.000                     | 21,518,640.000                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 7.75<br>11/23/34 | 8,891,000.000                      | 8,049,466.850                      |  |
|                               | MEXICAN BONDS 8.0<br>11/07/47  | 19,446,000.000                     | 17,232,267.360                     |  |
|                               | MEXICAN BONDS 8.5<br>05/31/29  | 24,201,000.000                     | 23,587,020.630                     |  |
| MEXICAN BONDS 8.5<br>11/18/38 | 11,800,000.000                 | 11,161,148.000                     |                                    |  |
| メキシコ・ペソ 小計                    |                                | 262,828,000.000<br>(2,254,722,564) | 241,910,496.610<br>(2,075,277,577) |  |
| ユーロ                           | AUSTRIA 0.0 02/20/30           | 1,550,000.000                      | 1,327,567.250                      |  |
|                               | AUSTRIA 0.0 02/20/31           | 1,280,000.000                      | 1,062,365.440                      |  |
|                               | AUSTRIA 0.0 04/20/25           | 630,000.000                        | 606,909.870                        |  |
|                               | AUSTRIA 0.0 10/20/28           | 900,000.000                        | 798,707.080                        |  |
|                               | AUSTRIA 0.0 10/20/40           | 400,000.000                        | 242,760.000                        |  |
|                               | AUSTRIA 0.25 10/20/36          | 200,000.000                        | 142,640.000                        |  |
|                               | AUSTRIA 0.5 02/20/29           | 1,200,000.000                      | 1,084,722.000                      |  |
|                               | AUSTRIA 0.5 04/20/27           | 1,000,000.000                      | 937,367.000                        |  |
|                               | AUSTRIA 0.7 04/20/71           | 210,000.000                        | 95,054.820                         |  |

|                       |               |               |  |
|-----------------------|---------------|---------------|--|
| AUSTRIA 0.75 02/20/28 | 850,000.000   | 791,755.450   |  |
| AUSTRIA 0.75 03/20/51 | 400,000.000   | 234,129.600   |  |
| AUSTRIA 0.75 10/20/26 | 1,520,000.000 | 1,446,032.240 |  |
| AUSTRIA 0.85 06/30/20 | 350,000.000   | 151,315.920   |  |
| AUSTRIA 0.9 02/20/32  | 650,000.000   | 564,777.850   |  |
| AUSTRIA 1.2 10/20/25  | 900,000.000   | 876,801.600   |  |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47  | 250,000.000   | 186,100.640   |  |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86  | 900,000.000   | 531,540.000   |  |
| AUSTRIA 1.85 05/23/49 | 200,000.000   | 158,051.000   |  |
| AUSTRIA 2.0 07/15/26  | 320,000.000   | 315,404.400   |  |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17  | 400,000.000   | 296,542.800   |  |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34  | 1,210,000.000 | 1,165,298.970 |  |
| AUSTRIA 2.9 02/20/33  | 1,250,000.000 | 1,263,163.750 |  |
| AUSTRIA 2.9 05/23/29  | 100,000.000   | 101,985.300   |  |
| AUSTRIA 3.15 06/20/44 | 570,000.000   | 577,844.680   |  |
| AUSTRIA 3.15 10/20/53 | 100,000.000   | 101,164.600   |  |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62  | 380,000.000   | 439,731.440   |  |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37 | 1,000,000.000 | 1,125,287.000 |  |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26 | 500,000.000   | 522,520.500   |  |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 400,000.000   | 449,081.600   |  |
| BELGIUM 0.0 10/22/27  | 1,000,000.000 | 912,231.500   |  |
| BELGIUM 0.0 10/22/31  | 1,500,000.000 | 1,224,084.000 |  |
| BELGIUM 0.1 06/22/30  | 1,100,000.000 | 942,150.000   |  |
| BELGIUM 0.35 06/22/32 | 750,000.000   | 617,625.000   |  |
| BELGIUM 0.4 06/22/40  | 860,000.000   | 559,361.200   |  |
| BELGIUM 0.65 06/22/71 | 70,000.000    | 29,737.400    |  |
| BELGIUM 0.8 06/22/25  | 1,300,000.000 | 1,260,948.000 |  |
| BELGIUM 0.8 06/22/27  | 800,000.000   | 756,184.000   |  |
| BELGIUM 0.8 06/22/28  | 1,400,000.000 | 1,301,300.000 |  |
| BELGIUM 0.9 06/22/29  | 1,150,000.000 | 1,059,148.850 |  |
| BELGIUM 1.0 06/22/26  | 1,800,000.000 | 1,732,797.000 |  |
| BELGIUM 1.0 06/22/31  | 1,310,000.000 | 1,167,381.610 |  |
| BELGIUM 1.25 04/22/33 | 1,000,000.000 | 882,714.000   |  |
| BELGIUM 1.4 06/22/53  | 680,000.000   | 440,601.920   |  |
| BELGIUM 1.45 06/22/37 | 800,000.000   | 661,824.800   |  |
| BELGIUM 1.6 06/22/47  | 920,000.000   | 672,768.400   |  |
| BELGIUM 1.7 06/22/50  | 1,030,000.000 | 745,176.160   |  |
| BELGIUM 1.9 06/22/38  | 400,000.000   | 345,716.000   |  |
| BELGIUM 2.15 06/22/66 | 600,000.000   | 453,900.000   |  |
| BELGIUM 2.25 06/22/57 | 550,000.000   | 436,064.150   |  |
| BELGIUM 2.75 04/22/39 | 300,000.000   | 287,268.600   |  |
| BELGIUM 3.0 06/22/33  | 1,200,000.000 | 1,221,897.600 |  |
| BELGIUM 3.0 06/22/34  | 840,000.000   | 851,979.240   |  |
| BELGIUM 3.3 06/22/54  | 850,000.000   | 842,613.500   |  |
| BELGIUM 3.45 06/22/43 | 400,000.000   | 412,537.600   |  |
| BELGIUM 3.75 06/22/45 | 800,000.000   | 864,428.000   |  |
| BELGIUM 4.0 03/28/32  | 650,000.000   | 713,443.250   |  |
| BELGIUM 4.25 03/28/41 | 1,250,000.000 | 1,429,835.000 |  |
| BELGIUM 4.5 03/28/26  | 700,000.000   | 727,212.500   |  |

|                              |               |               |  |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| BELGIUM 5.0 03/28/35         | 1,080,000.000 | 1,294,146.720 |  |
| BELGIUM 5.5 03/28/28         | 1,610,000.000 | 1,804,433.260 |  |
| BUNDESOBL 0.0 04/10/26       | 2,480,000.000 | 2,349,304.000 |  |
| BUNDESOBL 0.0 04/11/25       | 1,470,000.000 | 1,416,937.410 |  |
| BUNDESOBL 0.0 04/16/27       | 1,190,000.000 | 1,106,630.980 |  |
| BUNDESOBL 0.0 10/09/26       | 3,500,000.000 | 3,284,365.000 |  |
| BUNDESOBL 0.0 10/10/25       | 2,500,000.000 | 2,387,075.000 |  |
| BUNDESOBL 0.0 10/10/25       | 500,000.000   | 478,630.000   |  |
| BUNDESOBL 1.3 10/15/27       | 2,010,000.000 | 1,946,283.000 |  |
| BUNDESOBL 1.3 10/15/27       | 500,000.000   | 485,445.000   |  |
| BUNDESOBL 2.2 04/13/28       | 2,100,000.000 | 2,101,848.000 |  |
| BUNDESOBL 2.4 10/19/28       | 2,300,000.000 | 2,324,334.000 |  |
| BUNDESSCHAT 2.8 06/12/25     | 1,300,000.000 | 1,297,881.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30     | 2,210,000.000 | 1,946,766.900 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31     | 2,000,000.000 | 1,725,720.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32     | 2,180,000.000 | 1,838,492.100 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35     | 2,070,000.000 | 1,596,777.300 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36     | 2,300,000.000 | 1,723,896.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30     | 2,000,000.000 | 1,743,740.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30     | 820,000.000   | 716,073.200   |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31     | 2,400,000.000 | 2,048,064.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31     | 600,000.000   | 512,566.560   |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50     | 2,320,000.000 | 1,240,434.400 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50     | 1,070,000.000 | 573,915.900   |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52     | 1,560,000.000 | 792,823.200   |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27     | 1,800,000.000 | 1,656,432.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28     | 1,700,000.000 | 1,536,441.300 |  |
| DEUTSCHLAND 0.25<br>02/15/27 | 2,500,000.000 | 2,351,650.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.25<br>02/15/29 | 1,850,000.000 | 1,686,210.250 |  |
| DEUTSCHLAND 0.25<br>08/15/28 | 2,250,000.000 | 2,067,570.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25     | 1,050,000.000 | 1,020,747.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26     | 4,000,000.000 | 3,836,880.000 |  |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28     | 2,160,000.000 | 2,021,479.200 |  |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27     | 2,100,000.000 | 1,979,031.600 |  |
| DEUTSCHLAND 08/15/26         | 2,300,000.000 | 2,165,951.400 |  |
| DEUTSCHLAND 08/15/29         | 2,050,000.000 | 1,824,659.900 |  |
| DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38     | 1,150,000.000 | 953,465.000   |  |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25     | 3,000,000.000 | 2,917,890.000 |  |
| DEUTSCHLAND 1.25<br>08/15/48 | 2,900,000.000 | 2,282,787.200 |  |
| DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32     | 1,100,000.000 | 1,061,390.000 |  |
| DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53     | 1,720,000.000 | 1,495,970.000 |  |
| DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53     | 1,000,000.000 | 871,030.000   |  |
| DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29     | 2,300,000.000 | 2,295,124.000 |  |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33     | 3,260,000.000 | 3,293,349.800 |  |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33     | 900,000.000   | 909,045.000   |  |



