

【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】	2025年2月7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】	動的パッケージファンド<DC年金>
【届出の対象とした募集(売出) 内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

動的パッケージファンド<DC年金>（以下「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」と称することがあります。）です。

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ることとし、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、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、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。

また、当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付けまたは信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除して求めた金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

基準価額については、委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	https://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

注：電話番号はコールセンターのものであります（以下同じ）。

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時から午後5時までとさせていただきます。

（以下同じ。）

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

2025年2月8日から2025年8月8日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	https://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(9) 【払込期日】

取得申込金額は、販売会社が定める期日までに、販売会社にお支払いいただきます。なお、取得申込金額には利息は付されません。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、アセットマネジメントOne株式会社(「委託者」または「委託会社」といいます。)の指定する口座を経由して、みずほ信託銀行株式会社(「受託者」または「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座(受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座)に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込金額は、お申込みの販売会社にお支払いください。なお、払込取扱場所については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	https://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

投資信託振替制度における振替受益権について

当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。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、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。

投資信託振替制度(以下「振替制度」といいます。)においては、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します。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。

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】

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、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および外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券（以下、各々を「主要投資対象マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<ファンドの特色>

国内外の公社債・株式へ分散投資を行い、安定した収益の獲得を目指します。

国内債券、外国債券、国内株式および外国株式を主要投資対象とし、各資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析を勘案して配分比率を決定します。

資産配分比率は、リスク均等配分を基本としつつ、投資環境分析による各資産の魅力度判定に応じた機動的な変更を行うことで、安定した収益の獲得を目指します。

* ファンドの特色における「リスク」とは、各資産の価格変動やファンドの基準価額の振れ幅の大きさのことをいいます。

各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理し、配分比率を調整することにより、基準価額の変動を抑制することを目指します。

各資産のリスク水準の変化に応じて、各資産への配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券（以下、各主要投資対象マザーファンド受益証券を含め「マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて国内短期債券に投資することや、短期金融商品に直接投資することがあります。

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。

5,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

< 商品分類 >

・ 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・ 商品分類定義

追加型	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	目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書又は投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」及び「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。

< 属性区分 >

・ 属性区分表

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

1 当ファンドが投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「資産複合（株式・債券）/ 資産配分変更型」です。

2 「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

<p>その他資産 (投資信託証券)</p>	<p>目論見書又は投資信託約款において、主として「株式」、「債券」及び「不動産投信」以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載はその該当資産を表す。</p>
<p>資産複合 (株式・債券) 資産配分変更型</p>	<p>目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、括弧内の記載はその該当複数資産を表す。</p> <p>当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券に投資を行います。</p>
<p>年1回</p>	<p>目論見書又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。</p>
<p>グローバル (日本を含む)</p>	<p>目論見書又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。</p>
<p>ファミリーファンド</p>	<p>目論見書又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。</p>
<p>為替ヘッジなし</p>	<p>目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。</p>

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

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

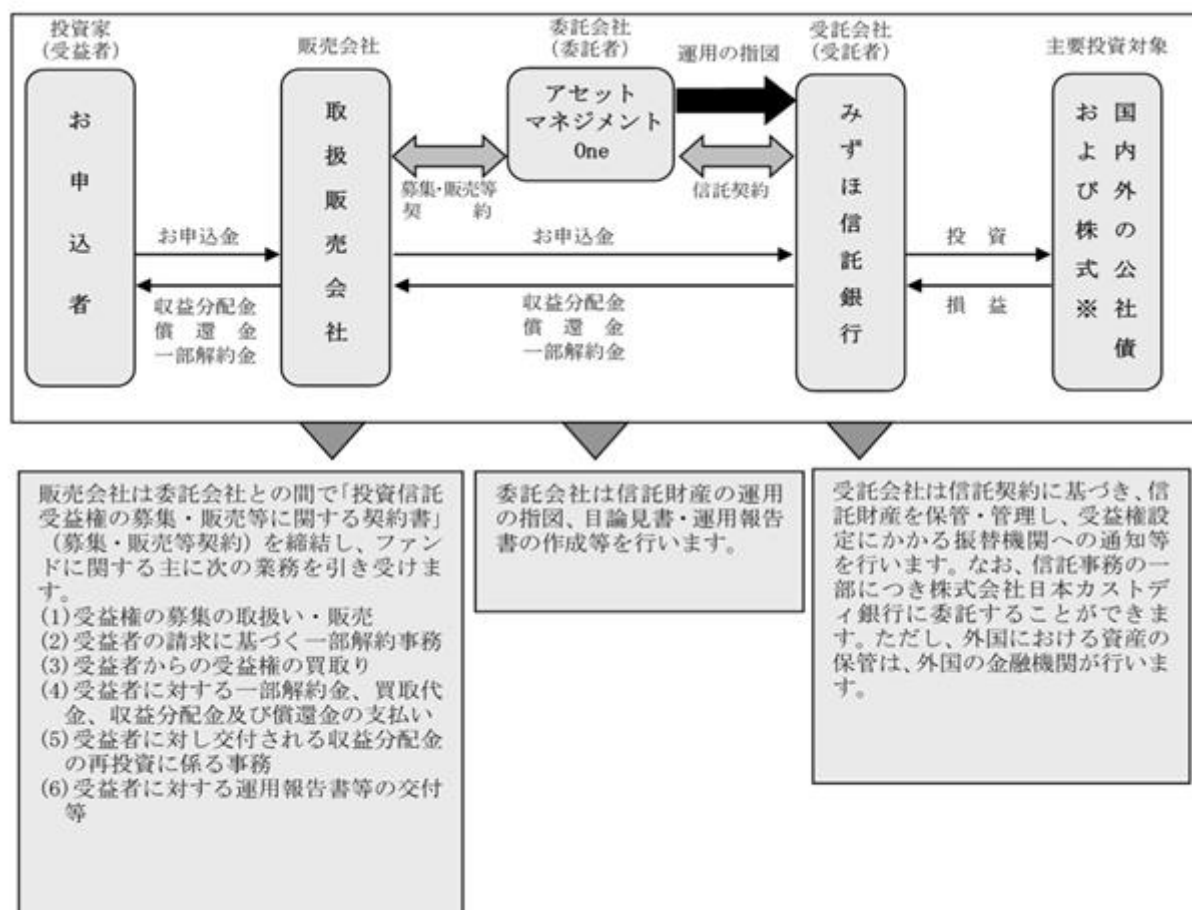
(注3) 当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（２）【ファンドの沿革】

2015年11月30日	信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2021年7月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を追加し、「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」を「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更
2021年12月17日	ファンドの主要投資対象から「MHAM TOPIXマザーファンド」を削除
2022年3月1日	ファンドの主要投資対象に「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」を追加し、「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」を「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更
2022年6月29日	ファンドの主要投資対象から「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」を削除

（３）【ファンドの仕組み】

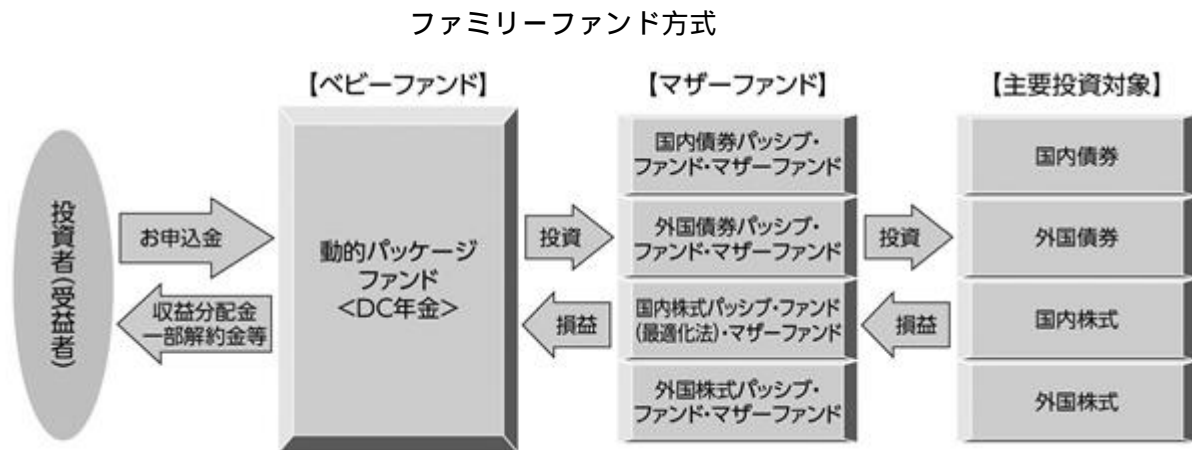
当ファンドの運営の仕組み



主要投資対象である国内外の公社債および株式には、主として、各マザーファンドを通じて投資を行います。

ファミリーファンド方式の仕組み

当ファンドは、下図のマザーファンドを通じて各資産への投資を行う「ファミリーファンド方式」で運用を行います。



ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資することにより、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。

資産配分の決定の際、一部のマザーファンド受益証券への投資を行わない場合があります。また、ファンド全体のリスクの状況によっては、上記のマザーファンドを通じた投資のほか、M H A M国内短期債券マザーファンドを通じて国内短期債券に投資する場合や、信託財産の純資産総額の50%を上限に短期金融商品等へ直接投資する場合があります。

マザーファンドのほかに、株式、公社債等に直接投資する場合があります。

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2024年11月29日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2024年11月29日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

運用方法

1．主要投資対象

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・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および外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

2．投資態度

a．主として、各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行います。

b．各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資割合については、各マザーファンドが主要投資対象とする資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析等を勘案のうえ配分比率を決定します。ただし、ファンドの価格変動リスクを勘案し、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券への投資を行う場合、および信託財産の純資産総額の50%を上限に預金等の短期金融商品への直接投資を行う場合があります。

c．実質組入 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

「実質組入」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額をいいます。（以下同じ。）

d．マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

e．市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの投資プロセス

1．当ファンドの投資プロセス

当ファンドは、以下の投資プロセスにより、各資産への投資割合を決定し、当ファンドを管理します。

各資産への配分比率は、特定の資産へのリスク集中回避を意図した「リスク均等配分」をベースに、投資環境分析やリスクの状況を踏まえて機動的に変更します。

STEP1

各資産のリスクを計測
⇒ リスク均等配分となる
ベース配分比率を決定

STEP2

投資環境分析を実施
⇒ ベース配分比率から
機動的に配分比率を変更

STEP3

リスクの管理
⇒ リスクの状況により、
各資産の配分比率を変更

STEP4

ポートフォリオの構築

STEP1 各資産のリスクを計測

「国内債券」、「外国債券」、「国内株式」および「外国株式」の各資産について、リスクを計測し、ポートフォリオに対するリスク寄与度が均等（リスク均等配分）となるよう、ベース配分比率を決定します。

☞ 下記「☞ リスク均等配分とは」をご参照ください。

STEP2 投資環境分析を実施

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

STEP3 リスクの管理

各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理します。資産別のリスク水準の変化に応じて、配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、各資産への配分比率を引き下げます[※]。

STEP4 ポートフォリオの構築

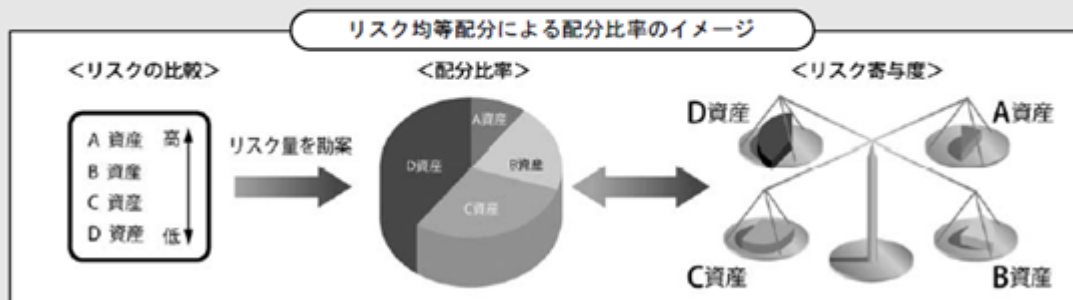
STEP1～3で決定した配分比率に従って、各資産への投資を行います。

※STEP3において各資産への配分比率の引き下げを行った場合、国内短期債券や短期金融商品への投資を行います。

上記のプロセスは、今後変更される場合があります。

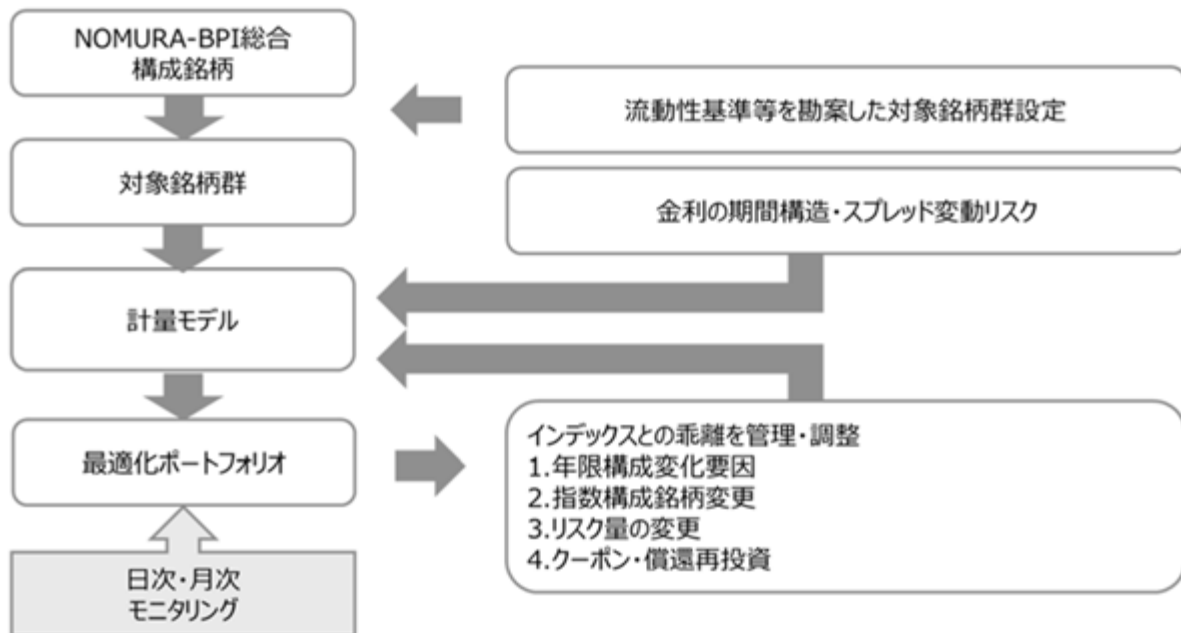
☞ リスク均等配分とは

「リスク均等配分」とは、各資産のリスク（価格変動性）の大きさに着目した分散投資の方法で、リスクが相対的に高い資産の配分比率を低くし、リスクが相対的に低い資産の配分比率を高くすることにより、ファンドに対する各資産のリスク寄与度を均等にすることを旨とする投資手法です。これにより、リスクが高い資産の値動きがファンド全体の値動きに与える影響を抑える効果が期待されます。



2. 各マザーファンドの投資プロセス

<国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス>



1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

NOMURA-BPI総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

- 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因
 - 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因
- 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

3. インデックスとの乖離を管理

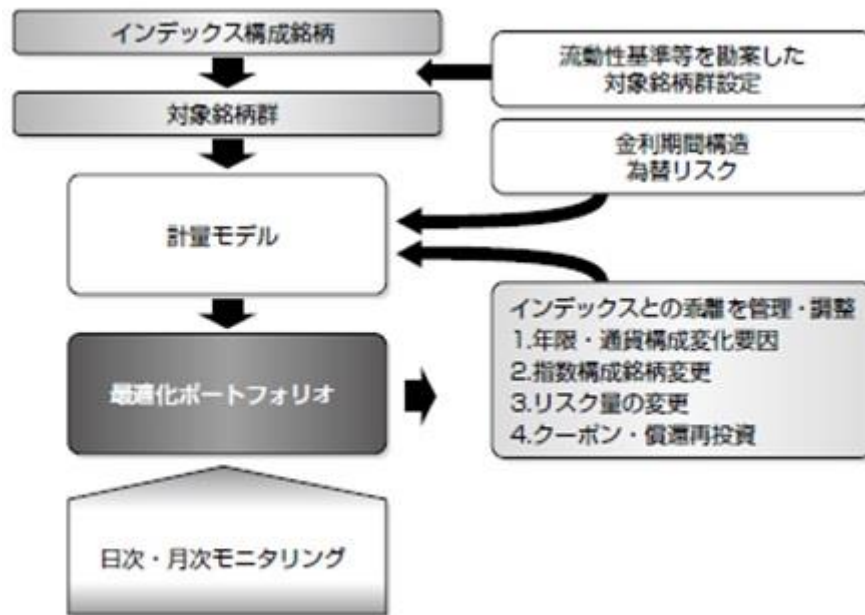
日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン、償還再投資

<外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス>



1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

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

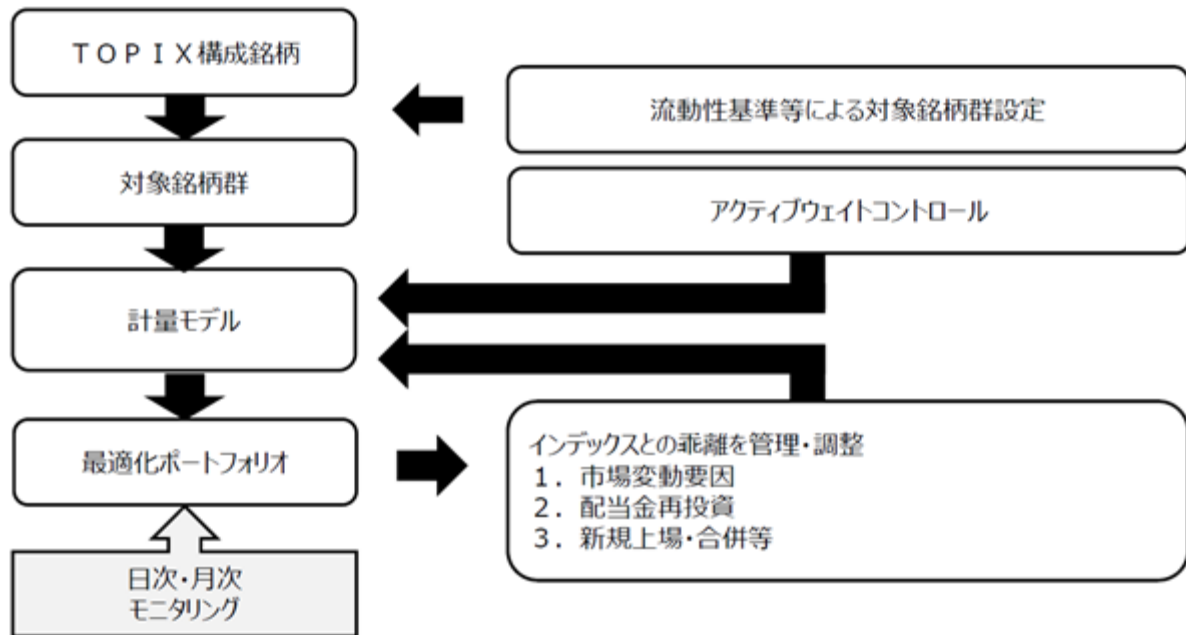
3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・年限・通貨構成変化要因
- ・指数構成銘柄変更
- ・リスク量の変更
- ・クーポン・償還再投資

<国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資プロセス>



1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

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

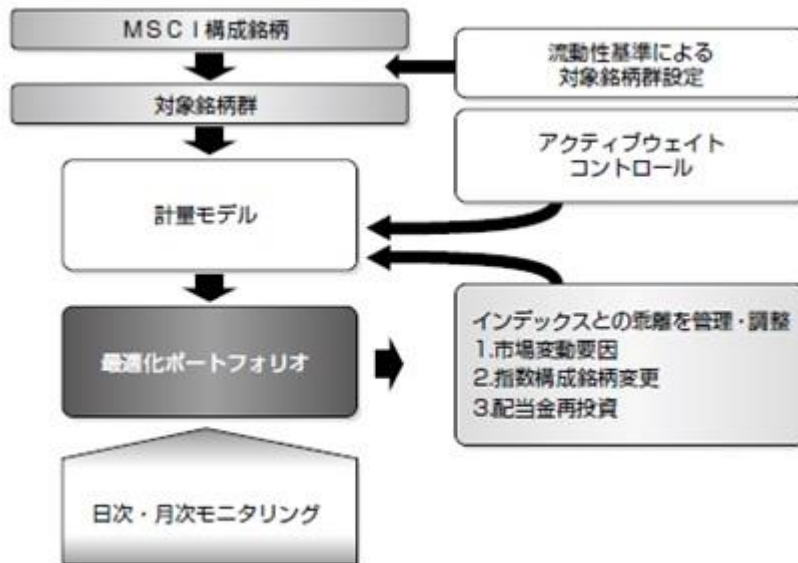
3. インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定

<外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス>



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、MSC I 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。

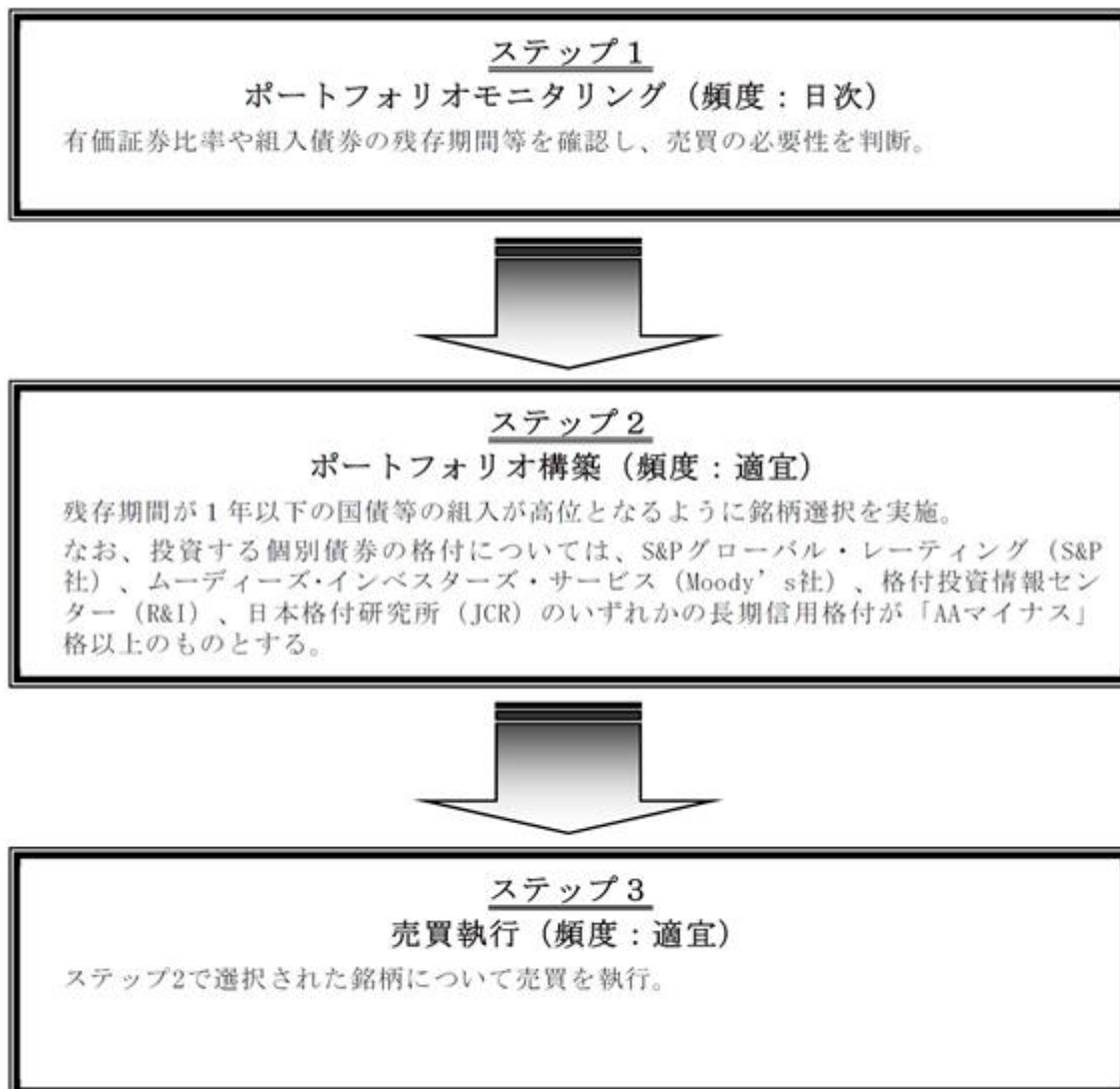
3. インデックスとの乖離を管理

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

< MHAM国内短期債券マザーファンドの投資プロセス >



市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

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項で定めるものをいいます。以下同じ。)
 - a. 有価証券
 - b. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第25条、第26条および第27条に定めるものに限りません。)
 - c. 金銭債権
 - d. 約束手形(a.に掲げるものに該当するものを除きます。)
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - a. 為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として下記1.から下記5.までの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の各受益証券を含む下記6.から下記27.までの有価証券(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. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
2. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
3. 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
4. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
5. MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券
6. 株券または新株引受権証券
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人が発行する債券
10. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
11. 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。)
12. 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。)
13. 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。)
14. 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。)
15. コマーシャル・ペーパー

16. 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
 17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1.から前記16.の証券または証書の性質を有するもの(外国の者の発行する証券または証書で、前記6.から前記11.の証券または証書の性質を有するプリファードセキュリティーズ(ハイブリッド型のプリファードセキュリティーズを含みます。))およびこれらに類するものを含みます。)
 18. 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。)
 19. 投資証券、投資法人債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、プリファードセキュリティーズ(投資証券および投資法人債券のハイブリッド型のものを含みます。))に該当するものを含みます。)
 20. 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。)
 21. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 22. 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。)
 23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 24. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 25. 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。)
 26. 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
 27. 外国の者に対する権利で前記26.の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記6.の証券または証書、前記17.および前記22.の証券または証書のうち前記6.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、前記7.から前記11.までの証券および前記17.ならびに前記22.の証券または証書のうち前記7.から前記11.までの証券の性質を有するものならびに前記19.の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、前記18.の証券および前記19.の証券(投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。また、 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、下記1.から下記4.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

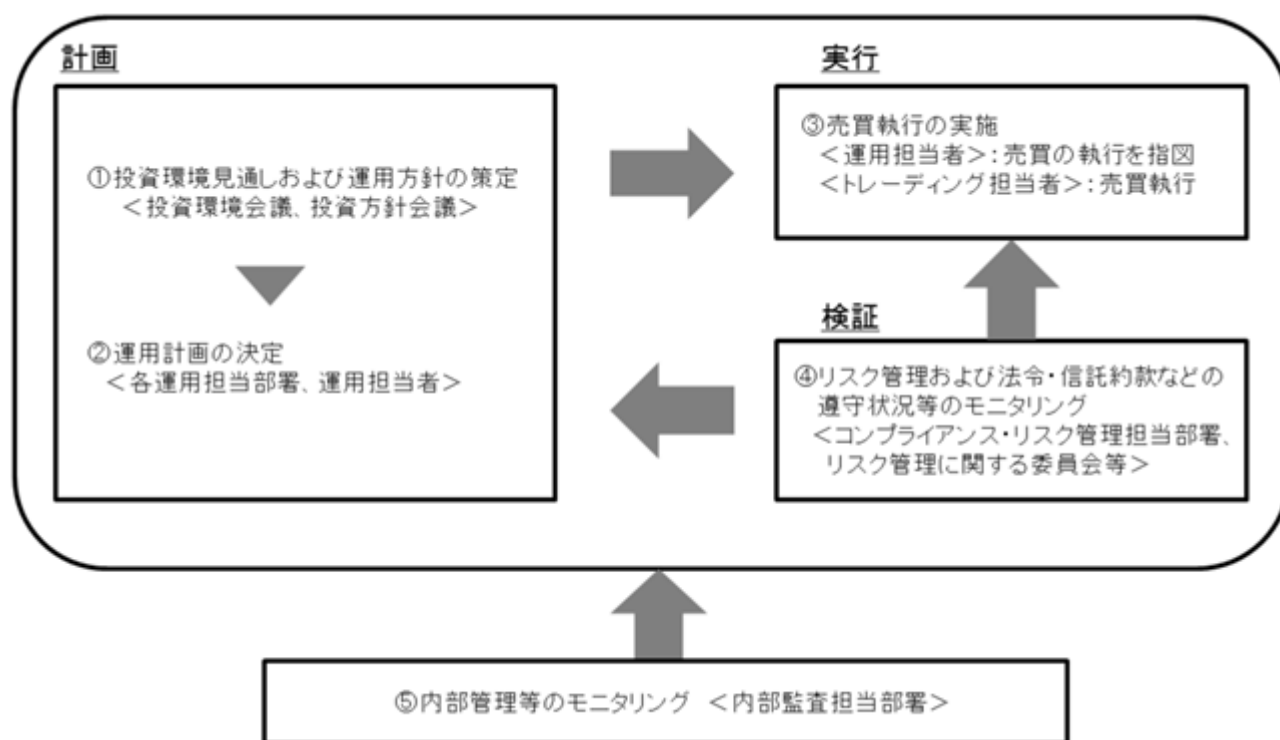
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

- 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前記5．の権利の性質を有するもの
- 7．金銭債権（ただし、流動性のあるプリファードセキュリティーズに該当するものに限り、前記1．から前記6．で該当するものならびに「有価証券の指図範囲」の17．および19．に定める証券または証書を除きます。）
- 8．投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に定めるものをいいます。）
- 9．外国の法律に基づく権利であって前記8．に掲げる権利に類するもの（リミテッド・パートナーシップ（LP）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含まず。）を含みます。）
- 10．合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
- 11．外国法人の社員権で前記10．に掲げる権利の性質を有するもの（リミテッド・ライアビリティ・カンパニー（LLC）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含まず。）を含みます。）

なお、前記5．、前記6．および前記8．から前記11．までの権利等を以下「みなし有価証券」といいます。

（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。

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2024年11月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【配分方針】

収益配分方針

毎計算期末(原則として5月8日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日)に、原則として以下の方針に基づき配分を行います。

- 1．分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（繰越分および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の水準や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には配分を行わないことがあります。
- 3．収益配分に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
将来の収益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。

収益分配金の再投資

- 1．収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、販売会社に交付されます。
- 2．販売会社は、分配金自動引き落とし投資に関する契約に基づき、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けを行い、当該再投資にかかる売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（５）【投資制限】

a．約款で定める投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券（約款 運用の基本方針 運用方法(3) 投資制限、約款第17条および約款第20条）

- 1．株式への実質投資割合 には制限を設けません。
「実質投資割合」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の当ファンドの信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。（以下同じ。）
- 2．委託会社は、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- 3．同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 4．同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合には制限を設けません。
- 5．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、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび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。なお、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。

みなし有価証券（約款第17条）

委託会社は、みなし有価証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。

投資信託証券（約款第17条）

委託会社は、投資信託証券（マザーファンド受益証券および取引所金融商品市場（金融商品取引法第2条第17項に規定する金融商品市場をいいます。）または外国金融商品市場に上場等（不動産投資信託証券については、予定を含みます。以下同じ。）され、かつこれらの市場において常時売却可能（市場の急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

転換社債等（約款第21条）

委託会社は、同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

外貨建資産（約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限および約款第31条）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、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（約款第32条）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

信用リスク集中回避のための投資制限（約款第22条）

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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限、約款第23条）

委託会社は、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。（ただし、この信託において取引可能なものに限る）

ます。以下同じ。)。) について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

信用取引(約款第24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り付けることの指図をすることができます。なお当該売り付けの決済については、株券の引き渡し又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. 信用取引の指図は、次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、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - a. 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
 - b. 株式分割により取得する株券
 - c. 有償増資により取得する株券
 - d. 売り出しにより取得する株券
 - e. 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
 - f. 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(前記e.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

有価証券先物取引等(約款第25条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の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。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)。
2. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
3. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引(約款第26条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、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たときは、担保の提供または担保の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(約款第27条)

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

有価証券の貸付(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、信託財産に属する株式および公社債を以下の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 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。
 - b. 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. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
3. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売り(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、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. 前記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とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記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(約款第30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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2．前記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、前記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．前記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。

資金の借入れ（約款第38条）

- 1．委託会社は、信託財産の効率的な運用および運用の安定性に資するため、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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金等および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を上回らない範囲内とします。
- 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。

b．法令で定める投資制限

同一の法人の発行する株式の取得割合（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を、運用の指図を行うすべ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の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

<各マザーファンドの投資方針および主な投資制限>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA - BPI総合 に連動する投資成果を目標として運用を行います。

NOMURA - BPI総合とは、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債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。NOMURA - BPI総合は、銘柄種類別・残存年数別に分類した各セクターポートフォリオに対して、それぞれの投資収益指数が用意され、一定の組入基準にもとづいて構成されたインデックス・ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算され、機関投資家に広く認知されています。NOMURA - BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - BPI総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。

公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

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。

(3) 投資制限

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。

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。

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。

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。

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。

有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。

スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。

外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行いません。

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

外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」

1. 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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)」に連動する投資成果を目指して運用を行います。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)は、FTSE世界国債インデックス・データに基づき当社が計算したものです。

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。

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。

(3) 投資制限

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。

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。

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。

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。

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。

スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

外国為替予約取引は約款24条の範囲で行いません。

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

外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」

1. 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。

東証株価指数(TOPIX=Tokyo Stock Price Index)とは、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、基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

- *1 東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
- *2 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。
- *3 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。
- *4 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。
- *5 本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- *6 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。
- *7 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。
- *8 以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

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目指して運用を行います。

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。

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。

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。

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。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。

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

外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」

1. 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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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)に連動する投資成果を目指して運用を行います。

MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み)とは、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。

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。

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。

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。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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。

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。

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。

スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。

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

外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

「MHAM国内短期債券マザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、主としてわが国の短期の国債、地方債、政府保証債、金融債等(以下「国債等」といいます。)に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

この投資信託は、わが国の短期の国債等を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

わが国の短期の国債等を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。

投資する個別債券の格付については、S&Pグローバル・レーティング(S&P社)、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's社)、格付投資情報センター(R&I)、日本格付研究所(JCR)のいずれかの長期信用格付が「AAマイナス」格以上のものとします。

投資する個別債券の残存期間については、原則として1年以下とします。

市場動向および資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

(3) 投資制限

株式(新株引受権証券を含みます。)への投資は行いません。

同一発行体が発行する有価証券への投資割合は、国債、地方債、特別の法律により法人の発行する債券を除き、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債等への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

(1) 当ファンドにおける主として想定されるリスクと収益性に与える影響度合い

- ・当ファンドは、主として各マザーファンド受益証券への投資を通じて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。したがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
- ・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。
- ・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・登録金融機関が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- ・投資信託は預貯金とは異なります。
- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

当ファンドにおいて主として想定されるリスクは以下の通りですが、基準価額の変動要因はこれらに限定されるものではありません。

なお、以下のリスクは、主にマザーファンドを通じて当ファンドが行う有価証券等への投資により発生します。

資産配分リスク

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

資産配分リスクとは、複数資産への投資(資産配分)を行った場合に、投資成果の悪い資産への配分が大きかったため、投資全体の成果も悪くなってしまいうリスクをいいます。

一般に、投資に際して資産配分を行う場合には、そのうちの1資産の価値変動が投資全体の成果に及ぼす影響度合いを小さくする効果が期待されますが、その場合にも、それぞれの資産の価値変動は、当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響を及ぼします。当ファンドは、国内外の公社債および株式に資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落

した場合や、複数の資産の価値が同時に下落した場合等には、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスクとは、金利変動により公社債の価格が下落するリスクをいいます。

一般に金利が上昇した場合には、既に発行されて流通している公社債の価格は下落します。金利上昇は、当ファンドが投資する公社債の価格に影響を及ぼし、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。また、金利変動により株式市場と公社債市場の間で資金シフトが起こる場合があり、その場合、金利変動の影響は株式市場にも及びます。

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。

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。

当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることがあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスクとは、為替変動により外貨建資産の円換算価格が下落するリスクをいいます。当ファンドでは、外貨建資産への投資にあたり、原則として為替ヘッジを行わないため、投資対象通貨と円との外国為替相場が円高となった場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

信用リスク

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

信用リスクとは、公社債等の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）リスクをいいます。

一般に債務不履行が生じた場合、またはその可能性が高まった場合には、当該発行体が発行する公社債および短期金融商品（コマーシャル・ペーパー等）の価格は下落します。また、当該発行体が企業の場合には、一般にその企業の株価が下落する要因となります。当ファンドが投資する公社債等の発行体や株式の発行企業がこうした状況に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

流動性リスク

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

流動性リスクとは、有価証券を売却(または購入)しようとする際に、需要(または供給)がないため、有価証券を希望する時期に、希望する価格で売却(または購入)することができなくなるリスクをいいます。

一般に規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあたっては、流動性リスクへの留意が特に必要とされます。また、一般に市場を取り巻く外部環境の急変があった場合には、市場実勢価格での売買ができなくなる可能性が高まります。当ファンドが投資する株式・公社債等の流動性が損なわれた場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

カントリーリスクとは、投資先となっている国(地域)の政治・経済・社会・国際関係等が不安定な状態、あるいは混乱した状態等に陥った場合に、当該国における資産価値や当該国通貨の価値が下落するリスクをいいます。

当ファンドの投資先となっている国(地域)がこうした状態に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

<その他>

- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- ・投資対象国において、税制、決済ルールの変更などにより税金や費用が新たに発生した場合や、外国為替取引規制や外国からの投資規制の実施などがあった場合は、当ファンドの基準価額に影響を与える場合があります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用に影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、一部解約の実行の請求金額が多額な場合や取引所等における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことがあります。

<収益分配金に関する留意点>

- ・投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落

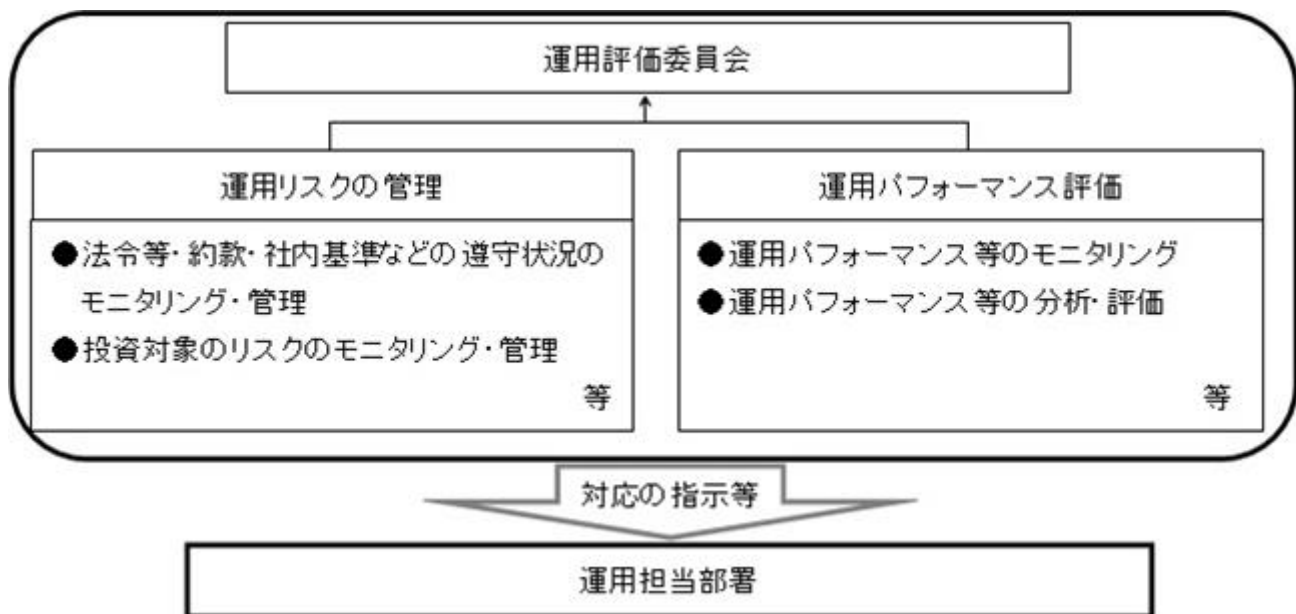
することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

- ・投資家(受益者)のファンドの取得価額によっては、分配金の一部または全部が、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。ファンド取得後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

(2) 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。

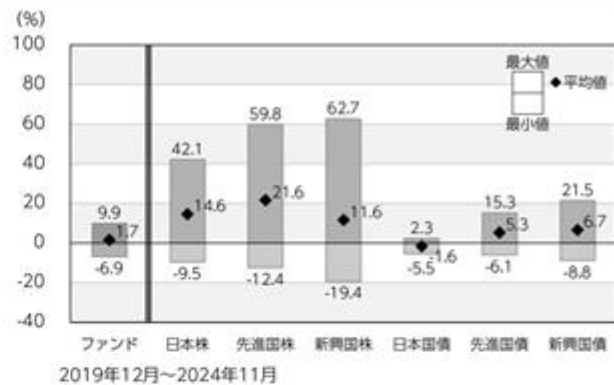
リスク管理体制は2024年11月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.649%（税抜0.59%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分（税抜）については、以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
0.38%	0.18%	0.03%

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ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税ならびに地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）を信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

委託会社	信託財産の運用、基準価額の算出、目論見書等各種書類の作成等の対価
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

(4)【その他の手数料等】

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係る消費税等相当額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、当該費用に係る消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用およびこれら手数料ならびに費用にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

上記、 の手数料等(借入金の利息および財務諸表の監査に要する費用を除きます。)については、当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおいて発生する場合、マザーファンドの信託財産中から支弁されます。これらはマザーファンドの基準価額に反映されるため、結果として当ファンドの受益者が間接的に負担することとなります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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11月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

… (参考情報) ファンドの総経費率 …

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.66%	0.65%	0.01%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年5月9日～2024年5月8日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2024年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	708,055,365	76.36
内 日本	708,055,365	76.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	219,199,325	23.64
純資産総額	927,254,690	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11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	448,202,495,200	85.93
内 日本	448,202,495,200	85.93
地方債証券	25,917,484,530	4.97
内 日本	25,917,484,530	4.97
特殊債券	24,696,564,420	4.73
内 日本	24,696,564,420	4.73
社債券	21,039,874,000	4.03
内 日本	20,646,353,000	3.96
内 フランス	393,521,000	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,724,160,376	0.33
純資産総額	521,580,578,526	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	265,141,107,095	98.56
内 アメリカ	124,486,139,339	46.28
内 中国	29,483,417,540	10.96
内 フランス	19,746,545,760	7.34
内 イタリア	18,466,310,441	6.86
内 ドイツ	15,499,544,616	5.76
内 イギリス	13,665,257,898	5.08
内 スペイン	11,931,184,903	4.44
内 カナダ	5,117,972,436	1.90
内 ベルギー	4,156,706,860	1.55
内 オランダ	3,536,100,443	1.31
内 オーストラリア	3,384,300,253	1.26
内 オーストリア	2,946,872,120	1.10
内 メキシコ	1,883,538,830	0.70
内 ポルトガル	1,559,007,492	0.58
内 ポーランド	1,329,077,602	0.49
内 マレーシア	1,320,952,461	0.49
内 フィンランド	1,320,743,025	0.49

内 アイルランド	1,244,420,687	0.46
内 シンガポール	1,059,319,275	0.39
内 イスラエル	797,134,893	0.30
内 ニュージーランド	700,515,237	0.26
内 デンマーク	696,709,982	0.26
内 スウェーデン	413,256,065	0.15
内 ノルウェー	396,078,937	0.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,867,247,236	1.44
純資産総額	269,008,354,331	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11月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	561,282,192,290	97.33
内 日本	561,282,192,290	97.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,390,584,839	2.67
純資産総額	576,672,777,129	100.00

その他資産の投資状況

2024年11月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	15,564,990,000	2.70
内 日本	15,564,990,000	2.70

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

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,692,455,478,923	96.45
内 アメリカ	1,271,348,662,903	72.45
内 イギリス	60,023,906,014	3.42
内 カナダ	57,622,911,887	3.28
内 スイス	45,272,641,148	2.58
内 フランス	41,271,460,653	2.35
内 ドイツ	37,783,247,180	2.15
内 アイルランド	33,077,109,480	1.89
内 オーストラリア	29,987,541,389	1.71
内 オランダ	26,795,534,147	1.53
内 デンマーク	13,660,387,743	0.78
内 スウェーデン	13,155,906,967	0.75
内 スペイン	11,211,123,122	0.64
内 イタリア	8,853,699,454	0.50
内 香港	6,237,790,931	0.36
内 シンガポール	5,108,417,099	0.29
内 フィンランド	4,175,711,564	0.24
内 イスラエル	3,771,514,148	0.21