|                               |               |               |  |
|-------------------------------|---------------|---------------|--|
| DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30      | 1,000,000.000 | 1,015,890.000 |  |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44      | 2,150,000.000 | 2,163,287.000 |  |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46      | 2,250,000.000 | 2,274,615.000 |  |
| DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33      | 2,000,000.000 | 2,067,140.000 |  |
| DEUTSCHLAND 3.25<br>07/04/42  | 1,050,000.000 | 1,170,645.000 |  |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37      | 1,850,000.000 | 2,181,703.150 |  |
| DEUTSCHLAND 4.25<br>07/04/39  | 1,290,000.000 | 1,588,686.600 |  |
| DEUTSCHLAND 4.75<br>07/04/28  | 1,000,000.000 | 1,111,500.000 |  |
| DEUTSCHLAND 4.75<br>07/04/34  | 2,180,000.000 | 2,681,160.200 |  |
| DEUTSCHLAND 4.75<br>07/04/40  | 1,800,000.000 | 2,357,730.000 |  |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31      | 1,590,000.000 | 1,932,549.600 |  |
| DEUTSCHLAND 5.625<br>01/04/28 | 1,350,000.000 | 1,522,422.000 |  |
| DEUTSCHLAND 6.25<br>01/04/30  | 900,000.000   | 1,106,037.000 |  |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27      | 970,000.000   | 1,104,393.500 |  |
| FINLAND 0.0 09/15/26          | 100,000.000   | 93,240.000    |  |
| FINLAND 0.0 09/15/30          | 380,000.000   | 320,568.000   |  |
| FINLAND 0.125 04/15/36        | 390,000.000   | 278,860.720   |  |
| FINLAND 0.125 04/15/52        | 380,000.000   | 179,211.640   |  |
| FINLAND 0.125 09/15/31        | 480,000.000   | 396,900.480   |  |
| FINLAND 0.25 09/15/40         | 100,000.000   | 64,518.400    |  |
| FINLAND 0.5 04/15/26          | 550,000.000   | 524,550.420   |  |
| FINLAND 0.5 04/15/43          | 300,000.000   | 190,966.800   |  |
| FINLAND 0.5 09/15/27          | 300,000.000   | 279,126.900   |  |
| FINLAND 0.5 09/15/28          | 500,000.000   | 456,143.500   |  |
| FINLAND 0.5 09/15/29          | 400,000.000   | 357,795.280   |  |
| FINLAND 0.75 04/15/31         | 200,000.000   | 175,694.760   |  |
| FINLAND 0.875 09/15/25        | 850,000.000   | 823,971.300   |  |
| FINLAND 1.125 04/15/34        | 500,000.000   | 426,383.800   |  |
| FINLAND 1.375 04/15/27        | 200,000.000   | 192,822.490   |  |
| FINLAND 1.375 04/15/47        | 440,000.000   | 324,025.240   |  |
| FINLAND 1.5 09/15/32          | 390,000.000   | 354,350.680   |  |
| FINLAND 2.625 07/04/42        | 470,000.000   | 445,567.050   |  |
| FINLAND 2.75 04/15/38         | 200,000.000   | 194,750.600   |  |
| FINLAND 2.75 07/04/28         | 700,000.000   | 707,598.500   |  |
| FINLAND 2.875 04/15/29        | 500,000.000   | 508,125.000   |  |
| FINLAND 3.0 09/15/33          | 500,000.000   | 510,556.500   |  |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/25       | 70,000.000    | 67,605.330    |  |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/26       | 3,500,000.000 | 3,311,294.000 |  |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/27       | 2,300,000.000 | 2,128,456.800 |  |
| FRANCE OAT 0.0 05/25/32       | 3,400,000.000 | 2,737,680.000 |  |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/29       | 3,060,000.000 | 2,650,798.440 |  |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/30       | 3,200,000.000 | 2,695,731.200 |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| FRANCE OAT 0.0 11/25/31  | 3,400,000.000 | 2,782,529.400 |  |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26 | 3,300,000.000 | 3,093,156.000 |  |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25  | 3,600,000.000 | 3,481,524.000 |  |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26  | 4,030,000.000 | 3,836,821.950 |  |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/29  | 4,720,000.000 | 4,259,068.400 |  |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/40  | 2,110,000.000 | 1,418,297.690 |  |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/72  | 930,000.000   | 366,973.350   |  |
| FRANCE OAT 0.5 06/25/44  | 970,000.000   | 588,045.040   |  |
| FRANCE OAT 0.75 02/25/28 | 4,330,000.000 | 4,041,696.680 |  |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28 | 5,200,000.000 | 4,835,162.800 |  |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/52 | 1,750,000.000 | 965,016.500   |  |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/53 | 1,700,000.000 | 917,211.200   |  |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28 | 4,090,000.000 | 3,772,076.120 |  |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27  | 2,370,000.000 | 2,256,237.630 |  |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25  | 2,900,000.000 | 2,808,558.560 |  |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34 | 3,300,000.000 | 2,851,018.500 |  |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 3,240,000.000 | 2,682,072.000 |  |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/38 | 950,000.000   | 754,205.000   |  |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31  | 3,600,000.000 | 3,351,135.600 |  |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/50  | 3,260,000.000 | 2,288,464.580 |  |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 660,000.000   | 452,523.720   |  |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39 | 1,860,000.000 | 1,576,217.940 |  |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48  | 2,300,000.000 | 1,843,716.800 |  |
| FRANCE OAT 2.0 11/25/32  | 3,600,000.000 | 3,416,072.400 |  |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30  | 3,900,000.000 | 3,899,913.880 |  |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/43  | 1,000,000.000 | 905,560.680   |  |
| FRANCE OAT 2.5 09/24/26  | 3,700,000.000 | 3,690,871.170 |  |
| FRANCE OAT 2.75 02/25/29 | 3,200,000.000 | 3,238,667.840 |  |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 4,290,000.000 | 4,330,064.310 |  |
| FRANCE OAT 3.0 05/25/33  | 3,300,000.000 | 3,382,120.170 |  |
| FRANCE OAT 3.0 05/25/54  | 1,150,000.000 | 1,094,587.250 |  |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 2,600,000.000 | 2,639,897.000 |  |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26  | 2,220,000.000 | 2,262,175.560 |  |
| FRANCE OAT 3.5 11/25/33  | 300,000.000   | 319,479.000   |  |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55  | 1,700,000.000 | 1,947,761.400 |  |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60  | 2,090,000.000 | 2,420,061.160 |  |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38  | 2,500,000.000 | 2,801,070.000 |  |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41  | 2,810,000.000 | 3,344,796.390 |  |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 2,150,000.000 | 2,543,196.300 |  |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29  | 3,100,000.000 | 3,553,353.300 |  |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | 3,290,000.000 | 4,076,915.360 |  |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25  | 6,470,000.000 | 6,825,487.680 |  |
| IRISH 0.0 10/18/31       | 1,000,000.000 | 827,542.500   |  |
| IRISH 0.2 05/15/27       | 500,000.000   | 465,030.250   |  |
| IRISH 0.2 10/18/30       | 400,000.000   | 345,026.140   |  |
| IRISH 0.35 10/18/32      | 400,000.000   | 332,280.800   |  |
| IRISH 0.4 05/15/35       | 550,000.000   | 428,384.000   |  |
| IRISH 0.55 04/22/41      | 330,000.000   | 225,164.280   |  |
| IRISH 0.9 05/15/28       | 650,000.000   | 611,487.710   |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| IRISH 1.0 05/15/26       | 1,850,000.000 | 1,785,486.800 |  |
| IRISH 1.1 05/15/29       | 950,000.000   | 888,551.150   |  |
| IRISH 1.3 05/15/33       | 280,000.000   | 250,720.400   |  |
| IRISH 1.35 03/18/31      | 300,000.000   | 278,614.500   |  |
| IRISH 1.5 05/15/50       | 470,000.000   | 343,941.300   |  |
| IRISH 1.7 05/15/37       | 450,000.000   | 394,042.500   |  |
| IRISH 2.0 02/18/45       | 900,000.000   | 758,442.600   |  |
| IRISH 2.4 05/15/30       | 500,000.000   | 499,512.000   |  |
| IRISH 3.0 10/18/43       | 270,000.000   | 273,278.610   |  |
| ITALY BTPS 0.0 04/01/26  | 1,250,000.000 | 1,169,500.000 |  |
| ITALY BTPS 0.0 08/01/26  | 1,000,000.000 | 926,900.000   |  |
| ITALY BTPS 0.25 03/15/28 | 2,030,000.000 | 1,804,873.000 |  |
| ITALY BTPS 0.45 02/15/29 | 800,000.000   | 696,440.000   |  |
| ITALY BTPS 0.5 02/01/26  | 1,400,000.000 | 1,329,510.000 |  |
| ITALY BTPS 0.5 07/15/28  | 1,000,000.000 | 890,300.000   |  |
| ITALY BTPS 0.6 08/01/31  | 1,700,000.000 | 1,374,771.300 |  |
| ITALY BTPS 0.85 01/15/27 | 900,000.000   | 844,470.000   |  |
| ITALY BTPS 0.9 04/01/31  | 2,300,000.000 | 1,925,269.200 |  |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/37 | 1,000,000.000 | 691,900.000   |  |
| ITALY BTPS 0.95 06/01/32 | 1,200,000.000 | 972,120.000   |  |
| ITALY BTPS 0.95 08/01/30 | 1,200,000.000 | 1,027,920.000 |  |
| ITALY BTPS 0.95 09/15/27 | 1,100,000.000 | 1,020,800.000 |  |
| ITALY BTPS 0.95 12/01/31 | 1,400,000.000 | 1,152,585.000 |  |
| ITALY BTPS 1.1 04/01/27  | 1,700,000.000 | 1,599,870.000 |  |
| ITALY BTPS 1.2 08/15/25  | 1,600,000.000 | 1,550,864.000 |  |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 1,810,000.000 | 1,724,148.080 |  |
| ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 1,700,000.000 | 1,509,445.670 |  |
| ITALY BTPS 1.45 03/01/36 | 1,100,000.000 | 837,320.000   |  |
| ITALY BTPS 1.45 05/15/25 | 2,830,000.000 | 2,765,226.960 |  |
| ITALY BTPS 1.5 04/30/45  | 1,040,000.000 | 645,112.000   |  |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25  | 2,400,000.000 | 2,344,020.000 |  |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26  | 1,190,000.000 | 1,152,039.000 |  |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 1,900,000.000 | 1,644,860.400 |  |
| ITALY BTPS 1.65 12/01/30 | 1,600,000.000 | 1,424,096.000 |  |
| ITALY BTPS 1.7 09/01/51  | 1,400,000.000 | 843,448.200   |  |
| ITALY BTPS 1.8 03/01/41  | 900,000.000   | 640,080.000   |  |
| ITALY BTPS 1.85 07/01/25 | 1,260,000.000 | 1,235,808.000 |  |
| ITALY BTPS 2.0 02/01/28  | 1,400,000.000 | 1,342,854.800 |  |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25  | 2,900,000.000 | 2,844,346.780 |  |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 1,100,000.000 | 1,064,016.800 |  |
| ITALY BTPS 2.1 07/15/26  | 1,800,000.000 | 1,761,181.110 |  |
| ITALY BTPS 2.15 03/01/72 | 400,000.000   | 240,600.000   |  |
| ITALY BTPS 2.15 09/01/52 | 680,000.000   | 445,944.000   |  |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27  | 1,950,000.000 | 1,898,130.000 |  |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 1,600,000.000 | 1,326,880.000 |  |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 1,580,000.000 | 1,419,664.760 |  |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 780,000.000   | 561,132.000   |  |
| ITALY BTPS 2.5 11/15/25  | 2,200,000.000 | 2,178,613.800 |  |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/32  | 1,200,000.000 | 1,096,560.000 |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| ITALY BTPS 2.65 12/01/27 | 1,100,000.000 | 1,083,610.000 |  |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47  | 1,280,000.000 | 994,816.000   |  |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67  | 700,000.000   | 502,250.000   |  |
| ITALY BTPS 2.8 06/15/29  | 1,000,000.000 | 976,500.000   |  |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28  | 2,100,000.000 | 2,065,355.040 |  |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 1,380,000.000 | 1,203,360.000 |  |
| ITALY BTPS 3.0 08/01/29  | 1,400,000.000 | 1,381,304.760 |  |
| ITALY BTPS 3.1 03/01/40  | 800,000.000   | 700,844.000   |  |
| ITALY BTPS 3.25 03/01/38 | 530,000.000   | 482,247.000   |  |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 1,440,000.000 | 1,233,999.360 |  |
| ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 1,500,000.000 | 1,426,081.500 |  |
| ITALY BTPS 3.4 03/28/25  | 1,100,000.000 | 1,100,660.000 |  |
| ITALY BTPS 3.4 04/01/28  | 1,050,000.000 | 1,061,340.000 |  |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 960,000.000   | 846,050.880   |  |
| ITALY BTPS 3.5 01/15/26  | 1,300,000.000 | 1,311,050.000 |  |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30  | 2,760,000.000 | 2,784,702.000 |  |
| ITALY BTPS 3.7 06/15/30  | 1,700,000.000 | 1,727,200.000 |  |
| ITALY BTPS 3.8 04/15/26  | 700,000.000   | 711,830.210   |  |
| ITALY BTPS 3.8 08/01/28  | 2,200,000.000 | 2,257,860.000 |  |
| ITALY BTPS 3.85 09/01/49 | 1,400,000.000 | 1,306,256.000 |  |
| ITALY BTPS 3.85 09/15/26 | 1,200,000.000 | 1,225,440.000 |  |
| ITALY BTPS 3.85 12/15/29 | 1,600,000.000 | 1,642,400.000 |  |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37  | 2,080,000.000 | 2,084,368.000 |  |
| ITALY BTPS 4.0 04/30/35  | 700,000.000   | 707,490.000   |  |
| ITALY BTPS 4.0 10/30/31  | 700,000.000   | 721,980.000   |  |
| ITALY BTPS 4.0 11/15/30  | 1,000,000.000 | 1,032,700.000 |  |
| ITALY BTPS 4.1 02/01/29  | 800,000.000   | 831,680.000   |  |
| ITALY BTPS 4.2 03/01/34  | 1,400,000.000 | 1,446,900.000 |  |
| ITALY BTPS 4.35 11/01/33 | 1,330,000.000 | 1,394,372.000 |  |
| ITALY BTPS 4.4 05/01/33  | 1,740,000.000 | 1,835,352.000 |  |
| ITALY BTPS 4.45 09/01/43 | 400,000.000   | 407,880.000   |  |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26  | 1,400,000.000 | 1,442,280.000 |  |
| ITALY BTPS 4.5 10/01/53  | 500,000.000   | 508,300.000   |  |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 1,400,000.000 | 1,494,344.600 |  |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 1,400,000.000 | 1,486,902.200 |  |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34  | 1,830,000.000 | 2,014,830.000 |  |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39  | 2,060,000.000 | 2,252,198.000 |  |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40  | 1,940,000.000 | 2,121,584.000 |  |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 2,240,000.000 | 2,472,288.000 |  |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 2,120,000.000 | 2,452,204.000 |  |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31  | 1,800,000.000 | 2,095,560.000 |  |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27  | 1,470,000.000 | 1,650,810.000 |  |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 1,100,000.000 | 1,225,180.000 |  |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/26 | 1,000,000.000 | 949,203.100   |  |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/27 | 1,500,000.000 | 1,396,599.300 |  |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/29 | 1,000,000.000 | 889,832.000   |  |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/38 | 700,000.000   | 482,851.110   |  |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/52 | 1,500,000.000 | 736,762.500   |  |
| NETHERLANDS 0.0 07/15/30 | 900,000.000   | 772,327.620   |  |