内	ジャージー	3,608,230,228	0.21
内	ベルギー	3,172,793,976	0.18
内	ケイマン諸島	2,704,262,893	0.15
内	ルクセンブルグ	2,565,870,096	0.15
内	ノルウェー	2,427,218,470	0.14
内	バミューダ	2,048,152,099	0.12
内	オランダ領キュラソー	1,612,019,098	0.09
内	リベリア	1,522,722,564	0.09
内	ニュージーランド	1,309,313,234	0.07
内	オーストリア	732,427,820	0.04
内	パナマ	637,282,478	0.04
内	ポルトガル	608,694,886	0.03
内	マン島	148,925,252	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		2,558,492,898	0.15
内	オーストラリア	2,109,902,948	0.12
内	シンガポール	448,589,950	0.03
投資証券		31,099,875,821	1.77
内	アメリカ	29,506,882,697	1.68
内	フランス	652,872,915	0.04
内	イギリス	451,160,818	0.03
内	香港	266,916,616	0.02
内	カナダ	120,038,954	0.01
内	ベルギー	102,003,821	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		28,602,880,666	1.63
純資産総額		1,754,716,728,308	100.00

その他資産の投資状況

2024年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
株価指数先物取引（買建）	28,437,336,349	1.62	
内	アメリカ	22,531,522,335	1.28
内	ドイツ	3,408,204,544	0.19
内	イギリス	1,033,088,550	0.06
内	カナダ	924,379,344	0.05
内	オーストラリア	540,141,576	0.03

（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】

2024年11月29日現在

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

1	国内債券パッシブ・ファンド ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	287,050,719	1.2206 350,377,301	1.2079 346,728,563	- -	37.39
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	13,736,292	9.0821 124,755,574	9.9161 136,210,445	- -	14.69
3	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	53,956,712	2.3844 128,658,409	2.4007 129,533,878	- -	13.97
4	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	19,993,825	4.7275 94,520,854	4.7806 95,582,479	- -	10.31

（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11月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	76.36
合計	76.36

（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11月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	349回 利付国庫債券 （10年） 日本	国債証 券	8,350,000,000	99.12 8,276,809,000	98.45 8,221,243,000	0.1 2027/12/20	1.58
2	350回 利付国庫債券 （10年） 日本	国債証 券	6,800,000,000	99.02 6,733,360,000	98.30 6,684,672,000	0.1 2028/3/20	1.28
3	150回 利付国庫債券 （5年） 日本	国債証 券	6,370,000,000	99.17 6,317,291,000	98.83 6,295,789,500	0.005 2026/12/20	1.21
4	348回 利付国庫債券 （10年） 日本	国債証 券	5,570,000,000	99.49 5,541,832,000	98.60 5,492,521,300	0.1 2027/9/20	1.05
5	153回 利付国庫債券 （5年） 日本	国債証 券	5,210,000,000	99.41 5,179,677,800	98.51 5,132,839,900	0.005 2027/6/20	0.98
6	345回 利付国庫債券 （10年） 日本	国債証 券	5,060,000,000	99.61 5,040,302,000	99.02 5,010,766,200	0.1 2026/12/20	0.96
7	365回 利付国庫債券 （10年） 日本	国債証 券	5,030,000,000	96.12 4,835,132,000	95.39 4,798,217,600	0.1 2031/12/20	0.92

8	371回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	96.72 4,836,496,000	95.87 4,793,950,000	0.4 2033/6/20	0.92
9	375回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,680,000,000	101.98 4,773,092,000	100.78 4,716,644,400	1.1 2034/6/20	0.90
10	370回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,850,000,000	97.91 4,748,635,000	96.98 4,703,869,500	0.5 2033/3/20	0.90
11	369回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,820,000,000	98.50 4,748,105,000	97.25 4,687,594,600	0.5 2032/12/20	0.90
12	372回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,600,000,000	100.04 4,602,124,000	98.94 4,551,332,000	0.8 2033/9/20	0.87
13	374回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,600,000,000	99.48 4,576,422,000	98.38 4,525,572,000	0.8 2034/3/20	0.87
14	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,750,000,000	96.06 4,562,850,000	95.21 4,522,475,000	0.2 2032/9/20	0.87
15	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,540,000,000	99.84 4,533,008,400	98.90 4,490,105,400	0.1 2027/3/20	0.86
16	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,670,000,000	96.90 4,525,498,000	95.91 4,479,137,100	0.1 2031/6/20	0.86
17	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	99.73 4,488,030,000	98.75 4,444,065,000	0.1 2027/6/20	0.85
18	154回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	99.30 4,468,869,000	98.60 4,437,405,000	0.1 2027/9/20	0.85
19	358回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,550,000,000	97.78 4,448,990,000	96.81 4,404,946,000	0.1 2030/3/20	0.84
20	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,200,000,000	97.92 4,112,651,000	96.97 4,073,118,000	0.1 2029/12/20	0.78
21	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,210,000,000	97.30 4,096,510,000	96.15 4,047,915,000	0.1 2031/3/20	0.78
22	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,150,000,000	98.04 4,068,766,500	96.64 4,010,560,000	0.1 2030/6/20	0.77
23	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	97.82 4,010,661,000	96.46 3,955,147,000	0.1 2030/9/20	0.76
24	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	97.57 4,000,370,000	96.32 3,949,202,000	0.1 2030/12/20	0.76

25	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,110,000,000	96.54 3,967,794,000	95.67 3,932,037,000	0.1 2031/9/20	0.75
26	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,040,000,000	97.01 3,919,204,000	95.79 3,870,198,800	0.2 2032/3/20	0.74
27	373回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,950,000,000	97.90 3,867,104,000	96.96 3,829,999,000	0.6 2033/12/20	0.73
28	367回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,970,000,000	96.33 3,824,444,000	95.49 3,790,992,700	0.2 2032/6/20	0.73
29	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,730,000,000	98.61 3,678,170,000	97.31 3,629,737,600	0.1 2029/6/20	0.70
30	163回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,650,000,000	99.88 3,645,810,000	99.05 3,615,471,000	0.4 2028/9/20	0.69

(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11月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	85.93
地方債証券	4.97
特殊債券	4.73
社債券	4.03
合計	99.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証券	1,281,290,000	101.77 1,304,053,422	100.96 1,293,602,402	4.375 2034/5/15	0.48
2	US T N/B 3.875 08/15/34 アメリカ	国債証券	1,205,920,000	99.80 1,203,622,045	97.02 1,170,025,042	3.875 2034/8/15	0.43
3	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証券	1,130,550,000	97.94 1,107,368,274	98.10 1,109,153,459	4 2034/2/15	0.41
4	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,293,349,200	83.76 1,083,406,346	85.65 1,107,758,645	1.875 2032/2/15	0.41
5	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,055,180,000	100.86 1,064,285,968	101.92 1,075,500,455	4.5 2033/11/15	0.40
6	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,181,801,600	89.86 1,062,015,403	90.44 1,068,930,315	2.75 2032/8/15	0.40

7	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 中国	国債証 券	1,039,885,000	100.02 1,040,143,807	101.30 1,053,452,691	2.18 2026/8/15	0.39
8	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,260,186,400	80.82 1,018,541,957	82.96 1,045,462,456	1.25 2031/8/15	0.39
9	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証 券	1,029,486,150	100.31 1,032,716,033	101.29 1,042,839,203	2.3 2026/5/15	0.39
10	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証 券	1,092,865,000	94.12 1,028,682,294	95.02 1,038,499,235	3.5 2033/2/15	0.39
11	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証 券	1,055,180,000	96.78 1,021,216,016	97.38 1,027,543,347	3.875 2033/8/15	0.38
12	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証 券	969,172,820	101.31 981,940,407	102.19 990,417,088	2.69 2026/8/12	0.37
13	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	1,062,717,000	90.28 959,502,679	91.54 972,863,448	2.875 2032/5/15	0.36
14	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証 券	1,055,180,000	91.41 964,572,220	90.80 958,173,514	1.125 2028/2/29	0.36
15	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証 券	1,009,958,000	93.91 948,467,074	93.96 949,005,454	3.375 2033/5/15	0.35
16	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	1,106,431,600	83.71 926,268,672	85.66 947,792,640	1.625 2031/5/15	0.35
17	US T N/B 4.0 02/29/28 アメリカ	国債証 券	934,588,000	98.88 924,210,615	99.47 929,696,010	4 2028/2/29	0.35
18	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証 券	904,440,000	98.40 890,025,487	99.24 897,639,036	3.75 2026/4/15	0.33
19	CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29 中国	国債証 券	873,503,400	100.31 876,229,437	101.03 882,562,154	1.91 2029/7/15	0.33
20	US T N/B 6.25 05/15/30 アメリカ	国債証 券	792,741,660	111.82 886,507,143	110.17 873,378,349	6.25 2030/5/15	0.32
21	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証 券	904,440,000	92.22 834,098,588	95.14 860,489,867	0.75 2026/4/30	0.32
22	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 中国	国債証 券	811,110,300	103.05 835,926,757	104.91 851,000,136	3.01 2028/5/13	0.32
23	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	1,008,450,600	81.48 821,768,691	83.74 844,537,984	1.125 2031/2/15	0.31
24	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証 券	844,144,000	98.74 833,528,706	99.51 840,071,662	4.125 2032/11/15	0.31
25	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証 券	811,110,300	101.94 826,894,783	102.19 828,895,028	3.03 2026/3/11	0.31
26	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証 券	862,232,800	92.49 797,531,660	95.39 822,556,621	0.75 2026/3/31	0.31
27	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証 券	859,218,000	92.22 792,410,438	95.48 820,418,934	0.375 2026/1/31	0.30
28	US T N/B 0.75 05/31/26 アメリカ	国債証 券	848,666,200	91.97 780,524,268	94.87 805,172,057	0.75 2026/5/31	0.30

29	US T N/B 2.875 05/15/52 アメリカ	国債証券	1,056,687,400	73.04 771,866,560	74.42 786,447,848	2.875 2052/5/15	0.29
30	US T N/B 1.25 04/30/28 アメリカ	国債証券	859,218,000	88.38 759,446,409	90.75 779,807,454	1.25 2028/4/30	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年11月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.56
合計	98.56

(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11月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,774,300	3,229.02 25,103,413,685	2,551.50 19,836,126,450	- -	3.44
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,446,400	1,437.10 13,575,442,635	1,792.00 16,927,948,800	- -	2.94
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,121,400	2,832.46 14,506,178,288	3,007.00 15,400,049,800	- -	2.67
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,803,600	2,555.42 9,719,797,911	3,751.00 14,267,303,600	- -	2.47
5	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,173,000	6,277.47 7,363,472,871	10,385.00 12,181,605,000	- -	2.11
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,004,800	2,639.02 7,929,738,671	3,686.00 11,075,692,800	- -	1.92
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	146,300	64,403.38 9,422,214,880	64,720.00 9,468,536,000	- -	1.64
8	任天堂 日本	株式 その他製品	923,400	8,314.85 7,677,939,671	8,810.00 8,135,154,000	- -	1.41
9	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,406,200	4,040.46 5,681,700,022	5,564.00 7,824,096,800	- -	1.36
10	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,040,100	6,783.93 7,055,969,063	7,384.00 7,680,098,400	- -	1.33
11	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,944,100	2,765.81 5,377,020,214	3,784.00 7,356,474,400	- -	1.28

12	信越化学工業 日本	株式 化学	1,313,700	5,852.47 7,688,391,162	5,554.00 7,296,289,800	- -	1.27
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	2,859,600	2,821.51 8,068,413,262	2,525.50 7,221,919,800	- -	1.25
14	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	309,500	28,649.05 8,866,883,926	23,310.00 7,214,445,000	- -	1.25
15	三井物産 日本	株式 卸売業	2,273,300	2,966.23 6,743,151,984	3,136.00 7,129,068,800	- -	1.24
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	43,630,000	180.33 7,867,881,735	153.40 6,692,842,000	- -	1.16
17	第一三共 日本	株式 医薬品	1,384,300	4,627.05 6,405,235,630	4,749.00 6,574,040,700	- -	1.14
18	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	723,500	6,843.95 4,951,604,665	8,936.00 6,465,196,000	- -	1.12
19	三菱重工業 日本	株式 機械	2,583,100	1,128.03 2,913,829,896	2,197.50 5,676,362,250	- -	0.98
20	HOYA 日本	株式 精密機器	285,700	18,502.50 5,286,165,801	19,260.00 5,502,582,000	- -	0.95
21	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,078,700	4,596.50 4,958,247,131	4,950.00 5,339,565,000	- -	0.93
22	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,305,100	4,218.79 5,505,943,064	4,083.00 5,328,723,300	- -	0.92
23	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	23,468,400	193.98 4,552,613,436	193.10 4,531,748,040	- -	0.79
24	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,465,100	1,698.53 5,885,577,687	1,291.50 4,475,176,650	- -	0.78
25	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	1,709,300	2,034.22 3,477,096,709	2,604.00 4,451,017,200	- -	0.77
26	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	87,000	39,802.58 3,462,824,701	51,110.00 4,446,570,000	- -	0.77
27	富士通 日本	株式 電気機器	1,359,300	2,327.71 3,164,069,068	2,866.00 3,895,753,800	- -	0.68
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,502,400	2,065.30 3,102,912,291	2,547.00 3,826,612,800	- -	0.66
29	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	460,900	6,389.97 2,945,137,728	8,240.00 3,797,816,000	- -	0.66
30	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	875,100	3,964.37 3,469,224,166	4,219.00 3,692,046,900	- -	0.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年11月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.33
合計	97.33

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年11月29日現在

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	16.86
銀行業		8.55
情報・通信業		7.46
輸送用機器		6.76
卸売業		6.56
機械		5.39
化学		5.19
サービス業		5.02
小売業		4.52
医薬品		4.46
保険業		3.22
食料品		3.10
その他製品		2.54
精密機器		2.37
陸運業		2.32
建設業		2.11
不動産業		1.76
電気・ガス業		1.26
その他金融業		1.20
証券、商品先物取引業		0.86
非鉄金属		0.80
鉄鋼		0.80
ガラス・土石製品		0.65
海運業		0.64
ゴム製品		0.56
石油・石炭製品		0.54
金属製品		0.49
繊維製品		0.40
空運業		0.34
鉱業		0.25
倉庫・運輸関連業		0.14
パルプ・紙		0.13
水産・農林業	0.08	
合計		97.33

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

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

1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,574,224	28,591.46 73,600,841,613	35,413.34 91,161,890,856	- -	5.20
2	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	4,153,709	12,026.79 49,955,795,293	20,401.15 84,740,447,011	- -	4.83
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,195,388	62,018.67 74,136,375,790	63,761.51 76,219,747,023	- -	4.34
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,599,478	26,117.58 41,774,510,246	31,013.24 49,605,007,244	- -	2.83
5	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	370,050	72,296.88 26,753,462,825	85,801.20 31,750,737,020	- -	1.81
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	991,958	22,429.52 22,249,146,334	25,509.73 25,304,580,949	- -	1.44
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	487,273	29,289.87 14,272,165,032	50,179.83 24,451,280,494	- -	1.39
8	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	850,403	22,573.84 19,196,863,850	25,749.40 21,897,372,790	- -	1.25
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	481,676	27,230.25 13,116,162,615	37,653.34 18,136,712,413	- -	1.03
10	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	752,345	19,736.21 14,848,446,085	24,068.65 18,107,932,847	- -	1.03
11	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	137,173	116,233.84 15,944,145,332	118,811.76 16,297,765,636	- -	0.93
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	223,286	60,874.75 13,592,481,494	72,819.47 16,259,570,232	- -	0.93

13	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロ バイ ダー/ヘル スケア ・サー ビス	155,633	78,605.74 12,233,647,481	91,707.20 14,272,666,844	- -	0.81
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	282,767	42,207.86 11,934,992,511	47,437.87 13,413,866,448	- -	0.76
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	749,411	15,418.66 11,554,915,135	17,736.06 13,291,604,755	- -	0.76
16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	138,792	70,275.63 9,753,695,393	80,250.96 11,138,191,406	- -	0.63
17	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	74,836	111,474.86 8,342,333,346	144,944.04 10,847,032,701	- -	0.62
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	167,305	54,081.40 9,048,089,934	64,394.62 10,773,541,999	- -	0.61
19	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	398,105	23,673.15 9,424,401,943	27,036.72 10,763,455,963	- -	0.61
20	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	746,634	8,750.13 6,533,145,099	13,849.99 10,340,874,329	- -	0.59
21	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	72,847	89,296.61 6,504,990,400	132,250.23 9,634,032,621	- -	0.55
22	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	406,354	23,453.96 9,530,611,738	23,424.99 9,518,840,824	- -	0.54
23	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	545,450	18,157.92 9,904,240,042	15,953.78 8,701,991,482	- -	0.50
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,177,385	5,120.22 6,028,473,538	7,200.84 8,478,172,541	- -	0.48
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	298,381	26,450.99 7,892,474,875	27,597.47 8,234,563,441	- -	0.47
26	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	161,829	43,210.07 6,992,642,669	49,745.70 8,050,298,082	- -	0.46
27	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	279,665	17,788.35 4,974,779,581	27,540.19 7,702,029,473	- -	0.44

28	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	295,246	22,781.38 6,726,112,111	24,436.46 7,214,767,482	- -	0.41
29	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	67,811	134,978.08 9,152,999,125	102,349.67 6,940,434,150	- -	0.40
30	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	576,023	7,479.05 4,308,109,917	11,638.63 6,704,121,679	- -	0.38

（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11月29日現在

種類	投資比率（％）
株式	96.45
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.15
投資証券	1.77
合計	98.37

（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11月29日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	8.71
半導体・半導体製造装置		8.61
銀行		5.71
コンピュータ・周辺機器		5.49
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.62
医薬品		4.27
石油・ガス・消耗燃料		3.84
資本市場		3.57
大規模小売り		3.25
金融サービス		3.25
保険		3.07
ヘルスケア機器・用品		2.08
航空宇宙・防衛		2.00
ホテル・レストラン・レジャー		1.98
自動車		1.83
生活必需品流通・小売り		1.81
機械		1.81
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.80
専門小売り		1.67
電力		1.62
バイオテクノロジー		1.58
化学		1.56
情報技術サービス		1.33
娯楽		1.32
飲料		1.21
金属・鉱業		1.15

電気設備	1.14
食品	1.02
家庭用品	0.98
陸上運輸	0.95
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.95
専門サービス	0.95
各種電気通信サービス	0.92
繊維・アパレル・贅沢品	0.82
通信機器	0.73
総合公益事業	0.71
建設関連製品	0.67
商業サービス・用品	0.64
コングロマリット	0.62
タバコ	0.59
メディア	0.55
パーソナルケア用品	0.50
電子装置・機器・部品	0.50
商社・流通業	0.49
消費者金融	0.48
航空貨物・物流サービス	0.41
建設資材	0.33
建設・土木	0.32
家庭用耐久財	0.30
不動産管理・開発	0.29
無線通信サービス	0.25
容器・包装	0.21
エネルギー設備・サービス	0.21
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.16
運送インフラ	0.08
自動車用部品	0.08
水道	0.08
ガス	0.08
販売	0.07
紙製品・林産品	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.06
旅客航空輸送	0.05
海上運輸	0.04
各種消費者サービス	0.02
合計	96.45

(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】

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。

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。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

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。

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11月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0612月	買建	581	15,617,991,730	15,564,990,000	2.70

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Dec24	買建	497	22,002,801,785	22,531,522,335	1.28
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec24	買建	449	3,469,130,384	3,408,204,544	0.19
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec24	買建	65	1,017,834,456	1,033,088,550	0.06
	モン トリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec24	買建	28	891,785,241	924,379,344	0.05
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Dec24	買建	26	526,021,365	540,141,576	0.03

（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】

直近日（2024年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2016年 5月 9日)	1	1	0.9860	0.9860
第2計算期間末 (2017年 5月 8日)	217	217	1.0039	1.0039
第3計算期間末 (2018年 5月 8日)	289	289	1.0266	1.0266
第4計算期間末 (2019年 5月 8日)	397	397	1.0208	1.0208
第5計算期間末 (2020年5月8日)	489	489	0.9968	0.9968
第6計算期間末 (2021年5月10日)	600	600	1.0465	1.0465
第7計算期間末 (2022年5月9日)	709	709	1.0329	1.0329
第8計算期間末 (2023年5月8日)	763	763	1.0290	1.0290
第9計算期間末 (2024年5月8日)	888	888	1.1148	1.1148
2023年11月末日	824	-	1.0662	-
12月末日	836	-	1.0693	-
2024年1月末日	846	-	1.0889	-
2月末日	873	-	1.1055	-
3月末日	890	-	1.1190	-
4月末日	886	-	1.1174	-
5月末日	885	-	1.1163	-
6月末日	902	-	1.1334	-
7月末日	888	-	1.1177	-
8月末日	888	-	1.1088	-
9月末日	892	-	1.1106	-
10月末日	937	-	1.1253	-
11月末日	927	-	1.1192	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
2024年5月9日～2024年11月8日	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.40
第2計算期間	1.82
第3計算期間	2.26
第4計算期間	0.56
第5計算期間	2.4
第6計算期間	5.0
第7計算期間	1.3
第8計算期間	0.4
第9計算期間	8.3
2024年5月9日～2024年11月8日	1.1

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）計算期間末が2019年8月29日以前の収益率については、小数点第2位で表示しています。

（4）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	3,049,848	1,969,584
第2計算期間	251,804,976	35,891,119
第3計算期間	84,136,037	18,864,592
第4計算期間	138,378,667	31,183,232
第5計算期間	146,647,081	44,796,931
第6計算期間	140,337,450	57,852,278
第7計算期間	173,877,049	60,405,379
第8計算期間	123,891,862	69,590,091
第9計算期間	135,078,320	79,383,426
2024年5月9日～ 2024年11月8日	78,399,832	46,170,113

（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。

参考情報

データの基準日:2024年11月29日

基準価額・純資産の推移 (2015年11月30日~2024年11月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2015年11月30日)

分配の推移(税引前)

2020年 5月	0円
2021年 5月	0円
2022年 5月	0円
2023年 5月	0円
2024年 5月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	37.39
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.69
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.97
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	10.31

■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	349回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/12/20	1.58
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.28
3	150回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2026/12/20	1.21
4	348回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/9/20	1.05
5	153回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2027/6/20	0.98

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 4.375 05/15/34	国債証券	アメリカ	4.375	2034/5/15	0.48
2	US T N/B 3.875 08/15/34	国債証券	アメリカ	3.875	2034/8/15	0.43
3	US T N/B 4.0 02/15/34	国債証券	アメリカ	4	2034/2/15	0.41
4	US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	アメリカ	1.875	2032/2/15	0.41
5	US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	アメリカ	4.5	2033/11/15	0.40

○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。

■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	3.44
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.94
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.67
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.47
5	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	2.11

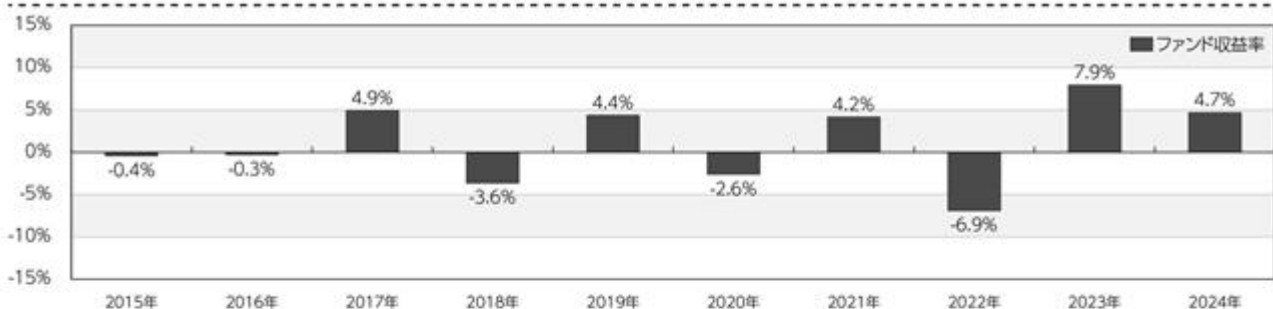
■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	5.20
2	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	4.83
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.34
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.83
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	1.81

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。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1)当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時30分までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該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分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。ただし、取得申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、お申込みの受付はいたしません。
- (2)取得申込者は販売会社に、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、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、
- (3)受益権の取得のお申込みは、確定拠出年金制度による取得のお申込みのみを対象といたします。確定拠出年金制度を通じての取得のお申込みについては、確定拠出年金制度の定めにしたがうものとし、
- (4)当ファンドは、収益分配がなされた場合、分配金を自動的に無手数料で再投資する「自動けいぞく投資」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、分配金自動けいぞく投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、
- (5)取得申込者は、販売会社において、1円以上1円単位をもって購入することができます。
- (6)取得申込みにかかる受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- (7)分配金自動けいぞく投資に関する契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
- (8)信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、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、販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、1口単位をもって解約を請求することができます。
- (2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる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、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。
- (3) 解約請求の受付けについては、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時30分までに解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付け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分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。ただし、解約請求受付日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、解約請求の受付けはいたしません。
- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。詳しくは、委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	0120-104-694

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時から午後5時までとさせていただきます。

（以下同じ。）

- (5) 解約代金は、受益者の解約請求を受付けた日から起算して、原則として、6営業日目から受益者に支払われます。
- (6) 信託財産の資金管理を円滑に行うために、大口の解約請求には制限を設ける場合があります。
- (7) 委託会社は、信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合（一部解約の実行の請求金額が多額な場合を含みます。）、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、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この日が前記(3)に規定する一部解約の実行の請求を受付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、前記(4)の規定に準じて算出した価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、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従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（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

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

外国で取引されているものについては、計算日の直近の日とします。

当ファンドの基準価額は、委託会社の毎営業日（土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。）に計算されます。基準価額については、委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。基準価額は1万口単位で表示されたものが発表されます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	https://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2015年11月30日から無期限とします。

(4)【計算期間】

原則として毎年5月9日から翌年5月8日までとします。ただし、第1計算期間は2015年11月30日から2016年5月8日までとします。

上記の規定にかかわらず、計算期間終了日に該当する日（以下「当該日」といいます。）が休業日のとき、計算期間終了日は、当該日の翌日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

信託契約の解約

1. 委託会社は、次のいずれかに該当する場合、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させることがあります。この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。ただし、当該信託契約の解約についての委託会社による提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合にも書面決議は行いません。
 - a. この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき。
 - b. やむを得ない事情が発生したとき。
 - c. 信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることでなるとき。
2. 前記1.により信託契約を解約する場合には、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。
3. 委託会社は、次の事象が起きた場合、信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させます。
 - a. 委託会社が監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき。
 - b. 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。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更等」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。
 - c. 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において、委託会社が新受託会社を選任できないとき。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は「信託約款の変更等」および「書面決議」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、
2. 委託会社は、前記1.の事項(前記1.の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前記1.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及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。ただし、当該重大な約款の変更等についての委託会社による提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。
3. 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つても、当該併合にかかる一又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。
4. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

書面決議

1. 委託会社は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に係る書面決議を行う場合には、あらかじめ、書面決議の日および当該決議の内容に応じて次の事項をそれぞれ定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約または信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
 - a. 信託契約の解約の場合 信託契約の解約の理由など
 - b. 重大な約款の変更等の場合 重大な約款の変更等の内容およびその理由など
2. 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係る受益者としての受託会社を除きます。以下この2.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、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
3. 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。
4. 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。
5. この信託は、受益者が一部解約の実行の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、信託契約の解約または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の買取請求の規定の適用を受けません。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

1. 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
2. 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

関係法人との契約の更改ならびに受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 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。また、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し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、「信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について、株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

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、次のアドレスに掲載します。

<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ます。

運用報告書

委託会社は、決算時および信託終了時に期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じて交付いたします。
- ・ 運用報告書(全体版)は、次のアドレスに掲載します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、交付いたします。

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金請求権

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

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

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2023年5月9日から2024年5月8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】

【動的パッケージファンド<DC年金>】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第8期 2023年5月8日現在	第9期 2024年5月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	22,012,142	202,934,166
親投資信託受益証券	745,540,085	689,536,372
流動資産合計	767,552,227	892,470,538
資産合計	767,552,227	892,470,538
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,115,467	934,923
未払受託者報酬	119,193	139,628
未払委託者報酬	2,225,643	2,607,250
その他未払費用	14,079	16,476
流動負債合計	4,474,382	3,698,277
負債合計	4,474,382	3,698,277
純資産の部		
元本等		
元本	741,569,764	797,264,658
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	21,508,081	91,507,603
(分配準備積立金)	329,508,582	306,064,972
元本等合計	763,077,845	888,772,261
純資産合計	763,077,845	888,772,261
負債純資産合計	767,552,227	892,470,538

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第8期 自 2022年5月10日 至 2023年5月8日	第9期 自 2023年5月9日 至 2024年5月8日
営業収益		
受取利息	144	19,723
有価証券売買等損益	2,845,097	70,996,287
その他収益	4,546	39,665
営業収益合計	2,849,787	71,055,675
営業費用		
支払利息	7,226	24,668
受託者報酬	238,786	270,784
委託者報酬	4,458,645	5,056,535
その他費用	28,186	33,145
営業費用合計	4,732,843	5,385,132
営業利益又は営業損失()	1,883,056	65,670,543
経常利益又は経常損失()	1,883,056	65,670,543
当期純利益又は当期純損失()	1,883,056	65,670,543
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()	813,693	2,970,132
期首剰余金又は期首欠損金()	22,592,576	21,508,081
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,219,431	9,788,536
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	2,219,431	9,788,536
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,234,563	2,489,425
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,234,563	2,489,425
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()	21,508,081	91,507,603

(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9期	
	自 2023年5月9日	至 2024年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第8期	第9期
	2023年5月8日現在	2024年5月8日現在
1. 期首元本額	687,267,993円	741,569,764円
期中追加設定元本額	123,891,862円	135,078,320円
期中一部解約元本額	69,590,091円	79,383,426円
2. 受益権の総数	741,569,764口	797,264,658口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期	第9期
	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日	自 2023年5月9日 至 2024年5月8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(3,458,179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(115,182,499円)及び分配準備積立金(326,050,403円)より分配対象収益は444,691,081円(1万口当たり5,996.61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(9,004,853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(181,093,944円)及び分配準備積立金(297,060,119円)より分配対象収益は487,158,916円(1万口当たり6,110.37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8期	第9期
	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日	自 2023年5月9日 至 2024年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 2023年5月8日現在	第9期 2024年5月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2023年5月8日現在	第9期 2024年5月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	8,182,315	64,412,497
合計	8,182,315	64,412,497

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第8期 2023年5月8日現在	第9期 2024年5月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0290円 (10,290円)	1.1148円 (11,148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5月8日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	265,939,792	325,058,207	
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	25,746,688	122,803,977	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12,852,907	115,744,283	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	52,571,556	125,929,905	
親投資信託受益証券	合計	357,110,943	689,536,372	
合計			689,536,372	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・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」受益証券及び「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託

受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年5月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,009,706,516
国債証券	475,414,712,300
地方債証券	27,615,059,454
特殊債証券	27,561,377,563
社債証券	23,336,540,800
未収利息	780,920,655
前払費用	144,851,821
流動資産合計	556,863,169,109
資産合計	556,863,169,109
負債の部	
流動負債	
未払解約金	475,593,000
流動負債合計	475,593,000
負債合計	475,593,000
純資産の部	
元本等	
元本	455,201,238,597
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	101,186,337,512
元本等合計	556,387,576,109
純資産合計	556,387,576,109
負債純資産合計	556,863,169,109

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5月9日 至 2024年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年5月8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	383,609,412,287円
同期中追加設定元本額	566,509,832,155円
同期中一部解約元本額	494,918,005,845円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	30,490,826,635円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	55,031,877円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	89,311,924円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	50,509,274円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	656,540,044円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	293,537,531円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	34,881,706円
たわらノーロード 国内債券	19,339,170,888円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	6,464,786,563円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,613,734,159円
たわらノーロード バランス（標準型）	3,263,954,144円
たわらノーロード バランス（積極型）	466,531,064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）	192,630,589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）	2,532,354,554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）	2,919,493,324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）	923,027,366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）	40,481,147円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	21,317,178円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	200,188,707円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	8,074,649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>	12,878,869,744円
Oneグローバルバランス	159,401,890円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	11,583,143,639円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	16,902,174,052円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	7,965,731,496円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,766,926,154円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,863,080,547円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	573,169,480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）	5,707,899,769円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,492,819,028円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	537,588,742円
投資のソムリエ	92,478,105,446円
クルーズコントロール	683,321,107円
投資のソムリエ<DC年金>	9,543,323,876円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	8,253,140,114円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,445,399,288円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,556,732,345円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	33,480,714,522円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	475,476,695円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	244,099,044円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	95,406,625円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,927,747,214円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,883,681,650円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,558,347,662円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,383,173,579円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	711,668,086円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	262,633,080円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	162,399,338円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,514,606,911円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	40,370,385円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	165,119,633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)	1,184,343,057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)	1,188,576,778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)	1,072,198,586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)	715,921,514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)	1,173,541,074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)	3,023,004,718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)	2,041,104,043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)	825,404,410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)	2,080,876,992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)	1,304,385,768円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,555,061,572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)	2,014,556,875円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,429,743,606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)	603,246,299円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	274,365,755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)	3,475,095,413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)	3,486,432,712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)	3,459,020,369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)	1,965,182,850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)	52,338,632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)	795,265,248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)	154,950,103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)	104,255,954円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	22,729,996円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	57,159,392円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	28,831,970円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	405,463円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,062,823円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	58,099,618円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,617,690,310円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,186,000,529円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,524,497,833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)	58,586,164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)	125,854,967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)	1,538,998,395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)	100,557,367円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	596,505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)	1,397,614,903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)	28,824,887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)	269,771,727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)	484,366,111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)	796,677,225円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	205,408,605円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	55,923,953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>	265,939,792円
コア資産形成ファンド	127,149,287円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	20,210,802,705円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	29,891,968,567円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	21,046,829,509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]	149,102,012円
計	455,201,238,597円
2. 受益権の総数	455,201,238,597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5月9日 至 2024年5月8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5月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年5月8日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	5,536,915,100
地方債証券	178,339,503
特殊債券	239,067,240
社債券	103,582,000
合計	6,057,903,843

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年2月15日から2024年5月8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5月8日現在
1口当たり純資産額	1.2223円

(1万口当たり純資産額)

(12,223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5月8日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	450回 利付国庫債券(2年)	8,800,000,000	8,789,880,000	
	451回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	998,520,000	
	455回 利付国庫債券(2年)	2,900,000,000	2,890,488,000	
	456回 利付国庫債券(2年)	9,300,000,000	9,280,098,000	
	457回 利付国庫債券(2年)	3,200,000,000	3,191,968,000	
	458回 利付国庫債券(2年)	3,300,000,000	3,296,700,000	
	459回 利付国庫債券(2年)	900,000,000	898,893,000	
	145回 利付国庫債券(5年)	7,300,000,000	7,294,452,000	
	146回 利付国庫債券(5年)	4,700,000,000	4,691,258,000	
	147回 利付国庫債券(5年)	1,050,000,000	1,045,128,000	
	148回 利付国庫債券(5年)	4,610,000,000	4,582,847,100	
	149回 利付国庫債券(5年)	1,680,000,000	1,668,727,200	
	150回 利付国庫債券(5年)	3,570,000,000	3,542,653,800	
	151回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,586,144,000	
	152回 利付国庫債券(5年)	1,290,000,000	1,282,311,600	
	153回 利付国庫債券(5年)	5,210,000,000	5,158,577,300	
	154回 利付国庫債券(5年)	3,300,000,000	3,273,633,000	
	155回 利付国庫債券(5年)	2,700,000,000	2,694,195,000	
	156回 利付国庫債券(5年)	7,200,000,000	7,158,816,000	
	157回 利付国庫債券(5年)	100,000,000	99,314,000	

158回 利付国庫債券(5年)	3,600,000,000	3,561,624,000	
159回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,161,120,000	
160回 利付国庫債券(5年)	7,100,000,000	7,042,490,000	
163回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	2,996,760,000	
164回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,482,705,000	
165回 利付国庫債券(5年)	2,900,000,000	2,879,671,000	
166回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,496,595,000	
167回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	996,190,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	123,175,800	
2回 利付国庫債券(40年)	330,000,000	355,109,700	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	579,139,200	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	769,356,000	
5回 利付国庫債券(40年)	710,000,000	726,237,700	
6回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	936,503,200	
7回 利付国庫債券(40年)	880,000,000	833,756,000	
8回 利付国庫債券(40年)	990,000,000	865,081,800	
9回 利付国庫債券(40年)	2,090,000,000	1,319,772,300	
10回 利付国庫債券(40年)	1,730,000,000	1,282,691,200	
11回 利付国庫債券(40年)	1,440,000,000	1,021,032,000	
12回 利付国庫債券(40年)	1,420,000,000	887,656,200	
13回 利付国庫債券(40年)	1,790,000,000	1,101,583,900	
14回 利付国庫債券(40年)	2,200,000,000	1,444,476,000	
15回 利付国庫債券(40年)	2,740,000,000	1,982,965,400	
16回 利付国庫債券(40年)	2,400,000,000	1,901,640,000	
339回 利付国庫債券(10年)	3,980,000,000	3,993,054,400	
340回 利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,311,022,000	
341回 利付国庫債券(10年)	3,620,000,000	3,624,923,200	
342回 利付国庫債券(10年)	3,520,000,000	3,509,862,400	
343回 利付国庫債券(10年)	4,090,000,000	4,074,089,900	
344回 利付国庫債券(10年)	3,570,000,000	3,554,042,100	

345回 利付国庫債券(10年)	4,890,000,000	4,864,572,000	
346回 利付国庫債券(10年)	4,540,000,000	4,512,941,600	
347回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,468,770,000	
348回 利付国庫債券(10年)	4,070,000,000	4,037,480,700	
349回 利付国庫債券(10年)	2,350,000,000	2,328,168,500	
350回 利付国庫債券(10年)	10,400,000,000	10,289,136,000	
351回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,358,690,000	
352回 利付国庫債券(10年)	4,950,000,000	4,880,997,000	
353回 利付国庫債券(10年)	3,690,000,000	3,630,738,600	
354回 利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,416,138,200	
355回 利付国庫債券(10年)	3,730,000,000	3,659,204,600	
356回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,330,640,000	
357回 利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,640,978,000	
358回 利付国庫債券(10年)	7,750,000,000	7,566,945,000	
359回 利付国庫債券(10年)	4,050,000,000	3,946,846,500	
360回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	3,985,241,000	
361回 利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	3,877,640,000	
362回 利付国庫債券(10年)	4,210,000,000	4,071,238,400	
363回 利付国庫債券(10年)	4,470,000,000	4,310,108,100	
364回 利付国庫債券(10年)	5,350,000,000	5,141,296,500	
365回 利付国庫債券(10年)	3,730,000,000	3,573,302,700	
366回 利付国庫債券(10年)	6,280,000,000	6,045,944,400	
367回 利付国庫債券(10年)	6,900,000,000	6,622,344,000	
368回 利付国庫債券(10年)	4,750,000,000	4,544,277,500	
369回 利付国庫債券(10年)	6,820,000,000	6,676,575,400	

370回 利付国庫債券(10年)	5,900,000,000	5,763,002,000	
371回 利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	3,667,722,000	
372回 利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	4,991,300,000	
373回 利付国庫債券(10年)	7,600,000,000	7,427,784,000	
374回 利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,787,742,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	123,481,600	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	110,809,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	229,934,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	225,542,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	269,802,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	256,500,600	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	165,924,000	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	389,017,800	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	300,237,600	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	277,332,000	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	309,544,200	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	454,964,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	318,642,800	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	382,866,000	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	353,226,400	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	336,843,700	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	406,728,000	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	375,952,500	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	713,638,600	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	720,731,400	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	894,824,700	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	987,675,600	

30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	997,691,200	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	804,542,400	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,095,401,600	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,278,530,000	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,331,868,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,140,878,000	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,470,640,200	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,434,201,600	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	879,724,500	
39回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,269,640,900	
40回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,061,239,900	
41回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,071,819,000	
42回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,008,980,000	
43回 利付国庫債券(30年)	1,610,000,000	1,622,155,500	
44回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,136,870,400	
45回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,114,879,000	
46回 利付国庫債券(30年)	1,670,000,000	1,616,059,000	
47回 利付国庫債券(30年)	1,340,000,000	1,318,144,600	
48回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	1,154,486,000	
49回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,227,668,000	
50回 利付国庫債券(30年)	2,250,000,000	1,874,925,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,122,064,000	
52回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,080,464,000	
53回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	959,993,600	
54回 利付国庫債券(30年)	2,290,000,000	1,880,983,100	

55回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	884,217,600	
56回 利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	848,681,600	
57回 利付国庫債券(30年)	2,030,000,000	1,649,841,900	
58回 利付国庫債券(30年)	1,660,000,000	1,343,637,200	
59回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	881,686,400	
60回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	930,159,500	
61回 利付国庫債券(30年)	1,560,000,000	1,217,439,600	
62回 利付国庫債券(30年)	1,020,000,000	752,188,800	
63回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	856,812,000	
64回 利付国庫債券(30年)	700,000,000	497,287,000	
65回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	424,098,000	
66回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	766,575,200	
67回 利付国庫債券(30年)	1,270,000,000	940,765,200	
68回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,135,457,400	
69回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,027,031,200	
70回 利付国庫債券(30年)	2,100,000,000	1,580,124,000	
71回 利付国庫債券(30年)	2,480,000,000	1,859,256,000	
72回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	963,565,500	
73回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	960,056,700	
74回 利付国庫債券(30年)	1,390,000,000	1,121,229,600	
75回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,321,381,600	
76回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,174,522,800	
77回 利付国庫債券(30年)	2,200,000,000	2,051,038,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,063,368,000	
79回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,009,416,000	

80回 利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	1,943,960,000	
81回 利付国庫債券(30年)	1,900,000,000	1,760,274,000	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	254,997,500	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,055,000	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	91,998,900	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	410,068,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	143,714,200	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	72,125,200	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	174,887,500	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	610,237,000	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	124,561,200	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	124,339,200	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	615,057,300	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,403,700	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	491,159,400	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	115,210,700	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,214,357,600	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	387,797,000	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	704,129,800	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	583,676,500	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	126,607,200	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	701,098,200	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	169,430,400	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	796,867,500	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	887,842,700	

101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	247,781,300	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	540,810,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	172,411,200	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	117,641,700	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	686,400,000	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	538,395,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	645,060,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	735,574,500	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	373,884,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	474,210,000	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	499,997,000	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	800,643,000	
113回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,487,285,700	
114回 利付国庫債券(20年)	2,010,000,000	2,188,668,900	
115回 利付国庫債券(20年)	1,360,000,000	1,488,329,600	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	581,648,500	
117回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	513,122,500	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	604,217,400	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	506,100,700	
120回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	532,315,000	
121回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	694,003,200	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	614,585,400	
123回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	714,317,500	
125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	664,812,000	
126回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	995,940,400	

127回 利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,240,137,600	
128回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	729,931,500	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	985,648,300	
131回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,183,688,000	
132回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,297,700	
133回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,333,135,500	
134回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	433,924,000	
135回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	140,052,900	
136回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	385,005,600	
137回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	517,454,400	
138回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,125,974,400	
139回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,048,531,400	
140回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,024,271,000	
141回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,143,814,200	
142回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	467,487,400	
143回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,317,428,400	
144回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	796,740,000	
145回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,428,222,500	
146回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,417,766,400	
147回 利付国庫債券(20年)	1,290,000,000	1,379,680,800	
148回 利付国庫債券(20年)	1,730,000,000	1,832,329,500	
149回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	2,422,980,300	
150回 利付国庫債券(20年)	3,330,000,000	3,486,210,300	
151回 利付国庫債券(20年)	2,060,000,000	2,112,715,400	
152回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,294,006,400	

153回 利付国庫債券(20年)	3,640,000,000	3,760,484,000	
154回 利付国庫債券(20年)	2,420,000,000	2,470,650,600	
155回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,274,072,000	
156回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,115,840,000	
157回 利付国庫債券(20年)	3,780,000,000	3,407,178,600	
158回 利付国庫債券(20年)	2,140,000,000	1,993,709,600	
159回 利付国庫債券(20年)	1,840,000,000	1,729,434,400	
160回 利付国庫債券(20年)	1,820,000,000	1,725,323,600	
161回 利付国庫債券(20年)	1,760,000,000	1,640,320,000	
162回 利付国庫債券(20年)	1,930,000,000	1,791,445,300	
163回 利付国庫債券(20年)	2,930,000,000	2,708,374,800	
164回 利付国庫債券(20年)	3,450,000,000	3,131,323,500	
165回 利付国庫債券(20年)	2,150,000,000	1,942,525,000	
166回 利付国庫債券(20年)	1,540,000,000	1,425,547,200	
167回 利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,566,495,000	
168回 利付国庫債券(20年)	3,090,000,000	2,711,475,000	
169回 利付国庫債券(20年)	1,720,000,000	1,477,514,400	
170回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,367,040,000	
171回 利付国庫債券(20年)	1,740,000,000	1,478,617,200	
172回 利付国庫債券(20年)	1,380,000,000	1,186,234,200	
173回 利付国庫債券(20年)	2,460,000,000	2,103,349,200	
174回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	1,700,840,000	
175回 利付国庫債券(20年)	2,020,000,000	1,738,593,800	
176回 利付国庫債券(20年)	3,200,000,000	2,739,808,000	
177回 利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,463,910,000	

	178回 利付国庫債券(20年)	3,400,000,000	2,881,908,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	1,855,942,000	
	180回 利付国庫債券(20年)	2,320,000,000	2,056,424,800	
	181回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,707,207,000	
	182回 利付国庫債券(20年)	2,750,000,000	2,549,360,000	
	183回 利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,626,290,000	
	184回 利付国庫債券(20年)	1,980,000,000	1,823,322,600	
	185回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,560,719,000	
	186回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,863,634,000	
	187回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,605,871,000	
	188回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	495,885,000	
	国債証券 合計	494,565,000,000	475,414,712,300	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,214,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	108,804,300	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	194,374,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	389,128,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	290,583,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	222,924,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	105,420,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,616,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	208,666,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	313,743,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,885,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,821,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	203,988,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,265,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	395,508,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	393,480,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	96,398,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	241,830,000	
	237回 神奈川県公募公債	200,000,000	196,302,000	

251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	193,506,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	287,895,000	
3回 神奈川県公募公債 30 年	100,000,000	116,290,000	
11回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	107,680,000	
16回 神奈川県公募公債 2 0年	300,000,000	327,714,000	
19回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	107,769,000	
413回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	99,107,000	
419回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	99,371,000	
464回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	192,124,000	
467回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	192,810,000	
469回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	191,890,000	
472回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	190,818,000	
474回 大阪府公募公債 1 0年	300,000,000	286,038,000	
10回 大阪府公募公債 20 年	200,000,000	214,214,000	
13回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	100,887,000	
14回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	92,425,000	
190回 大阪府公募公債 5 年	300,000,000	296,958,000	
29年度13回 京都府公募公 債	109,330,000	108,211,554	
令和2年度1回 京都府公募公 債	400,000,000	389,016,000	
令和2年度14回 京都府公募 公債	200,000,000	193,786,000	
令和元年度16回 兵庫県公募 公債	200,000,000	194,336,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公 債	100,000,000	96,483,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	112,024,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	205,646,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	309,837,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	102,264,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	100,834,000	
令和元年度 9回 静岡県公募 公債	200,000,000	194,478,000	

令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	96,854,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	192,734,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	103,063,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	103,433,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	202,446,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	102,636,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	323,364,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	327,312,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	107,001,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	210,252,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	144,258,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,280,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	195,674,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	207,465,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	98,900,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	193,706,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	80,024,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	84,548,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	194,844,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	167,254,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	211,698,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	109,045,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	106,149,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	315,603,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	100,974,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	99,556,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	196,886,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	194,614,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	96,770,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	103,082,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	140,868,000	

20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	106,830,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	109,220,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	319,329,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	200,948,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,522,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	190,900,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	102,170,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	100,564,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	91,056,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	193,252,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	104,999,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,075,000	
150回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,095,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,265,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,343,600	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,688,000	
160回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	496,380,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,105,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,000,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	397,208,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,036,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,159,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,700,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,485,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	293,205,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	486,960,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,140,000	

227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	479,945,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	477,740,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	98,423,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	193,302,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	198,110,000	
令和2年2回 大阪市公募公債	300,000,000	291,468,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	215,102,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	193,920,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	104,908,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	101,162,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	104,991,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	218,944,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	214,160,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	296,715,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	147,024,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	388,712,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	114,435,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	106,920,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	105,012,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	107,265,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	274,713,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	197,220,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	216,234,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	106,979,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	106,740,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	327,105,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	104,956,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	110,614,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	182,204,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	84,193,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	183,870,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	297,309,000	

	30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	91,493,000	
	令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	296,811,000	
	17回 さいたま市公募公債	200,000,000	194,764,000	
	令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	193,302,000	
	30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	196,006,000	
地方債証券 合計		27,939,330,000	27,615,059,454	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	205,210,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	203,692,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	297,960,000	
	125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	417,335,000	
	127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,645,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	73,892,000	
	156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	382,768,000	
	33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,362,000	
	1回 高速道路機構債	300,000,000	357,870,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	172,504,500	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	230,672,000	
	36回 高速道路機構債	300,000,000	349,647,000	
	50回 高速道路機構債	300,000,000	257,910,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,221,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,746,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,326,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	95,579,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	94,637,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	88,207,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	178,238,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	90,321,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,510,000	
	116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,136,000	
	121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	537,060,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,779,000		
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,628,000		

239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	303,492,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,170,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,313,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	186,170,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	500,485,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	90,889,000	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	298,296,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	180,508,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,324,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	794,344,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	185,068,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	91,266,000	
398回 政保道路債	300,000,000	209,982,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	128,028,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	144,100,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	145,812,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	581,880,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	213,454,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	325,002,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	325,707,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	109,206,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,986,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	215,046,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	106,299,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	212,944,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,782,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,942,000	

36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	104,704,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	515,625,000	
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	295,950,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	202,716,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	295,032,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	397,488,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,290,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	92,278,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	496,080,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,276,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,057,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,836,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	246,300,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	211,656,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,275,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	214,992,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,440,710	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	102,788,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	102,441,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	202,746,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	148,198,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	104,026,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	216,014,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,370,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	381,048,500	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,712,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,294,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,298,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	256,920,000	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,557,000	

172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,246,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,369,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,979,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	297,105,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,631,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	495,025,000	
325回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	495,025,000	
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,376,000	14,826,975	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,110,000	93,819,828	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,480,000	140,151,350	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,140,000	19,740,613	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,420,000	16,951,022	
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,232,000	19,772,611	
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,301,000	20,869,021	
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,646,000	25,250,812	
64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,014,000	61,815,113	
76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,407,000	27,869,082	
82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,539,000	33,679,528	
84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,134,000	34,273,608	
86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,768,000	37,815,965	
90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,147,000	38,888,238	
93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,543,000	43,362,165	
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,076,000	49,035,921	
99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,971,000	51,172,205	
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,211,000	186,309,175	

117回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	67,056,000	63,729,351	
118回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	66,539,000	63,341,801	
119回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	67,008,000	63,707,856	
126回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	209,106,000	197,389,790	
128回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	209,007,000	197,198,104	
130回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	142,682,000	134,436,407	
131回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	213,480,000	200,592,212	
132回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	211,584,000	198,886,844	
137回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	369,105,000	347,840,860	
139回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	73,492,000	69,197,862	
142回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	75,922,000	70,571,017	
154回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	245,589,000	226,629,529	
156回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	327,100,000	302,688,527	
160回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	251,847,000	233,333,727	
168回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	257,772,000	238,864,423	
170回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	788,067,000	728,213,311	
6回 沖縄振興開発金融公庫債 券	400,000,000	408,000,000	
21回 沖縄振興開発金融公庫 債券	100,000,000	100,413,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	99,675,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	297,420,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	296,841,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	197,814,000	
369回 利附信金中金債(5 年)	400,000,000	398,648,000	
377回 利附信金中金債(5 年)	300,000,000	297,594,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	106,622,000	
72回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,670,000	
77回 東日本高速道路社債	300,000,000	295,470,000	
85回 中日本高速道路債券	300,000,000	298,803,000	
87回 中日本高速道路債券	400,000,000	397,260,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	100,678,000	

	90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	192,106,000	
特殊債券 合計		28,044,871,000	27,561,377,563	
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	295,689,000	
	11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	99,126,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	397,908,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	83,392,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,266,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	194,598,000	
	79回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,423,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,282,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,198,000	
	91回 中日本高速道路債券	500,000,000	495,090,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	298,455,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	199,204,000	
	61回 西日本高速道路債券	500,000,000	495,600,000	
	62回 西日本高速道路債券	500,000,000	495,085,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,150,000	
	3回 ダイドーグループHD社債	300,000,000	290,163,000	
	9回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	92,232,000	
	12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	100,515,000	
	14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,150,000	
	30回 東レ社債	300,000,000	297,561,000	
	42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	198,196,000	
	23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	179,950,000	
	40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	98,994,000	
	17回 ダイセル社債	300,000,000	289,629,000	
	16回 武田薬品工業社債	500,000,000	472,990,000	
	4回 ENEOSホールディングス社債	300,000,000	289,839,000	
	14回 プリズトン社債	300,000,000	293,742,000	
	35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	296,853,000	
	17回 パナソニック社債	100,000,000	99,610,000	
	19回 パナソニック社債	100,000,000	96,748,000	
	23回 パナソニック社債	200,000,000	191,754,000	
	58回 川崎重工業社債	300,000,000	283,152,000	
	5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	98,394,000	
	26回 トヨタ自動車社債	200,000,000	198,336,000	
	26回 豊田通商社債	100,000,000	90,406,000	

73回	三井物産社債	400,000,000	389,568,000	
12回	新生銀行社債	400,000,000	398,592,000	
88回	三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	104,908,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,502,000	
20回	三井住友信託銀行社債	300,000,000	296,802,000	
28回	芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,417,000	
17回	NTTファイナンス社債	300,000,000	295,908,000	
18回	NTTファイナンス社債	400,000,000	388,052,000	
69回	ホンダファイナンス社債	300,000,000	297,075,000	
81回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,800,000	
96回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,097,000	
80回	日立キャピタル社債	200,000,000	193,016,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	287,301,000	
23回	三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	97,577,000	
27回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,110,000	
29回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,512,000	
31回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	192,196,000	
56回	三菱UFJリース社債	300,000,000	296,589,000	
3回	野村ホールディングス社債	300,000,000	296,049,000	
106回	住友不動産社債	100,000,000	99,643,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	198,648,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	102,119,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	87,406,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	305,865,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	204,774,000	
65回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	107,547,000	
71回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,655,000	
73回	東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	215,994,000	
107回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	90,639,000	
125回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	83,278,000	
127回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	89,647,000	
147回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,904,000	
160回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	65,241,000	
163回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,462,000	
165回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	166,048,000	
171回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	144,558,000	
21回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,133,000	

60回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	193,562,000	
70回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	74,048,000	
71回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	65,795,000	
74回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,552,000	
75回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	165,662,000	
32回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,708,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	124,720,800	
47回	東京地下鉄社債	100,000,000	64,005,000	
7回	ニッコンHD社債	300,000,000	289,266,000	
6回	横浜高速鉄道社債	200,000,000	193,188,000	
12回	ソフトバンク社債	400,000,000	388,548,000	
30回	光通信社債	200,000,000	187,160,000	
527回	中部電力社債	100,000,000	90,401,000	
532回	中部電力社債	200,000,000	194,038,000	
497回	関西電力社債	100,000,000	100,692,000	
508回	関西電力社債	300,000,000	298,212,000	
530回	関西電力社債	400,000,000	391,072,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	169,564,000	
541回	関西電力社債	300,000,000	285,450,000	
396回	中国電力社債	200,000,000	192,302,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	96,756,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	101,010,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	100,588,000	
488回	東北電力社債	100,000,000	99,260,000	
521回	東北電力社債	400,000,000	388,912,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	196,854,000	
536回	東北電力社債	300,000,000	283,683,000	
320回	四国電力社債	300,000,000	287,364,000	
463回	九州電力社債	100,000,000	88,403,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	87,235,000	
491回	九州電力社債	300,000,000	286,269,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	81,556,000	
493回	九州電力社債	200,000,000	198,056,000	
507回	九州電力社債	200,000,000	192,612,000	
340回	北海道電力社債	300,000,000	298,431,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	176,478,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	203,744,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	98,927,000	
75回	電源開発社債	200,000,000	189,790,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	180,632,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	84,749,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	81,420,000	
57回	東京瓦斯社債	300,000,000	184,242,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	197,764,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	179,548,000	
社債券 合計		24,320,000,000	23,336,540,800	
合計			553,927,690,117	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2024年5月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,598,213,339
コール・ローン	2,680,258,778
国債証券	253,116,825,658
未収入金	150,304,357
未収利息	2,018,286,969
前払費用	279,399,462
流動資産合計	259,843,288,563
資産合計	259,843,288,563
負債の部	
流動負債	
未払金	1,082,909,324
未払解約金	2,007,469,000
流動負債合計	3,090,378,324
負債合計	3,090,378,324
純資産の部	
元本等	
元本	107,187,363,672
剰余金	
剰余金又は欠損金()	149,565,546,567
元本等合計	256,752,910,239
純資産合計	256,752,910,239
負債純資産合計	259,843,288,563

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5月9日 至 2024年5月8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5月8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	102,423,436,687円
同期中追加設定元本額	42,457,960,597円
同期中一部解約元本額	37,694,033,612円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	6,226,636,838円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,774,331円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	10,463,837円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	31,539,332円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,166,121円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,392,644円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	21,795,399円
たわらノーロード 先進国債券	21,180,301,925円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,418,537,967円
たわらノーロード バランス(堅実型)	69,974,775円
たわらノーロード バランス(標準型)	405,126,589円
たわらノーロード バランス(積極型)	96,640,730円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	16,952,917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)	1,063,300,070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)	1,903,381,246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)	986,133,773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)	769,237,312円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,219,288円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	11,935,192円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	190,979,756円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	25,639,137円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	41,409,746円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,931,852,064円
One DC 先進国債券インデックスファンド	1,615,077,086円
One グローバルバランス	87,481,757円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	733,844,523円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,430,100,443円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,952,485,292円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	412,123,623円

D I A M D C バランス50インデックスファンド	854,188,656円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	849,698,771円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,663,517円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	961,381,549円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,942,671円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	154,157,168円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	160,868,965円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	272,620,908円
クルーズコントロール	533,561,169円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	226,647,379円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	920,773,340円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	706,047,234円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	178,147,558円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	527,777,107円
O n eグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	4,981,622円
O n eグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	90,036,902円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	968,512,208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)	323,054,478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)	324,399,236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)	93,337,771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)	195,302,590円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	544,565円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	824,855,040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)	394,237,611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)	225,388,809円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	691,505,560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)	797,162,118円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,428,765,387円
D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,375,445,092円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,510,282,459円
A M O n eマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	222,926,346円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	42,560,014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)	536,338,689円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	314,439,489円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	212,797,796円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,590,056円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	19,426,714円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,878,570円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	51,717円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,561,580円

DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	19,746,222円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,167,846,815円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,207,537,107円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,307,004,726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)	49,800,015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)	89,851,031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)	1,038,744,754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)	186,495,209円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	152,152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)	178,088,004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)	246,969,839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)	324,940,666円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	31,849,698円
動的パッケージファンド<DC年金>	52,571,556円
コア資産形成ファンド	25,616,459円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジなし)<ラップ専用>	3,618,639,485円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジあり)<ラップ専用>	11,863,552,876円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5,972,362,832円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	5,109,232,102円
計	107,187,363,672円
2. 受益権の総数	107,187,363,672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5月9日 至 2024年5月8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5月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短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5月8日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	579,998,815	
合計	579,998,815	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2024年2月22日から2024年5月8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5月8日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,395.4円 (23,954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5月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/31/25	1,690,000.000	1,605,566.610	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,314,746.080	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,584,914.070	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,374,179.280	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,484,375.790	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,732,500.000	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,274,058.600	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,303,660.950	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,310,607.220	

US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,835,214.810	
US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,714,140.640	
US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,780,432.420	
US T N/B 0.5 04/30/27	3,270,000.000	2,897,526.550	
US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,632,236.320	
US T N/B 0.5 06/30/27	780,000.000	687,039.840	
US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,678,157.410	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,183,771.080	
US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,856,249.980	
US T N/B 0.625 05/15/30	7,050,000.000	5,634,354.500	
US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,657,335.900	
US T N/B 0.625 08/15/30	7,740,000.000	6,130,624.170	
US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,397,722.650	
US T N/B 0.625 12/31/27	4,020,000.000	3,491,903.880	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,680,000.000	4,073,610.930	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,300,049.190	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,542,851.530	
US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,184,658.210	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,520,162.090	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,510,000.000	4,155,189.810	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,510,000.000	4,120,307.800	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,680,000.000	6,947,221.030	
US T N/B 1.0 07/31/28	7,270,000.000	6,292,383.760	
US T N/B 1.125 02/15/31	8,690,000.000	7,036,523.790	
US T N/B 1.125 02/28/27	3,600,000.000	3,268,546.870	
US T N/B 1.125 02/29/28	4,690,000.000	4,132,054.890	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,003,074.210	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,060,000.000	2,439,647.660	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,730,000.000	4,106,877.930	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,115,716.380	
US T N/B 1.25 03/31/28	4,610,000.000	4,071,476.330	
US T N/B 1.25 04/30/28	4,700,000.000	4,140,865.240	
US T N/B 1.25 05/15/50	5,380,000.000	2,633,783.190	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,639,965.620	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,253,858.390	
US T N/B 1.25 08/15/31	10,460,000.000	8,405,182.040	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,337,365.990	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,311,699.200	
US T N/B 1.25 12/31/26	4,290,000.000	3,927,193.350	
US T N/B 1.375 08/15/50	6,370,000.000	3,218,218.500	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,800,000.000	2,594,812.490	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,116,558.400	
US T N/B 1.375 11/15/31	8,890,000.000	7,157,318.170	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	2,697,046.870	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,003,347.640	
US T N/B 1.5 01/31/27	4,740,000.000	4,357,837.500	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,830,000.000	4,109,084.760	
US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,387,402.350	
US T N/B 1.625 02/15/26	6,090,000.000	5,753,979.480	

US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,855,155.060	
US T N/B 1.625 05/15/31	8,740,000.000	7,271,270.240	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,440,250.000	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,442,468.750	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,237,440.220	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,280,000.000	2,855,118.730	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,676,830.660	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	3,977,841.780	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,310,000.000	3,475,560.920	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,450,000.000	2,135,040.990	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,958,014.050	
US T N/B 1.875 02/15/32	5,780,000.000	4,808,011.730	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,100,000.000	3,451,962.870	
US T N/B 1.875 02/15/51	5,780,000.000	3,335,805.090	
US T N/B 1.875 02/28/27	5,210,000.000	4,830,341.610	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,700,000.000	4,172,167.940	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,710,912.480	
US T N/B 1.875 07/31/26	3,200,000.000	3,006,499.990	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,370,000.000	3,078,520.300	
US T N/B 2.0 02/15/50	4,020,000.000	2,415,847.240	
US T N/B 2.0 08/15/25	3,550,000.000	3,418,955.080	
US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,447,304.440	
US T N/B 2.0 11/15/41	3,350,000.000	2,280,159.160	
US T N/B 2.125 05/15/25	2,950,000.000	2,863,101.110	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,850,000.000	2,701,154.290	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,545,374.220	
US T N/B 2.25 02/15/52	5,000,000.000	3,149,218.740	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,146,859.370	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,168,414.830	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,939,721.880	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,570,000.000	1,036,935.930	
US T N/B 2.25 08/15/49	4,140,000.000	2,651,864.060	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	4,917,799.960	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,023,983.570	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,604,840.620	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,630,468.750	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,965,368.750	
US T N/B 2.375 05/15/27	4,830,000.000	4,525,766.590	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,770,000.000	3,416,267.970	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,760,000.000	3,751,987.480	
US T N/B 2.375 11/15/49	3,890,000.000	2,559,346.460	
US T N/B 2.5 02/15/45	500,000.000	353,593.750	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,370,000.000	957,019.910	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,186,217.180	
US T N/B 2.5 03/31/27	4,000,000.000	3,771,093.750	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,730,000.000	1,205,255.850	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,367,413.660	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,330,000.000	4,905,681.990	
US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,630,743.750	

US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,806,891.420	
US T N/B 2.625 12/31/25	3,000,000.000	2,891,601.570	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,256,515.990	
US T N/B 2.75 05/15/25	2,200,000.000	2,148,715.380	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,042,703.120	
US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,013,309.370	
US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,608,034.770	
US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	6,918,034.330	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	943,804.670	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,611,175.000	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,777,173.030	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,056,000.000	800,992.490	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,622,197.250	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,300,000.000	3,064,617.200	
US T N/B 2.875 05/15/28	3,560,000.000	3,344,383.570	
US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,194,844.700	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,763,210.540	
US T N/B 2.875 05/15/49	4,800,000.000	3,515,062.490	
US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,272,392.580	
US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,533,603.940	
US T N/B 2.875 06/15/25	2,420,000.000	2,362,619.520	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,143,539.050	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,710,811.120	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,470,000.000	1,106,691.790	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	804,346.850	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,360,000.000	3,255,918.750	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,160,000.000	1,642,443.730	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,000,232.410	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,610,000.000	2,711,941.990	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	857,798.430	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	994,962.880	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,229,491.390	
US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,124,437.500	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,810,000.000	2,867,620.300	
US T N/B 3.0 08/15/52	5,140,000.000	3,826,589.450	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,703,037.100	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,206,776.950	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,960,000.000	1,518,540.590	
US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	660,721.870	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,105,106.240	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,540,000.000	1,236,391.390	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,182,969.130	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,959,753.720	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,657,467.970	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,040,000.000	2,902,903.110	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,912,344.910	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,180,000.000	3,945,119.890	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	831,459.370	
US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	3,102,220.290	

US T N/B 3.25 06/30/27	4,200,000.000	4,033,722.670	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,500,000.000	3,302,373.050	
US T N/B 3.375 05/15/33	7,000,000.000	6,438,906.240	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,730,000.000	1,430,155.850	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,447,667.190	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,450,000.000	2,780,080.030	
US T N/B 3.5 01/31/28	3,680,000.000	3,546,096.860	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,700,000.000	2,567,636.710	
US T N/B 3.5 02/15/33	7,250,000.000	6,746,323.200	
US T N/B 3.5 02/15/39	800,000.000	714,718.750	
US T N/B 3.5 04/30/28	3,100,000.000	2,983,265.620	
US T N/B 3.5 04/30/30	3,000,000.000	2,848,417.980	
US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,940,527.340	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,401,545.300	
US T N/B 3.625 02/15/53	3,800,000.000	3,201,128.880	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,385,429.650	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,500,000.000	2,391,064.450	
US T N/B 3.625 05/15/26	3,900,000.000	3,811,031.250	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,510,000.000	2,957,312.100	
US T N/B 3.625 05/31/28	2,500,000.000	2,416,162.100	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,267,300.770	
US T N/B 3.75 04/15/26	6,000,000.000	5,879,531.280	
US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,366,630.850	
US T N/B 3.75 06/30/30	3,200,000.000	3,076,687.480	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,220,000.000	1,090,565.610	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,280,294.520	
US T N/B 3.875 01/15/26	4,300,000.000	4,227,941.410	
US T N/B 3.875 02/15/43	3,500,000.000	3,140,839.820	
US T N/B 3.875 05/15/43	800,000.000	716,843.750	
US T N/B 3.875 08/15/33	8,000,000.000	7,644,375.040	
US T N/B 3.875 09/30/29	2,950,000.000	2,864,841.780	
US T N/B 3.875 11/30/27	3,300,000.000	3,223,623.050	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,800,000.000	2,717,093.730	
US T N/B 3.875 12/31/27	3,600,000.000	3,516,257.800	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,716,218.730	
US T N/B 4.0 01/15/27	4,000,000.000	3,931,406.240	
US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	3,939,609.360	
US T N/B 4.0 02/15/34	2,500,000.000	2,410,351.550	
US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	2,927,343.750	
US T N/B 4.0 02/29/28	3,200,000.000	3,137,562.490	
US T N/B 4.0 06/30/28	2,000,000.000	1,960,312.500	
US T N/B 4.0 07/31/30	2,500,000.000	2,436,425.770	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,700,000.000	2,637,140.620	
US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	2,853,764.050	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,760,000.000	4,296,829.650	
US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,079,436.310	
US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,636,660.160	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,461,767.570	
US T N/B 4.125 08/15/53	2,600,000.000	2,398,500.000	

US T N/B 4.125 08/31/30	800,000.000	784,859.370	
US T N/B 4.125 09/30/27	3,220,000.000	3,173,209.370	
US T N/B 4.125 10/31/27	3,340,000.000	3,289,834.760	
US T N/B 4.125 11/15/32	7,100,000.000	6,932,623.030	
US T N/B 4.25 02/28/29	4,930,000.000	4,881,855.490	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,000,000.000	1,975,937.500	
US T N/B 4.25 03/15/27	3,850,000.000	3,809,244.130	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	921,295.890	
US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,958,828.110	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	958,886.700	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,210,000.000	1,182,633.180	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,430,000.000	1,388,496.470	
US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	3,965,937.520	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	1,917,812.500	
US T N/B 4.375 08/31/28	3,500,000.000	3,480,107.430	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,176,234.370	
US T N/B 4.375 12/15/26	4,800,000.000	4,762,500.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	500,000.000	508,056.630	
US T N/B 4.5 05/15/38	800,000.000	802,906.230	
US T N/B 4.5 07/15/26	4,100,000.000	4,075,816.390	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,480,000.000	1,473,929.680	
US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,545,177.360	
US T N/B 4.5 11/15/33	7,000,000.000	7,020,234.340	
US T N/B 4.625 02/15/40	690,000.000	695,040.230	
US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,614,544.140	
US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,490,224.600	
US T N/B 4.625 09/30/30	3,000,000.000	3,026,074.230	
US T N/B 4.625 10/15/26	3,400,000.000	3,391,500.000	
US T N/B 4.625 11/15/26	3,900,000.000	3,891,621.070	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,250,756.250	
US T N/B 4.75 11/15/43	2,620,000.000	2,638,012.500	
US T N/B 4.75 11/15/53	2,200,000.000	2,253,625.000	
US T N/B 4.875 10/31/28	3,000,000.000	3,043,828.140	
US T N/B 4.875 10/31/30	1,500,000.000	1,533,984.370	
US T N/B 5.0 05/15/37	855,000.000	905,732.220	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,390,236.320	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,860,000.000	1,969,129.690	
US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,453,624.990	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,200,000.000	2,310,773.430	
US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	829,118.540	
アメリカ・ドル 小計	872,300,000.000 (135,162,885,000)	767,721,648.220 (118,958,469,391)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,629,600.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,158,698.000
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,719,401.600

UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,430,000.000	2,210,060.700	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,390,000.000	1,108,247.000	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,880,000.000	1,597,342.000	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	563,906.000	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	1,015,947.670	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,650,000.000	1,127,775.000	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,640,000.000	659,772.000	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,050,000.000	520,661.110	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,700,000.000	1,283,500.000	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,030,000.000	875,278.550	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,870,000.000	2,297,865.500	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,670,000.000	1,080,657.000	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	269,175.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	1,006,005.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,730,000.000	842,683.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,750,000.000	1,070,702.500	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	847,790.460	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,200,000.000	675,307.200	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,210,000.000	616,011.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	931,747.670	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	662,035.240	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	380,737.600	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	430,000.000	251,566.510	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,910,000.000	1,010,427.050	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,890,000.000	1,403,729.460	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,072,659.600	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	790,250.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,910,000.000	1,585,873.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,500,000.000	2,350,368.500	

	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,550,000.000	1,328,040.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	880,000.000	718,295.060	
	UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,500,000.000	1,474,725.000	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,650,000.000	1,549,350.000	
	UK TREASURY 3.75 03/07/27	700,000.000	688,988.550	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	842,163.290	
	UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,555,011.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	815,175.000	
	UK TREASURY 4.0 10/22/31	900,000.000	897,633.000	
	UK TREASURY 4.0 10/22/63	820,000.000	739,722.000	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,440,000.000	2,427,190.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,300,000.000	1,302,873.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,570,000.000	1,597,393.360	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,040,125.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,210,000.000	1,215,774.240	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,190,000.000	1,159,855.850	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,219,408.120	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,147,000.000	1,087,000.430	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,112,000.000	1,050,617.600	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,800,000.000	1,823,940.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,234,096.800	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,745,000.000	1,740,550.250	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	1,050,000.000	1,091,144.460	
	UK TREASURY 4.75 10/22/43	500,000.000	512,395.150	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,495,000.000	1,561,482.650	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	580,000.000	603,671.300	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	980,000.000	1,060,755.720	
イギリス・ボンド	小計	81,669,000.000 (15,816,018,540)	66,953,157.750 (12,966,148,530)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,430,000.000	1,337,837.930	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,824,486.930	

	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	3,110,000.000	2,574,557.520	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,600,000.000	1,262,784.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,490,000.000	1,713,700.170	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,936,316.000	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,170,000.000	778,739.130	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,660,000.000	1,559,774.180	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	3,160,000.000	2,900,984.280	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,515,355.530	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,410,000.000	1,519,024.020	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,275,625.900	
	イスラエル・シュケル 小計	22,950,000.000 (961,336,485)	20,199,185.590 (846,109,546)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,377,270.340	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,115,000.000	1,028,847.310	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,470,000.000	1,965,500.910	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,370,000.000	1,125,349.220	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,200,000.000	1,757,700.810	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,010,000.000	1,683,923.600	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	2,020,000.000	1,111,325.320	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,520,863.660	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,080,000.000	1,013,248.230	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,660,000.000	1,522,645.900	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	752,857.390	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	559,256.400	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,130,000.000	1,086,989.040	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,600,000.000	1,521,732.840	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,313,701.580	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	833,195.450	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,670,000.000	1,502,639.160	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,400,000.000	1,354,953.690	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	707,754.470	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,500,000.000	1,395,492.200	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	776,146.710		
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,340,000.000	1,279,865.580		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,608,136.630		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,688,442.440		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,540,000.000	1,575,545.660		
	オーストラリア・ドル 小計	36,425,000.000 (3,716,442,750)	32,063,384.540 (3,271,427,125)	

オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27	9,000,000.000	9,007,830.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	50,000,000.000	50,146,250.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	20,059,354.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,523,078.730	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,962,113.220	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	49,500,000.000	49,859,691.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.33 12/15/25	4,000,000.000	4,022,374.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	3,000,000.000	3,007,980.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	3,000,000.000	3,028,870.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26	32,000,000.000	32,250,137.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	31,000,000.000	31,264,870.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,191,295.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,456,746.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	39,410,000.000	39,891,976.410	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	23,000,000.000	23,231,573.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	5,000,000.000	5,057,688.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	11,000,000.000	11,183,414.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	22,300,000.000	22,619,367.220	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	11,000,000.000	11,163,797.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	15,000,000.000	15,244,366.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	18,000,000.000	18,343,692.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	19,500,000.000	20,025,608.850	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	52,600,000.000	53,656,791.860	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	55,600,000.000	56,380,346.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	20,000,000.000	20,451,520.000		

CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	15,500,000.000	15,923,117.450	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	22,000,000.000	22,572,246.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,231,839.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	22,000,000.000	22,636,669.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,318,360.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,278,796.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	19,300,000.000	19,925,553.530	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	26,500,000.000	27,125,670.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	11,200,000.000	11,625,944.960	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	15,100,000.000	15,670,177.510	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	32,100,000.000	33,191,595.810	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	3,000,000.000	3,284,790.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	39,000,000.000	40,338,023.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	23,500,000.000	24,561,264.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	54,000,000.000	55,051,569.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	11,500,000.000	12,660,752.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,403,294.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	10,800,000.000	12,143,092.320	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	18,976,441.230	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30	9,000,000.000	9,575,189.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,337,544.950	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	11,000,000.000	11,657,143.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	8,820,000.000	10,026,635.090	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	19,100,000.000	21,801,114.360	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	12,450,000.000	14,662,921.510	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,281,282.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,600,000.000	9,182,746.360	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	18,000,000.000	22,026,457.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	14,300,000.000	17,515,716.790	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	11,300,000.000	14,236,562.640	
オフショア・人民元 小計		1,077,320,000.000 (23,094,077,912)	1,117,253,246.850 (23,950,110,951)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,810,000.000	1,687,984.580	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,197,105.340	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,138,446.560	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	506,100.120	
	CANADA 1.0 09/01/26	2,670,000.000	2,493,139.270	
	CANADA 1.25 03/01/27	2,110,000.000	1,961,928.330	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,940,000.000	1,696,744.400	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,613,896.870	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,153,362.040	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,240,000.000	1,933,983.540	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,493,286.970	
	CANADA 2.0 06/01/28	930,000.000	873,368.750	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,590,000.000	1,415,667.420	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,460,000.000	2,555,059.700	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,290,335.780	
	CANADA 2.25 06/01/29	530,000.000	499,068.980	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,400,198.850	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,330,000.000	1,245,832.640	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,016,364.270	
	CANADA 2.75 12/01/48	500,000.000	439,431.050	
	CANADA 2.75 12/01/55	800,000.000	694,137.370	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	335,116.830	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,350,000.000	1,321,672.080	
	CANADA 3.0 06/01/34	800,000.000	761,447.590	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,660,000.000	1,628,854.380	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,400,000.000	1,376,762.310	
	CANADA 3.25 12/01/33	1,620,000.000	1,577,501.910	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,030,000.000	1,021,998.200	
	CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	395,398.990	
	CANADA 3.5 12/01/45	900,000.000	897,654.510	
	CANADA 4.0 03/01/29	1,700,000.000	1,727,138.650	
	CANADA 4.0 05/01/26	500,000.000	498,581.760	
CANADA 4.0 06/01/41	590,000.000	624,188.300		
CANADA 5.0 06/01/37	330,000.000	379,566.840		
CANADA 5.75 06/01/29	640,000.000	705,012.360		
CANADA 5.75 06/01/33	810,000.000	944,952.850		
カナダ・ドル 小計		49,730,000.000	45,501,290.390	

		(5,610,041,300)	(5,133,000,569)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	280,000.000	268,156.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	484,245.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	840,000.000	754,152.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	630,000.000	472,500.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	381,316.800	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	690,000.000	672,687.900	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	770,000.000	691,845.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	770,484.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	240,000.000	213,962.400	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	240,000.000	234,408.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	460,000.000	420,359.500	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	611,490.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	520,000.000	511,628.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	197,500.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	606,980.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	116,812.500	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	820,000.000	828,673.690	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	803,680.000	
シンガポール・ドル 小計		9,695,000.000 (1,108,623,250)	9,040,880.790 (1,033,824,718)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,234,411.900	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,173,991.930	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,960,000.000	3,646,908.280	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	6,710,000.000	6,437,019.920	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,300,000.000	3,152,778.260	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,430,000.000	3,413,453.250	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,878,947.630	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,340,000.000	3,792,135.800	
スウェーデン・クローナ 小計		34,970,000.000 (497,972,800)	33,729,646.970 (480,310,173)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,268,406.610	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,560,000.000	2,472,340.800	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,850,000.000	4,525,270.670	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,140,000.000	4,647,082.730	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,640,000.000	3,577,341.760	
	DENMARK 2.25 11/15/33	2,740,000.000	2,700,153.810	
	DENMARK 4.5 11/15/39	6,550,000.000	8,136,987.040	
デンマーク・クローネ 小計		32,560,000.000 (726,739,200)	30,327,583.420 (676,911,662)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	650,000.000	548,554.310	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	380,000.000	349,391.130	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	717,024.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	252,060.920	

	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	890,000.000	734,235.940	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	1,140,000.000	909,653.090	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	810,000.000	541,299.350	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	699,848.710	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	450,000.000	411,797.950	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	125,215.100	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	798,041.000	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	500,000.000	498,845.190	
ニュージーランド・ドル 小計		7,780,000.000 (722,450,800)	6,585,966.690 (611,572,867)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,950,000.000	2,511,099.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,610,000.000	4,047,381.770	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,510,000.000	3,372,197.400	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,700,000.000	4,465,423.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,665,171.600	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,948,491.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,530,000.000	2,271,181.000	
	NORWAY 3.0 08/15/33	3,500,000.000	3,329,183.900	
	NORWAY 3.5 10/06/42	2,160,000.000	2,179,116.000	
	NORWAY 3.625 04/13/34	1,230,000.000	1,228,831.500	
ノルウェー・クローネ 小計		30,180,000.000 (427,650,600)	28,018,076.170 (397,016,139)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,280,000.000	2,022,371.400	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,720,000.000	3,665,259.360	
	POLAND 1.75 04/25/32	6,050,000.000	4,602,543.550	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,290,000.000	3,103,983.400	
	POLAND 2.5 07/25/27	5,060,000.000	4,646,334.880	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,148,634.600	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,755,442.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,554,193.200	
	POLAND 3.75 05/25/27	2,620,000.000	2,507,156.600	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,190,000.000	3,235,125.740	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,400,000.000	3,660,355.000	
ポーランド・ズロチ 小計		37,660,000.000 (1,454,466,860)	33,901,399.730 (1,309,305,959)	
マレーシア・リ ンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,854,056.090	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	648,438.030	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,369,258.050	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,002,422.800	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,438,244.700	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,270,000.000	2,251,462.650	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,652,250.060	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	705,121.480	

	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,008,767.200	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,748,508.400	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,675,125.920	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,220,000.000	1,230,454.910	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,650,000.000	1,662,332.100	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,653,246.520	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	685,860.430	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,400,000.000	1,432,033.820	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,066,902.370	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,450,000.000	1,492,268.950	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,243,902.600	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,590,000.000	1,643,486.160	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,450,000.000	1,533,524.350	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,160,000.000	1,234,072.720	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	321,868.680	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,900,000.000	2,039,236.370	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,186,423.740	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,759,287.840	
マレーシア・リングギット 小計		36,900,000.000 (1,205,172,450)	37,538,556.940 (1,226,028,039)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	9,500,000.000	9,074,590.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	25,080,000.000	22,387,912.800	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,290,000.000	16,891,867.200	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	16,790,000.000	14,099,234.600	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	11,010,000.000	10,279,486.500	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	4,805,000.000	4,962,411.800	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	31,672,000.000	29,255,103.020	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	25,146,000.000	23,534,644.320	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,148,000.000	27,295,396.240	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	24,707,000.000	20,594,519.850	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	10,035,000.000	8,836,620.300	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	17,461,000.000	14,771,482.170	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,619,000.000	19,652,793.660	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,281,458.840	
	メキシコ・ペソ 小計		261,905,000.000 (2,400,123,611)	235,917,521.300 (2,161,971,757)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,280,000.000	1,093,836.150	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,360,000.000	1,128,662.640	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	620,000.000	549,329.300	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	370,000.000	224,775.000	

AUSTRIA 0.25 10/20/36	740,000.000	529,544.000	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,368,370.110	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,190,000.000	1,111,684.910	
AUSTRIA 0.7 04/20/71	360,000.000	164,927.440	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	935,000.000	867,983.870	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	345,829.680	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,330,000.000	1,263,592.810	
AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	143,266.500	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	600,000.000	520,194.000	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	310,000.000	301,473.760	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	680,000.000	505,841.120	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	114,095.000	
AUSTRIA 1.85 05/23/49	460,000.000	362,088.540	
AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	450,937.080	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	299,321.770	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	670,000.000	641,512.940	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,150,000.000	1,153,576.500	
AUSTRIA 2.9 02/20/34	450,000.000	449,955.000	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	555,271.200	
AUSTRIA 3.15 10/20/53	420,000.000	423,185.280	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	350,000.000	404,075.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,131,904.980	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,010,000.000	1,042,770.460	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	677,750.910	
BELGIUM 0.0 10/22/27	1,030,000.000	936,513.310	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	847,233.130	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,100,000.000	938,465.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,050,000.000	862,995.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	930,000.000	604,230.910	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	374,819.990	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,380,000.000	1,341,889.220	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,360,000.000	1,278,759.040	
BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	866,680.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,740,000.000	1,591,102.980	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,340,000.000	1,286,300.840	
BELGIUM 1.0 06/22/31	940,000.000	833,691.160	
BELGIUM 1.25 04/22/33	860,000.000	754,701.600	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,540,000.000	987,797.160	
BELGIUM 1.45 06/22/37	560,000.000	461,563.200	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	668,651.400	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,020,000.000	732,371.670	
BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	524,682.350	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	340,740.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	305,716.710	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	304,641.280	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,200,000.000	1,211,917.200	
BELGIUM 3.0 06/22/34	680,000.000	685,066.680	
BELGIUM 3.3 06/22/54	420,000.000	413,220.360	
BELGIUM 3.45 06/22/43	240,000.000	245,504.640	

BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	684,192.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	740,000.000	801,643.480	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,180,000.000	1,336,563.580	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,098,668.510	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,370,000.000	1,625,003.580	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,759,252.800	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,310,000.000	3,134,404.500	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	2,060,000.000	1,907,271.600	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	2,760,000.000	2,584,050.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,650,000.000	2,538,700.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,293,570.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	3,080,000.000	2,950,855.600	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,050,000.000	1,006,666.500	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,700,000.000	1,678,427.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	2,000,000.000	1,989,980.000	
BUNDESSCHAT 2.5 03/19/26	800,000.000	793,120.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,020,000.000	1,763,520.600	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,340,000.000	1,998,289.800	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,550,000.000	1,293,614.500	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,760,000.000	1,346,646.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,680,000.000	1,250,037.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,530,000.000	1,321,093.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	890,000.000	769,307.100	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,890,000.000	2,441,529.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,400,000.000	1,183,751.370	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,634,140.780	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	940,000.000	490,172.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,190,000.000	1,086,283.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,481,473.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,060,000.000	950,357.840	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,420,000.000	2,265,483.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,630,000.000	1,472,359.440	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,270,000.000	2,068,378.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,860,000.000	3,699,810.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,120,000.000	1,968,229.200	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,610,000.000	2,441,412.270	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,290,000.000	2,151,621.060	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,690,000.000	2,374,998.310	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,660,000.000	1,359,274.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,620,000.000	2,006,967.160	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,180,000.000	2,070,738.400	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	2,400,000.000	2,033,016.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,800,000.000	1,769,004.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	2,950,000.000	2,928,465.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	700,000.000	695,527.000	

DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	600,000.000	599,472.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,320,000.000	2,283,715.200	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	2,209,636.800	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	500,000.000	495,285.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,900,000.000	1,929,488.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,080,000.000	1,181,077.200	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,030,000.000	2,353,533.280	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,580,000.000	1,908,339.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,281,161.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,720,000.000	2,070,364.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	2,059,946.700	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,720,000.000	2,038,045.200	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,140,000.000	1,257,705.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	840,000.000	1,005,152.400	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	650,000.000	723,450.000	
FINLAND 0.0 09/15/26	100,000.000	93,385.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	110,000.000	92,481.840	
FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	200,326.000	
FINLAND 0.125 04/15/52	640,000.000	301,253.600	
FINLAND 0.125 09/15/31	700,000.000	577,662.400	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	186,367.540	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	438,685.440	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	241,575.760	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	371,003.200	
FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	590,341.710	
FINLAND 0.5 09/15/29	770,000.000	684,861.870	
FINLAND 0.75 04/15/31	800,000.000	699,519.200	
FINLAND 0.875 09/15/25	810,000.000	786,388.500	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	407,851.200	
FINLAND 1.375 04/15/27	210,000.000	201,442.920	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	204,582.000	
FINLAND 1.5 09/15/32	600,000.000	541,337.520	
FINLAND 2.625 07/04/42	400,000.000	375,963.250	
FINLAND 2.75 04/15/38	370,000.000	357,144.350	
FINLAND 2.75 07/04/28	320,000.000	319,895.680	
FINLAND 2.95 04/15/55	20,000.000	19,436.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	220,000.000	221,895.300	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	3,530,000.000	3,343,704.250	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,500,000.000	4,155,327.000	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,790,000.000	2,234,511.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	4,310,000.000	3,711,392.720	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,880,000.000	3,248,848.160	

FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,670,000.000	2,984,983.490	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,120,000.000	2,918,017.440	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	4,460,000.000	4,241,740.980	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	4,290,000.000	3,841,866.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,950,000.000	1,302,832.050	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	308,884.470	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,490,000.000	897,055.990	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,780,000.000	3,504,910.500	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,690,000.000	4,331,383.840	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	4,150,000.000	2,251,275.400	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	3,660,000.000	1,941,161.520	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,200,000.000	3,844,864.800	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,560,000.000	3,370,344.560	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,652,067.920	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,560,000.000	3,048,305.440	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,680,000.000	3,026,432.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,400,000.000	1,104,180.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,880,000.000	5,414,803.800	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,020,000.000	1,396,238.140	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	940,000.000	634,265.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,450,000.000	2,052,014.650	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,541,003.100	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	3,550,000.000	3,329,399.450	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,650,000.000	3,602,891.550	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,050,000.000	938,772.450	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,320,000.000	4,273,266.240	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,300,000.000	3,297,274.200	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,240,000.000	4,228,793.680	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,000,000.000	3,033,432.300	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	900,000.000	842,090.070	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,340,000.000	2,341,166.930	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,850,000.000	3,885,050.400	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,722,810.600	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,663,121.040	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,540,000.000	1,698,401.320	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,790,000.000	3,272,061.780	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,714,303.210	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,100,000.000	3,486,892.400	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,610,000.000	3,171,129.120	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	170,000.000	176,614.870	
IRISH 0.0 10/18/31	670,000.000	550,659.600	
IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	389,259.680	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	300,179.320	
IRISH 0.35 10/18/32	350,000.000	288,652.000	
IRISH 0.4 05/15/35	420,000.000	323,343.300	
IRISH 0.55 04/22/41	300,000.000	203,670.300	
IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	662,870.200	
IRISH 1.0 05/15/26	890,000.000	856,772.740	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	676,999.240	