|                              |               |               |  |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| NETHERLANDS 0.0 07/15/31     | 780,000.000   | 653,181.490   |  |
| NETHERLANDS 0.25<br>07/15/25 | 1,600,000.000 | 1,540,373.600 |  |
| NETHERLANDS 0.25<br>07/15/29 | 700,000.000   | 624,864.100   |  |
| NETHERLANDS 0.5 01/15/40     | 1,170,000.000 | 843,490.670   |  |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/26     | 1,400,000.000 | 1,333,150.000 |  |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/32     | 1,400,000.000 | 1,192,153.350 |  |
| NETHERLANDS 0.75<br>07/15/27 | 1,350,000.000 | 1,277,268.070 |  |
| NETHERLANDS 0.75<br>07/15/28 | 1,480,000.000 | 1,379,565.720 |  |
| NETHERLANDS 2.0 01/15/54     | 570,000.000   | 494,811.300   |  |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/30     | 500,000.000   | 503,180.000   |  |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33     | 1,320,000.000 | 1,323,029.400 |  |
| NETHERLANDS 2.5 07/15/33     | 700,000.000   | 699,160.000   |  |
| NETHERLANDS 2.75<br>01/15/47 | 1,440,000.000 | 1,463,849.280 |  |
| NETHERLANDS 3.25<br>01/15/44 | 350,000.000   | 379,748.600   |  |
| NETHERLANDS 3.75<br>01/15/42 | 1,300,000.000 | 1,496,085.110 |  |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37     | 1,500,000.000 | 1,725,000.000 |  |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28     | 670,000.000   | 751,606.000   |  |
| SPAIN 0.0 01/31/26           | 2,600,000.000 | 2,453,058.400 |  |
| SPAIN 0.0 01/31/27           | 1,400,000.000 | 1,288,070.000 |  |
| SPAIN 0.0 01/31/28           | 2,000,000.000 | 1,794,200.000 |  |
| SPAIN 0.0 05/31/25           | 1,800,000.000 | 1,724,713.200 |  |
| SPAIN 0.1 04/30/31           | 2,490,000.000 | 2,028,105.000 |  |
| SPAIN 0.5 04/30/30           | 2,200,000.000 | 1,905,222.000 |  |
| SPAIN 0.5 10/31/31           | 1,300,000.000 | 1,078,682.800 |  |
| SPAIN 0.6 10/31/29           | 2,310,000.000 | 2,038,637.370 |  |
| SPAIN 0.7 04/30/32           | 2,000,000.000 | 1,663,590.000 |  |
| SPAIN 0.8 07/30/27           | 1,300,000.000 | 1,215,890.000 |  |
| SPAIN 0.8 07/30/29           | 2,000,000.000 | 1,792,500.000 |  |
| SPAIN 0.85 07/30/37          | 1,060,000.000 | 764,248.340   |  |
| SPAIN 1.0 07/30/42           | 1,400,000.000 | 908,180.000   |  |
| SPAIN 1.0 10/31/50           | 1,710,000.000 | 926,300.160   |  |
| SPAIN 1.2 10/31/40           | 1,850,000.000 | 1,292,132.500 |  |
| SPAIN 1.25 10/31/30          | 1,800,000.000 | 1,619,460.000 |  |
| SPAIN 1.3 10/31/26           | 2,640,000.000 | 2,538,007.870 |  |
| SPAIN 1.4 04/30/28           | 2,600,000.000 | 2,460,283.800 |  |
| SPAIN 1.4 07/30/28           | 1,400,000.000 | 1,320,830.000 |  |
| SPAIN 1.45 04/30/29          | 1,130,000.000 | 1,057,116.130 |  |
| SPAIN 1.45 10/31/27          | 2,300,000.000 | 2,194,551.900 |  |
| SPAIN 1.45 10/31/71          | 550,000.000   | 265,352.840   |  |
| SPAIN 1.5 04/30/27           | 2,240,000.000 | 2,152,528.000 |  |
| SPAIN 1.6 04/30/25           | 1,500,000.000 | 1,470,705.000 |  |
| SPAIN 1.85 07/30/35          | 1,400,000.000 | 1,207,122.000 |  |

|         |                     |  |                                      |  |
|---------|---------------------|--|--------------------------------------|--|
|         | SPAIN 1.9 10/31/52  | 1,400,000.000                            | 937,022.800                          |  |
|         | SPAIN 1.95 04/30/26 | 1,640,000.000                            | 1,607,828.120                        |  |
|         | SPAIN 1.95 07/30/30 | 2,460,000.000                            | 2,326,016.100                        |  |
|         | SPAIN 2.15 10/31/25 | 2,050,000.000                            | 2,023,551.310                        |  |
|         | SPAIN 2.35 07/30/33 | 1,960,000.000                            | 1,832,600.000                        |  |
|         | SPAIN 2.55 10/31/32 | 1,400,000.000                            | 1,344,989.800                        |  |
|         | SPAIN 2.7 10/31/48  | 1,100,000.000                            | 918,066.600                          |  |
|         | SPAIN 2.8 05/31/26  | 1,100,000.000                            | 1,098,570.000                        |  |
|         | SPAIN 2.9 10/31/46  | 1,750,000.000                            | 1,534,921.500                        |  |
|         | SPAIN 3.15 04/30/33 | 1,400,000.000                            | 1,403,035.200                        |  |
|         | SPAIN 3.45 07/30/43 | 400,000.000                              | 385,847.980                          |  |
|         | SPAIN 3.45 07/30/66 | 640,000.000                              | 578,510.720                          |  |
|         | SPAIN 3.55 10/31/33 | 1,800,000.000                            | 1,855,080.000                        |  |
|         | SPAIN 3.9 07/30/39  | 500,000.000                              | 518,755.700                          |  |
|         | SPAIN 4.2 01/31/37  | 1,480,000.000                            | 1,606,871.520                        |  |
|         | SPAIN 4.65 07/30/25 | 1,900,000.000                            | 1,945,425.200                        |  |
|         | SPAIN 4.7 07/30/41  | 1,900,000.000                            | 2,168,652.400                        |  |
|         | SPAIN 4.9 07/30/40  | 1,330,000.000                            | 1,539,475.000                        |  |
|         | SPAIN 5.15 10/31/28 | 1,100,000.000                            | 1,215,720.000                        |  |
|         | SPAIN 5.15 10/31/44 | 1,100,000.000                            | 1,332,633.500                        |  |
|         | SPAIN 5.75 07/30/32 | 2,100,000.000                            | 2,528,120.700                        |  |
|         | SPAIN 5.9 07/30/26  | 1,950,000.000                            | 2,094,920.290                        |  |
|         | SPAIN 6.0 01/31/29  | 1,500,000.000                            | 1,726,323.000                        |  |
|         | ユーロ 小計              | 524,950,000.000<br>(83,892,259,500)      | 492,628,074.870<br>(78,726,892,645)  |  |
| 国債証券 合計 |                     | 262,084,531,237.600<br>(262,084,531,238) | 241,252,263,833<br>(241,252,263,833) |  |
| 合計      |                     |  | 241,252,263,833<br>(241,252,263,833) |  |

(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<br>時価比率<br>(%) | 有価証券の合計金額に<br>対する比率<br>(%) |
|-------------|------------|---------------------|----------------------------|
| アメリカ・ドル     | 国債証券 255銘柄 | 48.24               | 47.28                      |
| イギリス・ポンド    | 国債証券 56銘柄  | 5.40                | 5.29                       |
| イスラエル・シュケル  | 国債証券 13銘柄  | 0.31                | 0.31                       |
| オーストラリア・ドル  | 国債証券 27銘柄  | 1.43                | 1.40                       |
| オフショア・人民元   | 国債証券 42銘柄  | 7.98                | 7.82                       |
| カナダ・ドル      | 国債証券 39銘柄  | 2.08                | 2.03                       |
| シンガポール・ドル   | 国債証券 20銘柄  | 0.43                | 0.42                       |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 8銘柄   | 0.21                | 0.21                       |
| デンマーク・クローネ  | 国債証券 7銘柄   | 0.28                | 0.28                       |
| ニュージーランド・ドル | 国債証券 13銘柄  | 0.25                | 0.24                       |
| ノルウェー・クローネ  | 国債証券 10銘柄  | 0.18                | 0.18                       |
| ポーランド・ズロチ   | 国債証券 14銘柄  | 0.54                | 0.52                       |
| マレーシア・リンギット | 国債証券 28銘柄  | 0.54                | 0.53                       |

|         |      |       |       |       |
|---------|------|-------|-------|-------|
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 16銘柄  | 0.88  | 0.86  |
| ユーロ     | 国債証券 | 357銘柄 | 33.30 | 32.63 |

(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1月11日現在

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



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                      | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日   |
|-------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法      | <p>株式<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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1月11日現在     |
|---------------------------------------|------------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 136,103,425,952円 |
| 同期中追加設定元本額                            | 75,001,343,868円  |
| 同期中一部解約元本額                            | 50,297,350,399円  |

## 元本の内訳

## ファンド名

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

|   |                |
|---|----------------|
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)                        | 9,259,264円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)                        | 191,917,200円   |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>                          | 138,504,634円   |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                           | 989,801,396円   |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                          | 133,792,920円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)                        | 65,268,596円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)                        | 31,844,529円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)                        | 19,420,783円    |
| 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>                          | 136,030,164円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)                        | 4,592,602円     |
| Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>                   | 28,201,646円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)         | 209,356円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)         | 228,308円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)         | 92,290円        |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)         | 236,047円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)        | 446,629円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)         | 192,676円       |
| MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)       | 340,931,490円   |
| DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)               | 34,996,421円    |
| DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)                 | 1,105,981,067円 |
| DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)                  | 197,645,900円   |
| 外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)                     | 1,234,342,586円 |
| 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)                         | 312,798,526円   |
| AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定) | 768,989円       |
| DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)                   | 5,524,946円     |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)                | 351,579円       |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)      | 4,253,427円     |
| DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)             | 19,656,355円    |
| DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)             | 37,663,527円    |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)               | 1,470,764円     |
| DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)               | 8,966,412円     |
| DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)               | 964,562円       |
| DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)               | 29,957円        |
| DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)                 | 759,522円       |
| DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                 | 15,616,979円    |
| DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)                   | 108,374,161円   |
| DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)                 | 198,222,031円   |
| DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                   | 691,557,102円   |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)              | 30,683,582円    |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)             | 25,068,627円    |

|   |                  |
|---|------------------|
| D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定） | 170,764,485円     |
| D I A M世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）        | 5,515,438円       |
| D I A M世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）          | 136,121円         |
| D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）       | 62,876,119円      |
| D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）      | 4,834,053円       |
| D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）      | 22,042,352円      |
| D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）       | 38,465,370円      |
| D I A M世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）       | 76,368,544円      |
| 動的パッケージファンド<DC年金>                         | 14,184,867円      |
| コア資産形成ファンド                                | 7,538,079円       |
| たわらノーロード 先進国株式（為替ヘッジなし）<ラップ専用>            | 2,600,149,750円   |
| MHAM外国株式インデックスファンド                        | 133,704,647円     |
| たわらノーロード 先進国株式（為替ヘッジあり）<ラップ専用>            | 7,847,856円       |
| MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]                | 1,672,117,081円   |
| MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]               | 1,924,685,550円   |
| 計   | 160,807,419,421円 |
| 2. 受益権の総数                                 | 160,807,419,421口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

|                            |  |
|----------------------------|--|
| 2. 時価の算定方法                 | <p>(1)有価証券<br/>「（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<br/>「（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<br/>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1月11日現在              |  |
|----------|---------------------------|--|
|          | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） |  |
| 株式       | 124,819,979,161           |  |
| 投資信託受益証券 | 140,191,816               |  |
| 投資証券     | 598,051,207               |  |
| 合計       | 125,558,222,184           |  |

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

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

（注）時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### （1）株式

2024年1月11日現在

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

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

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

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

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

(注)

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

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

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2024年1月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                    | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日   |
|-----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 投資証券<br>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<br>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<br>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  |

(貸借対照表に関する注記)