IRISH 1.3 05/15/33	290,000.000	257,348.900	
IRISH 1.35 03/18/31	540,000.000	496,737.900	
IRISH 1.5 05/15/50	550,000.000	399,358.850	
IRISH 1.7 05/15/37	780,000.000	677,804.400	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	710,551.800	
IRISH 2.4 05/15/30	690,000.000	680,064.690	
IRISH 3.0 10/18/43	280,000.000	280,459.690	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,898,598.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,850,000.000	1,721,240.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,304,656.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,900,000.000	1,666,585.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,533,927.500	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	984,390.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,920,000.000	1,574,257.920	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,605,177.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,110,000.000	1,786,131.880	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,480,000.000	1,047,544.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,580,000.000	1,299,076.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,167,345.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,560,048.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,418,585.400	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,300,000.000	1,223,690.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,160,000.000	1,127,601.200	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,180,000.000	2,074,841.160	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,654,547.500	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,320,000.000	1,024,584.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	510,000.000	327,318.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,380,000.000	1,333,632.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,290,000.000	2,006,610.210	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,340,000.000	2,099,331.000	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,170,000.000	725,113.350	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	837,085.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	310,000.000	296,885.760	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,626,883.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,639,903.300	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,840,000.000	1,794,861.120	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	223,776.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	960,000.000	646,944.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,542,300.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,149,744.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,080,000.000	982,599.120	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,480,000.000	1,086,912.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,531,278.280	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,237,624.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,520,000.000	1,491,424.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,270,000.000	1,008,634.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	500,000.000	371,800.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,172,400.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,905,475.760	

ITALY BTPS 2.95 02/15/27	1,300,000.000	1,288,950.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	220,000.000	194,920.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,210,000.000	2,180,179.360	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,060,000.000	945,765.920	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	554,940.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,207,552.440	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	2,120,000.000	2,042,509.760	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,150,000.000	1,157,015.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,440,000.000	1,293,696.000	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,310,000.000	1,313,013.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,190,484.800	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,000,000.000	1,016,300.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,513,030.500	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.000	1,047,674.100	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	1,600,000.000	1,620,160.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,743,860.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,340,000.000	2,383,290.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,160,000.000	1,187,260.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	900,000.000	932,400.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	500,000.000	517,250.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	260,000.000	262,808.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	720,000.000	750,024.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,500,000.000	1,591,500.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	800,000.000	830,960.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,152,200.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	770,000.000	803,726.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,180,000.000	2,310,438.120	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,460,000.000	1,580,604.760	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,360,000.000	2,618,184.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,890,000.000	2,096,010.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,650,000.000	1,831,500.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,899,248.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,660,000.000	3,085,334.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,260,000.000	2,625,442.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,225,673.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,250,000.000	1,367,500.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	1,500,000.000	1,427,270.620	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,280,000.000	1,189,343.850	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,340,000.000	1,185,902.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,240,000.000	848,817.200	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,330,000.000	645,030.050	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,200,000.000	1,024,503.600	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,900,000.000	1,581,327.390	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,060,000.000	940,124.810	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,310,000.000	934,776.700	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,560,000.000	1,482,390.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	900,000.000	760,537.990	

NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	940,966.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,370,680.660	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	563,273.560	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	150,000.000	149,039.400	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,310,000.000	1,296,111.380	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	350,000.000	345,017.750	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,290,000.000	1,290,825.070	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	140,000.000	149,548.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,490,000.000	1,685,627.570	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,320,000.000	1,489,356.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,090,000.000	1,197,801.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,555,804.040	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,010,000.000	1,853,019.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,880,000.000	1,687,112.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	839,728.350	
SPAIN 0.1 04/30/31	2,430,000.000	1,990,899.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,564,689.600	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,369,706.680	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,130,000.000	999,637.550	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,548,359.350	
SPAIN 0.8 07/30/27	2,300,000.000	2,147,165.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,521,585.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,600,000.000	1,166,950.400	
SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	354,834.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,790,000.000	988,889.080	
SPAIN 1.2 10/31/40	720,000.000	509,689.440	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,950,000.000	1,751,977.500	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,130,000.000	2,044,227.030	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	2,049,072.410	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,470,000.000	1,381,653.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,500,000.000	1,401,190.500	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,770,457.740	
SPAIN 1.45 10/31/71	660,000.000	329,637.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,660,000.000	1,590,612.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	430,000.000	422,720.100	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,640,000.000	1,423,684.000	
SPAIN 1.9 10/31/52	1,370,000.000	932,615.170	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,496,687.310	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,673,453.580	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,783,941.430	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,370,000.000	1,282,046.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,653,924.480	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,560,000.000	1,314,289.080	
SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,788,390.000	

	SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,150,743.740	
	SPAIN 3.15 04/30/33	1,570,000.000	1,574,181.690	
	SPAIN 3.25 04/30/34	1,270,000.000	1,274,667.250	
	SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	718,396.440	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	1,034,708.220	
	SPAIN 3.5 05/31/29	1,300,000.000	1,335,282.000	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,820,000.000	1,876,966.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	340,000.000	354,282.040	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,660,000.000	1,803,686.280	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,925,680.050	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,880,000.000	2,152,167.600	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,215,791.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,660,000.000	1,811,143.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,469,687.780	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,635,000.000	1,954,768.390	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,330,000.000	2,468,306.470	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,228,057.440	
	ユーロ 小計	519,660,000.000 (86,554,569,600)	480,875,469.690 (80,094,618,232)	
国債証券 合計		279,458,571,157.500 (279,458,571,158)	253,116,825,658 (253,116,825,658)	
合計			253,116,825,658 (253,116,825,658)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 245銘柄	46.33	47.00
イギリス・ポンド	国債証券 59銘柄	5.05	5.12
イスラエル・シケル	国債証券 12銘柄	0.33	0.33
オーストラリア・ドル	国債証券 25銘柄	1.27	1.29
オフショア・人民元	国債証券 55銘柄	9.33	9.46
カナダ・ドル	国債証券 36銘柄	2.00	2.03
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.40	0.41
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.19	0.19
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.26	0.27
ニュージーランド・ドル	国債証券 12銘柄	0.24	0.24
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.15	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	0.51	0.52
マレーシア・リングgit	国債証券 26銘柄	0.48	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.84	0.85
ユーロ	国債証券 346銘柄	31.20	31.64

(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。

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5月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	16,045,873,400
株式	578,748,382,490
派生商品評価勘定	89,578,260
未収配当金	5,576,131,823
差入委託証拠金	1,103,939,042
流動資産合計	601,563,905,015
資産合計	601,563,905,015
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	84,432,580
前受金	305,609,500
未払金	21,971,400
未払解約金	965,277,000
流動負債合計	1,377,290,480
負債合計	1,377,290,480
純資産の部	
元本等	
元本	125,832,649,128
剰余金	
剰余金又は欠損金()	474,353,965,407
元本等合計	600,186,614,535
純資産合計	600,186,614,535
負債純資産合計	601,563,905,015

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5月9日 至 2024年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年5月8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	119,728,617,791円
同期中追加設定元本額	49,976,477,315円
同期中一部解約元本額	43,872,445,978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	2,423,002,886円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	5,666,022,311円
One DC 国内株式インデックスファンド	32,242,235,286円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	5,018,159,666円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,315,171円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,134,287円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	19,489,718円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,659,832円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,735,412円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,444,282円
たわらノーロード TOPIX	2,495,642,435円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,719,020,398円
たわらノーロード バランス(堅実型)	46,166,378円
たわらノーロード バランス(標準型)	352,629,429円
たわらノーロード バランス(積極型)	621,718,943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)	2,100,237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)	134,361,687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)	401,745,532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)	355,804,355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)	496,956,056円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	365,178円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,268,143円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	26,135,849円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,449,960円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	13,103,612円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,523,441,485円
Oneグローバルバランス	60,853,960円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	871,135,516円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,246,713,918円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,814,570,047円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	272,482,464円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	927,753,839円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,064,201,750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)	254,266,639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)	554,319,710円
投資のソムリエ	10,422,458,154円
クルーズコントロール	173,264,050円
投資のソムリエ<DC年金>	1,063,299,702円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	366,314,329円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,136,270,486円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	685,190,248円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,170,973,656円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	78,251,691円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	41,118,366円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,190,061円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	205,549,877円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	498,668,553円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	421,629,829円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	216,636,335円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	91,914,093円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	43,187,630円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	26,717,256円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	523,025,702円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,653,520円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,483,047円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	28,515,521円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	348,992円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	282,142円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	200,478円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	165,167円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	715,577円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	120,178,770円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	173,190円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	69,561,851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)	348,508,238円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	427,966円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	159,170,232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)	3,401,626円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	21,114,452円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	361,860円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	5,776,743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)	32,552,955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)	65,972,330円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,463,373円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,637,566円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,916,436円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	76,842円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	516,435円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,796,097円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	248,211,683円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	368,598,349円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,144,523,282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)	9,876,684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)	12,727,031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)	129,679,004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)	25,437,274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)	132,554,350円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	7,291,519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)	34,114,273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)	91,891,724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)	120,886,118円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	15,800,962円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	6,077,232円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,746,688円
コア資産形成ファンド	12,404,005円
MHAMトピックスファンド	780,757,484円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	44,477,655円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,890,466,543円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,382,651,977円
計	125,832,649,128円
2. 受益権の総数	125,832,649,128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5月9日 至 2024年5月8日
----	----------------------------

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年5月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年5月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	31,803,869,838
合計	31,803,869,838

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年2月8日から2024年5月8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5月8日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	20,424,235,500	-	20,429,630,000	5,394,500
合計	20,424,235,500	-	20,429,630,000	5,394,500

（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5月8日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.7697円 (47,697円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年5月8日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	8,800	3,570.00	31,416,000	
ニッスイ	212,300	946.20	200,878,260	
マルハニチロ	31,500	3,131.00	98,626,500	
雪国まいたけ	18,100	988.00	17,882,800	
カネコ種苗	5,900	1,433.00	8,454,700	
サカタのタネ	24,200	3,660.00	88,572,000	
ホクト	17,000	1,805.00	30,685,000	
ホクリヨウ	1,200	1,023.00	1,227,600	
ショーボンドホールディングス	28,900	6,115.00	176,723,500	
ミライト・ワン	64,100	1,951.50	125,091,150	
タマホーム	13,300	4,460.00	59,318,000	
サンヨーホームズ	900	733.00	659,700	
日本アクア	3,000	930.00	2,790,000	
ファーストコーポレーション	2,000	833.00	1,666,000	
ベステラ	1,700	954.00	1,621,800	
robot home	41,600	157.00	6,531,200	
キャンディル	1,300	596.00	774,800	
住石ホールディングス	27,000	1,243.00	33,561,000	
日鉄鉱業	8,500	4,775.00	40,587,500	
三井松島ホールディングス	12,600	3,655.00	46,053,000	

INPEX	713,200	2,333.50	1,664,252,200	
石油資源開発	24,600	6,600.00	162,360,000	
K&Oエナジーグループ	9,600	3,245.00	31,152,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	30,100	2,834.00	85,303,400	
ダイセキ環境ソリューション	1,400	934.00	1,307,600	
第一カッター興業	6,100	1,505.00	9,180,500	
明豊ファシリティワークス	2,600	886.00	2,303,600	
安藤・間	123,000	1,154.00	141,942,000	
東急建設	66,400	837.00	55,576,800	
コムシスホールディングス	67,800	3,643.00	246,995,400	
ビーアールホールディングス	31,200	358.00	11,169,600	
高松コンストラクショングループ	15,800	2,704.00	42,723,200	
東建コーポレーション	5,300	10,890.00	57,717,000	
ソネック	900	926.00	833,400	
ヤマウラ	10,800	1,391.00	15,022,800	
オリエンタル白石	78,800	375.00	29,550,000	
大成建設	136,100	5,767.00	784,888,700	
大林組	531,300	1,727.00	917,555,100	
清水建設	421,200	988.00	416,145,600	
飛鳥建設	15,300	1,398.00	21,389,400	
長谷工コーポレーション	136,300	1,885.00	256,925,500	
松井建設	13,900	842.00	11,703,800	
銭高組	800	4,290.00	3,432,000	
鹿島建設	329,400	2,941.00	968,765,400	
不動テトラ	10,300	2,327.00	23,968,100	
大末建設	2,000	1,632.00	3,264,000	
鉄建建設	10,600	2,772.00	29,383,200	
西松建設	28,300	4,592.00	129,953,600	
三井住友建設	110,600	401.00	44,350,600	
大豊建設	5,100	3,175.00	16,192,500	
佐田建設	3,200	716.00	2,291,200	
ナカノフドー建設	3,600	621.00	2,235,600	
奥村組	24,100	4,885.00	117,728,500	
東鉄工業	18,400	3,060.00	56,304,000	
イチケン	1,300	2,362.00	3,070,600	
富士ピー・エス	2,400	445.00	1,068,000	
浅沼組	11,000	3,685.00	40,535,000	
戸田建設	201,000	1,042.50	209,542,500	
熊谷組	24,500	4,140.00	101,430,000	
北野建設	900	3,440.00	3,096,000	
植木組	1,400	1,718.00	2,405,200	
矢作建設工業	20,200	1,431.00	28,906,200	
ピーエス三菱	18,800	1,018.00	19,138,400	
日本ハウスホールディングス	31,800	310.00	9,858,000	
大東建託	54,700	16,180.00	885,046,000	
新日本建設	20,900	1,558.00	32,562,200	
東亜道路工業	29,600	1,297.00	38,391,200	
日本道路	17,400	1,879.00	32,694,600	
東亜建設工業	45,900	1,041.00	47,781,900	
日本国土開発	42,200	520.00	21,944,000	

若築建設	5,100	3,325.00	16,957,500
東洋建設	37,400	1,268.00	47,423,200
五洋建設	210,600	784.80	165,278,880
世紀東急工業	19,000	1,755.00	33,345,000
福田組	5,600	5,350.00	29,960,000
日本ドライケミカル	1,200	2,605.00	3,126,000
住友林業	128,400	5,562.00	714,160,800
日本基礎技術	3,100	522.00	1,618,200
巴コーポレーション	6,200	704.00	4,364,800
大和ハウス工業	410,900	4,298.00	1,766,048,200
ライト工業	29,500	2,085.00	61,507,500
積水ハウス	450,500	3,623.00	1,632,161,500
日特建設	14,200	1,135.00	16,117,000
北陸電気工事	10,200	1,149.00	11,719,800
ユアテック	32,700	1,448.00	47,349,600
日本リーテック	11,600	1,296.00	15,033,600
四電工	6,200	3,550.00	22,010,000
中電工	23,000	3,105.00	71,415,000
関電工	93,000	1,796.00	167,028,000
きんでん	103,300	3,004.00	310,313,200
東京エネシス	13,900	1,309.00	18,195,100
トーエネック	4,900	5,180.00	25,382,000
住友電設	14,100	3,315.00	46,741,500
日本電設工業	27,900	2,065.00	57,613,500
エクシオグループ	145,200	1,698.00	246,549,600
新日本空調	9,600	3,680.00	35,328,000
九電工	32,100	6,586.00	211,410,600
三機工業	32,100	2,180.00	69,978,000
日揮ホールディングス	147,000	1,371.00	201,537,000
中外炉工業	4,900	3,400.00	16,660,000
ヤマト	4,200	1,067.00	4,481,400
太平電業	9,200	4,275.00	39,330,000
高砂熱学工業	39,800	5,220.00	207,756,000
三晃金属工業	700	4,665.00	3,265,500
NECネットスアイ	59,200	2,533.00	149,953,600
朝日工業社	13,900	1,492.00	20,738,800
明星工業	28,700	1,335.00	38,314,500
大気社	17,100	4,675.00	79,942,500
ダイダン	19,500	2,754.00	53,703,000
日比谷総合設備	10,700	2,909.00	31,126,300
ニッポン	44,700	2,390.00	106,833,000
日清製粉グループ本社	137,900	2,070.00	285,453,000
日東富士製粉	2,400	5,300.00	12,720,000
昭和産業	14,500	3,480.00	50,460,000
鳥越製粉	4,500	680.00	3,060,000
中部飼料	20,700	1,412.00	29,228,400
フィード・ワン	21,800	1,012.00	22,061,600
東洋精糖	900	2,155.00	1,939,500
日本甜菜製糖	8,700	1,987.00	17,286,900
DM三井製糖ホールディングス	14,800	3,045.00	45,066,000

塩水港精糖	6,600	272.00	1,795,200
ウェルネオシュガー	7,500	2,200.00	16,500,000
L I F U L L	38,100	169.00	6,438,900
M I X I	33,400	2,381.00	79,525,400
ジェイエイシーリクルートメント	56,200	751.00	42,206,200
日本M&Aセンターホールディングス	248,100	771.30	191,359,530
メンバーズ	5,300	911.00	4,828,300
中広	800	430.00	344,000
UTグループ	20,200	3,300.00	66,660,000
アイティメディア	5,900	1,842.00	10,867,800
ケアネット	31,800	566.00	17,998,800
E・Jホールディングス	9,100	1,863.00	16,953,300
オープンアップグループ	46,800	1,982.00	92,757,600
コシダカホールディングス	46,600	872.00	40,635,200
アルトナー	2,200	2,228.00	4,901,600
パソナグループ	18,900	2,260.00	42,714,000
C D S	1,300	1,800.00	2,340,000
リンクアンドモチベーション	44,800	494.00	22,131,200
エス・エム・エス	54,600	2,138.50	116,762,100
サニーサイドアップグループ	1,800	695.00	1,251,000
パーソルホールディングス	1,585,000	221.20	350,602,000
リニカル	3,400	406.00	1,380,400
クックパッド	42,600	162.00	6,901,200
エスクリ	2,300	287.00	660,100
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,600	764.00	1,986,400
森永製菓	63,000	2,538.00	159,894,000
中村屋	3,600	3,245.00	11,682,000
江崎グリコ	42,700	4,110.00	175,497,000
名糖産業	5,900	1,775.00	10,472,500
井村屋グループ	9,000	2,500.00	22,500,000
不二家	10,300	2,458.00	25,317,400
山崎製パン	99,800	3,758.00	375,048,400
第一屋製パン	900	740.00	666,000
モロゾフ	4,700	4,160.00	19,552,000
亀田製菓	8,500	4,080.00	34,680,000
寿スピリッツ	70,500	1,667.00	117,523,500
カルビー	68,300	3,329.00	227,370,700
森永乳業	52,100	3,130.00	163,073,000
六甲バター	11,000	1,480.00	16,280,000
ヤクルト本社	213,100	3,033.00	646,332,300
明治ホールディングス	182,900	3,542.00	647,831,800
雪印メグミルク	36,100	2,569.00	92,740,900
プリマハム	20,000	2,441.00	48,820,000
日本ハム	64,100	5,085.00	325,948,500
林兼産業	1,700	554.00	941,800
丸大食品	15,100	1,610.00	24,311,000
S F o o d s	16,500	3,000.00	49,500,000
柿安本店	5,800	2,641.00	15,317,800
伊藤ハム米久ホールディングス	22,800	4,250.00	96,900,000
学情	7,900	1,831.00	14,464,900

スタジオアリス	7,800	2,032.00	15,849,600
クロスキャット	9,600	1,368.00	13,132,800
エプコ	1,500	830.00	1,245,000
システナ	229,700	264.00	60,640,800
N J S	3,400	3,090.00	10,506,000
デジタルアーツ	9,600	4,430.00	42,528,000
日鉄ソリューションズ	25,900	5,000.00	129,500,000
総合警備保障	260,100	860.80	223,894,080
キューブシステム	8,100	1,102.00	8,926,200
いちご	171,700	416.00	71,427,200
日本駐車場開発	177,400	198.00	35,125,200
コア	6,700	1,909.00	12,790,300
カカクコム	101,000	1,841.50	185,991,500
アイロムグループ	6,300	1,829.00	11,522,700
セントケア・ホールディング	11,300	879.00	9,932,700
サイネックス	900	744.00	669,600
ルネサンス	12,100	1,003.00	12,136,300
ディップ	23,800	2,757.00	65,616,600
S B S ホールディングス	13,500	2,624.00	35,424,000
デジタルホールディングス	8,100	1,077.00	8,723,700
新日本科学	14,200	1,411.00	20,036,200
キャリアデザインセンター	1,000	1,722.00	1,722,000
エムスリー	307,700	1,676.50	515,859,050
ツカダ・グローバルホールディング	3,300	445.00	1,468,500
プラス	700	710.00	497,000
ウェルネット	4,500	553.00	2,488,500
ワールドホールディングス	7,000	2,378.00	16,646,000
ディー・エヌ・エー	55,300	1,620.50	89,613,650
博報堂D Yホールディングス	198,600	1,488.50	295,616,100
ぐるなび	29,000	332.00	9,628,000
タカミヤ	21,200	542.00	11,490,400
ファンコミュニケーションズ	22,000	409.00	8,998,000
ライク	5,800	1,700.00	9,860,000
A o b a B B T	2,100	377.00	791,700
エスプール	44,800	328.00	14,694,400
W D B ホールディングス	8,000	2,249.00	17,992,000
手間いらず	2,600	3,155.00	8,203,000
ティア	3,700	459.00	1,698,300
C D G	600	1,342.00	805,200
アドウェイズ	21,500	401.00	8,621,500
バリューコマース	13,700	1,099.00	15,056,300
インフォマート	161,700	335.00	54,169,500
サッポロホールディングス	49,100	5,622.00	276,040,200
アサヒグループホールディングス	344,600	5,465.00	1,883,239,000
麒麟ホールディングス	621,200	2,227.00	1,383,412,400
宝ホールディングス	100,700	1,055.00	106,238,500
オエノンホールディングス	44,600	351.00	15,654,600
養命酒製造	4,900	2,404.00	11,779,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	116,800	2,177.50	254,332,000

ライフドリンク カンパニー	3,000	5,150.00	15,450,000	
サントリー食品インターナショナル	105,000	5,187.00	544,635,000	
ダイドーグループホールディングス	16,900	2,728.00	46,103,200	
伊藤園	50,500	3,885.00	196,192,500	
キーコーヒー	16,700	2,026.00	33,834,200	
ユニカフェ	1,800	913.00	1,643,400	
ジャパンフーズ	800	1,361.00	1,088,800	
日清オイリオグループ	21,000	5,010.00	105,210,000	
不二製油グループ本社	34,700	2,326.50	80,729,550	
かどや製油	600	3,635.00	2,181,000	
J・オイルミルズ	17,100	1,973.00	33,738,300	
サンエー	12,200	4,685.00	57,157,000	
カワチ薬品	12,500	2,829.00	35,362,500	
エービーシー・マート	70,100	3,138.00	219,973,800	
ハードオフコーポレーション	6,400	1,701.00	10,886,400	
高千穂交易	5,700	3,655.00	20,833,500	
アスクル	38,700	2,396.00	92,725,200	
ゲオホールディングス	18,000	1,937.00	34,866,000	
アダストリア	19,300	3,540.00	68,322,000	
ジーフット	4,300	282.00	1,212,600	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	700	587.00	410,900	
オルパヘルスケアホールディングス	900	2,029.00	1,826,100	
伊藤忠食品	3,600	7,330.00	26,388,000	
くら寿司	18,800	4,630.00	87,044,000	
キャンドゥ	5,700	2,861.00	16,307,700	
エレマテック	14,300	1,926.00	27,541,800	
IKホールディングス	1,900	441.00	837,900	
パルグループホールディングス	31,500	1,851.00	58,306,500	
エディオン	63,500	1,588.00	100,838,000	
あらた	24,500	3,370.00	82,565,000	
サーラコーポレーション	33,700	790.00	26,623,000	
ワッツ	2,300	692.00	1,591,600	
トーメンデバイス	2,300	6,700.00	15,410,000	
ハローズ	7,300	4,505.00	32,886,500	
J Pホールディングス	39,800	429.00	17,074,200	
フジオフードグループ本社	18,000	1,429.00	25,722,000	
あみやき亭	3,900	6,170.00	24,063,000	
東京エレクトロン デバイス	16,000	5,060.00	80,960,000	
ひらまつ	12,700	265.00	3,365,500	
円谷フィールズホールディングス	27,500	1,751.00	48,152,500	
双日	178,400	4,198.00	748,923,200	
アルフレッサ ホールディングス	160,900	2,385.50	383,826,950	
大黒天物産	4,900	7,880.00	38,612,000	
ハニーズホールディングス	14,200	1,732.00	24,594,400	
ファーマライズホールディングス	1,300	657.00	854,100	
キッコーマン	494,200	1,839.00	908,833,800	
味の素	354,400	5,752.00	2,038,508,800	
ブルドックソース	7,900	2,011.00	15,886,900	
キュービー	80,200	3,177.00	254,795,400	
ハウス食品グループ本社	51,400	3,107.00	159,699,800	

カゴメ	64,100	3,926.00	251,656,600
アリアケジャパン	14,900	5,010.00	74,649,000
ピエトロ	800	1,791.00	1,432,800
エバラ食品工業	3,500	2,917.00	10,209,500
やまみ	700	3,650.00	2,555,000
ニチレイ	68,300	3,957.00	270,263,100
横浜冷凍	40,300	1,045.00	42,113,500
東洋水産	75,400	10,060.00	758,524,000
イトアンドホールディングス	7,100	1,968.00	13,972,800
大冷	800	1,908.00	1,526,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,800	1,641.00	11,158,800
日清食品ホールディングス	157,300	4,167.00	655,469,100
永谷園ホールディングス	7,300	2,336.00	17,052,800
一正蒲鉾	2,400	755.00	1,812,000
フジッコ	15,400	1,885.00	29,029,000
ロック・フィールド	18,200	1,520.00	27,664,000
日本たばこ産業	906,300	4,275.00	3,874,432,500
ケンコーマヨネーズ	10,300	2,233.00	22,999,900
わらべや日洋ホールディングス	10,000	2,424.00	24,240,000
なとり	9,400	2,066.00	19,420,400
イフジ産業	1,000	1,401.00	1,401,000
ファーマフーズ	19,800	868.00	17,186,400
北の達人コーポレーション	64,000	184.00	11,776,000
ユーグレナ	92,800	507.00	47,049,600
紀文食品	13,000	1,169.00	15,197,000
ピククルスホールディングス	8,800	1,165.00	10,252,000
スター・マイカ・ホールディングス	17,400	635.00	11,049,000
SREホールディングス	6,400	4,205.00	26,912,000
ADワークスグループ	12,500	249.00	3,112,500
片倉工業	14,000	1,878.00	26,292,000
グンゼ	10,800	5,250.00	56,700,000
ヒューリック	347,900	1,472.50	512,282,750
神栄	800	1,714.00	1,371,200
ラサ商事	7,300	1,889.00	13,789,700
アルペン	13,200	2,079.00	27,442,800
ハブ	1,700	804.00	1,366,800
ラクーンホールディングス	11,400	681.00	7,763,400
クオールホールディングス	22,000	1,828.00	40,216,000
アルコニックス	21,100	1,369.00	28,885,900
神戸物産	124,000	3,477.00	431,148,000
ソリトンシステムズ	7,900	1,287.00	10,167,300
ジーンズホールディングス	12,200	3,450.00	42,090,000
ビックカメラ	95,900	1,452.00	139,246,800
DCMホールディングス	84,700	1,486.00	125,864,200
ペッパーフードサービス	39,400	126.00	4,964,400
ハイパー	1,100	302.00	332,200
Monotaro	227,200	1,802.00	409,414,400
東京一番フーズ	1,500	508.00	762,000
DDグループ	3,400	1,265.00	4,301,000
あいホールディングス	25,600	2,451.00	62,745,600

ディービーエックス	1,500	997.00	1,495,500	
きちりホールディングス	1,500	921.00	1,381,500	
J・フロント リテイリング	183,900	1,429.00	262,793,100	
ドトール・日レスホールディングス	28,400	2,071.00	58,816,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	291,500	2,238.00	652,377,000	
ブロンコビリー	9,400	3,760.00	35,344,000	
ZOZO	102,100	3,505.00	357,860,500	
トレジャー・ファクトリー	9,900	1,664.00	16,473,600	
物語コーポレーション	26,800	4,100.00	109,880,000	
三越伊勢丹ホールディングス	270,000	2,323.50	627,345,000	
東洋紡	65,500	1,116.00	73,098,000	
ユニチカ	49,100	214.00	10,507,400	
富士紡ホールディングス	6,600	4,105.00	27,093,000	
日清紡ホールディングス	115,000	1,179.00	135,585,000	
倉敷紡績	10,700	3,650.00	39,055,000	
ダイワボウホールディングス	70,900	2,710.50	192,174,450	
シキボウ	9,000	1,040.00	9,360,000	
日東紡績	19,200	5,730.00	110,016,000	
トヨタ紡織	63,800	2,305.00	147,059,000	
マクニカホールディングス	37,900	6,776.00	256,810,400	
Hamee	6,500	1,196.00	7,774,000	
マーケットエンタープライズ	500	757.00	378,500	
ラクト・ジャパン	6,200	2,634.00	16,330,800	
ウエルシアホールディングス	83,100	2,287.00	190,049,700	
クリエイトSDホールディングス	22,700	3,465.00	78,655,500	
グリムス	6,700	2,173.00	14,559,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,300	1,187.00	28,844,100	
八洲電機	13,000	1,520.00	19,760,000	
メディアスホールディングス	9,400	770.00	7,238,000	
レスター	13,600	2,930.00	39,848,000	
ジオリーブグループ	1,300	1,249.00	1,623,700	
丸善CHIホールディングス	6,500	332.00	2,158,000	
大光	2,800	642.00	1,797,600	
OCHIホールディングス	1,300	1,591.00	2,068,300	
TOKAIホールディングス	87,000	959.00	83,433,000	
黒谷	1,600	687.00	1,099,200	
ミサワ	1,100	618.00	679,800	
ティーライフ	700	1,410.00	987,000	
Cominix	1,100	881.00	969,100	
エー・ピーホールディングス	1,300	941.00	1,223,300	
三洋貿易	16,400	1,544.00	25,321,600	
チムニー	1,700	1,317.00	2,238,900	
シュッピン	14,500	1,228.00	17,806,000	
ビューティガレージ	5,100	1,974.00	10,067,400	
オイシックス・ラ・大地	21,600	1,191.00	25,725,600	
ウイン・パートナーズ	10,400	1,161.00	12,074,400	
ネクステージ	36,600	2,810.00	102,846,000	
ジョイフル本田	46,700	2,228.00	104,047,600	
エターナルホスピタリティグループ	5,900	3,940.00	23,246,000	

ホットランド	12,300	2,142.00	26,346,600
すかいらくホールディングス	219,100	2,170.00	475,447,000
SFPホールディングス	7,700	2,062.00	15,877,400
綿半ホールディングス	12,400	1,545.00	19,158,000
日本毛織	38,900	1,350.00	52,515,000
ダイトウボウ	8,300	90.00	747,000
トーア紡コーポレーション	1,800	432.00	777,600
ダイドーリミテッド	6,300	611.00	3,849,300
ヨシックスホールディングス	3,700	2,748.00	10,167,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,800	889.00	39,827,200
野村不動産ホールディングス	83,000	4,428.00	367,524,000
三重交通グループホールディングス	32,000	579.00	18,528,000
サムティ	23,700	2,676.00	63,421,200
ディア・ライフ	25,400	1,051.00	26,695,400
コーセーアールイー	1,600	784.00	1,254,400
地主	11,400	2,545.00	29,013,000
プレサンスコーポレーション	19,700	1,845.00	36,346,500
フィル・カンパニー	2,300	663.00	1,524,900
THEグローバル社	3,400	461.00	1,567,400
ハウスコム	800	959.00	767,200
JPMC	8,600	1,308.00	11,248,800
サンセイランディック	1,500	1,056.00	1,584,000
エストラスト	600	748.00	448,800
フージャースホールディングス	22,900	1,102.00	25,235,800
オープンハウスグループ	54,700	4,848.00	265,185,600
東急不動産ホールディングス	448,500	1,146.00	513,981,000
飯田グループホールディングス	142,900	1,988.50	284,156,650
イーランド	700	1,537.00	1,075,900
ムゲンエステート	3,300	1,458.00	4,811,400
帝国繊維	17,200	2,299.00	39,542,800
日本コークス工業	153,900	130.00	20,007,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,200	602.00	4,334,400
ミタチ産業	1,500	1,156.00	1,734,000
B E E N O S	9,500	2,140.00	20,330,000
あさひ	14,800	1,409.00	20,853,200
日本調剤	10,500	1,371.00	14,395,500
コスモス薬品	13,600	14,860.00	202,096,000
シップヘルスケアホールディングス	57,600	2,337.50	134,640,000
トーエル	2,500	770.00	1,925,000
ソフトクリエイイトホールディングス	12,500	1,877.00	23,462,500
セブン&アイ・ホールディングス	1,640,700	1,981.00	3,250,226,700
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	108,500	1,066.00	115,661,000
明治電機工業	6,000	1,633.00	9,798,000
ツルハホールディングス	33,700	9,950.00	335,315,000
デリカフーズホールディングス	2,400	583.00	1,399,200
スターティアホールディングス	1,400	1,482.00	2,074,800
サンマルクホールディングス	12,900	2,086.00	26,909,400
フェリシモ	1,200	905.00	1,086,000

トリドールホールディングス	44,900	3,688.00	165,591,200	
帝人	145,700	1,536.00	223,795,200	
東レ	1,016,500	709.60	721,308,400	
クラレ	221,100	1,707.00	377,417,700	
旭化成	1,026,400	1,095.50	1,124,421,200	
T O K Y O B A S E	17,100	300.00	5,130,000	
稲葉製作所	8,700	1,800.00	15,660,000	
宮地エンジニアリンググループ	7,800	3,990.00	31,122,000	
トーカロ	45,100	1,834.00	82,713,400	
アルファ	1,900	1,573.00	2,988,700	
S U M C O	277,700	2,419.00	671,756,300	
川田テクノロジーズ	11,100	2,983.00	33,111,300	
R S T e c h n o l o g i e s	10,500	3,210.00	33,705,000	
ジェイテックコーポレーション	900	2,046.00	1,841,400	
信和	3,400	737.00	2,505,800	
ビーロット	3,400	1,045.00	3,553,000	
ファーストブラザーズ	900	1,273.00	1,145,700	
A n d D o ホールディングス	9,000	1,269.00	11,421,000	
シーアールイー	6,700	1,413.00	9,467,100	
ケイアイスター不動産	7,200	3,770.00	27,144,000	
アグレ都市デザイン	900	1,480.00	1,332,000	
グッドコムアセット	13,800	820.00	11,316,000	
ジェイ・エス・ビー	7,400	2,805.00	20,757,000	
ロードスターキャピタル	9,700	3,480.00	33,756,000	
テンポイノベーション	1,600	912.00	1,459,200	
グローバル・リンク・マネジメント	1,000	2,711.00	2,711,000	
フェイスネットワーク	1,400	1,580.00	2,212,000	
霞ヶ関キャピタル	6,100	18,420.00	112,362,000	
住江織物	1,100	2,709.00	2,979,900	
日本フェルト	2,800	428.00	1,198,400	
イチカワ	700	1,895.00	1,326,500	
エコナックホールディングス	4,900	130.00	637,000	
日東製網	500	1,463.00	731,500	
芦森工業	1,000	2,473.00	2,473,000	
アツギ	3,600	659.00	2,372,400	
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,000.00	1,100,000	
J Mホールディングス	12,100	2,703.00	32,706,300	
コメダホールディングス	39,200	2,575.00	100,940,000	
サツドラホールディングス	2,200	886.00	1,949,200	
アレンザホールディングス	12,100	1,072.00	12,971,200	
串カツ田中ホールディングス	4,300	1,670.00	7,181,000	
パロックジャパンリミテッド	12,400	783.00	9,709,200	
クスリのアオキホールディングス	48,200	2,881.50	138,888,300	
ダイニック	1,600	743.00	1,188,800	
共和レザー	3,000	786.00	2,358,000	
ピーバンドットコム	800	371.00	296,800	
力の源ホールディングス	9,200	1,550.00	14,260,000	
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	85,500	2,867.00	245,128,500	
アセンテック	6,200	551.00	3,416,200	

セーレン	29,300	2,517.00	73,748,100
ソトー	1,600	693.00	1,108,800
東海染工	500	814.00	407,000
小松マテーレ	22,000	748.00	16,456,000
ワコールホールディングス	31,100	3,480.00	108,228,000
ホギメディカル	20,000	3,885.00	77,700,000
クラウディアホールディングス	1,300	406.00	527,800
T S Iホールディングス	49,300	903.00	44,517,900
マツオカコーポレーション	1,600	1,504.00	2,406,400
ワールド	21,400	2,106.00	45,068,400
T I S	160,600	3,410.00	547,646,000
テクミラホールディングス	2,300	388.00	892,400
グリー	50,800	475.00	24,130,000
G M Oペパボ	1,900	1,357.00	2,578,300
コーエーテックモホールディングス	95,100	1,363.50	129,668,850
三菱総合研究所	7,400	4,815.00	35,631,000
ボルテージ	1,500	264.00	396,000
電算	600	1,483.00	889,800
A G S	2,100	1,088.00	2,284,800
ファインデックス	12,000	1,011.00	12,132,000
ブレインパッド	12,600	1,241.00	15,636,600
K L a b	27,900	252.00	7,030,800
ポルトゥウィンホールディングス	26,000	487.00	12,662,000
ネクソン	333,300	2,504.50	834,749,850
アイスタイル	50,700	530.00	26,871,000
エムアップホールディングス	18,600	1,090.00	20,274,000
エイチーム	10,100	648.00	6,544,800
エニグモ	19,400	339.00	6,576,600
テクノスジャパン	4,500	604.00	2,718,000
e n i s h	5,200	225.00	1,170,000
コロプラ	51,600	601.00	31,011,600
オルトプラス	4,900	134.00	656,600
ブロードリーフ	72,100	566.00	40,808,600
クロス・マーケティンググループ	2,400	510.00	1,224,000
デジタルハーツホールディングス	9,500	973.00	9,243,500
メディアドゥ	6,900	1,404.00	9,687,600
じげん	44,300	553.00	24,497,900
ブイキューブ	18,200	238.00	4,331,600
エンカレッジ・テクノロジー	1,300	595.00	773,500
サイバーリンクス	2,000	786.00	1,572,000
ディー・エル・イー	3,600	161.00	579,600
フィックスターズ	15,200	1,911.00	29,047,200
C A R T A H O L D I N G S	7,200	1,702.00	12,254,400
オブティム	15,700	916.00	14,381,200
セレス	6,100	1,786.00	10,894,600
S H I F T	10,100	14,090.00	142,309,000
特種東海製紙	8,300	3,750.00	31,125,000
ティーガイア	15,900	2,183.00	34,709,700
セック	2,100	4,655.00	9,775,500
テクマトリックス	27,700	1,694.00	46,923,800

プロシップ	7,300	1,381.00	10,081,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,500	2,355.00	93,022,500
GMOペイメントゲートウェイ	34,700	7,846.00	272,256,200
ザッパラス	1,200	420.00	504,000
システムリサーチ	10,400	1,481.00	15,402,400
インターネットイニシアティブ	72,600	2,717.50	197,290,500
さくらインターネット	17,000	6,270.00	106,590,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,600	2,668.00	12,272,800
SRAホールディングス	7,800	3,925.00	30,615,000
システムインテグレータ	1,500	366.00	549,000
朝日ネット	16,300	636.00	10,366,800
eBASE	21,400	677.00	14,487,800
アバントグループ	19,200	1,294.00	24,844,800
アドソル日進	6,400	1,654.00	10,585,600
ODKソリューションズ	1,100	624.00	686,400
フリービット	6,600	1,457.00	9,616,200
コムチュア	21,900	1,953.00	42,770,700
アステリア	11,900	608.00	7,235,200
アイル	8,500	2,702.00	22,967,000
王子ホールディングス	631,700	616.60	389,506,220
日本製紙	85,600	1,098.00	93,988,800
三菱製紙	6,800	579.00	3,937,200
北越コーポレーション	74,600	1,381.00	103,022,600
中越パルプ工業	2,000	1,703.00	3,406,000
巴川コーポレーション	1,400	952.00	1,332,800
大王製紙	67,000	1,117.50	74,872,500
阿波製紙	1,400	467.00	653,800
マークライnz	8,200	3,150.00	25,830,000
メディカル・データ・ビジョン	18,100	580.00	10,498,000
gumi	24,700	376.00	9,287,200
ショーケース	1,200	312.00	374,400
モバイルファクトリー	1,100	671.00	738,100
テラスカイ	6,600	2,095.00	13,827,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,900	1,759.00	13,896,100
PCIホールディングス	2,100	938.00	1,969,800
アイビーシー	800	413.00	330,400
ネオジャパン	5,100	1,513.00	7,716,300
PR TIMES	3,100	1,891.00	5,862,100
ラクス	71,800	1,784.50	128,127,100
ランドコンピュータ	2,500	778.00	1,945,000
ダブルスタンダード	4,600	1,792.00	8,243,200
オーブンドア	8,900	721.00	6,416,900
マイネット	1,600	330.00	528,000
アカツキ	7,400	2,317.00	17,145,800
ベネフィットジャパン	300	1,135.00	340,500
Ubicomホールディングス	4,800	1,177.00	5,649,600
カナミックネットワーク	19,000	528.00	10,032,000

ノムラシステムコーポレーション	5,500	132.00	726,000	
レンゴー	138,100	1,178.00	162,681,800	
トーモク	8,700	2,775.00	24,142,500	
ザ・バック	11,300	3,695.00	41,753,500	
チェンジホールディングス	33,100	1,226.00	40,580,600	
シンクロ・フード	3,200	565.00	1,808,000	
オークネット	5,600	2,567.00	14,375,200	
キャピタル・アセット・プランニング	1,000	798.00	798,000	
セグエグループ	4,600	526.00	2,419,600	
エイトレッド	800	1,507.00	1,205,600	
マクロミル	29,800	731.00	21,783,800	
ビーグリー	1,100	1,089.00	1,197,900	
オロ	5,500	2,698.00	14,839,000	
ユーザーローカル	6,400	2,087.00	13,356,800	
テモナ	1,200	237.00	284,400	
ニーズウェル	2,800	865.00	2,422,000	
マネーフォワード	34,000	6,072.00	206,448,000	
サインポスト	2,000	677.00	1,354,000	
レゾナック・ホールディングス	146,600	3,484.00	510,754,400	
住友化学	1,125,900	329.70	371,209,230	
住友精化	7,100	5,030.00	35,713,000	
日産化学	70,800	5,353.00	378,992,400	
ラサ工業	5,800	2,843.00	16,489,400	
クレハ	33,200	2,827.00	93,856,400	
多木化学	5,900	3,955.00	23,334,500	
テイカ	13,000	1,536.00	19,968,000	
石原産業	25,100	1,826.00	45,832,600	
片倉コープアグリ	1,200	1,103.00	1,323,600	
日本曹達	17,900	5,770.00	103,283,000	
東ソー	202,500	2,168.50	439,121,250	
トクヤマ	49,000	3,130.00	153,370,000	
セントラル硝子	16,200	2,710.00	43,902,000	
東亜合成	72,900	1,616.00	117,806,400	
大阪ソーダ	10,600	9,050.00	95,930,000	
関東電化工業	29,300	1,036.00	30,354,800	
SUN A S T E R I S K	10,800	940.00	10,152,000	
デンカ	55,200	2,304.00	127,180,800	
イビデン	79,800	5,621.00	448,555,800	
信越化学工業	1,360,500	5,754.00	7,828,317,000	
日本カーバイド工業	7,200	1,755.00	12,636,000	
プラスアルファ・コンサルティング	19,100	2,037.00	38,906,700	
電算システムホールディングス	6,700	2,782.00	18,639,400	
堺化学工業	11,600	2,043.00	23,698,800	
第一稀元素化学工業	16,600	906.00	15,039,600	
エア・ウォーター	143,100	2,342.00	335,140,200	
日本酸素ホールディングス	147,200	4,506.00	663,283,200	
日本化学工業	5,600	2,388.00	13,372,800	
東邦アセチレン	5,500	377.00	2,073,500	
日本パーカライズン	67,600	1,186.00	80,173,600	
高圧ガス工業	22,200	872.00	19,358,400	

チタン工業	600	1,036.00	621,600	
四国化成ホールディングス	17,100	1,743.00	29,805,300	
戸田工業	3,500	2,092.00	7,322,000	
ステラ ケミファ	8,200	3,745.00	30,709,000	
保土谷化学工業	4,800	4,590.00	22,032,000	
日本触媒	88,300	1,491.00	131,655,300	
大日精化工業	10,600	2,842.00	30,125,200	
カネカ	37,400	4,096.00	153,190,400	
協和キリン	183,500	2,634.50	483,430,750	
A P P I E R G R O U P	52,000	1,382.00	71,864,000	
三菱瓦斯化学	110,700	2,793.00	309,185,100	
三井化学	125,100	4,421.00	553,067,100	
東京応化工業	72,400	4,307.00	311,826,800	
大阪有機化学工業	12,700	3,220.00	40,894,000	
三菱ケミカルグループ	1,109,200	896.90	994,841,480	
K H ネオケム	23,100	2,389.00	55,185,900	
ビジョナル	17,800	7,790.00	138,662,000	
ダイセル	195,000	1,468.50	286,357,500	
住友ベークライト	42,500	4,495.00	191,037,500	
積水化学工業	304,900	2,223.00	677,792,700	
日本ゼオン	104,000	1,472.50	153,140,000	
アイカ工業	38,300	3,457.00	132,403,100	
U B E	72,200	2,892.50	208,838,500	
積水樹脂	22,600	2,575.00	58,195,000	
タキロンシーアイ	38,700	691.00	26,741,700	
旭有機材	10,100	4,940.00	49,894,000	
ニチバン	8,300	1,858.00	15,421,400	
リケンテクノス	28,400	965.00	27,406,000	
大倉工業	7,100	3,130.00	22,223,000	
積水化成品工業	21,400	459.00	9,822,600	
群栄化学工業	3,600	3,435.00	12,366,000	
タイガースポリマー	2,300	1,071.00	2,463,300	
ミライアル	1,700	1,523.00	2,589,100	
ダイキアクシス	2,000	714.00	1,428,000	
ダイキョーニシカワ	33,500	723.00	24,220,500	
竹本容器	1,900	840.00	1,596,000	
森六ホールディングス	7,900	2,693.00	21,274,700	
恵和	10,900	1,160.00	12,644,000	
日本化薬	115,900	1,322.50	153,277,750	
カーリットホールディングス	16,400	1,116.00	18,302,400	
ソルクシーズ	4,300	328.00	1,410,400	
C L ホールディングス	3,700	1,407.00	5,205,900	
プレステージ・インターナショナル	72,900	671.00	48,915,900	
フェイス	1,200	444.00	532,800	
プロトコーポレーション	16,600	1,410.00	23,406,000	
ハイマックス	4,600	1,386.00	6,375,600	
アミューズ	9,400	1,587.00	14,917,800	
野村総合研究所	329,000	4,075.00	1,340,675,000	
ドリームインキュベータ	5,300	2,384.00	12,635,200	
クイック	10,800	2,302.00	24,861,600	