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



|   |                |
|---|----------------|
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)                            | 235,440,168円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)                            | 453,743,560円   |
| 投資のソムリエ   | 6,261,256,526円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>   | 602,537,467円   |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>                               | 168,765,080円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                                   | 678,148,430円   |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                                    | 2,258,533,877円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)                                | 46,208,736円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)                                | 22,978,722円    |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)                                | 5,793,727円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)                                | 99,152,449円    |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                                   | 1,403,846,679円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                                  | 129,770,255円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)                                | 47,570,480円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)                                | 25,369,162円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)                                | 15,229,494円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)                                | 3,696,192円     |
| Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>                           | 56,079,857円    |
| Jリートインデックスファンド(DC)                                    | 69,423,108円    |
| MHAM J-REITインデックスファンド(隔月決算型)                          | 3,183,268円     |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)                 | 199,039,010円   |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)           | 86,229,198円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)                 | 199,624,459円   |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)                    | 52,555,443円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)                 | 119,806,100円   |
| 固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)          | 182,820,385円   |
| 低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)                    | 69,524,532円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定) | 167,408,522円   |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)                 | 176,121,495円   |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)                | 503,104,481円   |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)       | 53,734,511円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)       | 88,456,676円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)       | 61,944,545円    |
| 低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)             | 69,474,043円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)                 | 176,368,346円   |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)       | 61,798,967円    |

|  |                 |
|--|-----------------|
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-12(適格機関投資家限定)        | 89,119,425円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定) | 154,237,015円    |
| DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)                       | 3,092,073,429円  |
| 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)                                  | 195,919,180円    |
| AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)          | 68,303,470円     |
| 日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)              | 435,860,545円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)                         | 328,874,163円    |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)               | 2,685,782円      |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)               | 1,226,633,727円  |
| MHAM J-REITインデックスファンド DC年金                             | 7,485,723,749円  |
| MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)                           | 33,918,287,989円 |
| MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)                          | 2,487,789,805円  |
| たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>                                  | 3,131,452,050円  |
| 計  | 82,686,701,762円 |
| 2. 受益権の総数  | 82,686,701,762口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2024年1月11日現在 |
|----|--------------|
|----|--------------|

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

| 種類                 | 2024年1月11日現在  |     |  |               |            |
|--------------------|---------------|-----|--|---------------|------------|
|                    | 契約額等(円)       | うち  |  | 時価(円)         | 評価損益(円)    |
|                    |               | 1年超 |  |               |            |
| 市場取引<br>先物取引<br>買建 | 5,118,001,230 | -   |  | 5,149,742,500 | 31,741,270 |
| 合計                 | 5,118,001,230 | -   |  | 5,149,742,500 | 31,741,270 |

## (注)時価の算定方法

## 不動産投信指数先物取引

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

| 2024年1月11日現在 |  |
|--------------|--|
|--------------|--|

|                           |                             |
|---------------------------|-----------------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 2,360,200円<br>(23,602,000円) |
|---------------------------|-----------------------------|

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

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

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

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2024年1月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                      | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1月11日  |
|-------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法      | <p>投資信託受益証券<br/>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<br/>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>為替予約取引<br/>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<br/>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<br/>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1月11日現在    |
|---------------------------------------|-----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 41,342,647,392円 |
| 同期中追加設定元本額                            | 51,126,172,202円 |
| 同期中一部解約元本額                            | 47,483,120,880円 |
| 元本の内訳                                 |                 |
| ファンド名                                 |                 |
| たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞       | 2,323,537,268円  |
| たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞       | 21,330,884円     |
| MITO ラップ型ファンド（安定型）                    | 3,391,032円      |
| MITO ラップ型ファンド（中立型）                    | 13,821,536円     |
| MITO ラップ型ファンド（積極型）                    | 35,518,263円     |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型）                  | 47,105,546円     |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型）                  | 42,759,959円     |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型）                  | 30,255,467円     |
| たわらノーロード 先進国リート                       | 14,977,569,054円 |
| たわらノーロード 先進国リート＜ラップ向け＞                | 1,610,081,413円  |
| たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞              | 312,413,276円    |
| たわらノーロード バランス（8資産均等型）                 | 3,933,058,648円  |
| たわらノーロード バランス（堅実型）                    | 27,315,784円     |
| たわらノーロード バランス（標準型）                    | 590,193,052円    |
| たわらノーロード バランス（積極型）                    | 1,274,081,511円  |

|   |                |
|---|----------------|
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)                   | 1,255,966円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)                 | 590,630,209円   |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)                   | 587,476,518円   |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)                   | 1,011,635,692円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型)                         | 523,451円       |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)                       | 40,242,973円    |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型)                         | 8,301,357円     |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型)                         | 27,670,846円    |
| One DC 先進国リートインデックスファンド                       | 1,816,302,161円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>                          | 18,120,531円    |
| マネックス資産設計ファンド<育成型>                            | 690,441,854円   |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション                        | 75,897,601円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)                    | 208,424,756円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)                    | 313,572,673円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)                    | 584,314,104円   |
| 投資のソムリエ                                       | 6,635,929,025円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>                                 | 638,247,483円   |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>                       | 224,486,292円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                           | 718,519,096円   |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                            | 2,391,465,106円 |
| ワールドアセットバランス(基本コース)                           | 306,471,994円   |
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)                        | 653,565,055円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)                        | 44,898,926円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)                        | 22,666,588円    |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)                        | 6,141,422円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)                        | 123,389,850円   |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                          | 169,790,603円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)                        | 43,907,830円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)                        | 24,586,973円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)                        | 14,995,943円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)                        | 3,543,871円     |
| Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>                   | 74,209,308円    |
| DIAMパッシブ資産分散ファンド                              | 275,542,143円   |
| DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>                     | 356,306,846円   |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)         | 217,802円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)         | 647,540円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)         | 125,270円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)         | 285,547円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)        | 711,941円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)         | 506,310円       |
| 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)                         | 207,457,098円   |
| AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定) | 1,865,358円     |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)                | 572,716円       |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)      | 2,887,159円     |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)               | 44,551,137円    |



|   |                 |
|---|-----------------|
| 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 )      | 126,783,242円    |
| D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド( 適格機関投資家限定 ) | 653,179,855円    |
| 計   | 44,985,698,714円 |
| 2. 受益権の総数                                     | 44,985,698,714口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年6月23日から2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

| 種類                  | 2024年1月11日現在 |           |            |         |
|---------------------|--------------|-----------|------------|---------|
|                     | 契約額等（円）      | うち<br>1年超 | 時価（円）      | 評価損益（円） |
|                     |              |           |            |         |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |              |           |            |         |
| 売建                  | 86,001,940   | -         | 86,192,320 | 190,380 |
| アメリカ・ドル             | 58,247,440   | -         | 58,250,920 | 3,480   |
| 香港・ドル               | 27,754,500   | -         | 27,941,400 | 186,900 |
| 買建                  | 3,266,232    | -         | 3,266,235  | 3       |
| カナダ・ドル              | 3,266,232    | -         | 3,266,235  | 3       |
| 合計                  | 89,268,172   | -         | 89,458,555 | 190,377 |

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

(注)

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

| 通貨          | 銘柄数                        | 組入<br>投資信託受益証券<br>時価比率<br>(%) | 組入<br>投資証券<br>時価比率<br>(%) | 有価証券の合計金額に<br>対する比率<br>(%) |
|-------------|----------------------------|-------------------------------|---------------------------|----------------------------|
| アメリカ・ドル     | 投資信託受益証券 5銘柄<br>投資証券 135銘柄 | 0.08                          | -                         | 78.01                      |
| イギリス・ポンド    | 投資証券 38銘柄                  | -                             | 4.90                      | 4.93                       |
| イスラエル・シケル   | 投資証券 3銘柄                   | -                             | 0.12                      | 0.12                       |
| オーストラリア・ドル  | 投資信託受益証券 31銘柄              | 6.62                          | -                         | 6.67                       |
| カナダ・ドル      | 投資証券 26銘柄                  | -                             | 1.51                      | 1.52                       |
| シンガポール・ドル   | 投資信託受益証券 22銘柄              | 3.27                          | -                         | 3.30                       |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 4銘柄                   | -                             | 0.29                      | 0.29                       |
| ユーロ         | 投資信託受益証券 1銘柄<br>投資証券 27銘柄  | 0.03                          | -                         | 3.79                       |
| 韓国・ウォン      | 投資証券 8銘柄                   | -                             | 0.17                      | 0.18                       |
| 香港・ドル       | 投資信託受益証券 1銘柄<br>投資証券 5銘柄   | 0.07                          | -                         | 1.18                       |

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2024年1月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                      | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1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. 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1月11日現在    |
|--|-----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額    | 64,251,853,316円 |
| 同期中追加設定元本額                               | 59,289,656,733円 |
| 同期中一部解約元本額                               | 80,432,880,771円 |
| 元本の内訳                                    |                 |
| ファンド名                                    |                 |
| D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ） | 84,978,240円     |
| たわらノーロード バランス（8資産均等型）                    | 3,138,545,187円  |
| たわらノーロード バランス（堅実型）                       | 190,962,852円    |
| たわらノーロード バランス（標準型）                       | 593,695,880円    |
| たわらノーロード バランス（積極型）                       | 269,849,763円    |
| たわらノーロード 最適化バランス（保守型）                    | 479,249円        |
| たわらノーロード 最適化バランス（安定型）                    | 4,873,130円      |
| たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）                  | 67,873,716円     |
| たわらノーロード 最適化バランス（成長型）                    | 5,090,952円      |
| たわらノーロード 最適化バランス（積極型）                    | 7,769,887円      |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション                   | 66,803,835円     |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）           | 271,810,079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）           | 794,325,757円    |
| 投資のソムリエ                                  | 13,214,442,947円 |
| クルーズコントロール                               | 339,862,214円    |
| 投資のソムリエ<DC年金>                            | 1,271,156,358円  |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>               | 308,073,145円    |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                      | 1,430,371,755円  |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                       | 4,762,496,820円  |
| ワールドアセットバランス（基本コース）                      | 365,283,783円    |
| ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）                   | 790,241,150円    |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）                   | 64,820,223円     |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）                   | 32,817,248円     |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）                   | 12,230,676円     |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）                   | 243,947,771円    |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                      | 897,164,068円    |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                     | 226,950,242円    |

|  |                 |
|--|-----------------|
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)                   | 94,125,468円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)                   | 35,579,539円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)                   | 21,721,137円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)                   | 5,181,361円      |
| Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>              | 2,110,115円      |
| Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>              | 20,715,333円     |
| エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)                | 9,091,771,409円  |
| 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)                    | 413,316,399円    |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)             | 523,182,615円    |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド2(適格機関投資家限定)            | 140,152,539円    |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) | 5,634,922円      |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)         | 107,045,267円    |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)         | 65,487,134円     |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定) | 2,716,131,537円  |
| 計  | 43,108,629,278円 |
| 2. 受益権の総数                                | 43,108,629,278口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 2. 時価の算定方法                 | <p>(1)有価証券<br/>「(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<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品<br/>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1月11日現在              |  |
|------|---------------------------|--|
|      | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) |  |
| 国債証券 | 2,776,193,749             |  |
| 合計   | 2,776,193,749             |  |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

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



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

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

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

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

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

(注)

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

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

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年1月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                      | 自 2023年1月12日<br>至 2024年1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1月11日現在    |
|---------------------------------------|-----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 70,027,488,260円 |
| 同期中追加設定元本額                            | 39,372,022,356円 |
| 同期中一部解約元本額                            | 54,889,521,701円 |
| 元本の内訳                                 |                 |
| ファンド名                                 |                 |
| D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>          | 9,894,562,328円  |
| たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>                 | 3,636,883,728円  |
| M I T O ラップ型ファンド(安定型)                 | 2,658,232円      |
| M I T O ラップ型ファンド(中立型)                 | 10,819,533円     |

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

2. 受益権の総数

54,509,988,915口



## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

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

## 2．金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

#### 通貨関連

| 種類                  | 2024年1月11日現在  |           |               |            |
|---------------------|---------------|-----------|---------------|------------|
|                     | 契約額等（円）       | うち<br>1年超 | 時価（円）         | 評価損益（円）    |
|                     |               |           |               |            |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |               |           |               |            |
| 売建                  | 4,352,785,647 | -         | 4,384,646,327 | 31,860,680 |
| アメリカ・ドル             | 2,205,214,104 | -         | 2,219,214,424 | 14,000,320 |
| インド・ルピー             | 700,000,000   | -         | 708,000,000   | 8,000,000  |
| インドネシア・ルピア          | 83,700,000    | -         | 84,600,000    | 900,000    |
| タイ・バーツ              | 103,250,000   | -         | 103,992,500   | 742,500    |
| フィリピン・ペソ            | 25,822,000    | -         | 25,879,000    | 57,000     |
| ブラジル・レアル            | 1,886,333     | -         | 1,903,543     | 17,210     |
| マレーシア・リングギット        | 52,848,410    | -         | 53,338,860    | 490,450    |
| 韓国・ウォン              | 537,040,000   | -         | 542,430,000   | 5,390,000  |
| 台湾・ドル               | 643,024,800   | -         | 645,288,000   | 2,263,200  |
| 買建                  | 2,147,571,543 | -         | 2,155,997,518 | 8,425,975  |
| アメリカ・ドル             | 2,147,571,543 | -         | 2,155,997,518 | 8,425,975  |
| 合計                  | 6,500,357,190 | -         | 6,540,643,845 | 23,434,705 |

（注）時価の算定方法

#### 為替予約取引

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

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

## (注) 時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

|                           | 2024年1月11日現在         |
|---------------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1,5407円<br>(15,407円) |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2024年1月11日現在

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

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

(1,071,260,080)

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

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



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

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

(注)

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

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

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

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(2024年1月12日から2024年7月11日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第5期<br>2024年1月11日現在 | 第6期中間計算期間末<br>2024年7月11日現在 |
|-----------------|---------------------|----------------------------|
| 資産の部            |                     |                            |
| 流動資産            |                     |                            |
| コール・ローン         | 78,568,234          | 205,807,078                |
| 親投資信託受益証券       | 2,748,421,879       | 3,175,337,914              |
| 派生商品評価勘定        | 783,617             | 9,428,182                  |
| 流動資産合計          | 2,827,773,730       | 3,390,573,174              |
| 資産合計            | 2,827,773,730       | 3,390,573,174              |
| 負債の部            |                     |                            |
| 流動負債            |                     |                            |
| 派生商品評価勘定        | 4,419,615           | 45,152,321                 |
| 未払解約金           | 2,997,253           | 7,827,239                  |
| 未払受託者報酬         | 429,007             | 494,533                    |
| 未払委託者報酬         | 10,297,261          | 11,869,847                 |
| その他未払費用         | 50,822              | 58,601                     |
| 流動負債合計          | 18,193,958          | 65,402,541                 |
| 負債合計            | 18,193,958          | 65,402,541                 |
| 純資産の部           |                     |                            |
| 元本等             |                     |                            |
| 元本              | 2,628,607,918       | 2,967,225,640              |
| 剰余金             |                     |                            |
| 中間剰余金又は中間欠損金( ) | 180,971,854         | 357,944,993                |
| (分配準備積立金)       | 77,585,568          | 71,545,139                 |
| 元本等合計           | 2,809,579,772       | 3,325,170,633              |
| 純資産合計           | 2,809,579,772       | 3,325,170,633              |
| 負債純資産合計         | 2,827,773,730       | 3,390,573,174              |

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

|   | 第5期中間計算期間<br>自 2023年1月12日<br>至 2023年7月11日 | 第6期中間計算期間<br>自 2024年1月12日<br>至 2024年7月11日 |
|---|---|---|
| <b>営業収益</b>                               |   |   |
| 受取利息                                      | 264                                       | 38,479                                    |
| 有価証券売買等損益                                 | 96,661,365                                | 227,806,035                               |
| 為替差損益                                     | 37,307,082                                | 69,210,042                                |
| <b>営業収益合計</b>                             | <b>59,354,547</b>                         | <b>158,634,472</b>                        |
| <b>営業費用</b>                               |   |   |
| 支払利息                                      | 14,306                                    | 1,153                                     |
| 受託者報酬                                     | 357,109                                   | 494,533                                   |
| 委託者報酬                                     | 8,571,778                                 | 11,869,847                                |
| その他費用                                     | 42,287                                    | 831,681                                   |
| <b>営業費用合計</b>                             | <b>8,985,480</b>                          | <b>13,197,214</b>                         |
| 営業利益又は営業損失( )                             | 50,369,067                                | 145,437,258                               |
| 経常利益又は経常損失( )                             | 50,369,067                                | 145,437,258                               |
| 中間純利益又は中間純損失( )                           | 50,369,067                                | 145,437,258                               |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( ) | 1,838,539                                 | 3,941,098                                 |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           | 22,611,350                                | 180,971,854                               |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 12,960,934                                | 51,230,842                                |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | -   | -   |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 12,960,934                                | 51,230,842                                |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 1,473,932                                 | 15,753,863                                |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 1,473,932                                 | 15,753,863                                |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | -   | -   |
| 分配金                                       | -   | -   |
| 中間剰余金又は中間欠損金( )                           | 82,628,880                                | 357,944,993                               |

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                    | 第6期中間計算期間   |              |
|-----------------------|---|--------------|
|                       | 自 2024年1月12日  | 至 2024年7月11日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |              |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>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。                            |              |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 項目        | 第5期            | 第6期中間計算期間末     |
|-----------|----------------|----------------|
|           | 2024年1月11日現在   | 2024年7月11日現在   |
| 1. 期首元本額  | 1,969,476,149円 | 2,628,607,918円 |
| 期中追加設定元本額 | 937,776,215円   | 562,810,865円   |
| 期中一部解約元本額 | 278,644,446円   | 224,193,143円   |
| 2. 受益権の総数 | 2,628,607,918口 | 2,967,225,640口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                     | 第5期  | 第6期中間計算期間末   |
|------------------------|--|--|
|                        | 2024年1月11日現在   | 2024年7月11日現在   |
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。   | 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。 |
| 2. 時価の算定方法             | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「(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。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |
|----------------------------|---|----|

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

| 種類                  | 第5期<br>2024年1月11日現在 |           |             |           |
|---------------------|---------------------|-----------|-------------|-----------|
|                     | 契約額等（円）             | うち<br>1年超 | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|                     |                     |           |             |           |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                     |           |             |           |
| 売建                  | 619,552,428         | -         | 623,479,077 | 3,926,649 |
| アメリカ・ドル             | 55,177,357          | -         | 55,108,650  | 68,707    |
| イギリス・ポンド            | 223,929,152         | -         | 226,315,249 | 2,386,097 |
| オーストラリア・ドル          | 84,955,356          | -         | 86,184,142  | 1,228,786 |
| カナダ・ドル              | 40,762,506          | -         | 40,960,819  | 198,313   |
| ユーロ                 | 214,728,057         | -         | 214,910,217 | 182,160   |
| 買建                  | 74,348,035          | -         | 74,638,686  | 290,651   |
| アメリカ・ドル             | 13,116,098          | -         | 13,005,931  | 110,167   |
| イギリス・ポンド            | 28,915,731          | -         | 29,194,224  | 278,493   |
| オーストラリア・ドル          | 1,538,833           | -         | 1,546,645   | 7,812     |
| カナダ・ドル              | 27,490,485          | -         | 27,581,658  | 91,173    |
| ユーロ                 | 3,286,888           | -         | 3,310,228   | 23,340    |
| 合計                  | 693,900,463         | -         | 698,117,763 | 3,635,998 |

| 種類                  | 第6期中間計算期間末<br>2024年7月11日現在 |           |             |            |
|---------------------|----------------------------|-----------|-------------|------------|
|                     | 契約額等（円）                    | うち<br>1年超 | 時価（円）       | 評価損益（円）    |
|                     |                            |           |             |            |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                            |           |             |            |
| 売建                  | 769,156,200                | -         | 814,308,521 | 45,152,321 |
| アメリカ・ドル             | 81,971,749                 | -         | 85,844,361  | 3,872,612  |
| イギリス・ポンド            | 257,830,742                | -         | 276,912,905 | 19,082,163 |
| オーストラリア・ドル          | 83,352,340                 | -         | 88,970,395  | 5,618,055  |
| カナダ・ドル              | 48,483,418                 | -         | 50,981,384  | 2,497,966  |
| ユーロ                 | 297,517,951                | -         | 311,599,476 | 14,081,525 |
| 買建                  | 261,305,535                | -         | 270,733,717 | 9,428,182  |
| アメリカ・ドル             | 19,973,191                 | -         | 20,668,916  | 695,725    |
| イギリス・ポンド            | 122,532,535                | -         | 127,813,912 | 5,281,377  |
| オーストラリア・ドル          | 6,289,189                  | -         | 6,582,353   | 293,164    |
| カナダ・ドル              | 33,888,676                 | -         | 34,613,925  | 725,249    |

|     |               |   |               |            |
|-----|---------------|---|---------------|------------|
| ユーロ | 78,621,944    | - | 81,054,611    | 2,432,667  |
| 合計  | 1,030,461,735 | - | 1,085,042,238 | 35,724,139 |

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

|              | 第5期<br>2024年1月11日現在 | 第6期中間計算期間末<br>2024年7月11日現在 |
|--------------|---------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.0688円             | 1.1206円                    |
| (1万口当たり純資産額) | (10,688円)           | (11,206円)                  |



## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第5期<br>2024年1月11日現在 | 第6期中間計算期間末<br>2024年7月11日現在 |
|-----------------|---------------------|----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                            |
| 流動資産            |                     |                            |
| コール・ローン         | 31,531,881          | 50,518,525                 |
| 親投資信託受益証券       | 1,312,956,319       | 1,633,480,416              |
| 派生商品評価勘定        | 425,372             | 3,831,544                  |
| 流動資産合計          | 1,344,913,572       | 1,687,830,485              |
| 資産合計            | 1,344,913,572       | 1,687,830,485              |
| <b>負債の部</b>     |                     |                            |
| 流動負債            |                     |                            |
| 派生商品評価勘定        | 1,437,625           | 10,595,767                 |
| 未払解約金           | 374,925             | 5,268,043                  |
| 未払受託者報酬         | 201,197             | 241,097                    |
| 未払委託者報酬         | 5,366,508           | 6,430,404                  |
| その他未払費用         | 23,786              | 28,525                     |
| 流動負債合計          | 7,404,041           | 22,563,836                 |
| 負債合計            | 7,404,041           | 22,563,836                 |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                            |
| 元本等             |                     |                            |
| 元本              | 1,239,961,982       | 1,433,172,437              |
| 剰余金             |                     |                            |
| 中間剰余金又は中間欠損金( ) | 97,547,549          | 232,094,212                |
| (分配準備積立金)       | 35,992,645          | 33,378,375                 |
| 元本等合計           | 1,337,509,531       | 1,665,266,649              |
| 純資産合計           | 1,337,509,531       | 1,665,266,649              |
| 負債純資産合計         | 1,344,913,572       | 1,687,830,485              |

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

|   | 第5期中間計算期間<br>自 2023年1月12日<br>至 2023年7月11日 | 第6期中間計算期間<br>自 2024年1月12日<br>至 2024年7月11日 |
|---|---|---|
| <b>営業収益</b>                               |   |   |
| 受取利息                                      | 143                                       | 13,299                                    |
| 有価証券売買等損益                                 | 47,981,523                                | 131,384,097                               |
| 為替差損益                                     | 15,834,020                                | 12,011,291                                |
| <b>営業収益合計</b>                             | <b>32,147,646</b>                         | <b>119,386,105</b>                        |
| <b>営業費用</b>                               |   |   |
| 支払利息                                      | 7,011                                     | 504                                       |
| 受託者報酬                                     | 162,164                                   | 241,097                                   |
| 委託者報酬                                     | 4,325,506                                 | 6,430,404                                 |
| その他費用                                     | 19,168                                    | 443,485                                   |
| <b>営業費用合計</b>                             | <b>4,513,849</b>                          | <b>7,115,490</b>                          |
| 営業利益又は営業損失( )                             | 27,633,797                                | 112,270,615                               |
| 経常利益又は経常損失( )                             | 27,633,797                                | 112,270,615                               |
| 中間純利益又は中間純損失( )                           | 27,633,797                                | 112,270,615                               |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( ) | 978,267                                   | 2,978,164                                 |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           | 9,634,920                                 | 97,547,549                                |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 7,464,872                                 | 33,307,504                                |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | -   | -   |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 7,464,872                                 | 33,307,504                                |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 597,941                                   | 8,053,292                                 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 597,941                                   | 8,053,292                                 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | -   | -   |
| 分配金                                       | -   | -   |
| 中間剰余金又は中間欠損金( )                           | 43,157,381                                | 232,094,212                               |

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                    | 第6期中間計算期間   |              |
|-----------------------|---|--------------|
|                       | 自 2024年1月12日  | 至 2024年7月11日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |              |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>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。                            |              |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 項目        | 第5期            | 第6期中間計算期間末     |
|-----------|----------------|----------------|
|           | 2024年1月11日現在   | 2024年7月11日現在   |
| 1. 期首元本額  | 871,056,393円   | 1,239,961,982円 |
| 期中追加設定元本額 | 493,442,158円   | 292,691,276円   |
| 期中一部解約元本額 | 124,536,569円   | 99,480,821円    |
| 2. 受益権の総数 | 1,239,961,982口 | 1,433,172,437口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                     | 第5期  | 第6期中間計算期間末   |
|------------------------|--|--|
|                        | 2024年1月11日現在   | 2024年7月11日現在   |
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。   | 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。 |
| 2. 時価の算定方法             | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「(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。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |
|----------------------------|---|----|