T A C	2,300	181.00	416,300
C Eホールディングス	2,400	577.00	1,384,800
日本システム技術	12,700	1,698.00	21,564,600
電通グループ	153,000	4,197.00	642,141,000
インテージホールディングス	17,200	1,447.00	24,888,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,700	1,002.00	6,713,400
東邦システムサイエンス	6,400	1,291.00	8,262,400
ぴあ	5,200	3,075.00	15,990,000
イオンファンタジー	5,600	2,257.00	12,639,200
ソースネクスト	69,500	181.00	12,579,500
シーティーエス	19,800	737.00	14,592,600
N E X Y Z . G r o u p	1,600	622.00	995,200
インフォコム	19,600	2,933.00	57,486,800
メディカルシステムネットワーク	17,400	630.00	10,962,000
日本精化	10,100	2,497.00	25,219,700
扶桑化学工業	16,100	4,160.00	66,976,000
トリケミカル研究所	18,400	4,405.00	81,052,000
シンプレクス・ホールディングス	23,100	2,711.00	62,624,100
H E R O Z	6,000	1,346.00	8,076,000
ラクスル	36,700	913.00	33,507,100
メルカリ	74,100	1,782.50	132,083,250
I P S	4,400	2,286.00	10,058,400
F I G	5,900	379.00	2,236,100
システムサポート	5,900	1,852.00	10,926,800
A D E K A	52,900	3,286.00	173,829,400
日油	137,400	2,101.50	288,746,100
ミヨシ油脂	1,900	1,255.00	2,384,500
新日本理化	7,000	176.00	1,232,000
ハリマ化成グループ	10,700	895.00	9,576,500
イーソル	11,000	830.00	9,130,000
東海ソフト	800	1,474.00	1,179,200
ウイングアーク1 s t	15,800	2,778.00	43,892,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,100	1,005.00	5,125,500
サーバーワークス	3,100	2,976.00	9,225,600
東名	500	2,333.00	1,166,500
ヴィッツ	500	807.00	403,500
トピラシステムズ	1,500	801.00	1,201,500
S a n s a n	49,900	1,566.00	78,143,400
L i n k - Uグループ	1,000	610.00	610,000
ギフトィ	13,300	1,237.00	16,452,100
花王	343,100	6,579.00	2,257,254,900
第一工業製薬	6,100	3,315.00	20,221,500
石原ケミカル	6,700	1,741.00	11,664,700
日華化学	2,100	1,026.00	2,154,600
ニイタカ	1,000	1,944.00	1,944,000
三洋化成工業	9,300	4,090.00	38,037,000
メドレー	20,400	3,615.00	73,746,000
ベース	5,300	3,560.00	18,868,000
J M D C	25,900	3,101.00	80,315,900

武田薬品工業	1,344,500	4,053.00	5,449,258,500
アステラス製薬	1,332,500	1,544.50	2,058,046,250
住友ファーマ	112,600	363.00	40,873,800
塩野義製薬	191,500	7,397.00	1,416,525,500
わかもと製薬	5,400	233.00	1,258,200
日本新薬	39,800	4,413.00	175,637,400
中外製薬	475,500	4,926.00	2,342,313,000
科研製薬	26,000	3,479.00	90,454,000
エーザイ	184,800	6,610.00	1,221,528,000
理研ビタミン	12,900	2,580.00	33,282,000
ロート製薬	147,200	3,078.00	453,081,600
小野薬品工業	310,700	2,293.50	712,590,450
久光製薬	33,800	3,778.00	127,696,400
有機合成薬品工業	4,200	301.00	1,264,200
持田製薬	17,000	3,190.00	54,230,000
参天製薬	268,000	1,545.00	414,060,000
扶桑薬品工業	5,400	2,206.00	11,912,400
日本ケミファ	600	1,601.00	960,600
ツムラ	47,800	3,750.00	179,250,000
テルモ	844,400	2,579.50	2,178,129,800
H.U.グループホールディングス	45,500	2,221.50	101,078,250
キッセイ薬品工業	25,100	3,230.00	81,073,000
生化学工業	25,700	740.00	19,018,000
栄研化学	27,200	2,004.00	54,508,800
鳥居薬品	8,200	3,975.00	32,595,000
JCRファーマ	51,400	800.00	41,120,000
東和薬品	23,300	2,711.00	63,166,300
富士製薬工業	11,200	1,602.00	17,942,400
ゼリア新薬工業	21,100	2,099.00	44,288,900
ネクセラファーマ	66,500	1,546.00	102,809,000
第一三共	1,323,400	5,289.00	6,999,462,600
杏林製薬	32,900	1,800.00	59,220,000
大幸薬品	31,700	358.00	11,348,600
ダイト	11,600	2,537.00	29,429,200
大塚ホールディングス	316,000	6,384.00	2,017,344,000
ペプチドリーム	73,600	1,975.00	145,360,000
大日本塗料	16,800	1,249.00	20,983,200
日本ペイントホールディングス	805,700	1,079.00	869,350,300
関西ペイント	131,100	2,116.50	277,473,150
神東塗料	4,700	127.00	596,900
中国塗料	31,100	2,039.00	63,412,900
日本特殊塗料	3,600	1,430.00	5,148,000
藤倉化成	17,500	466.00	8,155,000
太陽ホールディングス	26,400	3,095.00	81,708,000
DIC	59,200	2,933.50	173,663,200
サカタインクス	33,700	1,567.00	52,807,900
artience	33,000	2,934.00	96,822,000
アルプス技研	14,800	2,780.00	41,144,000
サニックス	24,900	329.00	8,192,100
日本空調サービス	16,700	870.00	14,529,000

オリエンタルランド	824,000	4,357.00	3,590,168,000
フォーカスシステムズ	10,100	1,237.00	12,493,700
ダスキン	34,000	3,281.00	111,554,000
パーク24	96,900	1,698.00	164,536,200
明光ネットワークジャパン	18,900	718.00	13,570,200
ファルコホールディングス	6,900	2,196.00	15,152,400
クレスコ	12,400	2,005.00	24,862,000
フジ・メディア・ホールディングス	145,900	1,811.00	264,224,900
秀英予備校	1,200	309.00	370,800
田谷	1,000	388.00	388,000
ラウンドワン	146,700	701.00	102,836,700
リゾートトラスト	67,600	2,580.00	174,408,000
オービック	50,800	21,085.00	1,071,118,000
ジャストシステム	21,800	2,861.00	62,369,800
TDCソフト	28,500	1,181.00	33,658,500
LINEヤフー	2,162,900	367.60	795,082,040
ビー・エム・エル	19,100	2,864.00	54,702,400
トレンドマイクロ	71,800	7,967.00	572,030,600
IDホールディングス	10,200	1,510.00	15,402,000
リソー教育	79,600	274.00	21,810,400
日本オラクル	29,100	11,845.00	344,689,500
早稲田アカデミー	8,600	1,492.00	12,831,200
アルファシステムズ	4,000	3,165.00	12,660,000
フューチャー	32,400	1,574.00	50,997,600
CAC Holdings	8,100	1,967.00	15,932,700
S Bテクノロジー	6,400	2,945.00	18,848,000
トーセ	1,400	691.00	967,400
ユー・エス・エス	349,400	1,178.50	411,767,900
オービックビジネスコンサルタント	21,400	6,695.00	143,273,000
アイティフォー	19,400	1,396.00	27,082,400
東京個別指導学院	18,600	404.00	7,514,400
東計電算	4,200	3,865.00	16,233,000
サイバーエージェント	344,100	966.50	332,572,650
楽天グループ	1,336,000	794.60	1,061,585,600
エクスネット	700	1,467.00	1,026,900
クリーク・アンド・リバー社	7,800	1,685.00	13,143,000
SBIグローバルアセットマネジメント	30,500	658.00	20,069,000
テー・オー・ダブリュー	30,600	376.00	11,505,600
大塚商会	150,700	2,974.50	448,257,150
サイボウズ	20,900	1,625.00	33,962,500
山田コンサルティンググループ	6,800	1,811.00	12,314,800
セントラルスポーツ	5,700	2,432.00	13,862,400
パラカ	4,700	2,078.00	9,766,600
電通総研	18,500	5,450.00	100,825,000
ACCESS	15,800	1,540.00	24,332,000
デジタルガレージ	24,300	2,855.00	69,376,500
イーエムシステムズ	25,300	641.00	16,217,300
ウェザーニューズ	4,700	4,730.00	22,231,000
C I J	37,800	464.00	17,539,200

ビジネスエンジニアリング	3,200	3,430.00	10,976,000	
日本エンタープライズ	5,100	139.00	708,900	
WOWOW	11,500	1,083.00	12,454,500	
スカラ	13,900	712.00	9,896,800	
インテリジェント ウェイブ	2,700	1,143.00	3,086,100	
フルキャストホールディングス	14,900	1,527.00	22,752,300	
エン・ジャパン	25,300	2,756.00	69,726,800	
セルソース	5,600	1,502.00	8,411,200	
あすか製薬ホールディングス	15,600	2,117.00	33,025,200	
サワイグループホールディングス	34,700	5,723.00	198,588,100	
富士フイルムホールディングス	845,500	3,455.00	2,921,202,500	
コニカミノルタ	341,600	509.70	174,113,520	
資生堂	317,200	4,297.00	1,363,008,400	
ライオン	193,300	1,429.50	276,322,350	
高砂香料工業	11,400	3,505.00	39,957,000	
マンダム	32,800	1,329.00	43,591,200	
ミルボン	20,600	3,137.00	64,622,200	
ファンケル	66,500	1,836.50	122,127,250	
コーセー	30,900	8,368.00	258,571,200	
コタ	15,400	1,414.00	21,775,600	
シーボン	700	1,395.00	976,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	77,900	1,467.00	114,279,300	
ノエビアホールディングス	13,500	5,210.00	70,335,000	
アジュバンホールディングス	1,200	852.00	1,022,400	
新日本製薬	8,700	1,681.00	14,624,700	
I - n e	4,000	1,857.00	7,428,000	
アクシージア	10,000	906.00	9,060,000	
エステー	11,700	1,532.00	17,924,400	
アグロ カネショウ	6,100	1,166.00	7,112,600	
コニシ	43,900	1,298.00	56,982,200	
長谷川香料	29,000	3,015.00	87,435,000	
小林製薬	44,200	5,304.00	234,436,800	
荒川化学工業	13,000	1,082.00	14,066,000	
メック	12,500	3,845.00	48,062,500	
日本高純度化学	3,400	3,245.00	11,033,000	
タカラバイオ	40,900	1,012.00	41,390,800	
J C U	16,800	3,695.00	62,076,000	
新田ゼラチン	3,500	716.00	2,506,000	
O A T アグリオ	5,600	2,042.00	11,435,200	
デクセリアルズ	37,500	5,874.00	220,275,000	
アース製薬	13,800	4,515.00	62,307,000	
北興化学工業	15,300	1,601.00	24,495,300	
大成ラミック	4,300	2,861.00	12,302,300	
クミアイ化学工業	60,300	808.00	48,722,400	
日本農薬	27,800	745.00	20,711,000	
富士興産	1,500	1,797.00	2,695,500	
ニチレキ	19,800	2,399.00	47,500,200	
ユシロ化学工業	7,900	1,979.00	15,634,100	
ビービー・カストロール	2,000	979.00	1,958,000	
富士石油	44,300	448.00	19,846,400	

MORESCO	1,900	1,298.00	2,466,200	
出光興産	788,700	1,023.00	806,840,100	
ENEOSホールディングス	2,405,100	695.50	1,672,747,050	
コスモエネルギーホールディングス	45,000	7,473.00	336,285,000	
ANYCOLOR	21,500	2,319.00	49,858,500	
テスホールディングス	32,000	444.00	14,208,000	
インフロニア・ホールディングス	171,300	1,373.00	235,194,900	
横浜ゴム	76,800	3,964.00	304,435,200	
TOYO TIRE	87,300	2,873.50	250,856,550	
ブリヂストン	444,700	6,806.00	3,026,628,200	
住友ゴム工業	149,000	1,880.00	280,120,000	
藤倉コンポジット	13,100	1,419.00	18,588,900	
オカモト	7,200	4,780.00	34,416,000	
アキレス	9,600	1,572.00	15,091,200	
フコク	8,000	1,783.00	14,264,000	
ニッタ	15,400	3,980.00	61,292,000	
クリエートメディック	1,600	955.00	1,528,000	
住友理工	23,600	1,257.00	29,665,200	
三ツ星ベルト	17,600	4,655.00	81,928,000	
パンドー化学	22,500	1,762.00	39,645,000	
AGC	135,500	5,244.00	710,562,000	
日本板硝子	72,500	517.00	37,482,500	
石塚硝子	900	2,845.00	2,560,500	
有沢製作所	26,600	1,554.00	41,336,400	
日本山村硝子	1,900	1,425.00	2,707,500	
日本電気硝子	62,000	3,644.00	225,928,000	
オハラ	7,200	1,326.00	9,547,200	
住友大阪セメント	25,300	3,880.00	98,164,000	
太平洋セメント	89,800	3,634.00	326,333,200	
リソルホールディングス	500	5,050.00	2,525,000	
日本ヒューム	13,400	847.00	11,349,800	
日本コンクリート工業	29,500	420.00	12,390,000	
三谷セキサン	6,400	5,420.00	34,688,000	
アジアパイルホールディングス	21,600	865.00	18,684,000	
東海カーボン	140,100	1,035.50	145,073,550	
日本カーボン	8,100	5,530.00	44,793,000	
東洋炭素	10,700	8,050.00	86,135,000	
ノリタケカンパニーリミテド	16,800	4,050.00	68,040,000	
TOTO	100,200	4,061.00	406,912,200	
日本碍子	176,700	2,106.50	372,218,550	
日本特殊陶業	127,200	4,846.00	616,411,200	
ダントーホールディングス	3,400	749.00	2,546,600	
MARUWA	5,600	34,500.00	193,200,000	
品川リフラクトリーズ	18,700	1,855.00	34,688,500	
黒崎播磨	12,400	3,325.00	41,230,000	
ヨータイ	9,400	1,442.00	13,554,800	
東京窯業	5,500	471.00	2,590,500	
ニッカトー	2,400	579.00	1,389,600	
フジインコーポレーテッド	40,800	3,515.00	143,412,000	
クニミネ工業	1,500	1,162.00	1,743,000	

エーアンドエーマテリアル	1,100	1,292.00	1,421,200	
ニチアス	38,400	4,195.00	161,088,000	
日本製鉄	700,000	3,400.00	2,380,000,000	
神戸製鋼所	314,300	1,869.00	587,426,700	
中山製鋼所	35,800	893.00	31,969,400	
合同製鐵	8,700	5,250.00	45,675,000	
JFEホールディングス	434,700	2,291.50	996,115,050	
東京製鐵	44,000	1,626.00	71,544,000	
共英製鋼	17,800	2,118.00	37,700,400	
大和工業	29,500	8,356.00	246,502,000	
東京鐵鋼	6,900	4,770.00	32,913,000	
大阪製鐵	7,200	2,490.00	17,928,000	
淀川製鋼所	17,800	4,900.00	87,220,000	
中部鋼鈹	10,300	2,233.00	22,999,900	
丸一鋼管	47,600	3,913.00	186,258,800	
モリ工業	3,600	6,410.00	23,076,000	
大同特殊鋼	98,400	1,720.50	169,297,200	
日本高周波鋼業	2,000	458.00	916,000	
日本冶金工業	11,400	4,690.00	53,466,000	
山陽特殊製鋼	15,500	2,227.00	34,518,500	
愛知製鋼	9,000	3,505.00	31,545,000	
日本金属	1,400	816.00	1,142,400	
ミガロホールディングス	700	2,819.00	1,973,300	
大平洋金属	13,400	1,291.00	17,299,400	
新日本電工	77,800	308.00	23,962,400	
栗本鐵工所	7,200	4,340.00	31,248,000	
虹 技	700	1,369.00	958,300	
日本鑄鐵管	600	1,386.00	831,600	
日本製鋼所	42,100	3,796.00	159,811,600	
三菱製鋼	11,600	1,385.00	16,066,000	
日亜鋼業	5,800	320.00	1,856,000	
日本精線	12,600	1,277.00	16,090,200	
エンピプロ・ホールディングス	13,900	515.00	7,158,500	
大紀アルミニウム工業所	19,900	1,307.00	26,009,300	
日本輕金属ホールディングス	45,800	1,855.00	84,959,000	
三井金属鈹業	45,500	5,020.00	228,410,000	
東邦亜鉛	10,100	1,046.00	10,564,600	
三菱マテリアル	111,700	3,044.00	340,014,800	
住友金属鈹山	181,200	5,213.00	944,595,600	
DOWAホールディングス	38,600	5,844.00	225,578,400	
古河機械金属	20,600	1,923.00	39,613,800	
エス・サイエンス	33,000	22.00	726,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,100	2,478.00	67,153,800	
東邦チタニウム	32,300	1,382.00	44,638,600	
UACJ	21,900	4,910.00	107,529,000	
CKサンエツ	2,800	3,890.00	10,892,000	
古河電氣工業	52,000	3,525.00	183,300,000	
住友電氣工業	584,600	2,397.00	1,401,286,200	
フジクラ	184,300	2,871.50	529,217,450	
SWCC	17,500	4,250.00	74,375,000	

タツタ電線	27,900	715.00	19,948,500
カナレ電気	900	1,587.00	1,428,300
平河ヒューテック	10,000	1,363.00	13,630,000
いよぎんホールディングス	177,500	1,210.00	214,775,000
しずおかフィナンシャルグループ	331,400	1,431.00	474,233,400
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	125,600	1,273.50	159,951,600
楽天銀行	69,200	3,290.00	227,668,000
京都フィナンシャルグループ	189,000	2,754.50	520,600,500
リョービ	16,600	2,715.00	45,069,000
アーレスティ	5,700	643.00	3,665,100
A R Eホールディングス	58,700	1,977.00	116,049,900
東洋製罐グループホールディングス	89,600	2,425.00	217,280,000
ホッカインホールディングス	7,600	1,742.00	13,239,200
コロナ	8,700	945.00	8,221,500
横河ブリッジホールディングス	24,400	2,845.00	69,418,000
駒井ハルテック	900	2,023.00	1,820,700
高田機工	400	3,780.00	1,512,000
三和ホールディングス	157,000	2,565.50	402,783,500
文化シャッター	40,900	1,696.00	69,366,400
三協立山	19,700	816.00	16,075,200
アルインコ	11,900	1,075.00	12,792,500
東洋シャッター	1,200	712.00	854,400
L I X I L	244,000	1,770.00	431,880,000
日本ファイルコン	3,400	547.00	1,859,800
ノーリツ	24,700	1,742.00	43,027,400
長府製作所	15,500	2,201.00	34,115,500
リンナイ	74,800	3,413.00	255,292,400
ユニプレス	27,200	1,141.00	31,035,200
ダイニチ工業	2,600	698.00	1,814,800
日東精工	22,700	621.00	14,096,700
三洋工業	600	2,915.00	1,749,000
岡部	27,900	782.00	21,817,800
ジーテクト	19,900	2,046.00	40,715,400
東プレ	27,500	2,498.00	68,695,000
高周波熱練	23,100	1,045.00	24,139,500
東京製綱	10,100	1,411.00	14,251,100
サンコール	15,800	473.00	7,473,400
モリテックスチール	4,800	241.00	1,156,800
パイオラックス	19,400	2,587.00	50,187,800
エイチワン	16,200	687.00	11,129,400
日本発条	138,300	1,641.00	226,950,300
中央発條	11,600	1,049.00	12,168,400
アドバネクス	600	1,285.00	771,000
三浦工業	63,900	2,542.50	162,465,750
タクマ	51,700	1,981.00	102,417,700
テクノプロ・ホールディングス	91,200	2,717.00	247,790,400
アトラグループ	1,600	169.00	270,400
アイ・アールジャパンホールディングス	8,100	1,212.00	9,817,200
K e e P e r 技研	9,600	3,945.00	37,872,000

ファーストロジック	1,600	504.00	806,400
三機サービス	900	1,330.00	1,197,000
Gunosy	12,300	755.00	9,286,500
デザインワン・ジャパン	1,600	132.00	211,200
イー・ガーディアン	7,500	1,675.00	12,562,500
リブセンス	2,400	225.00	540,000
ジャパンマテリアル	47,700	2,345.00	111,856,500
ベクトル	18,600	1,305.00	24,273,000
ウチヤマホールディングス	2,300	348.00	800,400
チャーム・ケア・コーポレーション	13,000	1,704.00	22,152,000
キャリアリンク	5,700	2,500.00	14,250,000
I B J	12,000	550.00	6,600,000
アサンテ	7,700	1,632.00	12,566,400
バリューHR	13,600	1,355.00	18,428,000
M&Aキャピタルパートナーズ	12,600	2,145.00	27,027,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,038.00	6,435,600
E R Iホールディングス	1,500	2,344.00	3,516,000
アビスト	800	3,265.00	2,612,000
シグマクシス・ホールディングス	20,400	1,604.00	32,721,600
ウィルグループ	13,000	1,069.00	13,897,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,500	143.00	929,500
メドピア	12,400	702.00	8,704,800
レアジョブ	1,000	701.00	701,000
リクルートホールディングス	1,121,400	7,037.00	7,891,291,800
エラン	20,600	1,003.00	20,661,800
ツガミ	34,000	1,384.00	47,056,000
オークマ	13,400	7,084.00	94,925,600
芝浦機械	15,300	3,545.00	54,238,500
アマダ	231,800	1,719.00	398,464,200
アイダエンジニアリング	35,400	872.00	30,868,800
F U J I	72,000	2,751.50	198,108,000
牧野フライス製作所	16,900	6,400.00	108,160,000
オーエスジー	67,400	1,990.50	134,159,700
ダイジェット工業	500	834.00	417,000
旭ダイヤモンド工業	35,300	900.00	31,770,000
D M G森精機	95,000	4,702.00	446,690,000
ソディック	37,200	742.00	27,602,400
ディスコ	73,700	49,860.00	3,674,682,000
日東工器	7,400	2,443.00	18,078,200
日進工具	14,200	919.00	13,049,800
パンチ工業	5,100	453.00	2,310,300
富士ダイス	10,200	665.00	6,783,000
土木管理総合試験所	2,500	323.00	807,500
日本郵政	1,829,600	1,495.50	2,736,166,800
ベルシステム24ホールディングス	16,700	1,531.00	25,567,700
鎌倉新書	13,300	565.00	7,514,500
S M N	1,000	310.00	310,000
一蔵	700	571.00	399,700
グローバルキッズCOMPANY	1,000	642.00	642,000

エアトリ	11,400	1,411.00	16,085,400
アトラエ	11,800	458.00	5,404,400
ストライク	7,700	4,120.00	31,724,000
ソラスト	42,900	498.00	21,364,200
セラク	4,800	1,069.00	5,131,200
インソース	33,800	974.00	32,921,200
豊田自動織機	129,200	15,035.00	1,942,522,000
豊和工業	2,800	786.00	2,200,800
石川製作所	1,300	1,280.00	1,664,000
リケンNPR	16,600	2,934.00	48,704,400
東洋機械金属	4,100	733.00	3,005,300
津田駒工業	900	403.00	362,700
エンシュウ	1,200	688.00	825,600
島精機製作所	24,300	1,412.00	34,311,600
オプトラン	25,100	1,994.00	50,049,400
NCホールディングス	1,200	1,915.00	2,298,000
イワキ	10,200	2,500.00	25,500,000
フリー	14,400	1,225.00	17,640,000
ヤマシンフィルタ	36,400	425.00	15,470,000
日阪製作所	16,700	1,048.00	17,501,600
やまびこ	25,000	2,061.00	51,525,000
野村マイクロ・サイエンス	20,700	5,360.00	110,952,000
平田機工	7,300	7,000.00	51,100,000
PEGASUS	16,900	521.00	8,804,900
マルマエ	6,700	1,924.00	12,890,800
タツモ	9,200	4,195.00	38,594,000
ナブテスコ	96,000	2,762.00	265,152,000
三井海洋開発	19,400	3,235.00	62,759,000
レオン自動機	17,700	1,513.00	26,780,100
S M C	45,800	84,050.00	3,849,490,000
ホソカワミクロン	10,700	4,655.00	49,808,500
ユニオンツール	6,700	4,385.00	29,379,500
瑞光	11,000	1,077.00	11,847,000
オイレス工業	20,700	2,307.00	47,754,900
日精エー・エス・ピー機械	5,200	5,330.00	27,716,000
サトーホールディングス	21,800	2,106.00	45,910,800
技研製作所	14,400	1,966.00	28,310,400
日本エアテック	7,100	1,195.00	8,484,500
カワタ	1,600	985.00	1,576,000
日精樹脂工業	11,400	1,124.00	12,813,600
オカダアイヨン	1,700	2,957.00	5,026,900
ワイエイシイホールディングス	6,500	2,309.00	15,008,500
小松製作所	717,100	4,591.00	3,292,206,100
住友重機械工業	90,500	4,313.00	390,326,500
日立建機	60,900	4,428.00	269,665,200
日工	22,800	729.00	16,621,200
巴工業	6,000	4,120.00	24,720,000
井関農機	14,400	1,030.00	14,832,000
T O W A	17,000	11,030.00	187,510,000
丸山製作所	900	2,520.00	2,268,000

北川鉄工所	6,000	1,571.00	9,426,000
シンニッタン	6,800	265.00	1,802,000
ローツェ	8,000	31,000.00	248,000,000
タカキタ	1,800	522.00	939,600
クボタ	799,800	2,466.00	1,972,306,800
荏原実業	8,100	3,350.00	27,135,000
東洋エンジニアリング	21,800	906.00	19,750,800
三菱化工機	5,400	3,865.00	20,871,000
月島ホールディングス	20,700	1,391.00	28,793,700
帝国電機製作所	10,500	2,507.00	26,323,500
東京機械製作所	1,400	439.00	614,600
新東工業	30,900	1,211.00	37,419,900
澁谷工業	14,400	3,450.00	49,680,000
アイチコーポレーション	21,100	1,148.00	24,222,800
小森コーポレーション	37,600	1,213.00	45,608,800
鶴見製作所	11,700	3,630.00	42,471,000
日本ギア工業	1,900	625.00	1,187,500
酒井重工業	2,700	6,250.00	16,875,000
荏原製作所	62,800	13,495.00	847,486,000
石井鐵工所	600	2,793.00	1,675,800
西島製作所	13,200	2,938.00	38,781,600
北越工業	15,400	1,940.00	29,876,000
ダイキン工業	182,600	22,275.00	4,067,415,000
オルガノ	18,400	8,000.00	147,200,000
トーヨーカネツ	5,200	4,255.00	22,126,000
栗田工業	85,600	6,299.00	539,194,400
椿本チエイン	21,000	5,370.00	112,770,000
大同工業	2,300	727.00	1,672,100
日機装	35,200	1,226.00	43,155,200
木村化工機	11,700	770.00	9,009,000
レイズネクスト	21,500	2,018.00	43,387,000
アネスト岩田	23,600	1,357.00	32,025,200
ダイフク	258,200	3,290.00	849,478,000
サムコ	3,600	4,565.00	16,434,000
加藤製作所	2,600	1,359.00	3,533,400
油研工業	900	2,207.00	1,986,300
タダノ	88,000	1,243.00	109,384,000
フジテック	35,700	3,936.00	140,515,200
C K D	42,300	3,045.00	128,803,500
平和	45,200	1,950.00	88,140,000
理想科学工業	12,200	2,962.00	36,136,400
S A N K Y O	147,300	1,625.00	239,362,500
日本金銭機械	18,500	1,333.00	24,660,500
マースグループホールディングス	7,700	3,180.00	24,486,000
フクシマガリレイ	10,000	6,270.00	62,700,000
オーイズミ	2,000	389.00	778,000
ダイコク電機	7,500	3,435.00	25,762,500
竹内製作所	27,700	6,090.00	168,693,000
アマノ	43,400	3,778.00	163,965,200
J U K I	23,600	542.00	12,791,200

サンデン	7,700	166.00	1,278,200
ジャノメ	15,400	658.00	10,133,200
ブラザー工業	204,400	2,767.00	565,574,800
マックス	21,500	3,670.00	78,905,000
モリタホールディングス	26,600	1,796.00	47,773,600
グローリー	36,700	2,872.00	105,402,400
新晃工業	15,400	3,900.00	60,060,000
大和冷機工業	23,400	1,600.00	37,440,000
セガサミーホールディングス	136,600	2,067.50	282,420,500
T P R	19,400	2,282.00	44,270,800
ツバキ・ナカシマ	30,700	854.00	26,217,800
ホシザキ	90,300	5,393.00	486,987,900
大豊工業	13,300	849.00	11,291,700
日本精工	283,100	866.60	245,334,460
N T N	331,600	309.20	102,530,720
ジェイテクト	136,200	1,222.50	166,504,500
不二越	11,300	3,395.00	38,363,500
ミネベアミツミ	266,100	2,979.50	792,844,950
日本トムソン	41,600	642.00	26,707,200
T H K	88,300	3,523.00	311,080,900
ユーシン精機	12,200	683.00	8,332,600
前澤給装工業	11,000	1,289.00	14,179,000
イーグル工業	16,900	1,802.00	30,453,800
前澤工業	3,200	1,274.00	4,076,800
日本ピラー工業	14,200	6,320.00	89,744,000
キッツ	51,200	1,303.00	66,713,600
日立製作所	735,200	14,195.00	10,436,164,000
三菱電機	1,702,800	2,816.50	4,795,936,200
富士電機	93,000	9,644.00	896,892,000
東洋電機製造	1,800	1,125.00	2,025,000
安川電機	166,200	6,465.00	1,074,483,000
シンフォニア テクノロジー	16,900	3,260.00	55,094,000
明電舎	28,400	3,660.00	103,944,000
オリジン	1,200	1,207.00	1,448,400
山洋電気	6,600	7,400.00	48,840,000
デンヨー	11,700	2,500.00	29,250,000
PHCホールディングス	28,600	1,155.00	33,033,000
KOKUSAI ELECTRIC	79,100	4,290.00	339,339,000
ソシオネクスト	111,300	4,700.00	523,110,000
ベイカレント・コンサルティング	114,400	3,613.00	413,327,200
Orchestra Holdings	3,400	993.00	3,376,200
アイモバイル	19,800	394.00	7,801,200
キャリアインデックス	1,700	173.00	294,100
MS - Japan	6,400	1,205.00	7,712,000
船場	1,100	1,312.00	1,443,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	50,400	2,509.00	126,453,600
フルテック	800	1,119.00	895,200
グリーンズ	1,900	2,229.00	4,235,100

ツナググループ・ホールディングス	1,500	682.00	1,023,000	
GAMEWITH	2,200	292.00	642,400	
MS&Consulting	700	593.00	415,100	
エル・ティー・エス	1,800	2,421.00	4,357,800	
ミダックホールディングス	9,400	1,461.00	13,733,400	
キュービーネットホールディングス	9,000	1,133.00	10,197,000	
RPAホールディングス	21,300	252.00	5,367,600	
三櫻工業	23,100	1,080.00	24,948,000	
マキタ	174,500	4,565.00	796,592,500	
東芝テック	19,600	3,275.00	64,190,000	
芝浦メカトロニクス	8,700	5,860.00	50,982,000	
マブチモーター	75,300	2,445.50	184,146,150	
ニデック	337,800	6,936.00	2,342,980,800	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,700	349.00	3,385,300	
トレックス・セミコンダクター	7,900	1,792.00	14,156,800	
東光高岳	9,200	2,106.00	19,375,200	
ダブル・スコープ	43,800	519.00	22,732,200	
宮越ホールディングス	6,800	1,096.00	7,452,800	
ダイヘン	14,500	9,780.00	141,810,000	
ヤーマン	29,700	910.00	27,027,000	
JVCケンウッド	120,700	829.00	100,060,300	
ミマキエンジニアリング	14,500	1,349.00	19,560,500	
I-PEX	10,600	1,771.00	18,772,600	
大崎電気工業	33,400	680.00	22,712,000	
オムロン	116,800	5,645.00	659,336,000	
日東工業	20,600	4,085.00	84,151,000	
IDEC	22,600	2,763.00	62,443,800	
正興電機製作所	1,700	1,449.00	2,463,300	
不二電機工業	1,200	1,117.00	1,340,400	
ジーエス・ユアサコーポレーション	59,700	3,006.00	179,458,200	
サクサホールディングス	1,200	2,907.00	3,488,400	
メルコホールディングス	4,800	3,345.00	16,056,000	
テクノメディカ	3,600	1,710.00	6,156,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,700	763.00	4,349,100	
日本電気	200,900	10,875.00	2,184,787,500	
富士通	1,407,700	2,330.00	3,279,941,000	
沖電気工業	69,100	1,194.00	82,505,400	
岩崎通信機	2,400	669.00	1,605,600	
電気興業	6,200	2,062.00	12,784,400	
サンケン電気	14,200	7,094.00	100,734,800	
ナカヨ	800	1,094.00	875,200	
アイホン	8,200	2,970.00	24,354,000	
ルネサスエレクトロニクス	953,600	2,521.50	2,404,502,400	
セイコーエプソン	196,300	2,500.50	490,848,150	
ワコム	111,900	613.00	68,594,700	
アルバック	33,500	9,881.00	331,013,500	
アクセル	6,900	1,585.00	10,936,500	
EIZO	11,200	5,110.00	57,232,000	
ジャパンディスプレイ	658,000	19.00	12,502,000	

日本信号	34,800	1,006.00	35,008,800
京三製作所	31,900	502.00	16,013,800
能美防災	20,700	2,395.00	49,576,500
ホーチキ	11,400	2,307.00	26,299,800
星和電機	2,300	590.00	1,357,000
エレコム	36,600	1,546.00	56,583,600
パナソニック ホールディングス	1,807,100	1,369.00	2,473,919,900
シャープ	257,900	852.60	219,885,540
アンリツ	107,700	1,208.50	130,155,450
富士通ゼネラル	43,300	2,115.00	91,579,500
ソニーグループ	1,071,400	12,050.00	12,910,370,000
T D K	242,200	7,093.00	1,717,924,600
帝国通信工業	6,700	1,867.00	12,508,900
タムラ製作所	60,900	662.00	40,315,800
アルプスアルパイン	136,600	1,529.00	208,861,400
池上通信機	1,600	759.00	1,214,400
日本電波工業	18,300	1,281.00	23,442,300
鈴木	8,200	1,410.00	11,562,000
メイコー	15,200	5,330.00	81,016,000
日本トリム	3,400	3,425.00	11,645,000
ローランド ディー . ジー .	8,400	5,610.00	47,124,000
フォスター電機	11,300	1,251.00	14,136,300
S M K	3,900	2,444.00	9,531,600
ヨコオ	13,500	1,670.00	22,545,000
ティアック	8,100	98.00	793,800
ホシデン	34,800	1,945.00	67,686,000
ヒロセ電機	22,600	18,605.00	420,473,000
日本航空電子工業	36,600	2,453.00	89,779,800
T O A	17,400	1,131.00	19,679,400
マクセル	33,700	1,528.00	51,493,600
古野電気	19,900	2,061.00	41,013,900
スミダコーポレーション	20,500	1,138.00	23,329,000
アイコム	5,900	3,180.00	18,762,000
リオン	6,300	3,115.00	19,624,500
横河電機	167,400	3,860.00	646,164,000
新電元工業	5,800	2,993.00	17,359,400
アズビル	104,200	4,494.00	468,274,800
東亜ディーケーケー	2,500	861.00	2,152,500
日本光電工業	65,000	4,268.00	277,420,000
チノー	6,300	2,735.00	17,230,500
共和電業	4,800	463.00	2,222,400
日本電子材料	9,300	2,856.00	26,560,800
堀場製作所	28,900	15,510.00	448,239,000
アドバンテスト	434,000	5,150.00	2,235,100,000
小野測器	2,100	676.00	1,419,600
エスベック	12,100	2,965.00	35,876,500
キーエンス	151,500	70,220.00	10,638,330,000
日置電機	7,100	7,670.00	54,457,000
シスメックス	392,200	2,655.50	1,041,487,100
日本マイクロニクス	27,200	7,850.00	213,520,000

メガチップス	12,000	3,720.00	44,640,000
OBARA GROUP	9,500	4,175.00	39,662,500
IMAGICA GROUP	15,100	612.00	9,241,200
澤藤電機	600	1,194.00	716,400
デンソー	1,249,700	2,642.50	3,302,332,250
原田工業	2,300	688.00	1,582,400
コーセル	16,200	1,466.00	23,749,200
イリソ電子工業	13,900	3,140.00	43,646,000
オブテックスグループ	27,800	1,825.00	50,735,000
千代田インテグレ	6,000	2,739.00	16,434,000
レーザーテック	69,400	41,740.00	2,896,756,000
スタンレー電気	97,000	2,761.00	267,817,000
ウシオ電機	67,000	2,102.00	140,834,000
岡谷電機産業	3,900	258.00	1,006,200
ヘリオス テクノ ホールディング	5,000	495.00	2,475,000
エノモト	1,400	1,575.00	2,205,000
日本セラミック	12,300	2,730.00	33,579,000
遠藤照明	2,300	1,568.00	3,606,400
古河電池	11,200	1,027.00	11,502,400
双信電機	2,000	476.00	952,000
山一電機	13,600	2,743.00	37,304,800
図研	12,600	4,220.00	53,172,000
日本電子	37,900	6,535.00	247,676,500
カシオ計算機	109,300	1,320.00	144,276,000
ファナック	738,600	4,578.00	3,381,310,800
日本シイエムケイ	35,500	587.00	20,838,500
エンプラス	4,400	7,530.00	33,132,000
大真空	22,500	830.00	18,675,000
ローム	280,000	2,254.50	631,260,000
浜松ホトニクス	121,600	5,820.00	707,712,000
三井ハイテック	13,400	7,231.00	96,895,400
新光電気工業	53,600	5,569.00	298,498,400
京セラ	941,200	1,893.50	1,782,162,200
協栄産業	500	2,613.00	1,306,500
太陽誘電	73,700	3,643.00	268,489,100
村田製作所	1,378,100	2,824.00	3,891,754,400
双葉電子工業	29,200	474.00	13,840,800
日東電工	97,600	12,760.00	1,245,376,000
北陸電気工業	1,900	1,362.00	2,587,800
東海理化電機製作所	42,700	2,252.00	96,160,400
ニチコン	39,700	1,382.00	54,865,400
日本ケミコン	16,100	1,636.00	26,339,600
KOA	22,900	1,590.00	36,411,000
三井E&S	75,900	1,601.00	121,515,900
日立造船	134,900	1,222.00	164,847,800
三菱重工業	2,675,200	1,327.50	3,551,328,000
川崎重工業	123,600	4,907.00	606,505,200
IHI	113,900	3,807.00	433,617,300
名村造船所	42,400	1,757.00	74,496,800
サノヤスホールディングス	7,400	189.00	1,398,600

スプリックス	1,600	778.00	1,244,800
マネジメントソリューションズ	6,700	1,881.00	12,602,700
プロレド・パートナーズ	3,800	467.00	1,774,600
and factory	1,500	311.00	466,500
テノ・ホールディングス	700	447.00	312,900
フロンティア・マネジメント	3,900	1,525.00	5,947,500
ピアラ	1,000	290.00	290,000
コプロ・ホールディングス	1,700	1,623.00	2,759,100
ギークス	700	517.00	361,900
アンビスホールディングス	33,300	2,103.00	70,029,900
カーブスホールディングス	42,500	771.00	32,767,500
フォーラムエンジニアリング	21,200	913.00	19,355,600
FAST FITNESS JAPAN	5,300	1,065.00	5,644,500
日本車輛製造	5,000	2,320.00	11,600,000
三菱ロジスネクスト	24,200	1,522.00	36,832,400
近畿車輛	700	2,201.00	1,540,700
一家ホールディングス	1,400	692.00	968,800
フルサト・マルカホールディングス	14,300	2,455.00	35,106,500
ヤマエグループホールディングス	14,100	2,662.00	37,534,200
ジャパクラフトホールディングス	4,300	160.00	688,000
FPG	55,500	2,152.00	119,436,000
島根銀行	1,500	546.00	819,000
じもとホールディングス	4,500	379.00	1,705,500
全国保証	39,000	5,704.00	222,456,000
めぶきフィナンシャルグループ	691,100	545.50	376,995,050
ジャパンインベストメントアドバイザー	24,200	1,380.00	33,396,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,100	4,340.00	82,894,000
九州フィナンシャルグループ	288,700	1,041.50	300,681,050
かんぽ生命保険	151,900	2,804.50	426,003,550
ゆうちょ銀行	1,639,300	1,553.50	2,546,652,550
あんしん保証	2,400	219.00	525,600
富山第一銀行	47,300	902.00	42,664,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	800,300	831.00	665,049,300
ジェイリース	10,000	1,304.00	13,040,000
西日本フィナンシャルホールディングス	83,500	1,959.00	163,576,500
イントラスト	1,900	860.00	1,634,000
日本モーゲージサービス	2,700	488.00	1,317,600
CASA	2,000	854.00	1,708,000
SBIアルヒ	14,300	850.00	12,155,000
プレミアグループ	25,200	2,200.00	55,440,000
日産自動車	2,044,000	571.20	1,167,532,800
いすゞ自動車	440,300	1,920.00	845,376,000
トヨタ自動車	8,316,900	3,579.00	29,766,185,100
日野自動車	227,900	462.60	105,426,540
三菱自動車工業	590,800	473.50	279,743,800
エフテック	3,500	724.00	2,534,000

レシップホールディングス	2,200	631.00	1,388,200	
GMB	1,000	1,147.00	1,147,000	
ファルテック	1,000	603.00	603,000	
武蔵精密工業	37,000	1,652.00	61,124,000	
日産車体	15,400	1,045.00	16,093,000	
新明和工業	43,600	1,292.00	56,331,200	
極東開発工業	25,000	2,561.00	64,025,000	
トビー工業	12,300	2,620.00	32,226,000	
ティラド	3,400	3,725.00	12,665,000	
曙ブレーキ工業	92,400	159.00	14,691,600	
タチエス	27,900	1,979.00	55,214,100	
NOK	58,900	2,273.00	133,879,700	
フタバ産業	40,600	939.00	38,123,400	
カヤバ	14,300	5,390.00	77,077,000	
市光工業	27,300	538.00	14,687,400	
大同メタル工業	29,600	602.00	17,819,200	
プレス工業	60,400	800.00	48,320,000	
ミクニ	6,400	428.00	2,739,200	
太平洋工業	34,700	1,543.00	53,542,100	
河西工業	8,100	263.00	2,130,300	
アイシン	116,800	5,623.00	656,766,400	
マツダ	501,000	1,696.00	849,696,000	
今仙電機製作所	3,300	629.00	2,075,700	
本田技研工業	3,588,800	1,750.00	6,280,400,000	
スズキ	1,112,800	1,767.50	1,966,874,000	
S U B A R U	469,700	3,327.00	1,562,691,900	
安永	2,200	657.00	1,445,400	
ヤマハ発動機	654,600	1,404.50	919,385,700	
小糸製作所	156,900	2,087.50	327,528,750	
T B K	5,600	361.00	2,021,600	
エクセディ	24,800	2,869.00	71,151,200	
ミツバ	28,400	1,397.00	39,674,800	
豊田合成	43,400	3,075.00	133,455,000	
愛三工業	25,100	1,429.00	35,867,900	
盟和産業	700	996.00	697,200	
日本プラスト	4,400	502.00	2,208,800	
ヨロズ	14,200	966.00	13,717,200	
エフ・シー・シー	26,800	2,165.00	58,022,000	
新家工業	1,100	4,045.00	4,449,500	
シマノ	61,100	25,225.00	1,541,247,500	
テイ・エス テック	53,900	1,917.50	103,353,250	
三十三フィナンシャルグループ	13,300	2,071.00	27,544,300	
第四北越フィナンシャルグループ	23,400	4,465.00	104,481,000	
ひろぎんホールディングス	212,300	1,109.50	235,546,850	
マーキュリアホールディングス	2,600	1,075.00	2,795,000	
おきなわフィナンシャルグループ	12,700	2,634.00	33,451,800	
ダイレクトマーケティングミックス	16,100	236.00	3,799,600	
ポピンス	2,300	1,282.00	2,948,600	
L I T A L I C O	12,100	1,858.00	22,481,800	
コンフィデンス・インターワークス	500	1,587.00	793,500	