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

| 種類                  | 第5期<br>2024年1月11日現在 |     |             |           |
|---------------------|---------------------|-----|-------------|-----------|
|                     | 契約額等（円）             | うち  |             | 時価（円）     |
|                     |                     | 1年超 |             |           |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                     |     |             |           |
| 売建                  | 198,380,634         | -   | 199,591,076 | 1,210,442 |
| アメリカ・ドル             | 19,042,472          | -   | 18,973,017  | 69,455    |
| イギリス・ポンド            | 76,803,043          | -   | 77,426,553  | 623,510   |
| オーストラリア・ドル          | 38,710,906          | -   | 39,269,230  | 558,324   |
| カナダ・ドル              | 12,468,757          | -   | 12,534,162  | 65,405    |
| ユーロ                 | 51,355,456          | -   | 51,388,114  | 32,658    |
| 買建                  | 52,666,210          | -   | 52,864,399  | 198,189   |
| アメリカ・ドル             | 6,134,478           | -   | 6,082,952   | 51,526    |
| イギリス・ポンド            | 17,100,701          | -   | 17,265,401  | 164,700   |
| オーストラリア・ドル          | 5,748,850           | -   | 5,778,034   | 29,184    |
| カナダ・ドル              | 12,492,328          | -   | 12,534,162  | 41,834    |
| ユーロ                 | 11,189,853          | -   | 11,203,850  | 13,997    |
| 合計                  | 251,046,844         | -   | 252,455,475 | 1,012,253 |

| 種類                  | 第6期中間計算期間末<br>2024年7月11日現在 |     |             |            |
|---------------------|----------------------------|-----|-------------|------------|
|                     | 契約額等（円）                    | うち  |             | 時価（円）      |
|                     |                            | 1年超 |             |            |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                            |     |             |            |
| 売建                  | 179,122,164                | -   | 189,717,931 | 10,595,767 |
| アメリカ・ドル             | 16,228,277                 | -   | 17,001,590  | 773,313    |
| イギリス・ポンド            | 81,055,317                 | -   | 87,043,362  | 5,988,045  |
| オーストラリア・ドル          | 43,874,536                 | -   | 46,402,335  | 2,527,799  |
| ユーロ                 | 37,964,034                 | -   | 39,270,644  | 1,306,610  |
| 買建                  | 104,449,931                | -   | 108,281,475 | 3,831,544  |
| アメリカ・ドル             | 8,673,183                  | -   | 8,975,296   | 302,113    |
| イギリス・ポンド            | 68,073,173                 | -   | 70,660,676  | 2,587,503  |
| オーストラリア・ドル          | 5,407,042                  | -   | 5,659,086   | 252,044    |
| ユーロ                 | 22,296,533                 | -   | 22,986,417  | 689,884    |
| 合計                  | 283,572,095                | -   | 297,999,406 | 6,764,223  |

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

|              | 第5期<br>2024年1月11日現在 | 第6期中間計算期間末<br>2024年7月11日現在 |
|--------------|---------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.0787円             | 1.1619円                    |
| (1万口当たり純資産額) | (10,787円)           | (11,619円)                  |

## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第5期<br>2024年1月11日現在 | 第6期中間計算期間末<br>2024年7月11日現在 |
|-----------------|---------------------|----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                            |
| 流動資産            |                     |                            |
| コール・ローン         | 22,581,594          | 23,750,205                 |
| 親投資信託受益証券       | 799,863,567         | 1,016,075,818              |
| 派生商品評価勘定        | 299,742             | 2,347,119                  |
| 流動資産合計          | 822,744,903         | 1,042,173,142              |
| 資産合計            | 822,744,903         | 1,042,173,142              |
| <b>負債の部</b>     |                     |                            |
| 流動負債            |                     |                            |
| 派生商品評価勘定        | 982,083             | 6,516,924                  |
| 未払解約金           | 2,761,658           | 540,035                    |
| 未払受託者報酬         | 123,024             | 148,467                    |
| 未払委託者報酬         | 3,281,733           | 3,960,193                  |
| その他未払費用         | 14,506              | 17,528                     |
| 流動負債合計          | 7,163,004           | 11,183,147                 |
| 負債合計            | 7,163,004           | 11,183,147                 |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                            |
| 元本等             |                     |                            |
| 元本              | 758,584,463         | 889,942,427                |
| 剰余金             |                     |                            |
| 中間剰余金又は中間欠損金( ) | 56,997,436          | 141,047,568                |
| (分配準備積立金)       | 22,954,931          | 20,819,026                 |
| 元本等合計           | 815,581,899         | 1,030,989,995              |
| 純資産合計           | 815,581,899         | 1,030,989,995              |
| 負債純資産合計         | 822,744,903         | 1,042,173,142              |

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

|   | 第5期中間計算期間<br>自 2023年1月12日<br>至 2023年7月11日 | 第6期中間計算期間<br>自 2024年1月12日<br>至 2024年7月11日 |
|---|---|---|
| <b>営業収益</b>                               |   |   |
| 受取利息                                      | 82  | 8,249                                     |
| 有価証券売買等損益                                 | 28,920,285                                | 81,232,251                                |
| 為替差損益                                     | 9,564,835                                 | 7,398,688                                 |
| <b>営業収益合計</b>                             | <b>19,355,532</b>                         | <b>73,841,812</b>                         |
| <b>営業費用</b>                               |   |   |
| 支払利息                                      | 3,877                                     | 283                                       |
| 受託者報酬                                     | 98,591                                    | 148,467                                   |
| 委託者報酬                                     | 2,630,197                                 | 3,960,193                                 |
| その他費用                                     | 11,620                                    | 432,488                                   |
| <b>営業費用合計</b>                             | <b>2,744,285</b>                          | <b>4,541,431</b>                          |
| 営業利益又は営業損失( )                             | 16,611,247                                | 69,300,381                                |
| 経常利益又は経常損失( )                             | 16,611,247                                | 69,300,381                                |
| 中間純利益又は中間純損失( )                           | 16,611,247                                | 69,300,381                                |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( ) | 860,656                                   | 2,730,031                                 |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           | 4,473,038                                 | 56,997,436                                |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 4,787,043                                 | 23,858,759                                |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | -   | -   |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 4,787,043                                 | 23,858,759                                |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 446,393                                   | 6,378,977                                 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 446,393                                   | 6,378,977                                 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | -   | -   |
| 分配金                                       | -   | -   |
| 中間剰余金又は中間欠損金( )                           | 24,564,279                                | 141,047,568                               |

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                    | 第6期中間計算期間   |              |
|-----------------------|---|--------------|
|                       | 自 2024年1月12日  | 至 2024年7月11日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |              |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>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。                            |              |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 項目        | 第5期          | 第6期中間計算期間末   |
|-----------|--------------|--------------|
|           | 2024年1月11日現在 | 2024年7月11日現在 |
| 1. 期首元本額  | 538,710,567円 | 758,584,463円 |
| 期中追加設定元本額 | 324,667,141円 | 212,269,021円 |
| 期中一部解約元本額 | 104,793,245円 | 80,911,057円  |
| 2. 受益権の総数 | 758,584,463口 | 889,942,427口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                     | 第5期  | 第6期中間計算期間末   |
|------------------------|--|--|
|                        | 2024年1月11日現在   | 2024年7月11日現在   |
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。   | 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。 |
| 2. 時価の算定方法             | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「(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。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |
|----------------------------|---|----|

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

| 種類                  | 第5期<br>2024年1月11日現在 |           |             |         |
|---------------------|---------------------|-----------|-------------|---------|
|                     | 契約額等（円）             | うち<br>1年超 | 時価（円）       | 評価損益（円） |
|                     |                     |           |             |         |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                     |           |             |         |
| 売建                  |                     |           |             |         |
| アメリカ・ドル             | 125,553,048         | -         | 126,398,490 | 845,442 |
| イギリス・ポンド            | 11,613,981          | -         | 11,572,092  | 41,889  |
| オーストラリア・ドル          | 49,278,761          | -         | 49,709,582  | 430,821 |
| カナダ・ドル              | 24,759,100          | -         | 25,125,691  | 366,591 |
| ユーロ                 | 7,565,313           | -         | 7,604,997   | 39,684  |
| 買建                  |                     |           |             |         |
| アメリカ・ドル             | 32,335,893          | -         | 32,386,128  | 50,235  |
| イギリス・ポンド            | 36,783,255          | -         | 36,946,356  | 163,101 |
| オーストラリア・ドル          | 3,724,504           | -         | 3,693,221   | 31,283  |
| カナダ・ドル              | 12,912,401          | -         | 13,036,763  | 124,362 |
| ユーロ                 | 4,693,927           | -         | 4,717,755   | 23,828  |
| 合計                  | 7,579,619           | -         | 7,604,996   | 25,377  |
|                     | 7,872,804           | -         | 7,893,621   | 20,817  |
| 合計                  | 162,336,303         | -         | 163,344,846 | 682,341 |

| 種類                  | 第6期中間計算期間末<br>2024年7月11日現在 |           |             |           |
|---------------------|----------------------------|-----------|-------------|-----------|
|                     | 契約額等（円）                    | うち<br>1年超 | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|                     |                            |           |             |           |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                            |           |             |           |
| 売建                  |                            |           |             |           |
| アメリカ・ドル             | 110,767,375                | -         | 117,284,299 | 6,516,924 |
| イギリス・ポンド            | 9,979,521                  | -         | 10,455,093  | 475,572   |
| オーストラリア・ドル          | 49,635,132                 | -         | 53,305,785  | 3,670,653 |
| ユーロ                 | 27,527,218                 | -         | 29,088,354  | 1,561,136 |
| 買建                  |                            |           |             |           |
| アメリカ・ドル             | 23,625,504                 | -         | 24,435,067  | 809,563   |
| イギリス・ポンド            | 63,884,527                 | -         | 66,231,646  | 2,347,119 |
| オーストラリア・ドル          | 5,346,908                  | -         | 5,533,157   | 186,249   |
| ユーロ                 | 41,425,368                 | -         | 43,004,551  | 1,579,183 |
| 合計                  | 3,331,402                  | -         | 3,486,692   | 155,290   |
|                     | 13,780,849                 | -         | 14,207,246  | 426,397   |
| 合計                  | 174,651,902                | -         | 183,515,945 | 4,169,805 |

## （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はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

|                           | 第5期<br>2024年1月11日現在  | 第6期中間計算期間末<br>2024年7月11日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1,0751円<br>(10,751円) | 1,1585円<br>(11,585円)       |

## （参考）

「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）」、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）」、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）」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、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「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ており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・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<br>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<br>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)

## 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。 |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| 2024年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) |

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<br>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<br>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<br>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<br>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)

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 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<br>先物取引<br>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。

## (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    | 5.1707円      |
| (1万口当たり純資産額) | (51,707円)    |

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
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          | 1,560,791       |
| コール・ローン     | 952,055,536     |
| 国債証券        | 249,425,287,602 |
| 未収入金        | 410,513,907     |
| 未収利息        | 981,204,676     |
| 前払費用        | 1,153,581,385   |
| 流動資産合計      | 252,924,203,897 |
| 資産合計        | 252,924,203,897 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 2,837,068,877   |
| 未払金         | 6,250,887       |
| 未払解約金       | 464,859,000     |
| 流動負債合計      | 3,308,178,764   |
| 負債合計        | 3,308,178,764   |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 216,417,983,353 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 33,198,041,780  |
| 元本等合計       | 249,616,025,133 |
| 純資産合計       | 249,616,025,133 |
| 負債純資産合計     | 252,924,203,897 |

## 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<br>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<br>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<br>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<br>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 | 200,817,570,221円 |
| 同期中追加設定元本額                            | 303,900,733,809円 |
| 同期中一部解約元本額                            | 288,300,320,677円 |
| 元本の内訳                                 |                  |
| ファンド名                                 |                  |
| たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>               | 13,744,119,174円  |
| たわらノーロード バランス(堅実型)                    | 1,641,449,976円   |
| たわらノーロード バランス(標準型)                    | 5,181,147,751円   |
| たわらノーロード バランス(積極型)                    | 2,894,000,640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)           | 45,510,968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)           | 1,657,964,394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)         | 1,766,250,431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)           | 100,253,525円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)           | 173,393円         |
| たわらノーロード 最適化バランス(保守型)                 | 1,572,380円       |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型)                 | 17,070,260円      |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)               | 171,845,161円     |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型)                 | 8,978,047円       |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型)                 | 91,804円          |
| 投資のソムリエ                               | 76,165,776,743円  |
| 投資のソムリエ<DC年金>                         | 8,308,218,059円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                   | 11,662,020,290円  |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                    | 35,007,388,470円  |
| ワールドアセットバランス(基本コース)                   | 1,730,651,620円   |
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)                | 5,290,408,773円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)                | 672,995,744円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)                | 347,131,581円     |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)                | 108,999,581円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)                | 1,812,593,447円   |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                   | 13,139,280,422円  |

|  |                  |
|--|------------------|
| 9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>                    | 6,910,020,001円   |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）                   | 714,033,403円     |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）                   | 371,771,089円     |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）                   | 226,629,730円     |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）                   | 57,645,596円      |
| Oneグローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>              | 6,486,083円       |
| 外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）        | 18,115,883,421円  |
| 先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）        | 5,252,978,442円   |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）                    | 1,252,057,960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） | 42,772,857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）         | 337,812,007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）        | 30,124,275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）        | 266,454,448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）         | 505,089,033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）         | 852,332,374円     |
| 計  | 216,417,983,353円 |
| 2. 受益権の総数                                | 216,417,983,353口 |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

| 種類        | 2024年7月11日現在 |           |       |         |
|-----------|--------------|-----------|-------|---------|
|           | 契約額等（円）      | うち<br>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          | 246,169,101,084 | - | 249,006,169,961 | 2,837,068,877 |
| アメリカ・ドル     | 116,857,221,274 | - | 117,648,000,860 | 790,779,586   |
| イギリス・ポンド    | 12,990,308,640  | - | 13,300,902,897  | 310,594,257   |
| イスラエル・シケル   | 772,127,449     | - | 800,385,212     | 28,257,763    |
| オーストラリア・ドル  | 3,259,745,970   | - | 3,314,365,570   | 54,619,600    |
| オフショア・人民元   | 25,543,761,390  | - | 25,721,253,380  | 177,491,990   |
| カナダ・ドル      | 4,988,418,477   | - | 5,043,857,853   | 55,439,376    |
| シンガポール・ドル   | 996,445,402     | - | 1,007,665,385   | 11,219,983    |
| スウェーデン・クローナ | 407,502,672     | - | 411,693,916     | 4,191,244     |
| デンマーク・クローネ  | 638,649,771     | - | 649,345,821     | 10,696,050    |
| ニュージーランド・ドル | 611,805,973     | - | 615,313,766     | 3,507,793     |
| ノルウェー・クローネ  | 405,768,155     | - | 405,810,343     | 42,188        |
| ポーランド・ズロチ   | 1,401,722,515   | - | 1,441,590,170   | 39,867,655    |
| マレーシア・リンギット | 1,148,912,700   | - | 1,161,966,260   | 13,053,560    |
| メキシコ・ペソ     | 1,968,883,160   | - | 2,034,115,426   | 65,232,266    |
| ユーロ         | 74,177,827,536  | - | 75,449,903,102  | 1,272,075,566 |
| 合計          | 246,169,101,084 | - | 249,006,169,961 | 2,837,068,877 |

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

|              | 2024年7月11日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.1534円      |
| (1万口当たり純資産額) | (11,534円)    |



## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2024年7月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                      | 自 2024年1月12日<br>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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

|                               |                 |
|-------------------------------|-----------------|
| DIAM外国株式パッシブ・ファンド             | 3,786,814,481円  |
| MITO ラップ型ファンド(安定型)            | 1,326,759円      |
| MITO ラップ型ファンド(中立型)            | 6,348,704円      |
| MITO ラップ型ファンド(積極型)            | 16,058,553円     |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型)          | 17,590,613円     |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型)          | 19,677,824円     |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型)          | 11,150,523円     |
| たわらノーロード 先進国株式                | 65,154,608,653円 |
| たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>       | 2,681,276,401円  |
| たわらノーロード バランス(8資産均等型)         | 926,117,070円    |
| たわらノーロード バランス(堅実型)            | 70,139,754円     |
| たわらノーロード バランス(標準型)            | 711,977,424円    |
| たわらノーロード バランス(積極型)            | 1,035,656,067円  |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)   | 1,335円          |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)   | 39,104,327円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型) | 228,080,989円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)   | 248,623,158円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)   | 455,106,289円    |
| たわらノーロード 最適化バランス(保守型)         | 1,447円          |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型)         | 223,342円        |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)       | 13,524,867円     |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型)         | 4,504,651円      |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型)         | 14,241,371円     |
| たわらノーロード 全世界株式                | 4,713,223,458円  |
| DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>      | 58,340,550,430円 |
| One DC 先進国株式インデックスファンド        | 3,624,046,455円  |
| Oneグローバルバランス                  | 37,488,691円     |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型       | 114,533,318円    |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型    | 695,225,687円    |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型       | 955,326,040円    |
| DIAM DC バランス30インデックスファンド      | 61,391,912円     |
| DIAM DC バランス50インデックスファンド      | 188,107,574円    |
| DIAM DC バランス70インデックスファンド      | 207,351,904円    |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>          | 16,139,878円     |
| マネックス資産設計ファンド<育成型>            | 605,955,973円    |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション        | 111,796,003円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)    | 129,457,591円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)    | 169,369,244円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)    | 296,561,969円    |
| 投資のソムリエ                       | 7,559,051,391円  |
| クルーズコントロール                    | 79,514,101円     |
| 投資のソムリエ<DC年金>                 | 836,364,730円    |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>       | 185,639,140円    |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>           | 321,104,265円    |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型           | 605,571,370円    |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド            | 1,817,914,503円  |
| ワールドアセットバランス(基本コース)           | 80,909,672円     |
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)        | 235,434,236円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)        | 59,088,402円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)        | 30,471,122円     |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)        | 5,660,084円      |

|   |                |
|---|----------------|
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)                                  | 182,488,963円   |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>                                    | 141,102,623円   |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                                     | 468,334,850円   |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                                    | 108,108,498円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)                                  | 66,960,165円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)                                  | 32,662,704円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)                                  | 20,516,212円    |
| 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>                                    | 163,659,938円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)                                  | 5,030,858円     |
| Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>                             | 28,671,733円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)                   | 7,702,222円     |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)                   | 7,730,896円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)                      | 27,473,602円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)                   | 4,606,089円     |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)                   | 236,047円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)                  | 19,579,460円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定) | 12,574,663円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)                   | 5,378,624円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定) | 49,649,435円    |
| 予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)                        | 22,210,044円    |
| MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)                 | 323,596,758円   |
| DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)                         | 34,009,488円    |
| DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)                           | 971,567,301円   |
| 外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)                               | 1,040,757,502円 |
| 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)                                   | 126,043,128円   |
| AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)           | 334,992円       |
| DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)                             | 4,490,767円     |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)                          | 12,764,035円    |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)                | 4,250,347円     |
| DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)                       | 16,442,784円    |
| DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                       | 31,105,961円    |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)                         | 1,244,899円     |
| DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                         | 7,096,057円     |
| DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)                         | 727,975円       |
| DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                         | 26,032円        |
| DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)                           | 263,486円       |
| DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                           | 1,552,306円     |
| DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)                             | 80,295,215円    |
| DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)                           | 160,864,281円   |

|  |                  |
|--|------------------|
| DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)            | 574,488,282円     |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)       | 24,296,786円      |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)      | 19,486,538円      |
| DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 124,554,861円     |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)        | 3,927,619円       |
| DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)          | 115,385円         |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)       | 39,870,314円      |
| DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)      | 3,555,175円       |
| DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)      | 15,717,802円      |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)       | 23,838,992円      |
| DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)       | 60,342,065円      |
| 動的パッケージファンド<DC年金>                      | 11,799,046円      |
| コア資産形成ファンド                             | 5,627,650円       |
| たわらノーロード 先進国株式(為替ヘッジなし)<ラップ専用>         | 2,084,428,375円   |
| MHAM外国株式インデックスファンド                     | 130,350,216円     |
| たわらノーロード 先進国株式(為替ヘッジあり)<ラップ専用>         | 949,639,486円     |
| MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]             | 1,330,095,505円   |
| MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]            | 2,005,942,374円   |
| 計                                      | 169,125,591,156円 |
| 2. 受益権の総数                              | 169,125,591,156口 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

| 種類                        | 2024年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<br>為替予約取引<br>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  |                | 時価（円）       | 評価損益（円） |
|                    |                | 1年超 |                |             |         |
| 市場取引<br>先物取引<br>買建 | 22,878,628,149 | -   | 23,319,086,698 | 440,458,549 |         |
| 合計                 | 22,878,628,149 | -   | 23,319,086,698 | 440,458,549 |         |

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年7月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                    | 自 2024年1月12日<br>至 2024年7月11日   |
|-----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 投資証券<br>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<br>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<br>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  |

(貸借対照表に関する注記)

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



|   |                |
|---|----------------|
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)                            | 555,306,569円   |
| 投資のソムリエ   | 1,617,803,438円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>   | 175,592,309円   |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>                               | 225,908,401円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                                   | 512,471,480円   |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                                    | 1,539,782,687円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)                                | 12,313,425円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)                                | 6,346,452円     |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)                                | 4,792,192円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)                                | 38,383,584円    |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                                   | 423,557,216円   |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                                  | 134,590,634円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)                                | 14,077,544円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)                                | 6,806,031円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)                                | 4,271,230円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)                                | 1,117,036円     |
| Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>                           | 61,256,722円    |
| Jリートインデックスファンド(DC)                                    | 79,538,155円    |
| MHAM J-REITインデックスファンド(隔月決算型)                          | 16,163,543円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)                 | 51,063,861円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用法)20-04(適格機関投資家限定)           | 169,553,372円   |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)                 | 51,451,100円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)                    | 93,430,455円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)                 | 30,936,738円    |
| 固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)          | 201,439,141円   |
| 低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)                    | 82,907,926円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用法・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定) | 199,986,573円   |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)                 | 112,116,826円   |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)                | 130,077,552円   |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)       | 42,575,122円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)       | 70,134,077円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)       | 48,988,137円    |
| 低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)             | 82,857,437円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)                 | 35,750,832円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)       | 48,851,477円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-12(適格機関投資家限定)       | 70,790,495円    |

|  |                 |
|--|-----------------|
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定) | 334,021,063円    |
| 予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)                       | 100,997,102円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)24-04(適格機関投資家限定)  | 133,248,553円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2024-05(適格機関投資家限定) | 336,667,703円    |
| DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)                       | 3,086,039,681円  |
| 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)                                  | 26,345,852円     |
| AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)          | 19,757,111円     |
| 日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)              | 432,163,523円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)                         | 85,106,821円     |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)               | 938,185円        |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)               | 125,726,810円    |
| MHAM J-REITインデックスファンド DC年金                             | 6,866,614,167円  |
| MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)                           | 31,084,136,991円 |
| MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)                          | 2,599,496,480円  |
| たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>                                  | 5,280,020,928円  |
| 計  | 74,375,234,055円 |
| 2. 受益権の総数  | 74,375,234,055口 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

| 種類                 | 2024年7月11日現在  |           |               |            |
|--------------------|---------------|-----------|---------------|------------|
|                    | 契約額等(円)       |           | 時価(円)         | 評価損益(円)    |
|                    |               | うち<br>1年超 |               |            |
| 市場取引<br>先物取引<br>買建 | 4,856,185,750 | -         | 4,875,470,500 | 19,284,750 |
| 合計                 | 4,856,185,750 | -         | 4,875,470,500 | 19,284,750 |

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年7月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                      | 自 2024年1月12日<br>至 2024年7月11日  |
|-------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法      | <p>投資信託受益証券<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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 | 44,985,698,714円 |
| 同期中追加設定元本額                            | 8,398,331,551円  |
| 同期中一部解約元本額                            | 10,211,199,003円 |
| 元本の内訳<br>ファンド名                        |                 |
| たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞       | 3,571,055,580円  |
| MITO ラップ型ファンド（安定型）                    | 2,846,749円      |
| MITO ラップ型ファンド（中立型）                    | 13,627,449円     |
| MITO ラップ型ファンド（積極型）                    | 34,521,750円     |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型）                  | 37,734,241円     |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型）                  | 42,240,217円     |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型）                  | 23,753,266円     |
| たわらノーロード 先進国リート                       | 15,394,580,937円 |
| たわらノーロード 先進国リート＜ラップ向け＞                | 127,602,314円    |
| たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞              | 241,948,348円    |

|  |                |
|--|----------------|
| たわらノーロード バランス(8資産均等型)                  | 4,289,543,043円 |
| たわらノーロード バランス(堅実型)                     | 27,062,049円    |
| たわらノーロード バランス(標準型)                     | 614,077,443円   |
| たわらノーロード バランス(積極型)                     | 1,458,600,487円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)            | 1,255,966円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)          | 533,024,778円   |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)            | 665,972,132円   |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)            | 1,199,632,426円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型)                  | 8,688円         |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)                | 39,627,111円    |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型)                  | 12,422,159円    |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型)                  | 37,826,520円    |
| One DC 先進国リートインデックスファンド                | 2,319,701,441円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>                   | 15,876,493円    |
| マネックス資産設計ファンド<育成型>                     | 596,420,560円   |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション                 | 79,425,412円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)             | 189,471,408円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)             | 313,572,673円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)             | 612,101,769円   |
| 投資のソムリエ                                | 3,613,701,283円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>                          | 391,876,183円   |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>                | 268,571,746円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                    | 454,055,708円   |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                     | 1,362,332,435円 |
| ワールドアセットバランス(基本コース)                    | 230,288,004円   |
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)                 | 686,701,640円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)                 | 70,869,974円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)                 | 36,552,462円    |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)                 | 4,243,732円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)                 | 85,483,017円    |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                    | 1,040,514,893円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                   | 153,981,745円   |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)                 | 46,947,361円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)                 | 39,179,034円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)                 | 24,607,767円    |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)                 | 6,035,241円     |
| Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>            | 76,165,831円    |
| DIAMパッシブ資産分散ファンド                       | 270,424,593円   |
| DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>              | 385,324,057円   |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)  | 217,802円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)  | 647,540円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)  | 125,270円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)  | 867,926円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定) | 711,941円       |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)  | 501,108円       |
| 予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)       | 5,202円         |
| 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)                  | 59,203,791円    |

|   |                 |
|---|-----------------|
| AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定) | 895,492円        |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)                | 572,716円        |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)      | 1,984,806円      |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)               | 37,013,879円     |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)              | 93,407,812円     |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)      | 1,233,285,862円  |
| 計   | 43,172,831,262円 |
| 2. 受益権の総数                                     | 43,172,831,262口 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

| 種類                        | 2024年7月11日現在 |           |             |         |
|---------------------------|--------------|-----------|-------------|---------|
|                           | 契約額等(円)      |           | 時価(円)       | 評価損益(円) |
|                           |              | うち<br>1年超 |             |         |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引<br>買建 |              |           |             |         |
| アメリカ・ドル                   | 109,129,540  | -         | 109,135,319 | 5,779   |
| アメリカ・ドル                   | 80,848,350   | -         | 80,852,750  | 4,400   |
| イギリス・ポンド                  | 10,394,550   | -         | 10,395,485  | 935     |
| オーストラリア・ドル                | 13,090,620   | -         | 13,090,404  | 216     |
| シンガポール・ドル                 | 4,796,020    | -         | 4,796,680   | 660     |
| 合計                        | 109,129,540  | -         | 109,135,319 | 5,779   |