十六フィナンシャルグループ	19,300	4,625.00	89,262,500
北國フィナンシャルホールディングス	15,700	4,955.00	77,793,500
ネットプロテクションズホールディングス	49,700	221.00	10,983,700
プロクレアホールディングス	17,100	1,864.00	31,874,400
F Pパートナー	3,900	4,745.00	18,505,500
あいちフィナンシャルグループ	30,600	2,963.00	90,667,800
ジャムコ	8,200	1,127.00	9,241,400
小野建	16,200	1,831.00	29,662,200
はるやまホールディングス	2,500	596.00	1,490,000
南陽	2,300	1,245.00	2,863,500
ノジマ	46,500	1,775.00	82,537,500
佐鳥電機	10,000	2,257.00	22,570,000
カップ・クリエイト	25,100	1,599.00	40,134,900
エコートレーディング	1,000	1,215.00	1,215,000
伯東	9,200	5,150.00	47,380,000
コンドーテック	12,300	1,262.00	15,522,600
中山福	3,100	353.00	1,094,300
ライトオン	4,000	386.00	1,544,000
ナガイレーベン	20,200	2,352.00	47,510,400
三菱食品	14,800	5,460.00	80,808,000
良品計画	190,800	2,459.00	469,177,200
パリミキホールディングス	6,700	400.00	2,680,000
松田産業	12,200	2,689.00	32,805,800
第一興商	62,000	1,816.00	112,592,000
メディバルホールディングス	162,900	2,443.00	397,964,700
アドヴァングループ	13,700	1,044.00	14,302,800
S P K	7,100	2,118.00	15,037,800
萩原電気ホールディングス	6,900	4,265.00	29,428,500
アルビス	5,200	2,644.00	13,748,800
アズワン	49,700	2,604.50	129,443,650
スズデン	5,500	1,870.00	10,285,000
尾家産業	1,300	1,638.00	2,129,400
シモジマ	10,800	1,235.00	13,338,000
ドウシシャ	14,800	2,167.00	32,071,600
小津産業	1,200	1,777.00	2,132,400
コナカ	6,300	394.00	2,482,200
高速	9,600	2,165.00	20,784,000
ハウス オブ ローゼ	700	1,592.00	1,114,400
G - 7ホールディングス	17,500	1,341.00	23,467,500
たけびし	6,000	2,066.00	12,396,000
イオン北海道	47,400	939.00	44,508,600
コジマ	31,000	807.00	25,017,000
ヒマラヤ	2,000	915.00	1,830,000
コーナン商事	19,700	4,530.00	89,241,000
ネットワンシステムズ	59,100	2,661.50	157,294,650
エコス	6,000	2,365.00	14,190,000
ワタミ	16,900	920.00	15,548,000
マルシェ	1,900	246.00	467,400
リックス	3,600	4,400.00	15,840,000

システムソフト	53,900	62.00	3,341,800	
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	323,700	3,687.00	1,193,481,900	
丸文	14,300	1,453.00	20,777,900	
西松屋チェーン	31,500	2,218.00	69,867,000	
ゼンショーホールディングス	81,600	5,886.00	480,297,600	
ハピネット	13,600	2,986.00	40,609,600	
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,278.00	15,208,200	
ハークスレイ	1,600	897.00	1,435,200	
橋本総業ホールディングス	6,200	1,336.00	8,283,200	
日本ライフライン	42,900	1,205.00	51,694,500	
サイゼリヤ	23,700	5,370.00	127,269,000	
タカショー	14,000	515.00	7,210,000	
V Tホールディングス	61,900	525.00	32,497,500	
アルゴグラフィックス	13,900	4,120.00	57,268,000	
魚力	5,600	2,365.00	13,244,000	
I D O M	42,400	1,341.00	56,858,400	
日本エム・ディ・エム	12,100	672.00	8,131,200	
ポブラ	1,400	230.00	322,000	
フジ・コーポレーション	7,600	1,820.00	13,832,000	
ユナイテッドアローズ	18,800	1,942.00	36,509,600	
進和	9,800	2,782.00	27,263,600	
エスケイジャパン	1,300	824.00	1,071,200	
ダイトロン	6,300	3,380.00	21,294,000	
ハイデイ日高	23,800	2,880.00	68,544,000	
シークス	22,800	1,602.00	36,525,600	
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	3,100	146.00	452,600	
コロワイド	68,900	2,102.00	144,827,800	
田中商事	1,600	888.00	1,420,800	
オーハシテクニカ	8,400	1,572.00	13,204,800	
壱番屋	63,300	1,084.00	68,617,200	
白銅	4,600	2,700.00	12,420,000	
トップカルチャー	2,100	155.00	325,500	
P L A N T	1,200	1,831.00	2,197,200	
スギホールディングス	96,800	2,337.50	226,270,000	
ダイコー通産	600	1,395.00	837,000	
薬王堂ホールディングス	7,800	2,823.00	22,019,400	
島津製作所	201,200	4,334.00	872,000,800	
J M S	14,000	527.00	7,378,000	
クボテック	1,400	217.00	303,800	
長野計器	11,000	2,370.00	26,070,000	
ブイ・テクノロジー	8,000	2,678.00	21,424,000	
スター精密	28,100	1,854.00	52,097,400	
東京計器	11,600	2,634.00	30,554,400	
愛知時計電機	6,600	2,313.00	15,265,800	
インターアクション	9,100	1,584.00	14,414,400	
オーバル	4,400	528.00	2,323,200	
東京精密	31,000	10,855.00	336,505,000	
マニー	60,600	1,865.00	113,019,000	

ニコン	219,000	1,668.00	365,292,000	
トプコン	73,600	1,873.50	137,889,600	
オリンパス	894,700	2,257.50	2,019,785,250	
理研計器	21,400	3,880.00	83,032,000	
S C R E E Nホールディングス	51,800	17,500.00	906,500,000	
キヤノン電子	16,700	2,225.00	37,157,500	
タムロン	9,300	7,930.00	73,749,000	
H O Y A	298,200	18,175.00	5,419,785,000	
シード	3,100	610.00	1,891,000	
ノーリツ鋼機	14,300	3,160.00	45,188,000	
A & Dホロンホールディングス	22,100	2,802.00	61,924,200	
朝日インテック	184,600	2,300.00	424,580,000	
キヤノン	755,500	4,305.00	3,252,427,500	
リコー	379,800	1,295.00	491,841,000	
シチズン時計	139,300	1,012.00	140,971,600	
リズム	1,100	3,270.00	3,597,000	
大研医器	4,400	553.00	2,433,200	
メニコン	52,100	1,519.50	79,165,950	
シンシア	600	491.00	294,600	
K Y O R I T S U	7,500	170.00	1,275,000	
中本パックス	1,700	1,667.00	2,833,900	
パラマウントベッドホールディングス	31,500	2,650.00	83,475,000	
トランザクション	10,000	1,827.00	18,270,000	
粧美堂	1,400	575.00	805,000	
ニホンフラッシュ	14,300	918.00	13,127,400	
前田工織	13,100	3,345.00	43,819,500	
永大産業	6,200	261.00	1,618,200	
アートネイチャー	13,700	757.00	10,370,900	
フルヤ金属	4,800	11,060.00	53,088,000	
バンダイナムコホールディングス	415,000	2,979.50	1,236,492,500	
アイフィスジャパン	1,500	609.00	913,500	
S H O E I	42,600	2,007.00	85,498,200	
フランスベッドホールディングス	19,500	1,212.00	23,634,000	
マーベラス	24,600	670.00	16,482,000	
パイロットコーポレーション	21,300	4,208.00	89,630,400	
萩原工業	10,100	1,540.00	15,554,000	
エイベックス	25,800	1,270.00	32,766,000	
フジシールインターナショナル	30,700	2,007.00	61,614,900	
タカラトミー	68,900	2,623.50	180,759,150	
広済堂ホールディングス	44,000	715.00	31,460,000	
エステールホールディングス	1,200	644.00	772,800	
レック	19,500	1,100.00	21,450,000	
タカノ	2,000	1,000.00	2,000,000	
三光合成	19,100	709.00	13,541,900	
プロネクサス	15,800	1,146.00	18,106,800	
ホクシン	4,000	118.00	472,000	
ウッドワン	1,800	987.00	1,776,600	
きもと	8,500	210.00	1,785,000	
T O P P A Nホールディングス	186,200	3,738.00	696,015,600	
大日本印刷	157,000	4,573.00	717,961,000	

共同印刷	4,200	3,130.00	13,146,000
N I S S H A	25,900	1,697.00	43,952,300
光村印刷	400	1,575.00	630,000
藤森工業	12,000	4,290.00	51,480,000
ヴィア・ホールディングス	8,300	124.00	1,029,200
TAKARA & COMPANY	8,900	2,645.00	23,540,500
前澤化成工業	9,800	1,727.00	16,924,600
未来工業	5,400	3,835.00	20,709,000
アシックス	129,000	7,036.00	907,644,000
ツツミ	3,600	2,164.00	7,790,400
ウェブロックホールディングス	2,000	681.00	1,362,000
J S P	10,700	2,239.00	23,957,300
ニチハ	19,000	3,615.00	68,685,000
ローランド	11,200	4,250.00	47,600,000
エフピコ	28,700	2,631.50	75,524,050
小松ウオール工業	6,200	3,150.00	19,530,000
ヤマハ	95,500	3,316.00	316,678,000
河合楽器製作所	4,600	3,645.00	16,767,000
クリナップ	14,900	734.00	10,936,600
ピジョン	96,400	1,459.00	140,647,600
天馬	11,000	2,261.00	24,871,000
キングジム	13,400	888.00	11,899,200
象印マホービン	41,100	1,515.00	62,266,500
リンテック	30,400	3,450.00	104,880,000
信越ポリマー	32,800	1,582.00	51,889,600
東リ	11,200	397.00	4,446,400
イトーキ	28,900	1,871.00	54,071,900
任天堂	956,300	7,337.00	7,016,373,100
三菱鉛筆	21,500	2,288.00	49,192,000
松風	6,800	3,285.00	22,338,000
タカラスタンダード	31,000	1,950.00	60,450,000
コクヨ	62,000	2,699.00	167,338,000
ナカバヤシ	16,400	518.00	8,495,200
ニフコ	45,400	3,829.00	173,836,600
立川ブラインド工業	7,100	1,419.00	10,074,900
グローブライト	13,600	1,979.00	26,914,400
オカムラ	45,600	2,312.00	105,427,200
バルカー	12,700	4,520.00	57,404,000
MUTOHホールディングス	700	2,230.00	1,561,000
伊藤忠商事	1,077,300	7,097.00	7,645,598,100
丸紅	1,329,300	2,877.00	3,824,396,100
スクロール	23,800	909.00	21,634,200
高島	3,600	1,152.00	4,147,200
ヨンドシーホールディングス	15,200	1,900.00	28,880,000
三陽商会	6,400	2,834.00	18,137,600
長瀬産業	73,500	2,700.00	198,450,000
ナイガイ	1,800	259.00	466,200
蝶理	10,100	3,560.00	35,956,000
豊田通商	140,400	9,828.00	1,379,851,200
オンワードホールディングス	89,400	613.00	54,802,200

三共生興	22,200	750.00	16,650,000	
兼松	67,000	2,591.00	173,597,000	
美津濃	15,100	7,500.00	113,250,000	
ツカモトコーポレーション	800	1,170.00	936,000	
ルックホールディングス	4,700	2,943.00	13,832,100	
三井物産	1,200,200	7,640.00	9,169,528,000	
日本紙パルプ商事	7,700	5,610.00	43,197,000	
東京エレクトロン	320,600	36,280.00	11,631,368,000	
カメイ	17,100	1,975.00	33,772,500	
東都水産	300	6,190.00	1,857,000	
OUGホールディングス	800	2,695.00	2,156,000	
スターゼン	11,100	2,684.00	29,792,400	
セイコーグループ	21,100	4,155.00	87,670,500	
山善	48,600	1,358.00	65,998,800	
椿本興業	10,000	2,125.00	21,250,000	
住友商事	969,900	4,180.00	4,054,182,000	
BIPROGY	49,700	3,846.00	191,146,200	
内田洋行	6,500	7,010.00	45,565,000	
三菱商事	3,077,100	3,321.00	10,219,049,100	
第一実業	15,100	2,107.00	31,815,700	
キャノンマーケティングジャパン	37,100	4,341.00	161,051,100	
西華産業	6,300	3,875.00	24,412,500	
佐藤商事	11,200	1,694.00	18,972,800	
東京産業	14,700	660.00	9,702,000	
ユアサ商事	12,500	5,680.00	71,000,000	
神鋼商事	4,000	6,670.00	26,680,000	
トルク	3,900	250.00	975,000	
阪和興業	28,800	6,060.00	174,528,000	
正栄食品工業	10,700	4,290.00	45,903,000	
カナデン	12,000	1,517.00	18,204,000	
RYODEN	12,900	2,573.00	33,191,700	
ニプロ	126,200	1,250.50	157,813,100	
岩谷産業	36,500	8,920.00	325,580,000	
ナイス	1,700	1,753.00	2,980,100	
ニチモウ	1,700	2,019.00	3,432,300	
極東貿易	9,600	1,927.00	18,499,200	
アステナホールディングス	30,100	493.00	14,839,300	
三愛オブリ	37,400	2,060.00	77,044,000	
稲畑産業	31,600	3,225.00	101,910,000	
G S Iクレオス	8,600	2,230.00	19,178,000	
明和産業	18,900	732.00	13,834,800	
クワザワホールディングス	1,900	1,011.00	1,920,900	
キムラタン	33,600	17.00	571,200	
ゴールドウイン	26,900	9,307.00	250,358,300	
ユニ・チャーム	316,500	4,817.00	1,524,580,500	
デサント	26,100	3,580.00	93,438,000	
キング	2,000	656.00	1,312,000	
ワキタ	26,500	1,555.00	41,207,500	
ヤマトインターナショナル	4,000	354.00	1,416,000	
東邦ホールディングス	43,300	3,995.00	172,983,500	

サンゲツ	36,900	3,275.00	120,847,500
ミツウロコグループホールディングス	20,500	1,301.00	26,670,500
シナネンホールディングス	4,400	4,680.00	20,592,000
伊藤忠エネクス	39,700	1,506.00	59,788,200
サンリオ	130,100	2,689.00	349,838,900
サンワテクノス	8,100	2,249.00	18,216,900
新光商事	21,400	1,030.00	22,042,000
トーヨー	6,200	3,165.00	19,623,000
三信電気	6,400	2,194.00	14,041,600
東陽テクニカ	14,700	1,486.00	21,844,200
モスフードサービス	23,500	3,420.00	80,370,000
加賀電子	14,600	6,130.00	89,498,000
三益半導体工業	14,100	3,690.00	52,029,000
都築電気	8,000	2,210.00	17,680,000
ソーダニッカ	15,300	1,117.00	17,090,100
立花エレテック	10,600	2,997.00	31,768,200
木曽路	24,200	2,453.00	59,362,600
SRSホールディングス	26,400	1,116.00	29,462,400
千趣会	29,600	315.00	9,324,000
リテールパートナーズ	23,800	1,703.00	40,531,400
上新電機	15,900	2,573.00	40,910,700
日本瓦斯	84,900	2,429.50	206,264,550
ロイヤルホールディングス	28,200	2,488.00	70,161,600
東天紅	400	908.00	363,200
いなげや	15,600	1,256.00	19,593,600
チヨダ	15,300	893.00	13,662,900
ライフコーポレーション	16,800	3,935.00	66,108,000
リンガーハット	20,600	2,316.00	47,709,600
MrMaxHD	20,200	650.00	13,130,000
テンアライド	7,400	293.00	2,168,200
AOKIホールディングス	34,400	1,242.00	42,724,800
オークワ	23,100	932.00	21,529,200
コメリ	24,700	3,775.00	93,242,500
青山商事	34,200	1,585.00	54,207,000
しまむら	37,600	7,674.00	288,542,400
はせがわ	2,500	341.00	852,500
高島屋	110,700	2,318.50	256,657,950
松屋	27,200	931.00	25,323,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	70,900	1,824.00	129,321,600
近鉄百貨店	6,900	2,207.00	15,228,300
丸井グループ	106,400	2,385.00	253,764,000
クレディセゾン	94,500	2,860.50	270,317,250
アクシアル リテイリング	43,700	997.00	43,568,900
井筒屋	2,500	501.00	1,252,500
イオン	543,200	3,251.00	1,765,943,200
イズミ	28,400	3,536.00	100,422,400
フォーバル	6,300	1,288.00	8,114,400
平和堂	26,800	2,403.00	64,400,400
フジ	24,600	1,960.00	48,216,000
ヤオコー	19,000	8,410.00	159,790,000

ゼビオホールディングス	21,700	1,007.00	21,851,900
ケースホールディングス	107,600	1,470.50	158,225,800
PALTAC	21,600	4,753.00	102,664,800
三谷産業	28,200	359.00	10,123,800
Olympicグループ	2,500	511.00	1,277,500
日産東京販売ホールディングス	8,000	547.00	4,376,000
あおぞら銀行	107,200	2,466.50	264,408,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,084,700	1,551.00	14,090,369,700
りそなホールディングス	1,725,200	949.70	1,638,422,440
三井住友トラスト・ホールディングス	536,100	3,194.00	1,712,303,400
三井住友フィナンシャルグループ	1,060,600	8,801.00	9,334,340,600
千葉銀行	415,700	1,280.00	532,096,000
群馬銀行	289,400	941.40	272,441,160
武蔵野銀行	20,800	3,010.00	62,608,000
千葉興業銀行	31,700	1,024.00	32,460,800
筑波銀行	65,500	284.00	18,602,000
七十七銀行	43,400	4,340.00	188,356,000
秋田銀行	10,000	2,080.00	20,800,000
山形銀行	16,600	1,148.00	19,056,800
岩手銀行	9,400	2,474.00	23,255,600
東邦銀行	118,000	323.00	38,114,000
東北銀行	2,400	1,196.00	2,870,400
ふくおかフィナンシャルグループ	129,900	4,122.00	535,447,800
スルガ銀行	131,500	1,018.00	133,867,000
八十二銀行	320,100	1,039.00	332,583,900
山梨中央銀行	16,700	1,758.00	29,358,600
大垣共立銀行	28,400	2,185.00	62,054,000
福井銀行	13,300	1,833.00	24,378,900
清水銀行	6,000	1,534.00	9,204,000
富山銀行	900	1,795.00	1,615,500
滋賀銀行	24,800	3,965.00	98,332,000
南都銀行	22,400	3,035.00	67,984,000
百五銀行	140,200	638.00	89,447,600
紀陽銀行	53,400	1,775.00	94,785,000
ほくほくフィナンシャルグループ	92,300	1,886.50	174,123,950
山陰合同銀行	93,300	1,214.00	113,266,200
鳥取銀行	1,700	1,360.00	2,312,000
百十四銀行	14,600	2,788.00	40,704,800
四国銀行	21,900	1,096.00	24,002,400
阿波銀行	20,900	2,588.00	54,089,200
大分銀行	8,900	2,937.00	26,139,300
宮崎銀行	9,000	3,130.00	28,170,000
佐賀銀行	8,800	2,172.00	19,113,600
琉球銀行	31,700	1,142.00	36,201,400
セブン銀行	467,400	277.60	129,750,240
みずほフィナンシャルグループ	2,013,600	2,995.50	6,031,738,800
高知銀行	1,700	923.00	1,569,100
山口フィナンシャルグループ	146,200	1,561.00	228,218,200
芙蓉総合リース	13,700	13,125.00	179,812,500
みずほリース	124,900	1,111.00	138,763,900

東京センチュリー	111,500	1,532.00	170,818,000
SBIホールディングス	239,400	3,773.00	903,256,200
日本証券金融	54,800	1,631.00	89,378,800
アイフル	219,500	445.00	97,677,500
日本アジア投資	3,600	234.00	842,400
名古屋銀行	9,500	6,900.00	65,550,000
北洋銀行	226,000	453.00	102,378,000
大光銀行	1,600	1,435.00	2,296,000
愛媛銀行	20,100	1,135.00	22,813,500
トマト銀行	1,800	1,204.00	2,167,200
京葉銀行	61,300	770.00	47,201,000
栃木銀行	74,600	350.00	26,110,000
北日本銀行	4,900	2,473.00	12,117,700
東和銀行	27,400	661.00	18,111,400
福島銀行	5,200	294.00	1,528,800
大東銀行	2,200	703.00	1,546,600
リコーリース	14,100	5,210.00	73,461,000
イオンフィナンシャルサービス	85,600	1,301.00	111,365,600
アコム	266,300	405.30	107,931,390
ジャックス	15,900	5,590.00	88,881,000
オリエントコーポレーション	48,600	1,006.00	48,891,600
オリックス	894,600	3,223.00	2,883,295,800
三菱HCキャピタル	664,700	1,013.00	673,341,100
ジャフコグループ	44,400	1,774.00	78,765,600
九州リースサービス	2,000	1,238.00	2,476,000
トモニホールディングス	141,200	414.00	58,456,800
大和証券グループ本社	1,155,600	1,147.00	1,325,473,200
野村ホールディングス	2,508,600	895.80	2,247,203,880
岡三証券グループ	130,900	746.00	97,651,400
丸三証券	49,600	1,039.00	51,534,400
東洋証券	39,600	371.00	14,691,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	177,000	577.00	102,129,000
光世証券	1,200	637.00	764,400
水戸証券	44,000	552.00	24,288,000
いちよし証券	27,900	813.00	22,682,700
松井証券	73,300	807.00	59,153,100
SOMPOホールディングス	673,200	3,050.00	2,053,260,000
日本取引所グループ	384,600	3,630.00	1,396,098,000
マネックスグループ	146,100	776.00	113,373,600
極東証券	20,400	1,556.00	31,742,400
岩井コスモホールディングス	17,000	2,300.00	39,100,000
アイザワ証券グループ	21,500	1,684.00	36,206,000
フィデアホールディングス	15,400	1,521.00	23,423,400
池田泉州ホールディングス	206,700	395.00	81,646,500
アニコムホールディングス	50,700	594.00	30,115,800
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1,002,000	2,770.00	2,775,540,000
マネーパートナーズグループ	5,200	274.00	1,424,800
スパークス・グループ	16,600	1,777.00	29,498,200

小林洋行	2,200	336.00	739,200	
第一生命ホールディングス	701,400	3,510.00	2,461,914,000	
東京海上ホールディングス	1,456,500	4,940.00	7,195,110,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	2,600	391.00	1,016,600	
イー・ギャランティ	24,300	1,706.00	41,455,800	
アサックス	2,100	806.00	1,692,600	
NECキャピタルソリューション	7,300	3,850.00	28,105,000	
T&Dホールディングス	400,500	2,519.00	1,008,859,500	
アドバンスクリエイト	11,400	1,026.00	11,696,400	
三井不動産	2,069,600	1,575.00	3,259,620,000	
三菱地所	975,100	2,871.00	2,799,512,100	
平和不動産	24,200	3,955.00	95,711,000	
東京建物	130,300	2,588.00	337,216,400	
京阪神ビルディング	27,900	1,580.00	44,082,000	
住友不動産	215,700	5,326.00	1,148,818,200	
太平洋興発	2,000	798.00	1,596,000	
テーオーシー	26,600	762.00	20,269,200	
レオパレス21	149,200	516.00	76,987,200	
スターツコーポレーション	21,400	3,510.00	75,114,000	
フジ住宅	18,800	777.00	14,607,600	
空港施設	21,000	614.00	12,894,000	
明和地所	9,600	977.00	9,379,200	
ゴールドクレスト	12,200	2,587.00	31,561,400	
リログループ	78,000	1,387.50	108,225,000	
エスリード	7,000	3,425.00	23,975,000	
日神グループホールディングス	24,000	534.00	12,816,000	
日本エスコン	27,800	1,088.00	30,246,400	
MIRARTHホールディングス	68,600	484.00	33,202,400	
AVANTIA	2,700	821.00	2,216,700	
イオンモール	77,300	1,799.50	139,101,350	
毎日コムネット	2,000	818.00	1,636,000	
ファースト住建	2,100	1,077.00	2,261,700	
ランド	827,400	8.00	6,619,200	
カチタス	40,100	1,941.00	77,834,100	
東祥	10,900	724.00	7,891,600	
トーセイ	24,800	2,400.00	59,520,000	
穴吹興産	1,200	2,144.00	2,572,800	
サンフロンティア不動産	22,100	1,979.00	43,735,900	
FJネクストホールディングス	15,700	1,362.00	21,383,400	
インテリックス	1,200	568.00	681,600	
ランドビジネス	1,900	263.00	499,700	
サンネクスタグループ	1,700	1,029.00	1,749,300	
グランディハウス	12,600	569.00	7,169,400	
東武鉄道	166,400	2,916.00	485,222,400	
相鉄ホールディングス	54,200	2,494.00	135,174,800	
東急	424,700	1,839.50	781,235,650	
京浜急行電鉄	187,400	1,235.50	231,532,700	
小田急電鉄	250,500	1,740.50	435,995,250	
京王電鉄	72,800	3,812.00	277,513,600	
京成電鉄	97,700	5,875.00	573,987,500	

富士急行	18,700	3,315.00	61,990,500
東日本旅客鉄道	834,800	2,884.00	2,407,563,200
西日本旅客鉄道	359,300	3,140.00	1,128,202,000
東海旅客鉄道	583,400	3,434.00	2,003,395,600
西武ホールディングス	183,200	2,364.00	433,084,800
鴻池運輸	25,800	2,220.00	57,276,000
西日本鉄道	40,400	2,423.50	97,909,400
ハマキョウレックス	12,900	3,795.00	48,955,500
サカイ引越センター	16,800	2,535.00	42,588,000
近鉄グループホールディングス	151,200	3,889.00	588,016,800
阪急阪神ホールディングス	201,600	4,023.00	811,036,800
南海電気鉄道	67,400	2,684.50	180,935,300
京阪ホールディングス	83,400	3,193.00	266,296,200
神戸電鉄	4,100	2,747.00	11,262,700
名古屋鉄道	156,000	2,013.50	314,106,000
山陽電気鉄道	11,400	2,049.00	23,358,600
アルプス物流	12,100	3,815.00	46,161,500
トランコム	4,400	5,390.00	23,716,000
ヤマトホールディングス	183,800	2,016.00	370,540,800
山九	38,500	5,389.00	207,476,500
日新	11,500	3,000.00	34,500,000
丸運	3,300	280.00	924,000
丸全昭和運輸	9,400	4,575.00	43,005,000
センコーグループホールディングス	79,900	1,129.00	90,207,100
トナミホールディングス	3,300	4,610.00	15,213,000
ニッコンホールディングス	46,600	2,981.50	138,937,900
日本石油輸送	600	2,802.00	1,681,200
福山通運	17,300	3,765.00	65,134,500
セイノーホールディングス	85,100	2,105.50	179,178,050
エスライングループ本社	1,600	875.00	1,400,000
神奈川中央交通	4,100	3,005.00	12,320,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	38,700	1,169.00	45,240,300
C & F ロジホールディングス	14,600	3,540.00	51,684,000
日本郵船	433,400	4,480.00	1,941,632,000
商船三井	328,400	4,759.00	1,562,855,600
川崎汽船	364,300	2,194.50	799,456,350
N S ユナイテッド海運	8,100	4,640.00	37,584,000
明海グループ	5,500	772.00	4,246,000
飯野海運	55,500	1,263.00	70,096,500
共栄タンカー	1,000	974.00	974,000
九州旅客鉄道	106,900	3,379.00	361,215,100
S Gホールディングス	253,900	1,637.00	415,634,300
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	51,300	7,853.00	402,858,900
I D & E ホールディングス	9,400	4,575.00	43,005,000
日本航空	371,400	2,704.00	1,004,265,600
A N Aホールディングス	411,500	2,967.50	1,221,126,250
ピーウィズ	3,200	2,014.00	6,444,800
パスコ	900	1,989.00	1,790,100
T R Eホールディングス	29,800	1,253.00	37,339,400

人・夢・技術グループ	6,400	1,699.00	10,873,600	
西本Wismettacホールディングス	4,100	5,720.00	23,452,000	
シルバーライフ	4,300	898.00	3,861,400	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	2,771.00	1,108,400	
Genky DrugStores	7,000	5,700.00	39,900,000	
コア商事ホールディングス	11,200	833.00	9,329,600	
KPPグループホールディングス	41,500	734.00	30,461,000	
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,385.00	1,246,500	
ブックオフグループホールディングス	10,500	1,741.00	18,280,500	
ギフトホールディングス	6,800	2,735.00	18,598,000	
三菱倉庫	37,100	5,183.00	192,289,300	
三井倉庫ホールディングス	14,100	4,565.00	64,366,500	
住友倉庫	40,400	2,574.00	103,989,600	
澁澤倉庫	6,900	3,030.00	20,907,000	
ヤマタネ	7,100	2,621.00	18,609,100	
東陽倉庫	1,400	1,521.00	2,129,400	
乾汽船	17,700	1,101.00	19,487,700	
日本トランスシティ	30,500	709.00	21,624,500	
ケイヒン	900	1,989.00	1,790,100	
中央倉庫	8,100	1,142.00	9,250,200	
川西倉庫	1,000	1,146.00	1,146,000	
安田倉庫	10,300	1,416.00	14,584,800	
ファイズホールディングス	700	1,130.00	791,000	
NISSOホールディングス	13,500	835.00	11,272,500	
大栄環境	28,300	2,644.00	74,825,200	
日本管財ホールディングス	16,300	2,579.00	42,037,700	
東洋埠頭	1,500	1,353.00	2,029,500	
上組	69,800	3,317.00	231,526,600	
サンリツ	1,200	917.00	1,100,400	
キムラユニティー	2,400	1,752.00	4,204,800	
キューソー流通システム	7,700	1,129.00	8,693,300	
東海運	2,800	284.00	795,200	
エーアイティー	9,500	1,777.00	16,881,500	
内外トランスライン	6,100	2,490.00	15,189,000	
ショーエイコーポレーション	1,700	585.00	994,500	
日本コンセプト	5,500	1,860.00	10,230,000	
TBSホールディングス	76,400	3,937.00	300,786,800	
日本テレビホールディングス	134,500	2,217.50	298,253,750	
朝日放送グループホールディングス	14,400	645.00	9,288,000	
テレビ朝日ホールディングス	36,900	2,002.00	73,873,800	
スカパーJSAATHホールディングス	118,000	916.00	108,088,000	
テレビ東京ホールディングス	10,900	3,085.00	33,626,500	
日本BS放送	1,900	901.00	1,711,900	
ビジョン	22,900	1,153.00	26,403,700	
スマートバリュー	1,500	499.00	748,500	
U-NEXT HOLDINGS	17,000	4,560.00	77,520,000	
ワイヤレスゲート	2,200	228.00	501,600	
日本通信	149,400	203.00	30,328,200	
クロップス	700	1,063.00	744,100	

日本電信電話	45,186,100	168.10	7,595,783,410	
KDDI	1,173,800	4,278.00	5,021,516,400	
ソフトバンク	2,424,500	1,875.00	4,545,937,500	
光通信	15,300	24,895.00	380,893,500	
エムティーアイ	10,400	815.00	8,476,000	
GMOインターネットグループ	55,600	2,540.00	141,224,000	
ファイバーゲート	8,100	1,143.00	9,258,300	
アйдママーケティングコミュニケーション	1,700	227.00	385,900	
KADOKAWA	80,300	2,723.00	218,656,900	
学研ホールディングス	27,800	924.00	25,687,200	
ゼンリン	25,900	864.00	22,377,600	
昭文社ホールディングス	2,100	378.00	793,800	
インプレスホールディングス	5,000	157.00	785,000	
東京電力ホールディングス	1,365,300	968.00	1,321,610,400	
中部電力	558,200	1,984.50	1,107,747,900	
関西電力	584,900	2,484.50	1,453,184,050	
中国電力	263,100	1,010.00	265,731,000	
北陸電力	154,800	1,009.50	156,270,600	
東北電力	398,800	1,289.00	514,053,200	
四国電力	141,000	1,348.50	190,138,500	
九州電力	349,100	1,597.50	557,687,250	
北海道電力	146,300	1,212.00	177,315,600	
沖縄電力	38,800	1,093.00	42,408,400	
電源開発	124,300	2,665.00	331,259,500	
エフオン	11,200	421.00	4,715,200	
イーレックス	27,000	841.00	22,707,000	
レノバ	40,400	1,544.00	62,377,600	
東京瓦斯	294,900	3,462.00	1,020,943,800	
大阪瓦斯	301,900	3,440.00	1,038,536,000	
東邦瓦斯	65,600	4,046.00	265,417,600	
北海道瓦斯	9,000	3,445.00	31,005,000	
広島ガス	32,200	378.00	12,171,600	
西部ガスホールディングス	15,800	1,954.00	30,873,200	
静岡ガス	30,300	947.00	28,694,100	
メタウォーター	18,100	2,034.00	36,815,400	
M&A総研ホールディングス	16,600	4,730.00	78,518,000	
アイネット	9,200	2,083.00	19,163,600	
松竹	7,900	9,300.00	73,470,000	
東宝	84,500	5,064.00	427,908,000	
エイチ・アイ・エス	45,200	1,706.00	77,111,200	
東映	25,100	3,740.00	93,874,000	
ラックランド	7,100	1,890.00	13,419,000	
NTTデータグループ	397,200	2,415.00	959,238,000	
共立メンテナンス	48,900	3,260.00	159,414,000	
イチネンホールディングス	16,400	1,681.00	27,568,400	
建設技術研究所	8,000	4,705.00	37,640,000	
スペース	10,100	1,001.00	10,110,100	
アインホールディングス	22,100	6,063.00	133,992,300	
燦ホールディングス	14,600	1,075.00	15,695,000	

ピー・シー・エー	8,700	1,958.00	17,034,600
スバル興業	5,400	2,742.00	14,806,800
東京テアトル	2,100	1,132.00	2,377,200
タナベコンサルティンググループ	6,000	1,009.00	6,054,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	2,013.00	12,078,000
ナガワ	4,900	7,350.00	36,015,000
東京都競馬	13,000	4,245.00	55,185,000
常磐興産	1,900	1,202.00	2,283,800
カナモト	24,100	2,647.00	63,792,700
D T S	31,800	4,230.00	134,514,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	69,400	6,089.00	422,576,600
シーイーシー	19,200	1,848.00	35,481,600
カブコン	271,700	2,595.00	705,061,500
ニシオホールディングス	12,900	3,980.00	51,342,000
アイ・エス・ビー	7,800	1,423.00	11,099,400
アゴーラ ホスピタリティグループ	33,400	66.00	2,204,400
日本空港ビルディング	52,800	5,550.00	293,040,000
トランス・コスモス	19,300	3,240.00	62,532,000
乃村工藝社	67,800	857.00	58,104,600
ジャステック	9,300	1,939.00	18,032,700
S C S K	106,300	2,909.00	309,226,700
藤田観光	6,200	6,440.00	39,928,000
K N T - C Tホールディングス	9,300	1,292.00	12,015,600
トーカイ	13,800	2,090.00	28,842,000
白洋舎	800	2,501.00	2,000,800
セコム	158,600	10,580.00	1,677,988,000
N S W	6,700	3,255.00	21,808,500
セントラル警備保障	8,400	2,697.00	22,654,800
アイネス	11,800	1,667.00	19,670,600
丹青社	30,100	887.00	26,698,700
メイテックグループホールディングス	53,000	2,964.00	157,092,000
T K C	27,100	3,530.00	95,663,000
富士ソフト	30,500	6,140.00	187,270,000
応用地質	14,500	2,352.00	34,104,000
船井総研ホールディングス	31,100	2,382.00	74,080,200
N S D	53,600	3,055.00	163,748,000
進学会ホールディングス	1,700	242.00	411,400
丸紅建材リース	400	3,020.00	1,208,000
オオバ	3,600	1,145.00	4,122,000
コナミグループ	56,900	9,323.00	530,478,700
いであ	1,400	2,439.00	3,414,600
学究社	6,200	2,152.00	13,342,400
イオンディライト	16,700	3,695.00	61,706,500
ナック	13,300	539.00	7,168,700
福井コンピュータホールディングス	9,400	2,454.00	23,067,600
ダイセキ	31,800	3,090.00	98,262,000
ステップ	5,700	1,971.00	11,234,700
泉州電業	9,900	5,570.00	55,143,000

元気寿司	9,100	2,888.00	26,280,800	
トラスコ中山	33,700	2,629.00	88,597,300	
ヤマダホールディングス	493,100	426.70	210,405,770	
オートバックスセブン	55,800	1,545.50	86,238,900	
モリト	11,500	1,529.00	17,583,500	
アーケランズ	47,700	1,890.00	90,153,000	
ニトリホールディングス	58,300	20,385.00	1,188,445,500	
グルメ杵屋	13,000	1,068.00	13,884,000	
愛眼	4,200	184.00	772,800	
ケーユーホールディングス	7,500	1,139.00	8,542,500	
吉野家ホールディングス	59,000	2,805.00	165,495,000	
加藤産業	19,800	4,435.00	87,813,000	
北恵	1,400	861.00	1,205,400	
イノテック	10,100	1,809.00	18,270,900	
イエローハット	25,500	2,005.00	51,127,500	
松屋フーズホールディングス	7,600	5,500.00	41,800,000	
JBCホールディングス	10,100	3,260.00	32,926,000	
JKホールディングス	12,400	1,072.00	13,292,800	
サガミホールディングス	24,000	1,512.00	36,288,000	
日伝	10,500	2,588.00	27,174,000	
関西フードマーケット	10,900	1,835.00	20,001,500	
ミロク情報サービス	13,800	1,675.00	23,115,000	
北沢産業	3,300	336.00	1,108,800	
杉本商事	7,800	2,493.00	19,445,400	
因幡電機産業	41,500	3,580.00	148,570,000	
王将フードサービス	11,900	7,700.00	91,630,000	
ミニストップ	11,700	1,535.00	17,959,500	
アークス	29,400	2,982.00	87,670,800	
パローホールディングス	30,600	2,405.00	73,593,000	
東テック	16,000	2,942.00	47,072,000	
ミスミグループ本社	242,000	2,778.00	672,276,000	
アルテック	2,900	276.00	800,400	
ベルク	8,000	7,350.00	58,800,000	
大庄	8,600	1,215.00	10,449,000	
タキヒヨー	1,300	1,186.00	1,541,800	
ファーストリテイリング	90,100	41,160.00	3,708,516,000	
ソフトバンクグループ	749,400	7,941.00	5,950,985,400	
蔵王産業	1,000	2,540.00	2,540,000	
スズケン	57,200	4,758.00	272,157,600	
サンドラッグ	54,100	4,258.00	230,357,800	
サックスパーホールディングス	13,500	822.00	11,097,000	
ジェコス	9,700	1,016.00	9,855,200	
ヤマザワ	1,200	1,245.00	1,494,000	
やまや	1,100	3,110.00	3,421,000	
グローセル	4,500	747.00	3,361,500	
ベルーナ	38,500	630.00	24,255,000	
合計	244,904,200		578,748,382,490	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年5月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	32,608,056,342
コール・ローン	1,886,289,585
株式	1,412,984,929,396
投資信託受益証券	2,351,209,437
投資証券	24,262,903,675
派生商品評価勘定	428,677,149
未収入金	180,281,882
未収配当金	1,206,809,981
差入委託証拠金	11,426,106,208
流動資産合計	1,487,335,263,655
資産合計	1,487,335,263,655
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	155,948,647
未払解約金	450,596,000
流動負債合計	606,544,647
負債合計	606,544,647
純資産の部	
元本等	
元本	165,095,497,021
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,321,633,221,987
元本等合計	1,486,728,719,008
純資産合計	1,486,728,719,008
負債純資産合計	1,487,335,263,655

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5月9日 至 2024年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年5月8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	146,902,072,648円
同期中追加設定元本額	63,036,260,224円
同期中一部解約元本額	44,842,835,851円

元本の内訳

ファンド名

D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,722,870,520円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,656,016円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	6,988,496円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	17,474,299円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	19,780,695円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,971,224円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,062,534円
たわらノーロード 先進国株式	61,157,043,092円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,709,306,714円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	926,117,070円
たわらノーロード バランス(堅実型)	74,868,776円
たわらノーロード バランス(標準型)	740,079,934円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,036,703,175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)	31,469,937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)	197,820,419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)	239,415,634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)	425,197,341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)	113,476円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	12,308,944円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,911,362円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,822,163円
たわらノーロード 全世界株式	3,474,148,923円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	57,540,703,904円
One DC 先進国株式インデックスファンド	3,501,432,961円
Oneグローバルバランス	32,769,026円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	124,608,500円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	740,848,709円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	998,997,804円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	74,920,631円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	222,751,813円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	232,367,550円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	16,139,878円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	605,955,973円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	111,796,003円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	139,171,683円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	178,505,848円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	303,120,563円
投資のソムリエ	8,554,988,646円
クルーズコントロール	47,687,413円
投資のソムリエ<DC年金>	879,133,636円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	199,933,857円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	293,346,951円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	741,193,886円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,350,514,882円
ワールドアセットバランス(基本コース)	84,598,478円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	183,568,689円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	57,909,154円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	29,887,056円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,699,027円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	177,132,826円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	137,593,430円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	626,844,214円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	117,703,899円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	60,214,159円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	31,962,086円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	19,772,786円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	140,911,423円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,918,629円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	23,541,939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)	8,737,897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)	8,766,571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)	15,014,391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)	5,312,095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)	22,209,823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)	6,119,385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)	15,796,481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)	334,223,545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)	34,323,818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)	976,102,415円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,040,921,215円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	131,469,698円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	780,957円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	4,867,024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)	14,403,088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)	4,793,125円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	17,495,495円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	35,512,143円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,325,867円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,783,140円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	784,534円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,604円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	278,030円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,911,105円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	89,044,937円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	173,606,310円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	616,087,080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)	26,339,905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)	20,311,146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)	139,678,488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)	4,557,863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)	120,792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)	47,561,977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)	3,924,925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)	18,358,762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)	32,973,310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)	65,070,285円
動的パッケージファンド<DC年金>	12,852,907円
コア資産形成ファンド	6,211,288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>	2,114,893,552円
MHAM外国株式インデックスファンド	131,255,999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>	979,045,302円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,447,913,716円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,033,211,546円
計	165,095,497,021円
2. 受益権の総数	165,095,497,021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5月9日 至 2024年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年5月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年5月8日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	58,659,343,109	
投資信託受益証券	158,163,034	
投資証券	358,270,871	
合計	58,459,235,272	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2024年2月16日から2024年5月8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5月8日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	110,723,830	-	110,736,997	13,167	
ユーロ	110,723,830	-	110,736,997	13,167	
買建	1,672,333,602	-	1,678,383,054	6,049,452	
アメリカ・ドル	1,387,920,100	-	1,393,502,296	5,582,196	
イギリス・ポンド	56,149,662	-	56,152,109	2,447	
オーストラリア・ドル	21,465,651	-	21,423,262	42,389	
カナダ・ドル	61,561,314	-	61,582,100	20,786	
ユーロ	145,236,875	-	145,723,287	486,412	
合計	1,783,057,432	-	1,789,120,051	6,036,285	

(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5月8日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	46,967,473,630	-	47,234,165,847	266,692,217
合計	46,967,473,630	-	47,234,165,847	266,692,217

(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5月8日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	9.0053円 (90,053円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年5月8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	1,432,341	188.760	270,368,687.160	
	ABBOTT LABORATORIES	267,923	106.170	28,445,384.910	
	AES CORP	109,122	18.840	2,055,858.480	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	140,501	168.380	23,657,558.380	
	ADVANCED MICRO DEVICES	249,270	154.430	38,494,766.100	
	ADOBE INC	69,437	492.270	34,181,751.990	
	CHUBB LTD	62,823	251.950	15,828,254.850	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	34,261	248.650	8,518,997.650	
	ALLSTATE CORP	39,652	168.190	6,669,069.880	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	101,335	196.850	19,947,794.750	
AMGEN INC	82,631	300.300	24,814,089.300	
HESS CORP	41,496	158.490	6,576,701.040	
AMERICAN EXPRESS CO	89,859	234.660	21,086,312.940	
AMERICAN ELECTRIC POWER	83,039	89.870	7,462,714.930	
AFLAC INC	84,730	84.680	7,174,936.400	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	80.280	8,682,282.000	
ANALOG DEVICES	76,233	203.570	15,518,751.810	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	102,432	64.460	6,602,766.720	
VALERO ENERGY CORP	52,332	156.670	8,198,854.440	
ANSYS INC	13,252	325.040	4,307,430.080	
APPLE INC	2,261,698	182.400	412,533,715.200	
APPLIED MATERIALS INC	128,053	207.320	26,547,947.960	
ALBEMARLE CORP	18,991	131.550	2,498,266.050	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	61.590	5,019,831.360	
AMEREN CORP	40,644	74.360	3,022,287.840	
AUTODESK INC	33,059	214.620	7,095,122.580	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	62,963	245.120	15,433,490.560	
AUTOZONE INC	2,716	2,990.650	8,122,605.400	
AVERY DENNISON CORP	11,542	223.900	2,584,253.800	
BALL CORP	46,288	69.210	3,203,592.480	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	201,742	406.140	81,935,495.880	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	116,387	57.400	6,680,613.800	
BAXTER INTERNATIONAL INC	80,219	36.120	2,897,510.280	
BECTON DICKINSON & CO	43,938	237.150	10,419,896.700	
AMETEK INC	36,304	169.580	6,156,432.320	
VERIZON COMM INC	641,522	39.310	25,218,229.820	
WR BERKLEY CORP	31,607	78.550	2,482,729.850	
BEST BUY CO INC	30,568	73.060	2,233,298.080	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	279.910	845,608.110	
YUM! BRANDS INC	42,053	135.910	5,715,423.230	
FIRSTENERGY CORP	83,697	39.350	3,293,476.950	
BOEING CO	88,812	176.710	15,693,968.520	
ROBERT HALF INC	14,456	69.980	1,011,630.880	
BORGWARNER INC	37,010	36.800	1,361,968.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	226,432	73.430	16,626,901.760	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	79.530	1,370,540.490	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	26,064	148.330	3,866,073.120	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,247.740	4,256,041.140	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	315,127	44.040	13,878,193.080	
ONEOK INC	90,252	78.370	7,073,049.240	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	129.180	1,254,208.620	
UNITED RENTALS INC	10,788	674.270	7,274,024.760	
SEMPRA	98,372	73.990	7,278,544.280	
FEDEX CORP	36,746	259.470	9,534,484.620	
VERISIGN INC	14,698	169.560	2,492,192.880	
AMPHENOL CORP	91,520	124.720	11,414,374.400	
BROWN-FORMAN CORP	48,308	47.510	2,295,113.080	
QUANTA SERVICES INC	23,271	266.880	6,210,564.480	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	3.130	318,524.450	
CSX CORP	304,211	33.960	10,331,005.560	
COTERRA ENERGY INC	114,711	28.080	3,221,084.880	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	45.160	1,218,326.480	
CONSTELLATION BRANDS INC	24,629	258.490	6,366,350.210	
CARDINAL HEALTH INC	38,298	99.720	3,819,076.560	
CARLISLE COS INC	7,520	405.550	3,049,736.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	14.120	2,095,520.960	
CATERPILLAR INC	77,969	345.000	26,899,305.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	14,608	154.740	2,260,441.920	
JPMORGAN CHASE & CO	444,827	191.750	85,295,577.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	38,911	106.930	4,160,753.230	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,876	117.200	2,681,067.200	
CINTAS CORP	14,169	692.780	9,815,999.820	
CISCO SYSTEMS INC	625,028	47.280	29,551,323.840	
CLEVELAND-CLIFFS INC	83,513	17.310	1,445,610.030	
CLOROX COMPANY	18,305	141.170	2,584,116.850	
COCA-COLA CO/THE	634,080	62.620	39,706,089.600	
COPART INC	135,251	55.930	7,564,588.430	
COLGATE-PALMOLIVE CO	121,309	94.080	11,412,750.720	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	38,376	235.990	9,056,352.240	
MOLINA HEALTHCARE INC	8,928	349.820	3,123,192.960	
NRG ENERGY, INC.	34,874	73.400	2,559,751.600	
COMCAST CORP-CL A	619,656	38.490	23,850,559.440	
CONAGRA BRANDS INC	73,639	30.720	2,262,190.080	
CONSOLIDATED EDISON INC	51,736	97.500	5,044,260.000	
CMS ENERGY CORP	44,128	62.220	2,745,644.160	
COOPER COS INC	31,884	93.420	2,978,603.280	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	58.270	1,773,505.720	
CORNING INC	126,561	33.420	4,229,668.620	
HEICO CORP-CL A	11,614	166.920	1,938,608.880	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	216.640	2,045,514.880	
CUMMINS INC	22,263	286.910	6,387,477.330	

DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	44.520	1,059,843.120	
DR HORTON INC	45,784	151.400	6,931,697.600	
DANAHER CORP	108,358	248.760	26,955,136.080	
MOODY'S CORP	25,623	393.970	10,094,693.310	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,997	67.660	5,141,957.020	
TARGET CORP	71,189	160.410	11,419,427.490	
DEERE & CO	41,361	405.570	16,774,780.770	
MORGAN STANLEY	189,813	95.790	18,182,187.270	
REPUBLIC SERVICES INC	33,574	188.560	6,330,713.440	
COSTAR GROUP INC	61,975	92.460	5,730,208.500	
DECKERS OUTDOOR CORP	4,174	862.380	3,599,574.120	
THE WALT DISNEY CO	283,075	105.390	29,833,274.250	
DOLLAR TREE INC	31,756	121.670	3,863,752.520	
DOVER CORP	22,599	181.830	4,109,176.170	
OMNICOM GROUP	30,586	94.700	2,896,494.200	
DTE ENERGY CO	33,700	113.340	3,819,558.000	
DUKE ENERGY CORP	118,123	102.260	12,079,257.980	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,701	147.030	2,602,578.030	
EBAY INC	84,227	50.070	4,217,245.890	
BANK OF AMERICA CORP	1,090,810	37.840	41,276,250.400	
CITIGROUP INC	294,170	62.000	18,238,540.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	100.630	1,689,577.700	
EATON CORP PLC	61,113	327.430	20,010,229.590	
CADENCE DESIGN SYS INC	41,715	284.040	11,848,728.600	
ECOLAB INC	39,987	232.920	9,313,772.040	
REVVITY INC	17,972	103.170	1,854,171.240	
ELECTRONIC ARTS INC	38,801	130.240	5,053,442.240	
SALESFORCE INC	148,357	277.180	41,121,593.260	
ERIE INDEMNITY CO	4,050	405.440	1,642,032.000	
EMERSON ELECTRIC CO	87,960	107.400	9,446,904.000	
ATMOS ENERGY CORP	24,532	120.340	2,952,180.880	
ENTERGY CORP	33,557	110.580	3,710,733.060	
EOG RESOURCES INC	90,394	130.260	11,774,722.440	
EQUIFAX INC	18,730	236.740	4,434,140.200	
EQT CORP	59,729	40.510	2,419,621.790	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	35,846	129.490	4,641,698.540	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	114.900	2,575,483.500	
EXXON MOBIL CORP	690,621	116.170	80,229,441.570	
FMC CORP	17,711	66.750	1,182,209.250	
NEXTERA ENERGY INC	317,255	71.950	22,826,497.250	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,019	435.460	2,621,033.740	
FAIR ISAAC CORP	3,775	1,240.620	4,683,340.500	
ASSURANT INC	8,766	178.580	1,565,432.280	
FASTENAL CO	89,185	66.410	5,922,775.850	
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	38.030	4,008,742.300	
M&T BANK CORP	24,958	148.310	3,701,520.980	

FISERV INC	91,718	153.040	14,036,522.720	
FORD MOTOR CO	608,574	12.170	7,406,345.580	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	23.300	1,106,214.100	
FREEPORT-MCMORAN INC	224,733	51.390	11,549,028.870	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,712.330	2,712,330.720	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	33,344	245.020	8,169,946.880	
GENERAL DYNAMICS CORP	35,855	293.370	10,518,781.350	
GENERAL MILLS INC	88,517	69.910	6,188,223.470	
GENUINE PARTS CO	20,769	154.920	3,217,533.480	
GILEAD SCIENCES INC	190,011	65.460	12,438,120.060	
GARTNER INC	11,988	437.130	5,240,314.440	
MCKESSON CORP	20,854	545.750	11,381,070.500	
NVIDIA CORP	380,370	905.540	344,440,249.800	
GRACO INC	27,006	83.520	2,255,541.120	
GENERAL ELECTRIC CO	167,599	168.780	28,287,359.220	
VW GRAINGER INC	6,777	945.890	6,410,296.530	
HALLIBURTON CO	139,251	37.200	5,180,137.200	
MONSTER BEVERAGE CORP	117,637	54.670	6,431,214.790	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	50,300	443.800	22,323,140.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28,728	215.910	6,202,662.480	
HASBRO INC	16,359	61.160	1,000,516.440	
HENRY SCHEIN INC	20,863	71.200	1,485,445.600	
HEICO CORP	6,878	208.420	1,433,512.760	
HERSHEY FOODS CORP	24,324	198.160	4,820,043.840	
HP INC	145,950	28.410	4,146,439.500	
F5 INC	8,981	168.320	1,511,681.920	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	83.840	1,519,600.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	266.220	2,027,265.300	
JUNIPER NETWORKS INC	50,704	34.500	1,749,288.000	
HOLOGIC INC	38,399	76.100	2,922,163.900	
HOME DEPOT INC	152,731	340.690	52,033,924.390	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29,668	82.580	2,449,983.440	
HORMEL FOODS CORP	49,054	35.310	1,732,096.740	
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	29.600	2,894,169.600	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	471.200	2,316,890.400	
HUBBELL INC	7,820	393.060	3,073,729.200	
HUMANA INC	18,641	324.630	6,051,427.830	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	168.110	2,063,718.360	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	215,385	13.850	2,983,082.250	
BIOGEN INC	21,910	218.920	4,796,537.200	
IDEX CORP	12,292	221.750	2,725,751.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	46,463	247.140	11,482,865.820	
INTUIT INC	43,142	641.150	27,660,493.300	
IDEXX LABORATORIES INC	12,500	483.680	6,046,000.000	

TRANE TECHNOLOGIES PLC	35,154	325.890	11,456,337.060	
INTEL CORP	650,991	30.680	19,972,403.880	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	94.330	3,866,869.690	
INTERNATIONAL PAPER CO	53,419	38.840	2,074,793.960	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	30.960	1,673,790.480	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	165.650	1,964,112.050	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	117.430	2,299,983.980	
INCYTE CORP	31,654	54.370	1,721,027.980	
JOHNSON & JOHNSON	370,879	148.720	55,157,124.880	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,659	99.340	4,535,765.060	
KLA CORPORATION	20,937	714.380	14,956,974.060	
DEVON ENERGY CORP	96,985	50.980	4,944,295.300	
KELLANOVA	42,451	61.640	2,616,679.640	
KEYCORP	144,072	14.930	2,150,994.960	
KIMBERLY-CLARK CORP	52,932	135.980	7,197,693.360	
BLACKROCK INC/NEW YORK	22,727	780.920	17,747,968.840	
KROGER CO	103,385	55.310	5,718,224.350	
LAM RESEARCH CORP	20,285	914.910	18,558,949.350	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	7,446	393.030	2,926,501.380	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,451	179.150	2,409,746.650	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	71.800	1,454,668.000	
AKAMA I TECHNOLOGIES	23,313	101.670	2,370,232.710	
LENNAR CORP	37,667	161.100	6,068,153.700	
ELI LILLY & CO	124,326	777.770	96,697,033.020	
BATH & BODY WORKS INC	34,638	47.220	1,635,606.360	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	110,884	147.090	16,309,927.560	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,825	141.270	6,332,427.750	
LOCKHEED MARTIN CORP	33,842	466.680	15,793,384.560	
LOEWS CORP	30,289	77.810	2,356,787.090	
LOWE'S COS INC	88,486	231.460	20,480,969.560	
DOMINION ENERGY INC	126,501	52.120	6,593,232.120	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	40.640	1,641,896.640	
MCCORMICK & CO INC	40,279	76.180	3,068,454.220	
MCDONALD'S CORPORATION	111,035	267.500	29,701,862.500	
S&P GLOBAL INC	50,122	428.560	21,480,284.320	
EVEREST GROUP LTD	6,670	378.640	2,525,528.800	
MARKEL GROUP INC	2,013	1,615.150	3,251,296.950	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	91,510	85.840	7,855,218.400	
MARSH & MCLENNAN COS	75,606	203.710	15,401,698.260	

MASCO CORP	34,561	70.680	2,442,771.480	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,365	598.810	5,607,855.650	
METLIFE INC	97,405	71.260	6,941,080.300	
MEDTRONIC PLC	205,863	81.900	16,860,179.700	
CVS HEALTH CORP	197,356	55.740	11,000,623.440	
MERCK & CO. INC.	390,800	130.380	50,952,504.000	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	65,250	70.790	4,619,047.500	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,876	201.500	2,594,514.000	
MICROSOFT CORP	1,087,148	409.340	445,013,162.320	
MICRON TECH INC	168,037	119.210	20,031,690.770	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	81,668	92.060	7,518,356.080	
3M CO	86,733	95.540	8,286,470.820	
ENTEGRIS INC	23,675	132.700	3,141,672.500	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	236.300	1,813,366.200	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	25,570	358.170	9,158,406.900	
ILLUMINA INC	24,379	112.820	2,750,438.780	
XCEL ENERGY INC	88,125	55.020	4,848,637.500	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	143.190	2,092,435.470	
NETAPP INC	32,785	107.360	3,519,797.600	
NEWMONT CORP	182,697	41.440	7,570,963.680	
NVR INC	483	7,754.420	3,745,384.860	
NIKE INC-CL B	187,720	93.780	17,604,381.600	
NORDSON CORP	8,735	272.060	2,376,444.100	
NORFOLK SOUTHERN CORP	35,167	232.320	8,169,997.440	
EVERSOURCE ENERGY	51,861	61.170	3,172,337.370	
NISOURCE INC	64,543	29.050	1,874,974.150	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	84.660	2,782,604.880	
NORTHROP GRUMMAN CORP	22,098	473.750	10,468,927.500	
WELLS FARGO & CO	558,286	60.260	33,642,314.360	
NUCOR CORP	37,496	171.790	6,441,437.840	
CHENIERE ENERGY INC	36,422	156.310	5,693,122.820	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,630	142.560	8,215,732.800	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,774	65.070	6,492,294.180	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	29,708	184.790	5,489,741.320	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,084	1,020.710	9,272,129.640	
ORACLE CORP	254,062	117.930	29,961,531.660	
PACCAR INC	80,726	106.600	8,605,391.600	
PTC INC	18,085	178.380	3,226,002.300	
EXELON CORP	157,197	37.910	5,959,338.270	
PARKER HANNIFIN CORP	19,900	550.180	10,948,582.000	
PAYCHEX INC	49,152	121.790	5,986,222.080	

ALIGN TECHNOLOGY INC	11,452	286.520	3,281,227.040	
PPL CORPORATION	113,687	28.350	3,223,026.450	
PEPSICO INC	212,674	178.020	37,860,225.480	
PENTAIR PLC	25,545	83.020	2,120,745.900	
PFIZER INC	873,728	27.770	24,263,426.560	
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	38.670	1,559,135.730	
CONOCOPHILLIPS	183,994	123.540	22,730,618.760	
PG&E CORP	306,139	17.730	5,427,844.470	
ALTRIA GROUP INC	271,033	43.850	11,884,797.050	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	61,632	156.150	9,623,836.800	
BROWN & BROWN INC	36,907	85.240	3,145,952.680	
GARMIN LTD	23,281	169.960	3,956,838.760	
PPG INDUSTRIES INC	35,748	134.210	4,797,739.080	
COSTCO WHOLESALE CORP	68,386	771.310	52,746,805.660	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,293	111.250	3,815,096.250	
QUEST DIAGNOSTICS	16,574	136.940	2,269,643.560	
PROCTER & GAMBLE CO	363,111	165.760	60,189,279.360	
PROGRESSIVE CORP	89,808	215.460	19,350,031.680	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	74,243	71.980	5,344,011.140	
PULTE GROUP INC	33,950	116.950	3,970,452.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	40,068	110.850	4,441,537.800	
QUALCOMM INC	172,540	180.150	31,083,081.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,141	125.270	3,650,493.070	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	61.410	1,599,423.450	
RELIANCE INC	8,747	295.360	2,583,513.920	
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,559	969.970	16,061,733.230	
REPLIGEN CORP	8,576	167.720	1,438,366.720	
RESMED INC	22,899	216.160	4,949,847.840	
US BANCORP	241,484	41.580	10,040,904.720	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,309	98.210	5,530,106.890	
ROSS STORES INC	50,878	131.580	6,694,527.240	
ROLLINS INC	45,708	47.200	2,157,417.600	
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,344	520.260	8,503,129.440	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,327	272.040	4,713,637.080	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	37,464	141.590	5,304,527.760	
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	112.300	2,162,673.400	
ACCENTURE PLC-CL A	96,538	310.660	29,990,495.080	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	208,847	70.890	14,805,163.830	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	254.860	4,133,064.620	
AXON ENTERPRISE INC	11,039	312.730	3,452,226.470	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	34,835	216.970	7,558,149.950	

FIDELITY NATIONAL INFORMATION	89,354	74.310	6,639,895.740	
BOOKING HOLDINGS INC	5,452	3,605.410	19,656,695.320	
SCHLUMBERGER LTD	217,990	48.170	10,500,578.300	
SCHWAB (CHARLES) CORP	230,145	75.540	17,385,153.300	
POOL CORP	6,305	372.680	2,349,747.400	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	121.430	3,899,603.020	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	68.300	988,779.100	
ELEVANCE HEALTH INC	36,139	536.170	19,376,647.630	
CENCORA INC	25,701	226.740	5,827,444.740	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,591	82.460	2,934,833.860	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	37,500	318.750	11,953,125.000	
CENTENE CORP	82,487	75.900	6,260,763.300	
SMITH (A.O.) CORP	19,563	85.220	1,667,158.860	
SNAP-ON INC	8,204	276.860	2,271,359.440	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,392	116.230	6,321,982.160	
EDISON INTERNATIONAL	57,612	73.890	4,256,950.680	
SOUTHERN CO	166,722	76.950	12,829,257.900	
TRUIST FINANCIAL CORP	206,811	39.110	8,088,378.210	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	27.000	531,900.000	
AT&T INC	1,094,228	17.080	18,689,414.240	
CHEVRON CORP	277,081	162.670	45,072,766.270	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,592	87.290	1,972,055.680	
STATE STREET CORP	50,416	75.350	3,798,845.600	
STARBUCKS CORP	175,161	72.500	12,699,172.500	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	132.710	3,043,969.270	
STRYKER CORP	52,791	332.140	17,534,002.740	
NETFLIX INC	67,648	606.000	40,994,688.000	
GEN DIGITAL INC	92,583	19.960	1,847,956.680	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	48.060	1,316,844.000	
SYNOPSIS INC	23,314	549.610	12,813,607.540	
SYSCO CORP	81,369	75.810	6,168,583.890	
INTUITIVE SURGICAL INC	54,381	388.650	21,135,175.650	
TELEFLEX INC	6,985	201.520	1,407,617.200	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	13.950	2,361,037.500	
TERADYNE INC	22,066	121.090	2,671,971.940	
TEXAS INSTRUMENTS INC	140,780	182.670	25,716,282.600	
TEXTRON INC	29,841	87.490	2,610,789.090	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	59,645	572.870	34,168,831.150	
GLOBE LIFE INC	14,973	85.160	1,275,100.680	
TORO CO	14,644	89.080	1,304,487.520	
DAVITA INC	6,813	137.690	938,081.970	

TRACTOR SUPPLY CO	16,808	270.130	4,540,345.040	
BIO-TECHNE CORP	25,934	77.460	2,008,847.640	
TRIMBLE INC	37,504	57.000	2,137,728.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,175	481.380	2,972,521.500	
TYSON FOODS INC	41,316	58.890	2,433,099.240	
MARATHON OIL CORP	92,952	27.050	2,514,351.600	
UNION PACIFIC CORP	93,133	242.380	22,573,576.540	
RTX CORP	223,486	103.230	23,070,459.780	
UNITEDHEALTH GROUP INC	142,800	500.960	71,537,088.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,903	169.500	1,678,558.500	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	12.890	1,048,292.140	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	39,411	410.240	16,167,968.640	
VULCAN MATERIALS CO	20,095	268.350	5,392,493.250	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	17.350	1,858,601.400	
WALMART INC	678,540	60.620	41,133,094.800	
WASTE MANAGEMENT INC	62,122	210.500	13,076,681.000	
WATERS CORP	8,786	326.060	2,864,763.160	
WATSCO INC	4,889	467.990	2,288,003.110	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,464	368.350	4,222,764.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,604	112.940	1,762,315.760	
VAIL RESORTS INC	6,523	197.490	1,288,227.270	
WESTERN DIGITAL CORP	49,451	71.490	3,535,251.990	
WABTEC CORP	28,400	164.590	4,674,356.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,319	92.560	2,343,526.640	
WYNN RESORTS LTD	15,379	97.230	1,495,300.170	
NASDAQ INC	52,969	60.900	3,225,812.100	
CME GROUP INC	55,935	208.340	11,653,497.900	
WILLIAMS COS INC	188,794	39.110	7,383,733.340	
WILLIAMS-SONOMA INC	9,646	301.620	2,909,426.520	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	202.680	1,733,116.680	
LKQ CORP	43,882	44.440	1,950,116.080	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	51.130	2,071,992.120	
WEC ENERGY GROUP INC	47,882	83.830	4,013,948.060	
CARMAX INC	22,414	69.230	1,551,721.220	
TJX COMPANIES INC	175,938	97.920	17,227,848.960	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	317.870	2,474,617.950	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.280	511,840.720	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	39.840	937,355.520	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,271	154.330	2,974,093.430	
CBRE GROUP INC	48,577	86.510	4,202,396.270	
REGIONS FINANCIAL CORP	152,588	19.650	2,998,354.200	

DOMINO'S PIZZA INC	5,137	517.230	2,657,010.510	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,519	702.220	5,279,992.180	
WESTLAKE CORP	6,030	156.450	943,393.500	
T-MOBILE US INC	80,697	162.190	13,088,246.430	
LAS VEGAS SANDS CORP	59,474	46.720	2,778,625.280	
MOSAIC CO/THE	48,502	29.880	1,449,239.760	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	200.890	1,230,652.140	
CELANESE CORP	16,273	162.730	2,648,105.290	
DEXCOM INC	58,553	130.100	7,617,745.300	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	162.620	3,179,871.480	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	112.910	2,481,535.980	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	74.990	2,322,365.310	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,536	424.870	6,600,780.320	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	87,385	133.720	11,685,122.200	
LIVE NATION	23,597	96.340	2,273,334.980	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,226	3,193.680	13,496,491.680	
TRANSDIGM GROUP INC	8,496	1,310.400	11,133,158.400	
MASTERCARD INC	128,934	453.060	58,414,838.040	
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	76.950	1,817,789.850	
OWENS CORNING	13,227	175.080	2,315,783.160	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,679	142.850	2,953,995.150	
AERCAP HOLDINGS NV	30,064	87.440	2,628,796.160	
FIRST SOLAR INC	15,579	194.670	3,032,763.930	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	18,398	201.360	3,704,621.280	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,793	819.290	6,384,726.970	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	93.140	1,964,695.160	
DELTA AIR LINES INC	21,592	52.200	1,127,102.400	
INSULET CORP	10,158	184.280	1,871,916.240	
DISCOVER FINANCIAL	39,188	123.610	4,844,028.680	
TE CONNECTIVITY LTD	47,054	143.240	6,740,014.960	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,837	349.850	6,240,274.450	
MERCADOLIBRE INC	6,913	1,688.690	11,673,913.970	
ULTA BEAUTY INC	7,263	393.670	2,859,225.210	
MSCI INC	11,948	471.400	5,632,287.200	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	236,746	97.530	23,089,837.380	
VISA INC	243,751	276.460	67,387,401.460	
KEURIG DR PEPPER INC	160,760	33.810	5,435,295.600	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	31,751	131.820	4,185,416.820	
MARATHON PETROLEUM CORP	58,062	180.920	10,504,577.040	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	72.820	1,560,532.600	

KINDER MORGAN INC/DELAWARE	298,312	18.770	5,599,316.240	
XYLEM INC	36,891	140.030	5,165,846.730	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	40,421	101.450	4,100,710.450	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	248.570	1,610,982.170	
EPAM SYSTEMS INC	9,031	249.540	2,253,595.740	
HCA HEALTHCARE INC	30,702	314.450	9,654,243.900	
VERISK ANALYTICS INC	21,663	247.000	5,350,761.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,706	111.210	1,190,614.260	
CORPAY INC	11,338	304.720	3,454,915.360	
NXP SEMICONDUCTOR NV	38,938	258.650	10,071,313.700	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,242	151.400	2,913,238.800	
TARGA RESOURCES CORP	33,263	112.830	3,753,064.290	
LEAR CORP	9,398	128.030	1,203,225.940	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,608	184.245	2,875,695.960	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	62.720	2,150,982.400	
DOLLAR GENERAL CORP	33,444	139.900	4,678,815.600	
FORTINET INC	100,599	59.430	5,978,598.570	
HYATT HOTELS CORP	6,647	150.400	999,708.800	
TESLA INC	440,906	177.810	78,397,495.860	
ENPHASE ENERGY INC	21,539	114.925	2,475,369.570	
GENERAL MOTORS CO	208,056	45.280	9,420,775.680	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	39.400	1,545,662.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	268.970	3,199,398.150	
APTIV PLC	43,097	83.000	3,577,051.000	
PHILLIPS 66	68,358	145.210	9,926,265.180	
META PLATFORMS INC	341,856	468.240	160,070,653.440	
IQVIA HOLDINGS INC	27,848	229.140	6,381,090.720	
DIAMONDBACK ENERGY INC	26,616	203.680	5,421,146.880	
SERVICENOW INC	31,602	713.330	22,542,654.660	
PALO ALTO NETWORKS INC	48,773	305.520	14,901,126.960	
WORKDAY INC	32,378	249.430	8,076,044.540	
ABBVIE INC	272,283	162.550	44,259,601.650	
ZOETIS INC	70,224	168.450	11,829,232.800	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	24.420	1,323,832.620	
CDW CORP	20,262	220.680	4,471,418.160	
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	79.830	5,038,071.300	
TWILIO INC	25,710	63.370	1,629,242.700	
SNAP INC	152,250	17.140	2,609,565.000	
TRADE DESK INC A	69,828	89.640	6,259,381.920	
OKTA INC	25,106	98.560	2,474,447.360	
BAKER HUGHES CO	152,160	32.140	4,890,422.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	85.100	1,853,903.500	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	11.900	1,927,347.800	

BROADCOM INC	68,510	1,303.110	89,276,066.100	
ARES MANAGEMENT CORP	26,510	137.290	3,639,557.900	
MONGODB INC	10,906	355.310	3,875,010.860	
BURLINGTON STORES INC	10,565	187.720	1,983,261.800	
VEEVA SYSTEMS INC	23,273	205.310	4,778,179.630	
EVERGY INC	33,192	54.450	1,807,304.400	
ALLEGION PLC	13,423	124.370	1,669,418.510	
DAYFORCE INC	22,002	59.180	1,302,078.360	
STERIS PLC	15,540	212.870	3,307,999.800	
DOCUSIGN INC	31,974	58.310	1,864,403.940	
WIX.COM LTD	8,997	122.140	1,098,893.580	
DROPBOX INC	41,801	23.610	986,921.610	
KKR & CO INC	90,373	99.540	8,995,728.420	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	71.060	358,853.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	39,400	62.140	2,448,316.000	
MODERNA INC	50,006	121.070	6,054,226.420	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40,232	199.710	8,034,732.720	
CIGNA GROUP	45,163	346.700	15,658,012.100	
DELL TECHNOLOGIES INC	38,669	127.550	4,932,230.950	
DOW INC	106,037	58.360	6,188,319.320	
OVINTIV INC	39,160	52.510	2,056,291.600	
AMCOR PLC	223,348	10.120	2,260,281.760	
PINTEREST INC	90,936	41.900	3,810,218.400	
FOX CORP-A	36,501	32.320	1,179,712.320	
FOX CORP-B	27,507	29.850	821,083.950	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	35,283	312.550	11,027,701.650	
AVANTOR INC	107,376	24.850	2,668,293.600	
DYNATRACE INC	39,362	46.760	1,840,567.120	
CLOUDFLARE INC	46,487	74.130	3,446,081.310	
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	110.380	1,867,408.840	
CARRIER GLOBAL CORP	124,379	64.260	7,992,594.540	
OTIS WORLDWIDE CORP	62,600	93.890	5,877,514.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	285,830	70.430	20,131,006.900	
CORTEVA INC	108,001	57.520	6,212,217.520	
MATCH GROUP INC	44,764	31.510	1,410,513.640	
FERGUSON PLC	30,868	218.970	6,759,165.960	
BILL HOLDINGS INC	16,243	57.680	936,896.240	
BLACKSTONE INC	108,546	121.500	13,188,339.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	7,385	169.090	1,248,729.650	
CARLYLE GROUP INC	34,847	41.980	1,462,877.060	
DATADOG INC	42,674	112.400	4,796,557.600	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	89.510	2,764,963.900	
VERTIV HOLDINGS CO	53,234	94.910	5,052,438.940	
INGERSOLL RAND INC	61,976	89.850	5,568,543.600	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	62,373	81.430	5,079,033.390	

PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	176.470	1,577,818.270	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	10.250	957,616.500	
DRAFTKINGS INC	63,900	43.300	2,766,870.000	
UNITY SOFTWARE INC	40,967	25.320	1,037,284.440	
AON PLC	31,309	288.350	9,027,950.150	
WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	7.770	2,730,541.170	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,718	569.720	1,548,498.960	
BENTLEY SYSTEMS INC	33,634	54.930	1,847,515.620	
COINBASE GLOBAL INC	26,305	214.340	5,638,213.700	
UIPATH INC	53,439	20.020	1,069,848.780	
AIRBNB INC	67,475	159.810	10,783,179.750	
CONSTELLATION ENERGY CORP	48,214	200.560	9,669,799.840	
MONDAY.COM LTD	4,308	190.370	820,113.960	
SOLVENTUM CORP	21,683	65.560	1,421,537.480	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	39,050	30.040	1,173,062.000	
APPOVIN CORP	25,377	77.090	1,956,312.930	
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	28.280	1,758,252.440	
ROBLOX CORP	66,477	40.540	2,694,977.580	
VIATRIS INC	184,148	11.720	2,158,214.560	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	36.350	1,257,855.400	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	88.620	1,404,272.520	
HF SINCLAIR CORP	25,560	54.850	1,401,966.000	
SNOWFLAKE INC	42,608	159.090	6,778,506.720	
DOORDASH INC	39,376	115.560	4,550,290.560	
ARISTA NETWORKS INC	40,807	273.990	11,180,709.930	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	61,704	113.180	6,983,658.720	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	32.690	519,542.170	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	290,013	21.400	6,206,278.200	
FNF GROUP	38,907	52.150	2,029,000.050	
JACOBS SOLUTIONS INC	18,723	141.640	2,651,925.720	
MARVELL TECHNOLOGY INC	134,511	68.680	9,238,215.480	
APA CORP	49,146	30.260	1,487,157.960	
CONFLUENT INC	27,524	27.830	765,992.920	
LINDE PLC	74,454	430.000	32,015,220.000	
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	17.990	1,323,452.340	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	65.280	782,119.680	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	188.770	702,413.170	
TOAST INC	45,399	23.730	1,077,318.270	
GE VERNOVA INC	41,899	167.360	7,012,216.640	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.500	978,302.500	
CATALENT INC	27,357	56.530	1,546,491.210	
SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	45.270	3,110,094.270	
VERALTO CORP	37,086	97.270	3,607,355.220	
SAMSARA INC	27,908	38.270	1,068,039.160	

	LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM	19,871	25.150	499,755.650	
	LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	28,191	72.060	2,031,443.460	
	BUNGE GLOBAL SA	21,715	104.350	2,265,960.250	
	KENVUE INC	264,038	20.080	5,301,883.040	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	35.570	2,597,072.410	
	CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	237.470	1,614,558.530	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	150.100	4,159,721.300	
	HUBSPOT INC	7,360	615.460	4,529,785.600	
	QORVO INC	14,144	96.750	1,368,432.000	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,444	52.160	962,039.040	
	LIBERTY GLOBAL LTD	36,034	17.470	629,513.980	
	GODADDY INC	19,713	131.350	2,589,302.550	
	ETSY INC	18,558	62.770	1,164,885.660	
	TRANSUNION	31,262	78.590	2,456,880.580	
	ALBERTSONS COS INC	54,086	20.600	1,114,171.600	
	BLOCK INC	84,306	71.600	6,036,309.600	
	DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	79.290	5,410,353.150	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	73.300	2,273,179.600	
	WESTROCK CO	42,166	51.620	2,176,608.920	
	KRAFT HEINZ CO	129,447	35.810	4,635,497.070	
	FORTIVE CORP	55,370	77.040	4,265,704.800	
	WASTE CONNECTIONS INC	38,848	165.500	6,429,344.000	
	ALPHABET INC-CL A	912,175	171.250	156,209,968.750	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	186,711	16.860	3,147,947.460	
	PAYPAL HOLDINGS INC	158,507	65.920	10,448,781.440	
	SEA LTD ADR	58,070	65.160	3,783,841.200	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	39.430	2,221,052.470	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	43.120	964,766.880	
	ALPHABET INC-CL C	792,918	172.980	137,158,955.640	
	ZSCALER INC	14,051	176.890	2,485,481.390	
	ATLASSIAN CORP PLC	23,713	184.120	4,366,037.560	
	ROKU INC	19,331	60.140	1,162,566.340	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,049	268.000	4,033,132.000	
	VISTRA CORP	49,633	81.740	4,057,001.420	
アメリカ・ドル	小計	52,418,783		6,871,350,242.270 (1,064,715,720,038)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	21.980	1,347,264.100	
	ASHTREAD GROUP	66,851	57.720	3,858,639.720	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	25.770	1,173,771.960	
	BARCLAYS PLC	2,229,023	2.103	4,687,635.360	

BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.928	612,037.880	
BT GROUP PLC	904,198	1.054	953,024.690	
BUNZL PLC	53,979	31.480	1,699,258.920	
CRH PLC	108,593	64.280	6,980,358.040	
AVIVA PLC	429,205	4.826	2,071,343.330	
CRODA INTERNATIONAL	20,573	48.310	993,881.630	
DIAGEO PLC	346,858	27.555	9,557,672.190	
SCHRODERS PLC	110,366	3.606	397,979.790	
DCC PLC	17,471	57.450	1,003,708.950	
NATIONAL GRID PLC	579,825	10.955	6,351,982.870	
KINGFISHER PLC	336,026	2.539	853,170.010	
BAE SYSTEMS PLC	457,388	13.730	6,279,937.240	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	315,055	23.870	7,520,362.850	
HALMA PLC	62,208	22.840	1,420,830.720	
NEXT PLC	18,588	91.060	1,692,623.280	
IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	18.475	2,331,157.020	
ANGLO AMERICAN PLC	193,117	26.800	5,175,535.600	
COMPASS GROUP PLC	259,074	22.730	5,888,752.020	
HSBC HOLDINGS PLC	2,973,100	7.126	21,186,310.600	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	949,467	2.466	2,341,385.620	
CENTRICA PLC	793,776	1.311	1,040,640.330	
UNILEVER PLC	382,437	42.120	16,108,246.440	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,134	10.870	1,251,506.580	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	26.870	1,479,005.410	
PEARSON PLC	84,159	9.976	839,570.180	
PERSIMMON PLC	56,989	14.140	805,824.460	
PRUDENTIAL PLC	418,146	7.594	3,175,400.720	
RIO TINTO PLC	173,077	55.910	9,676,735.070	
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.679	2,432,791.130	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	110,858	45.500	5,044,039.000	
RELX PLC	289,143	34.110	9,862,667.730	
RENTOKIL INITIAL PLC	374,845	4.196	1,572,849.620	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,303,232	4.184	5,452,722.680	
NATWEST GROUP PLC	896,355	3.120	2,796,627.600	
ST JAMES'S PLACE PLC	89,082	4.578	407,817.390	
SSE PLC	168,922	17.805	3,007,656.210	
BP PLC	2,631,576	5.037	13,255,248.310	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	11.885	1,808,849.460	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.570	856,586.150	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	90.200	969,740.200	
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	7.506	2,721,135.160	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,868,076	0.537	5,299,156.810	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.414	805,786.280	

	TESCO PLC	1,122,991	3.043	3,417,261.610	
	3I GROUP PLC	149,486	29.500	4,409,837.000	
	SMITH & NEPHEW PLC	125,930	9.978	1,256,529.540	
	GSK PLC	626,067	17.610	11,025,039.870	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	63,356	93.080	5,897,176.480	
	WPP PLC	176,061	8.256	1,453,559.610	
	ASTRAZENECA PLC	239,773	121.180	29,055,692.140	
	WHITBREAD PLC	31,475	29.960	942,991.000	
	INTERTEK GROUP PLC	23,309	50.100	1,167,780.900	
	BURBERRY GROUP PLC	52,229	11.510	601,155.790	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	79.020	2,123,583.480	
	SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.678	711,831.140	
	ADMIRAL GROUP PLC	40,084	27.410	1,098,702.440	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	51.150	843,412.350	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	19.560	360,979.800	
	ABRDN PLC	285,831	1.542	440,751.400	
	EXPERIAN PLC	140,133	33.830	4,740,699.390	
	MONDI PLC	67,554	15.630	1,055,869.020	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.248	304,697.610	
	OCADO GROUP PLC	69,766	3.600	251,157.600	
	INFORMA PLC	223,961	8.314	1,862,011.750	
	GLENORE PLC	1,570,188	4.679	7,346,909.650	
	ENTAIN PLC	96,924	7.858	761,628.790	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	26.760	830,496.600	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	5.175	702,909.900	
	M&G PLC	270,401	2.024	547,291.620	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	16.840	472,783.000	
	WISE PLC	96,207	8.035	773,023.240	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.188	453,900.340	
	HALEON PLC	947,490	3.267	3,095,449.830	
	SHELL PLC	1,001,245	28.950	28,986,042.750	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	7.358	1,053,577.300	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	27,104	162.000	4,390,848.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	5.912	1,277,725.080	
	イギリス・ポンド 小計	42,077,422		310,762,533.330 (60,182,272,205)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	187,404	33.670	6,309,892.680	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	29.600	7,076,856.800	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	750.000	2,497,500.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	19.120	3,115,489.280	
	ICL GROUP LTD	103,067	18.250	1,880,972.750	
	NICE LTD	10,202	825.400	8,420,730.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	136.500	4,019,106.000	

	AZRIELI GROUP	4,672	244.300	1,141,369.600	
イスラエル・シュケル 小計		740,146		34,461,917.910 (1,443,551,156)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	51.600	1,460,589.600	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	540,278	27.890	15,068,353.420	
	FORTESCUE LTD	253,090	26.780	6,777,750.200	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.640	2,183,464.920	
	ASX LTD	31,215	65.350	2,039,900.250	
	BHP GROUP LTD	775,707	43.420	33,681,197.940	
	AMPOL LTD	31,828	36.000	1,145,808.000	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	26.710	2,447,277.040	
	CSL LIMITED	73,693	279.560	20,601,615.080	
	REA GROUP LTD	9,317	183.540	1,710,042.180	
	TRANSURBAN GROUP	476,258	12.750	6,072,289.500	
	COCHLEAR LTD	10,446	327.810	3,424,303.260	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	10.060	2,592,381.520	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	255,604	119.000	30,416,876.000	
	RIO TINTO LIMITED	56,991	131.710	7,506,284.610	
	APA GROUP	222,829	8.550	1,905,187.950	
	ARISTOCRAT LEISU	86,829	40.030	3,475,764.870	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	6.400	2,304,524.800	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	69,336	55.960	3,880,042.560	
	ORICA LTD	63,862	17.970	1,147,600.140	
	BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	22.660	1,735,461.420	
	MACQUARIE GROUP LTD	56,701	191.100	10,835,561.100	
	SUNCORP GROUP LTD	199,628	16.290	3,251,940.120	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	482,840	34.140	16,484,157.600	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.160	693,979.440	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	219,807	17.350	3,813,651.450	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	14.710	2,392,272.590	
	REECE LTD	31,558	27.900	880,468.200	
	SANTOS LTD	478,809	7.550	3,615,007.950	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	26.620	1,727,558.140	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	32.560	1,283,515.200		
WESFARMERS LTD	172,824	70.660	12,211,743.840		
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	296,262	27.840	8,247,934.080		
WOOLWORTHS GROUP LTD	183,840	30.910	5,682,494.400		
SEEK LTD	58,513	24.190	1,415,429.470		
MINERAL RESOURCES LTD	28,865	77.720	2,243,387.800		

	BRAMBLES LTD	220,767	14.490	3,198,913.830	
	PILBARA MINERALS LTD	404,496	4.170	1,686,748.320	
	CAR GROUP LTD	58,310	34.830	2,030,937.300	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	28,600	39.230	1,121,978.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.820	851,283.180	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	11.470	1,547,417.700	
	XERO LTD	23,149	127.100	2,942,237.900	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	16.620	746,620.260	
	LOTTERY CORP LTD	366,780	5.030	1,844,903.400	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.240	1,224,273.600	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	462,432	28.790	13,313,417.280	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.660	1,510,668.660	
	SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.650	2,491,993.700	
	COLES GROUP LTD	197,589	16.260	3,212,797.140	
	WISETECH GLOBAL LTD	27,325	96.430	2,634,949.750	
	オーストラリア・ドル 小計	10,481,938		266,714,956.660 (27,212,927,028)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	75,291	90.440	6,809,318.040	
	BARRICK GOLD CORP	267,495	22.990	6,149,710.050	
	BANK OF MONTREAL	109,727	126.320	13,860,714.640	
	BANK OF NOVA SCOTIA	189,801	64.690	12,278,226.690	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,706	113.610	5,874,318.660	
	BCE INC	14,197	45.910	651,784.270	
	BROOKFIELD CORP	211,045	60.030	12,669,031.350	
	SAPUTO INC	34,582	26.570	918,843.740	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	133.410	1,535,282.280	
	CGI INC	31,091	141.490	4,399,065.590	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	72.360	1,523,756.880	
	CAE INC	40,808	28.270	1,153,642.160	
	CAMECO CORP	66,084	70.970	4,689,981.480	
	ROGERS COMM-CL B	53,375	52.660	2,810,727.500	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	143,011	65.850	9,417,274.350	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	164,344	104.900	17,239,685.600	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	135.820	1,210,292.020	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	31.160	508,842.800	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,693	171.890	14,385,989.770	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	44.790	1,350,060.180	
	OPEN TEXT CORP	40,459	41.480	1,678,239.320	
	EMPIRE CO LTD	20,608	32.690	673,675.520	
	KINROSS GOLD CORP	192,737	9.290	1,790,526.730	
	RB GLOBAL INC	26,641	98.540	2,625,204.140	
	FORTIS INC	82,632	55.170	4,558,807.440	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	18.490	1,579,434.290	

TELUS CORP	31,890	22.540	718,800.600	
GREAT WEST LIFECO INC	43,551	42.890	1,867,902.390	
IMPERIAL OIL LTD	27,434	94.840	2,601,840.560	
ENBRIDGE INC	326,190	50.580	16,498,690.200	
IGM FINANCIAL INC	12,478	37.900	472,916.200	
MANULIFE FINANCIAL CORP	271,363	33.270	9,028,247.010	
LOBLAW CO LTD	24,803	154.500	3,832,063.500	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	120,276	74.720	8,987,022.720	
MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	63.950	2,703,742.050	
SUN LIFE FINANCIAL INC	90,324	72.520	6,550,296.480	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,133	1,562.280	4,894,623.240	
METRO INC	35,059	72.550	2,543,530.450	
EMERA INC	44,643	47.730	2,130,810.390	
ONEX CORP	10,157	99.990	1,015,598.430	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	25.940	1,436,375.620	
POWER CORP OF CANADA	89,864	38.980	3,502,898.720	
QUEBECOR INC-B	30,598	29.000	887,342.000	
ROYAL BANK OF CANADA	218,798	138.650	30,336,342.700	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	144,017	111.560	16,066,536.520	
STANTEC INC	18,358	115.900	2,127,692.200	
SUNCOR ENERGY INC	198,439	53.440	10,604,580.160	
LUNDIN MINING CORP	119,660	16.190	1,937,295.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	72,863	69.110	5,035,561.930	
THOMSON REUTERS CORP	24,837	229.080	5,689,659.960	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	123.170	1,613,157.490	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	275,206	75.970	20,907,399.820	
TC ENERGY CORP	157,154	51.450	8,085,573.300	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	106.310	861,323.620	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	187.330	1,843,139.870	
INTACT FINANCIAL CORP	28,756	229.550	6,600,939.800	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	73,865	73.900	5,458,623.500	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,041	3,755.350	11,420,019.350	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,420	172.990	5,089,365.800	
TOURMALINE OIL CORP	49,085	67.150	3,296,057.750	
KEYERA CORP	39,997	34.630	1,385,096.110	
PARKLAND CORP	24,129	40.550	978,430.950	
ALTAGAS LTD	47,249	30.100	1,422,194.900	
PEMBINA PIPELINE CORP	82,164	49.450	4,063,009.800	
DOLLARAMA INC	41,508	118.760	4,929,490.080	
MEG ENERGY CORP	47,181	31.590	1,490,447.790	
CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	28.280	6,412,970.760	
ARC RESOURCES LTD	96,301	25.400	2,446,045.400	