## (注)時価の算定方法

## 為替予約取引

1. 計算日に対顧客先物売買取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取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中

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。

#### 不動産投信関連

| 種類                 | 2024年7月11日現在 |           |               |            |
|--------------------|--------------|-----------|---------------|------------|
|                    | 契約額等（円）      | うち<br>1年超 | 時価（円）         | 評価損益（円）    |
|                    |              |           |               |            |
| 市場取引<br>先物取引<br>買建 | 994,421,164  | -         | 1,004,611,770 | 10,190,606 |
| 合計                 | 994,421,164  | -         | 1,004,611,770 | 10,190,606 |

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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



エマージング債券パッシブ・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年7月11日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                      | 自 2024年1月12日<br>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）

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

| 種類                        | 2024年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<br>為替予約取引<br>売建 | 210,000,000  | -   |  | 210,009,486 | 9,486   |

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

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

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

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<br>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<DC年金>          | 10,436,039,981円 |
| たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>                 | 5,485,712,495円  |
| 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）

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

| 種類                  | 2024年7月11日現在 |           |             |         |
|---------------------|--------------|-----------|-------------|---------|
|                     | 契約額等（円）      | 時価（円）     |             | 評価損益（円） |
|                     |              | うち<br>1年超 |             |         |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |              |           |             |         |
| 売建                  | 218,508,616  | -         | 218,519,713 | 11,097  |
| アメリカ・ドル             | 217,675,200  | -         | 217,685,033 | 9,833   |
| ブラジル・レアル            | 833,416      | -         | 834,680     | 1,264   |
| 買建                  | 75,284,916   | -         | 75,382,283  | 97,367  |
| アメリカ・ドル             | 75,284,916   | -         | 75,382,283  | 97,367  |
| 合計                  | 293,793,532  | -         | 293,901,996 | 86,270  |

## （注）時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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)       |           | 時価(円)         | 評価損益(円)     |
|                    |               | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引<br>先物取引<br>買建 | 4,742,870,933 | -         | 4,902,579,712 | 159,708,779 |
| 合計                 | 4,742,870,933 | -         | 4,902,579,712 | 159,708,779 |

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)

2024年7月31日現在

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 3,330,933,981円 |
| 負債総額           | 13,559,702円    |
| 純資産総額( - )     | 3,317,374,279円 |
| 発行済数量          | 3,026,689,896口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.0960円        |

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)

2024年7月31日現在

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 1,653,017,716円 |
| 負債総額           | 5,030,401円     |
| 純資産総額( - )     | 1,647,987,315円 |
| 発行済数量          | 1,464,283,507口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.1255円        |

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

2024年7月31日現在

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 1,018,785,633円 |
| 負債総額           | 6,488,738円     |
| 純資産総額( - )     | 1,012,296,895円 |
| 発行済数量          | 902,580,068口   |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.1216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          |

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 251,643,874,738円 |
| 負債総額           | 60,763,887円      |
| 純資産総額( - )     | 251,583,110,851円 |
| 発行済数量          | 216,513,520,253口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.1620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            |

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

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

## 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<br>(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<br>(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. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

##### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

| 基本的性格      | 本数    | 純資産総額（単位：円）        |
|------------|-------|--------------------|
| 追加型公社債投資信託 | 26    | 1,480,586,385,664  |
| 追加型株式投資信託  | 773   | 16,670,840,637,703 |
| 単位型公社債投資信託 | 21    | 31,003,186,015     |
| 単位型株式投資信託  | 196   | 1,062,795,195,927  |
| 合計         | 1,016 | 19,245,225,405,309 |

### 3【委託会社等の経理状況】

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



## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 百万円 )

|           | 第38期<br>( 2023年3月31日現在 ) | 第39期<br>( 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<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(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<br>( 自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日 ) |         | 第39期<br>( 自 2023年4月1日<br>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<br>（自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日） |        | 第39期<br>（自 2023年4月1日<br>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<br>合計 |
|-----------------------------|-------|-------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
|                             | 資本金   | 資本剰余金 |              |             | 利益剰余金     |           |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                             |       | 資本準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本剰余<br>金合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             |             |            |
|                             |       |       |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>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<br>項目の当期変動<br>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<br>合計 |
|-----------------------------|----------------------|----------------|-----------|
|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>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<br>項目の当期変動<br>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<br>合計 |
|                             |       | 資本準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本剰余<br>金合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                             |       |       |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>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<br>項目の当期変動<br>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<br>合計 |
|-----------------------------|----------------------|----------------|-----------|
|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>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<br>項目の当期変動<br>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<br/>移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券<br/>市場価格のない株式等以外のもの<br/>決算日の市場価格等に基づく時価法<br/>(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)<br/>市場価格のない株式等<br/>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)<br/>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。<br/>なお、主な耐用年数は次のとおりであります。<br/>建物 ... 8～18年<br/>器具備品 ... 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く)<br/>定額法を採用しております。<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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。<br/>退職給付見込額の期間帰属方法<br/>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。<br/>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br/>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。<br/>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<br/>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<br>（2023年3月31日現在） | 第39期<br>（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<br>（自 2022年4月 1日<br>至 2023年3月31日） | 第39期<br>（自 2023年4月 1日<br>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<br>株式数（株） | 当事業年度<br>増加株式数（株） | 当事業年度<br>減少株式数（株） | 当事業年度末<br>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<br>種類  | 配当金の総額<br>（百万円） | 1株当たり配<br>当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|------------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2022年6月16日<br>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<br>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<br>(百万円) | 1株当たり配当<br>額(円) | 基準日        | 効力発生(予定)日  |
|----------------------|--------|-----------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2023年6月16日<br>定時株主総会 | 普通株式   | 利益<br>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<br>株式数(株) | 当事業年度<br>増加株式数(株) | 当事業年度<br>減少株式数(株) | 当事業年度末<br>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<br>(百万円) | 1株当たり配<br>当額(円) | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|------------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2023年6月16日<br>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<br>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<br>(百万円) | 1株当たり配当<br>額(円) | 基準日        | 効力発生(予定)日  |
|----------------------|------------|-----------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2024年6月17日<br>定時株主総会 | 普通株式       | 利益<br>剰余金 | 10,280          | 257,000         | 2024年3月31日 | 2024年6月18日 |
|                      | A種種類<br>株式 |           |                 |                 |            |            |

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてあります。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<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|----------------------|-------------------|-------------|-------------|
| (1) 金銭の信託            | 29,184            | 29,184      | -           |
| (2) 投資有価証券<br>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<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|----------------------|-------------------|-------------|-------------|
| (1) 金銭の信託            | 28,143            | 28,143      | -           |
| (2) 投資有価証券<br>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<br>(百万円) | 1年超5年以内<br>(百万円) | 5年超10年以内<br>(百万円) | 10年超<br>(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<br>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<br>(百万円) | 1年超5年以内<br>(百万円) | 5年超10年以内<br>(百万円) | 10年超<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>（2023年3月31日現在） | 第39期<br>（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<br>貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------------------|------------------------|------|----|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの<br>投資信託  | -                      | -    | -  |
| 小計                               | -                      | -    | -  |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの<br>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<br>貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------------------|------------------------|------|----|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの<br>投資信託  | -                      | -    | -  |
| 小計                               | -                      | -    | -  |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの<br>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<br>(百万円) | 売却益の合計額<br>(百万円) | 売却損の合計額<br>(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<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>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<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(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<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>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<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(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<br>(存続会社) | MHAM<br>(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<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(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<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>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<br>（自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日） | 第39期<br>（自 2023年4月1日<br>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<br>又は<br>出資金 | 事業の<br>内容又は<br>職業 | 議決権<br>等の所有(被<br>所有)<br>割合 | 関係内容       |                     | 取引の内容                | 取引金額<br>(百万円) | 科目        | 期末残高<br>(百万円) |
|-------------|-------------------|-----------------|------------------|-------------------|----------------------------|------------|---------------------|----------------------|---------------|-----------|---------------|
|             |                   |                 |                  |                   |                            | 役員の<br>兼任等 | 事業上<br>の関係          |                      |               |           |               |
| 親会社<br>の子会社 | 株式会社<br>みずほ銀行     | 東京都<br>千代田<br>区 | 14,040<br>億円     | 銀行業               | -                          | -          | 当社設定<br>投資信託<br>の販売 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料 | 7,474         | 未払<br>手数料 | 1,579         |
|             | みずほ証<br>券株式会<br>社 | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,251<br>億円      | 証券業               | -                          | -          | 当社設定<br>投資信託<br>の販売 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料 | 13,932        | 未払<br>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<br>又は<br>出資金 | 事業の<br>内容又は<br>職業 | 議決権<br>等の所有(被<br>所有)<br>割合 | 関係内容       |                     | 取引の内容                | 取引金額<br>(百万円) | 科目        | 期末残高<br>(百万円) |
|-------------|-------------------|-----------------|------------------|-------------------|----------------------------|------------|---------------------|----------------------|---------------|-----------|---------------|
|             |                   |                 |                  |                   |                            | 役員の<br>兼任等 | 事業上<br>の関係          |                      |               |           |               |
| 親会社<br>の子会社 | 株式会社<br>みずほ銀行     | 東京都<br>千代田<br>区 | 14,040<br>億円     | 銀行業               | -                          | -          | 当社設定<br>投資信託<br>の販売 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料 | 8,140         | 未払<br>手数料 | 1,870         |
|             | みずほ証<br>券株式会<br>社 | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,251<br>億円      | 証券業               | -                          | -          | 当社設定<br>投資信託<br>の販売 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料 | 16,655        | 未払<br>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<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>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<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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



## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

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

#### (2) 販売会社

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

| 名 称            | 資本金の額<br>(単位:百万円) | 事 業 の 内 容                        |
|----------------|-------------------|----------------------------------|
| 株式会社みずほ銀行      | 1,404,065         | 日本において銀行業務を営んでおります。              |
| 株式会社横浜銀行       | 215,628           | 日本において銀行業務を営んでおります。              |
| 第一生命保険株式会社     | 60,000            | 日本において保険業務を営んでおります。              |
| 損保ジャパンDC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。 |

（注）資本金の額は2024年3月末日現在

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

#### (3) 投資顧問会社

|       |                               |
|-------|-------------------------------|
| 名称    | Asset Management One USA Inc. |
| 資本金の額 | 400万米ドル（2023年12月末日現在）         |
| 事業の内容 | 米国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、委託会社との投資顧問契約に基づき、信託財産の運用の助言を行います。

### 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3月15日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 森重俊寛  
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」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）の2023年1月12日から2024年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）の2024年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年3月15日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森重俊寛  
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」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）の2023年1月12日から2024年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）の2024年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。



## 独立監査人の監査報告書

2024年3月15日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 森重俊寛  
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」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）の2023年1月12日から2024年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）の2024年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）の2024年1月12日から2024年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）の2024年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月12日から2024年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）の2024年1月12日から2024年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）の2024年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月12日から2024年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）の2024年1月12日から2024年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）の2024年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月12日から2024年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。