	NORTHLAND POWER INC	34,152	21.550	735,975.600	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	22.910	1,173,977.130	
	TMX GROUP LTD	46,884	36.860	1,728,144.240	
	BRP INC	4,307	94.120	405,374.840	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	19.890	1,965,529.800	
	NUTRIEN LTD	77,339	75.820	5,863,842.980	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	184.540	2,139,003.140	
	WSP GLOBAL INC	20,394	214.500	4,374,513.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	16,448	86.470	1,422,258.560	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	45.910	1,637,471.970	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	40.690	655,231.070	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	54.610	2,853,317.890	
	AIR CANADA	41,858	18.530	775,628.740	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,113	102.010	4,601,977.130	
	SHOPIFY INC	184,248	105.750	19,484,226.000	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	206.630	1,082,121.310	
	HYDRO ONE LTD	56,437	39.600	2,234,905.200	
カナダ・ドル 小計		6,180,035		415,249,589.610 (46,844,306,204)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.920	673,456.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	5.230	848,306.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	310,981	35.930	11,173,547.330	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	101,000	5.930	598,930.000	
	SEATRUM LTD	361,761	1.940	701,816.340	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	27.000	418,500.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.250	1,294,075.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.885	673,655.800	
	KEPPEL LTD	249,600	6.710	1,674,816.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	502,098	14.260	7,159,917.480	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	2.380	3,191,175.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.690	1,632,360.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	30.550	5,852,341.300	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.180	822,030.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.600	1,053,754.000	
シンガポール・ドル 小計		5,216,219		37,768,680.650 (4,318,848,632)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	76.380	1,812,802.920	
	NESTLE SA-REGISTERED	412,946	92.160	38,057,103.360	
	CIE FINANC RICHEMONT	83,477	132.850	11,089,919.450	

ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	108,977	221.300	24,116,610.100	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	235.400	1,250,209.400	
SIKA INHABER	23,397	274.000	6,410,778.000	
SGS SA-REG	22,978	82.380	1,892,927.640	
NOVARTIS AG-REG SHS	316,216	89.780	28,389,872.480	
BALOISE HOLDING AG -R	5,830	141.700	826,111.000	
BARRY CALLEBAUT AG	711	1,535.000	1,091,385.000	
CLARIANT AG-REG	22,909	14.390	329,660.510	
SWISSCOM AG-REG	4,457	495.800	2,209,780.600	
ABB LTD	247,495	45.730	11,317,946.350	
ADECCO GROUP AG-REG	26,454	32.040	847,586.160	
GEBERIT AG	5,105	539.200	2,752,616.000	
LONZA GROUP AG-REG	11,536	520.200	6,001,027.200	
LINDT & SPRUENGLI PART	161	10,660.000	1,716,260.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	107,000.000	1,712,000.000	
GIVAUDAN-REG	1,392	4,072.000	5,668,224.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	22,758	451.600	10,277,512.800	
ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	241.400	1,161,134.000	
HOLCIM LTD	77,519	79.280	6,145,706.320	
TEMENOS GROUP	10,930	55.050	601,696.500	
BACHEM HOLDING AG	4,673	82.050	383,419.650	
SONOVA HOLDING AG	8,100	267.100	2,163,510.000	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,597	247.900	2,131,196.300	
STRAUMANN HOLDING AG	16,475	118.500	1,952,287.500	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	195.050	838,715.000	
THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	38.750	358,786.250	
HELVETIA HOLDING AG	4,906	123.400	605,400.400	
SCHINDLER NAMEN	4,209	228.000	959,652.000	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	639.400	2,879,218.200	
BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	95.750	469,462.250	
EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	768.500	956,782.500	
SWISS PRIME SITE AG	13,356	86.550	1,155,961.800	
AVOLTA AG	12,933	36.700	474,641.100	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,433	1,237.500	4,248,337.500	
JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	53.060	1,703,968.840	
SWISS RE LTD	45,502	102.500	4,663,955.000	
BKW AG	3,194	141.800	452,909.200	
SIG GROUP AG	50,969	18.700	953,120.300	
ALCON INC	74,922	73.320	5,493,281.040	
SANDOZ GROUP AG	57,347	30.220	1,733,026.340	
UBS GROUP AG	503,306	26.790	13,483,567.740	
VAT GROUP AG	4,131	458.000	1,891,998.000	
スイス・フラン 小計	2,311,496		215,632,066.700 (36,756,642,090)	

スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	422,695	199.250	84,221,978.750	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	241,869	172.250	41,661,935.250	
	ERICSSON LM-B SHS	465,668	58.380	27,185,697.840	
	GETINGE AB-B SHS	38,925	235.400	9,162,945.000	
	LUNDBERGS B	14,872	561.000	8,343,192.000	
	SKF AB-B SHS	46,594	238.800	11,126,647.200	
	SANDVIK AB	169,218	229.500	38,835,531.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	250,203	151.650	37,943,284.950	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	201.600	8,857,699.200	
	SWEDBANK AB	132,581	219.000	29,035,239.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,795	165.150	15,325,094.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	97.900	21,425,023.400	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	287.000	6,944,826.000	
	VOLVO AB-B SHS	237,569	277.700	65,972,911.300	
	HOLMEN AB-B SHS	17,320	443.400	7,679,688.000	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	102.700	6,948,065.800	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	359.600	5,499,003.200	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	358.700	7,649,277.500	
	SAAB AB-B	47,156	224.000	10,562,944.000	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	112.450	8,555,758.250	
	INVESTOR AB-B SHS	271,548	280.000	76,033,440.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	169.350	17,725,695.150	
	ASSA ABLOY AB-B	153,368	304.400	46,685,219.200	
	TELIA CO AB	344,810	25.240	8,703,004.400	
	BOLIDEN AB	36,260	362.200	13,133,372.000	
	ALFA LAVAL AB	44,407	478.600	21,253,190.200	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	72.720	5,304,342.240	
	INDUTRADE AB	39,178	265.400	10,397,841.200	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	87.500	4,179,787.500	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	53.840	11,458,874.880	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	280.800	10,215,784.800	
	HEXAGON AB-B SHS	307,116	120.600	37,038,189.600	
	SAGAX AB	28,022	284.600	7,975,061.200	
EPIROC AB-A	103,115	212.000	21,860,380.000		
EPIROC AB-B	61,487	192.600	11,842,396.200		
ESSITY AB-B	99,980	277.400	27,734,452.000		
EQT AB	55,194	316.000	17,441,304.000		
VOLVO CAR AB	143,747	34.300	4,930,522.100		
BEIJER REF AB	50,493	163.550	8,258,130.150		
LIFCO AB	39,631	270.000	10,700,370.000		
EVOLUTION AB	28,266	1,231.000	34,795,446.000		
INVESTMENT AB LATOUR	27,638	280.500	7,752,459.000		
スウェーデン・クローナ 小計	4,953,655		868,356,003.710 (12,365,389,493)		

デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	15,167	936.000	14,196,312.000	
	A P MOLLER A/S	663	10,145.000	6,726,135.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	9,950.000	5,402,850.000	
	DANSKE BANK A/S	102,303	195.000	19,949,085.000	
	GENMAB A/S	9,783	2,012.000	19,683,396.000	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	54,795	414.200	22,696,089.000	
	ROCKWOOL AS	873	2,578.000	2,250,594.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	502,851	882.600	443,816,292.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	187.300	28,941,783.300	
	COLOPLAST-B	21,291	842.400	17,935,538.400	
	DSV A/S	28,190	1,016.500	28,655,135.000	
	DEMANT A/S	17,700	320.400	5,671,080.000	
	TRYG A/S	58,222	141.200	8,220,946.400	
	PANDORA A/S	12,473	1,112.000	13,869,976.000	
	SVITZER A/S	2,412	228.000	549,936.000	
ORSTED A/S	26,911	433.000	11,652,463.000		
デンマーク・クローネ 小計	1,008,698		650,217,611.700 (14,512,857,093)		
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	229,726	7.810	1,794,160.060	
	EBOS GROUP LTD	25,631	35.250	903,492.750	
	FISHER & PAYKEL	78,460	28.900	2,267,494.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	4.410	1,379,108.430	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.420	403,394.280	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.990	1,433,454.920	
ニュージーランド・ドル 小計	948,682		8,181,104.440 (759,697,358)		
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	193.150	14,122,741.700	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	70.060	15,496,010.920	
	TELENOR ASA	119,576	129.400	15,473,134.400	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	815.500	9,121,367.500	
	ORKLA ASA	116,068	80.700	9,366,687.600	
	EQUINOR ASA	129,895	305.650	39,702,406.750	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	320.800	9,436,011.200	
	AKER BP ASA	40,933	271.500	11,113,309.500	
	SALMAR ASA	12,897	663.500	8,557,159.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	180.900	4,652,928.900	
	DNB BANK ASA	143,909	203.000	29,213,527.000	
ノルウェー・クローネ 小計	923,898		166,255,284.970 (2,355,837,388)		
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	25,025	80.450	2,013,261.250	
	KINGSPAN GROUP PLC	24,704	88.100	2,176,422.400	
	UMICORE	33,545	22.420	752,078.900	
	AIR LIQUIDE	81,240	183.980	14,946,535.200	
	AIRBUS SE	90,775	158.860	14,420,516.500	
	AXA SA	279,056	32.640	9,108,387.840	

VEOLIA ENVIRONNEMENT	107,926	30.000	3,237,780.000	
ADIDAS AG	24,550	222.100	5,452,555.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	23.940	3,462,035.220	
DASSAULT AVIATION SA	3,120	203.600	635,232.000	
DANONE	96,532	58.720	5,668,359.040	
SAFRAN SA	52,883	208.800	11,041,970.400	
INTESA SANPAOLO	2,225,194	3.598	8,006,248.010	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	49,783	104.200	5,187,388.600	
ACCOR SA	31,427	41.610	1,307,677.470	
BOUYGUES	29,123	34.800	1,013,480.400	
BNP PARIBAS	160,893	69.600	11,198,152.800	
THALES SA	15,023	163.050	2,449,500.150	
CAPGEMINI SA	25,063	205.100	5,140,421.300	
LOTUS BAKERIES NV	77	9,420.000	725,340.000	
UNICREDIT SPA	235,573	36.090	8,501,829.570	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	127.800	1,585,103.400	
D'IETTEREN TRDG	2,736	216.800	593,164.800	
COMMERZBANK AG	158,792	14.190	2,253,258.480	
EIFFAGE	12,706	102.500	1,302,365.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	28.130	1,654,437.820	
PUBLICIS GROUPE	33,467	105.050	3,515,708.350	
IBERDROLA SA	939,014	11.895	11,169,571.530	
ENI SPA	332,847	14.968	4,982,053.890	
JERONIMO MARTINS	45,606	19.600	893,877.600	
KESKO OYJ-B	35,252	16.080	566,852.160	
KBC GROUPE	35,962	71.220	2,561,213.640	
HANNOVER RUECK SE	9,638	229.700	2,213,848.600	
WARTSILA OYJ	77,148	17.950	1,384,806.600	
L'OREAL	36,699	444.900	16,327,385.100	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	42,615	789.400	33,640,281.000	
GEA GROUP AG	25,513	37.280	951,124.640	
BOLLORE	114,808	6.120	702,624.960	
MEDIOBANCA SPA	86,792	13.970	1,212,484.240	
MICHELIN(CGDE) -B	98,359	37.130	3,652,069.670	
CONTINENTAL AG	17,635	63.640	1,122,291.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	151,735	38.590	5,855,453.650	
OMV AG	23,354	44.900	1,048,594.600	
VERBUND AG	10,663	71.500	762,404.500	
PERNOD-RICARD	30,948	145.650	4,507,576.200	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	49.600	1,156,225.600	
RENAULT SA	27,902	48.140	1,343,202.280	
REPSOL SA	195,049	14.480	2,824,309.520	
REMY COINTREAU	2,866	95.350	273,273.100	
MERCK KGAA	20,216	153.500	3,103,156.000	

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	69,501	78.400	5,448,878.400	
RWE AG	98,751	33.110	3,269,645.610	
SEB SA	2,596	114.300	296,722.800	
SOCIETE GENERALE-A	116,635	24.810	2,893,714.350	
VINCI S.A.	76,313	112.500	8,585,212.500	
SODEXO	12,910	81.900	1,057,329.000	
SOFINA	2,281	225.200	513,681.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	83,164	221.500	18,420,826.000	
VIVENDI SE	98,944	9.842	973,806.840	
SAP SE	161,215	174.360	28,109,447.400	
TELEFONICA S.A	755,720	4.282	3,235,993.040	
TOTALENERGIES SE	332,113	67.070	22,274,818.910	
E.ON SE	339,366	12.900	4,377,821.400	
VOEST-ALPINE AG	18,032	25.560	460,897.920	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	71.200	1,273,483.200	
SIEMENS AG-REG	116,150	180.140	20,923,261.000	
UPM-KYMMENE OYJ	77,973	34.120	2,660,438.760	
ING GROEP NV-CVA	510,410	16.128	8,231,892.480	
PUMA AG	17,210	45.230	778,408.300	
BAYER AG	147,329	28.485	4,196,666.560	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	12.985	1,246,300.300	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	79.420	1,921,249.220	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	123,737	73.300	9,069,922.100	
BASF SE	135,442	50.080	6,782,935.360	
BEIERSDORF AG	15,743	144.100	2,268,566.300	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	98.340	2,122,767.240	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	37.430	1,258,845.760	
ASM INTERNATIONAL NV	7,273	620.400	4,512,169.200	
ORANGE	286,957	10.425	2,991,526.720	
SAMPO OYJ-A SHS	70,999	37.660	2,673,822.340	
RANDSTAD NV	15,584	47.400	738,681.600	
ALLIANZ SE	61,413	272.500	16,735,042.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	3.576	1,807,457.010	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	28.260	4,144,809.420	
HERMES INTL	4,880	2,294.000	11,194,720.000	
ENDESA S.A.	50,946	17.590	896,140.140	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	6.822	741,189.830	
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	45.850	2,593,917.900	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	20,996	420.000	8,818,320.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	23.970	1,944,662.130	
DASSAULT SYSTEMES SA	101,597	38.030	3,863,733.910	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	38.680	1,347,456.480	
RHEINMETALL STAMM	6,662	528.800	3,522,865.600	

HEINEKEN NV	43,759	90.680	3,968,066.120	
AKZO NOBEL	26,032	64.280	1,673,336.960	
ASML HOLDING NV	62,104	854.200	53,049,236.800	
AEGON LTD	232,433	6.068	1,410,403.440	
VOLKSWAGEN AG	5,460	136.100	743,106.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	30,425	118.050	3,591,671.250	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	914,652	10.195	9,324,877.140	
KERING	11,443	329.850	3,774,473.550	
ACCIONA S.A.	5,005	116.200	581,581.000	
FORTUM OYJ	73,699	13.280	978,722.720	
AGEAS	24,086	44.320	1,067,491.520	
UCB SA	20,020	119.900	2,400,398.000	
NEMETSCHEK SE	10,222	84.100	859,670.200	
CARREFOUR SA	90,642	15.840	1,435,769.280	
NOKIA OYJ	827,068	3.462	2,863,309.410	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	121,772	24.810	3,021,163.320	
WOLTERS KLUWER-CVA	38,724	146.000	5,653,704.000	
SANOFI	174,457	91.880	16,029,109.160	
STMICROELECTRONICS NV	104,058	38.315	3,986,982.270	
ELISA OYJ	20,242	41.840	846,925.280	
BANCO SANTANDER SA	2,484,377	4.728	11,746,134.450	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	16.080	1,054,671.120	
QIAGEN N.V.	34,544	39.720	1,372,087.680	
DEUTSCHE BANK AG-REG	282,637	16.044	4,534,628.020	
BMW VORZUG	7,821	98.600	771,150.600	
ENEL SPA	1,241,600	6.384	7,926,374.400	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	501,748	21.720	10,897,966.560	
SARTORIUS AG	3,651	280.700	1,024,835.700	
LEONARDO SPA	64,915	21.460	1,393,075.900	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	197,936	36.385	7,201,901.360	
RATIONAL AG	860	826.000	710,360.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	7,150	99.650	712,497.500	
BECHTLE AG	14,521	45.980	667,675.580	
KONINKLIJKE KPN NV	496,095	3.371	1,672,336.240	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	56.720	1,306,715.360	
TELEPERFORMANCE	9,581	99.540	953,692.740	
DEUTSCHE BOERSE AG	28,751	187.050	5,377,874.550	
EURAZEO	5,673	85.350	484,190.550	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	71.300	921,053.400	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	75.150	1,329,403.500	
INDITEX	168,449	43.060	7,253,413.940	
ESSILORLUXOTTICA	45,265	204.800	9,270,272.000	
SNAM SPA	317,518	4.372	1,388,188.690	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	15.275	2,549,718.270	
ENAGAS	38,270	14.090	539,224.300	
TENARIS SA	76,002	15.860	1,205,391.720	

TELECOM ITALIA SPA	1,970,516	0.224	441,395.580	
TERNA SPA	207,655	7.524	1,562,396.220	
BIOMERIEUX	4,870	99.800	486,026.000	
GRIFOLS SA	31,982	9.286	296,984.850	
NESTE OYJ	66,248	22.110	1,464,743.280	
RECORDATI SPA	18,197	50.500	918,948.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	10.080	846,115.200	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	229.200	1,992,206.400	
KONE OYJ	49,300	48.090	2,370,837.000	
ELIA GROUP	4,078	96.450	393,323.100	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,801	208.200	999,568.200	
ENGIE	277,054	15.455	4,281,869.570	
ALSTOM	47,494	15.645	743,043.630	
IPSEN SA	5,964	115.200	687,052.800	
ARKEMA SA	10,489	101.700	1,066,731.300	
LEGRAND SA	41,105	97.160	3,993,761.800	
AMPLIFON SPA	20,249	33.850	685,428.650	
ADP	6,104	122.700	748,960.800	
ORION OYJ	13,559	36.110	489,615.490	
METSO CORPORATION	102,831	11.095	1,140,909.940	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	19.810	1,576,578.850	
SYMRISE AG	19,547	103.100	2,015,295.700	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39,869	43.800	1,746,262.200	
REXEL SA	33,916	26.840	910,305.440	
PRYSMIAN SPA	38,343	52.860	2,026,810.980	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	93.880	228,034.520	
CAIXABANK	569,844	4.937	2,813,319.820	
BUREAU VERITAS SA	39,729	27.980	1,111,617.420	
GETLINK	63,968	16.635	1,064,107.680	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	13.790	547,297.520	
AMADEUS IT GROUP SA	68,848	59.600	4,103,340.800	
BRENTAG SE	21,559	76.320	1,645,382.880	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	20.370	872,569.320	
EDENRED	35,618	46.270	1,648,044.860	
TALANX AG	10,349	71.700	742,023.300	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	84.080	1,001,813.200	
VONOVIA SE	107,478	28.670	3,081,394.260	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	10.735	1,762,214.660	
KNORR-BREMSE AG	10,342	69.600	719,803.200	
OCI NV	12,329	25.770	317,718.330	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	52.000	2,338,024.000	
FERRARI NV	19,594	378.800	7,422,207.200	
ASR NEDERLAND NV	27,365	47.980	1,312,972.700	
AIB GROUP PLC	226,914	5.165	1,172,010.810	
NORDEA BANK ABP	492,403	11.250	5,539,533.750	

LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	34.320	593,495.760	
MONCLER SPA	33,422	64.200	2,145,692.400	
NEXI SPA	83,576	5.682	474,878.830	
PROSUS NV	220,842	33.220	7,336,371.240	
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	85.020	1,561,902.420	
JDE PEET'S BV	14,385	20.540	295,467.900	
EXOR NV	14,142	102.100	1,443,898.200	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	20.000	1,497,840.000	
EURONEXT NV	14,077	85.350	1,201,471.950	
IMCD NV	9,332	145.350	1,356,406.200	
WORLDLINE SA	36,232	10.845	392,936.040	
NN GROUP NV	43,478	45.000	1,956,510.000	
FINECOBANK SPA	96,393	14.480	1,395,770.640	
ARGENX SE	9,078	366.600	3,327,994.800	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	125,611	29.230	3,671,609.530	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	83,468	40.980	3,420,518.640	
DSM-FIRMENICH AG	28,846	105.950	3,056,233.700	
EDP RENOVAVEIS SA-RTS	39,688	0.210	8,334.480	
SYENQO SA	11,217	95.640	1,072,793.880	
ZALANDO SE	31,321	26.510	830,319.710	
STELLANTIS NV	341,919	20.200	6,906,763.800	
FERROVIAL SE	73,817	35.520	2,621,979.840	
AENA SME SA	11,603	173.400	2,011,960.200	
CELLNEX TELECOM SAU	74,060	32.840	2,432,130.400	
BANCO BPM SPA	202,727	6.344	1,286,100.080	
ABN AMRO BANK NV	75,982	15.905	1,208,493.710	
SCOUT24 SE	10,048	71.400	717,427.200	
COVESTRO AG	27,558	49.220	1,356,404.760	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	136,318	56.540	7,707,419.720	
POSTE ITALIANE SPA	88,762	12.360	1,097,098.320	
AMUNDI SA	11,288	68.900	777,743.200	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.250	429,259.750	
ADYEN NV	3,378	1,215.000	4,104,270.000	
DELIVERY HERO SE	22,564	25.740	580,797.360	
ユーロ 小計	27,940,490		805,915,665.030 (134,233,313,167)	
香港・ドル				
HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	8.750	2,248,750.000	
CLP HOLDINGS LTD	241,796	63.700	15,402,405.200	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	45.150	4,213,127.100	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	183,491	266.000	48,808,606.000	
MTR CORP	207,441	27.150	5,632,023.150	
HANG SENG BANK LTD	122,096	106.000	12,942,176.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	24.500	7,300,314.000	

POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	44.950	9,566,259.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	25.500	5,151,000.000	
HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	6.160	9,464,260.960	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	37.200	12,532,828.800	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	24.250	16,502,003.750	
SINO LAND CO	659,200	8.620	5,682,304.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	75.200	15,383,288.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	68.800	3,647,776.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	111.800	24,054,440.800	
AIA GROUP LTD	1,778,516	61.250	108,934,105.000	
HKT TRUST / HKT LTD	797,136	9.030	7,198,138.080	
SANDS CHINA LTD	335,800	19.980	6,709,284.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	19.500	2,730,000.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	15.860	3,197,376.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	24.400	6,249,694.000	
ESR GROUP LTD	465,200	9.870	4,591,524.000	
WH GROUP LTD	1,001,000	5.750	5,755,750.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	39.600	14,630,022.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	34.350	9,143,798.250	
香港・ドル 小計	11,114,703		367,671,254.090 (7,283,567,544)	
合計	166,316,165		1,412,984,929,396 (1,412,984,929,396)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年5月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル 小計		2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券	合計		2,968	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,157,762.340	
		GOODMAN GROUP	255,895.000	8,797,670.100	
		GPT GROUP	349,447.000	1,474,666.340	
		MIRVAC GROUP	700,332.000	1,456,690.560	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,657,961.880	
		STOCKLAND	369,843.000	1,693,880.940	
	VICINITY CENTRES	545,645.000	1,058,551.300		
オーストラリア・ドル 小計		3,210,605.000	18,297,183.460 (1,866,861,629)		

シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,511,483.520		
	CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,576,581.240		
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	644,776.000		
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	502,820.000		
シンガポール・ドル 小計		2,277,909.000	4,235,660.760 (484,347,808)		
投資信託受益証券 合計		5,488,514	2,351,209,437 (2,351,209,437)		
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,823.000	3,210,981.330	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,859,787.650	
		AMERICAN TOWER CORP	71,260.000	12,918,012.800	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,575,383.320	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,518.000	4,215,161.020	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,473.000	1,489,426.780	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,786,037.490	
		CROWN CASTLE INC	67,799.000	6,518,873.850	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	45,607.000	6,596,140.410	
		EQUINIX INC	14,804.000	10,538,523.480	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,719,270.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	3,608,736.800	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,549,129.310	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	34,180.000	4,897,994.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	41,252.000	1,823,338.400	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,133.000	1,730,553.600	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	2,066,968.800	
		INVITATION HOMES INC	96,467.000	3,374,415.660	
		IRON MOUNTAIN INC	43,616.000	3,384,601.600	
		KIMCO REALTY	95,524.000	1,814,000.760	
		MID AMERICA	17,537.000	2,388,364.030	
		PROLOGIS INC	142,980.000	15,407,524.800	
		PUBLIC STORAGE	24,573.000	6,713,343.600	
		REALTY INCOME CORP	129,955.000	7,150,124.100	
		REGENCY CENTERS CORP	27,176.000	1,615,341.440	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	16,539.000	3,241,644.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	48,901.000	7,234,902.950			
SUN COMMUNITIES INC	18,509.000	2,156,298.500			
UDR INC	50,449.000	1,965,997.530			
VENTAS INC	60,757.000	2,863,477.410			
VICI PROPERTIES INC	152,711.000	4,512,610.050			

	WELLTOWER INC	86,083.000	8,389,649.180	
	WEYERHAEUSER CO	114,764.000	3,540,469.400	
	WP CAREY INC	32,996.000	1,906,178.920	
アメリカ・ドル	小計	1,947,147.000	146,763,262.970 (22,740,967,598)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	833,033.420	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,461,957.330	
イギリス・ポンド	小計	286,426.000	2,294,990.750 (444,447,909)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	391,792.240	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	254,439.360	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	646,231.600 (72,901,387)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	247,626.080	
	GECINA SA	8,697.000	869,700.000	
	KLEPIERRE	36,407.000	924,737.800	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	18,477.000	1,472,986.440	
	WAREHOUSES DE PAUW	31,043.000	816,430.900	
ユーロ	小計	99,690.000	4,331,481.220 (721,451,512)	
香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	14,292,542.600	
香港・ドル	小計	410,116.000	14,292,542.600 (283,135,269)	
投資証券	合計	2,766,525	24,262,903,675 (24,262,903,675)	
合計			26,614,113,112 (26,614,113,112)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証 券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証 券 時価比 率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 590銘柄 投資証券 34銘柄	71.61	-	-	-	75.54
イギリス・ポンド	株式 81銘柄 投資証券 2銘柄	4.05	-	-	0.03	4.21
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	-	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式 51銘柄 投資信託受益証 券 7銘柄	1.83	-	0.13	-	2.02

カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.15	-	-	-	3.26
	新株予約権証券	1銘柄	-	0.00	-	-	
	投資証券	2銘柄	-	-	-	0.00	
シンガポール・ドル	株式	15銘柄	0.29	-	-	-	0.33
	投資信託受益証券	4銘柄	-	-	0.03	-	
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.47	-	-	-	2.55
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	0.83	-	-	-	0.86
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.98	-	-	-	1.01
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.05	-	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.16	-	-	-	0.16
ユーロ	株式	218銘柄	9.03	-	-	-	9.37
	投資証券	5銘柄	-	-	-	0.05	
香港・ドル	株式	26銘柄	0.49	-	-	-	0.53
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.02	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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10期中間計算期間(2024年5月9日から2024年11月8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】

【動的パッケージファンド<DC年金>】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第9期 2024年5月8日現在	第10期中間計算期間末 2024年11月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	202,934,166	258,411,769
親投資信託受益証券	689,536,372	682,256,835
流動資産合計	892,470,538	940,668,604
資産合計	892,470,538	940,668,604
負債の部		
流動負債		
未払解約金	934,923	2,449,867
未払受託者報酬	139,628	148,697
未払委託者報酬	2,607,250	2,776,669
その他未払費用	16,476	17,551
流動負債合計	3,698,277	5,392,784
負債合計	3,698,277	5,392,784
純資産の部		
元本等		
元本	797,264,658	829,494,377
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	91,507,603	105,781,443
(分配準備積立金)	306,064,972	288,826,159
元本等合計	888,772,261	935,275,820
純資産合計	888,772,261	935,275,820
負債純資産合計	892,470,538	940,668,604

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第9期中間計算期間 自 2023年5月9日 至 2023年11月8日	第10期中間計算期間 自 2024年5月9日 至 2024年11月8日
営業収益		
受取利息	380	160,999
有価証券売買等損益	20,725,532	13,420,463
その他収益	463	2,734
営業収益合計	20,726,375	13,584,196
営業費用		
支払利息	14,965	-
受託者報酬	131,156	148,697
委託者報酬	2,449,285	2,776,669
その他費用	15,486	17,551
営業費用合計	2,610,892	2,942,917
営業利益又は営業損失()	18,115,483	10,641,279
経常利益又は経常損失()	18,115,483	10,641,279
中間純利益又は中間純損失()	18,115,483	10,641,279
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()	832,754	330,488
期首剰余金又は期首欠損金()	21,508,081	91,507,603
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,472,639	9,269,914
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	3,472,639	9,269,914
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,193,092	5,306,865
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,193,092	5,306,865
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()	41,070,357	105,781,443

(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10期中間計算期間	
	自 2024年5月9日	至 2024年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第9期	第10期中間計算期間末
	2024年5月8日現在	2024年11月8日現在
1. 期首元本額	741,569,764円	797,264,658円
期中追加設定元本額	135,078,320円	78,399,832円
期中一部解約元本額	79,383,426円	46,170,113円
2. 受益権の総数	797,264,658口	829,494,377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9期	第10期中間計算期間末
	2024年5月8日現在	2024年11月8日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第9期 2024年5月8日現在	第10期中間計算期間末 2024年11月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1148円 (11,148円)	1.1275円 (11,275円)

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年11月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,403,989,368
国債証券	445,491,394,950
地方債証券	26,104,109,467
特殊債証券	25,467,665,628
社債証券	21,687,751,600
未収入金	403,435,000
未収利息	829,349,690
前払費用	112,877,187
流動資産合計	521,500,572,890
資産合計	521,500,572,890
負債の部	
流動負債	
未払解約金	871,016,000
流動負債合計	871,016,000
負債合計	871,016,000
純資産の部	
元本等	
元本	429,830,578,911
剰余金	
剰余金又は欠損金()	90,798,977,979
元本等合計	520,629,556,890
純資産合計	520,629,556,890
負債純資産合計	521,500,572,890

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5月9日 至 2024年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月8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	455,201,238,597円
同期中追加設定元本額	353,283,292,957円
同期中一部解約元本額	378,653,952,643円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	31,373,012,219円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	45,165,322円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	86,633,261円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	47,590,569円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	590,059,079円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	248,774,585円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	29,071,504円
たわらノーロード 国内債券	20,443,205,390円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	7,640,192,766円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,743,957,115円
たわらノーロード バランス(標準型)	3,801,402,291円
たわらノーロード バランス(積極型)	578,921,939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)	237,967,492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)	2,546,062,435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)	3,145,391,209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)	977,086,928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)	52,974,087円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	23,873,565円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	202,491,401円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	8,523,040円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	62,284円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	16,586円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	109,815円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,639,395,629円
Oneグローバルバランス	256,136,176円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	12,388,526,666円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	18,599,462,773円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	8,738,853,966円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,506,393,761円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,835,357,796円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	551,401,393円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	91,596,262円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,507,090,002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
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	5,838,300,641円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	2,665,925,969円
D I A M D C 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	69,272,974,770円
クルーズコントロール	577,675,383円
投資のソムリエ<DC年金>	8,418,935,155円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	8,421,912,158円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	3,105,179,998円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	11,425,285,323円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	31,247,220,743円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	612,024,536円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	324,682,134円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	113,992,860円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,971,762,104円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,652,991,225円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	11,215,608,577円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,778,526,734円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	712,813,638円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	352,788,874円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	214,013,052円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,531,418,335円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	56,398,565円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	179,209,850円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	386,378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)	1,192,459,136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)	1,196,656,314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)	776,829,743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)	720,541,220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)	1,177,307,466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)	3,042,305,086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)	2,025,958,023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)	831,102,079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)	2,056,745,622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)	1,323,819,551円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,899,818,461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)	1,349,837,669円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,240,522,105円
A M O n eマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	199,558,776円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	260,847,236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)	2,814,592,645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)	2,817,341,321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)	2,797,674,886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)	1,988,321,960円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(F O F s 用)(適格機関投資家専用)	35,598,082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)	470,587,299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)	136,996,795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)	95,203,714円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	23,018,646円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	56,348,275円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	28,916,994円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	413,820円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,149,272円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,178,840円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,338,246,445円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,126,141,437円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,415,881,629円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	52,053,665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)	126,419,725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)	1,369,726,883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)	94,300,340円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	609,852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)	1,059,291,784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)	27,564,747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)	164,114,500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)	233,026,915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)	612,676,262円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	203,803,361円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	49,924,108円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	77,213,508円
動的パッケージファンド<DC年金>	272,461,937円
コア資産形成ファンド	122,478,346円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	16,168,556,693円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	29,261,840,768円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	23,149,683,063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]	130,228,505円
計	429,830,578,911円
2. 受益権の総数	429,830,578,911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11月8日現在
----	--------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短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。

(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11月8日現在
1口当たり純資産額	1,2112円
(1万口当たり純資産額)	(12,112円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年11月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	720,057,130
コール・ローン	1,221,980,366
国債証券	263,156,043,794
派生商品評価勘定	217,363
未収入金	505,881,667
未収利息	2,046,590,121
前払費用	312,826,160
流動資産合計	267,963,596,601
資産合計	267,963,596,601
負債の部	
流動負債	
未払金	222,517,164
未払解約金	736,393,000
流動負債合計	958,910,164
負債合計	958,910,164
純資産の部	
元本等	
元本	109,689,418,811
剰余金	
剰余金又は欠損金()	157,315,267,626
元本等合計	267,004,686,437
純資産合計	267,004,686,437
負債純資産合計	267,963,596,601

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年5月9日 至 2024年11月8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11月8日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	107,187,363,672円
同期中追加設定元本額	24,058,949,408円
同期中一部解約元本額	21,556,894,269円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,593,726,593円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	1,442,849円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	10,043,801円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	29,393,532円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	18,834,911円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	28,673,317円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	17,956,082円
たわらノーロード 先進国債券	22,957,110,131円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,970,654,259円
たわらノーロード バランス（堅実型）	73,472,516円
たわらノーロード バランス（標準型）	457,866,696円
たわらノーロード バランス（積極型）	115,444,774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）	22,065,916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）	1,083,514,662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）	2,082,737,073円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	1,122,443,892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）	641,889,286円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,501,623円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	14,033,378円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	194,180,238円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	33,806,916円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	30,072,525円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	4,297円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	4,355円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	4,058円

DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	7,001,827,827円
One DC 先進国債券インデックスファンド	2,334,316,242円
Oneグローバルバランス	136,686,465円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	763,420,740円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,642,102,545円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,251,181,357円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	361,388,583円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	816,699,062円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	809,964,193円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,995,201円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	955,746,909円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,942,671円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	155,013,865円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	167,564,257円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	282,592,662円
クルーズコントロール	439,465,948円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	225,130,824円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,126,047,080円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	962,747,670円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	184,326,782円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	708,406,951円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	5,085,141円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	53,578,605円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	846,010,552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)	312,012,143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)	313,342,461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)	75,102,637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)	188,643,891円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	544,565円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	796,151,510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)	231,539,207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)	217,503,388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)	255,429,133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)	516,856,473円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,828,158,683円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,361,904,531円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,508,507,510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)	25,596,990円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	39,330,400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)	520,216,787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)	271,732,662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)	188,877,820円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,408,433円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	18,615,122円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,731,063円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	51,369円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,560,970円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,032,102円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,013,988,880円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,141,611,485円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,188,610,132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)	43,010,029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)	87,729,490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)	908,727,940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)	172,003,888円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	151,290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)	131,202,162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)	115,801,649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)	242,973,960円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	30,714,543円
動的パッケージファンド<DC年金>	51,133,009円
コア資産形成ファンド	23,202,611円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジなし)<ラップ専用>	2,410,109,257円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジあり)<ラップ専用>	12,726,188,631円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5,548,468,510円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	5,388,821,683円
計	109,689,418,811円
2. 受益権の総数	109,689,418,811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11月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年11月8日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	244,938,000	-	244,720,637	217,363
オフショア・人民元	244,938,000	-	244,720,637	217,363
合計	244,938,000	-	244,720,637	217,363

（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）

	2024年11月8日現在
1口当たり純資産額	2,4342円
（1万口当たり純資産額）	（24,342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11月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,453,349,346
株式	567,543,356,810
派生商品評価勘定	255,122,620
未収入金	2,310,000
未収配当金	5,641,227,273
差入委託証拠金	756,564,537
流動資産合計	580,651,930,586
資産合計	580,651,930,586
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,790,790
前受金	217,070,000
未払金	6,992,615,742
未払解約金	935,375,000
流動負債合計	8,147,851,532
負債合計	8,147,851,532
純資産の部	
元本等	
元本	117,083,189,191
剰余金	
剰余金又は欠損金()	455,420,889,863
元本等合計	572,504,079,054
純資産合計	572,504,079,054
負債純資産合計	580,651,930,586

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5月9日 至 2024年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月8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	125,832,649,128円
同期中追加設定元本額	17,148,183,021円
同期中一部解約元本額	25,897,642,958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	2,346,976,884円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	5,783,221,400円
One DC 国内株式インデックスファンド	34,211,058,641円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,562,916,554円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,880,069円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,826,598円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	18,232,883円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	24,549,767円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,316,470円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,142,104円
たわらノーロード TOPIX	3,386,737,820円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,041,837,743円
たわらノーロード バランス(堅実型)	50,204,440円
たわらノーロード バランス(標準型)	410,173,672円
たわらノーロード バランス(積極型)	762,899,601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)	2,587,909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)	143,269,351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)	448,903,885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)	412,838,413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)	623,564,951円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	305,467円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,231,972円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	28,097,011円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	7,396,624円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	16,924,488円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	26,773円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	641,815円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	682,202円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,038,711,904円
Oneグローバルバランス	98,947,338円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	923,187,999円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,317,814,943円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,081,426,705円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	246,054,078円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	850,785,541円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,016,613,423円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,371,271円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	971,013,845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)	261,301,268円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	325,830,834円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	590,684,229円
投資のソムリエ	2,473,288,931円
クルーズコントロール	145,263,277円
投資のソムリエ<DC年金>	300,921,648円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	377,997,580円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,439,609,826円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	100,442,537円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	275,105,940円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	62,247,125円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	32,999,642円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,001,254円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	141,859,221円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	652,782,386円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	94,767,468円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	231,396,530円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	48,511,611円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	35,891,411円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	21,752,079円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	730,547,785円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	5,736,185円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,036,574円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	29,872,383円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	39,577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)	2,648,223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)	2,635,121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)	778,172円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	1,524,526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)	7,979,560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)	6,494,577円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	49,360,407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)	1,809,480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)	37,841,316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)	347,888,936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)	7,822,378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)	351,627,162円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	44,344,377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)	1,959,566円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	20,085,364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)	26,977,294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)	4,206,206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)	1,272,008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)	28,891,994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)	60,271,226円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,495,403円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,504,811円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,926,650円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	78,522円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	531,194円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,548,216円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	221,828,423円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	358,648,257円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,117,575,077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)	8,780,478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)	12,791,344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)	115,317,037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)	23,868,085円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	51,527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)	100,521,647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)	6,976,880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)	20,761,116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)	44,206,308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)	92,190,207円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	15,686,572円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	5,414,631円
動的パッケージファンド<DC年金>	18,363,560円
コア資産形成ファンド	8,304,945円
MHAMトピックスファンド	762,460,597円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	42,945,117円

MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,989,870,327円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,566,048,372円
計	117,083,189,191円
2. 受益権の総数	117,083,189,191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11月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2024年11月8日現在			評価損益(円)
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	
市場取引 先物取引 買建	12,072,570,000	-	12,325,050,000	252,480,000
合計	12,072,570,000	-	12,325,050,000	252,480,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年11月8日現在
1口当たり純資産額	4.8897円
(1万口当たり純資産額)	(48,897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11月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	14,586,177,282
コール・ローン	448,415,310
株式	1,661,004,638,661
投資信託受益証券	2,359,484,248
投資証券	29,450,989,391
派生商品評価勘定	744,972,272
未収入金	46,995,647
未収配当金	833,501,053
差入委託証拠金	14,164,944,778
流動資産合計	1,723,640,118,642
資産合計	1,723,640,118,642
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,582,822
未払解約金	361,400,000
流動負債合計	438,982,822
負債合計	438,982,822
純資産の部	
元本等	
元本	171,536,806,483
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,551,664,329,337
元本等合計	1,723,201,135,820
純資産合計	1,723,201,135,820
負債純資産合計	1,723,640,118,642

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5月9日 至 2024年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月8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	165,095,497,021円
同期中追加設定元本額	26,335,122,924円
同期中一部解約元本額	19,893,813,462円

元本の内訳

ファンド名

D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,894,649,478円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,289,973円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	6,434,215円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	15,631,666円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	16,837,137円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	18,355,246円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	9,548,493円
たわらノーロード 先進国株式	70,293,715,122円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,910,005,224円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,012,630,649円
たわらノーロード バランス(堅実型)	72,624,653円
たわらノーロード バランス(標準型)	770,847,881円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,147,972,331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)	39,885,866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)	239,453,783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)	266,474,690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)	486,485,683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)	239,884円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	13,788,904円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,104,193円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	15,468,077円
たわらノーロード 全世界株式	6,614,548,724円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	12,329円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	161,001円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	140,281円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	58,364,451,302円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3,718,022,395円
O n eグローバルバランス	47,595,766円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	120,820,128円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	666,980,385円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	975,921,982円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	60,125,463円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	181,639,812円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	201,696,199円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	15,733,125円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	602,328,460円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	111,796,003円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	132,917,279円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	166,675,054円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	296,171,366円
投資のソムリエ	3,399,100,588円
クルーズコントロール	36,822,047円
投資のソムリエ<DC年金>	413,486,578円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	190,140,944円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	340,664,443円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	254,456,386円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	695,689,405円
ワールドアセットバランス(基本コース)	77,842,187円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	223,633,830円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	67,476,486円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	35,798,075円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,537,096円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	189,226,233円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	160,633,210円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	367,957,941円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	115,557,811円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	73,447,063円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	38,895,015円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	23,595,487円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	184,674,518円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,217,652円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	27,577,985円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	43,433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)	7,803,639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)	7,834,884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)	12,584,665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)	4,710,620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)	19,868,832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)	4,566,112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)	5,429,708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)	6,123,376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)	12,905,222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)	444,233,854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)	14,243,024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)	968,286,827円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,039,660,120円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	60,979,002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)	448,456円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	4,189,934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)	13,006,551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)	1,749,378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)	14,073,898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)	29,363,040円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,215,777円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,947,600円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	712,453円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	25,595円

D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	258,807円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,131,773円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	72,020,539円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	152,891,634円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	544,482,463円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	21,447,499円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	18,745,499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)	112,548,099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)	3,870,322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)	113,221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)	32,639,621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)	3,398,714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)	10,113,527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)	14,393,590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)	45,356,233円
動的パッケージファンド<DC年金>	13,736,292円
コア資産形成ファンド	6,225,715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>	2,707,596,841円
MHAM外国株式インデックスファンド	129,494,794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>	965,482,229円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,487,933,998円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,071,069,062円
計	171,536,806,483円
2. 受益権の総数	171,536,806,483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11月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年11月8日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	656,344,798	-	656,363,666	18,868	
イギリス・ポンド	525,573,700	-	525,582,628	8,928	
オーストラリア・ドル	20,658,872	-	20,660,172	1,300	
カナダ・ドル	8,982,160	-	8,982,248	88	
ユーロ	21,840,786	-	21,842,330	1,544	
ユーロ	79,289,280	-	79,296,288	7,008	
合計	656,344,798	-	656,363,666	18,868	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2024年11月8日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建					
	30,185,691,952	-	30,853,062,534	667,370,582	
合計	30,185,691,952	-	30,853,062,534	667,370,582	

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年11月8日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	10.0457円 (100,457円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年11月29日現在

資産総額	927,867,654円
負債総額	612,964円
純資産総額(-)	927,254,690円
発行済数量	828,463,199口
1口当たり純資産額(/)	1.1192円

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産総額	534,206,988,526円
負債総額	12,626,410,000円
純資産総額(-)	521,580,578,526円
発行済数量	431,794,069,961口
1口当たり純資産額(/)	1.2079円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産総額	269,519,394,577円
負債総額	511,040,246円
純資産総額(-)	269,008,354,331円
発行済数量	112,054,728,900口
1口当たり純資産額(/)	2.4007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11月29日現在

資産総額	577,378,726,218円
負債総額	705,949,089円
純資産総額(-)	576,672,777,129円
発行済数量	120,626,494,418口
1口当たり純資産額(/)	4.7806円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産総額	1,756,651,141,936円
負債総額	1,934,413,628円
純資産総額(-)	1,754,716,728,308円
発行済数量	176,955,901,760口
1口当たり純資産額(/)	9.9161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、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11月29日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2024年11月29日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見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11月29日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,516,988,622,283
追加型株式投資信託	758	17,219,132,752,149
単位型公社債投資信託	22	35,192,723,676
単位型株式投資信託	194	1,045,153,503,499
合計	1,000	19,816,467,601,607

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「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282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第40期中間会計期間（自2024年4月1日至2024年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	33,770	41,183
金銭の信託	29,184	28,143
未収委託者報酬	16,279	19,018
未収運用受託報酬	3,307	3,577
未収投資助言報酬	283	315
未収収益	15	6
前払費用	1,129	1,510
その他	2,377	2,088
流動資産計	86,346	95,843
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 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
関係会社株式	182	184
長期差入保証金	5,810	4,447
繰延税金資産	775	768
繰延税金資産	2,895	3,406
その他	104	128
固定資産計	15,918	14,524
資産合計	102,265	110,368

（単位：百万円）

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,481	1,982
リース債務	1	1
未払金	7,246	8,970
未払収益分配金	0	1
未払償還金	-	0
未払手数料	7,005	8,246
その他未払金	240	721
未払費用	7,716	8,616
未払法人税等	1,958	3,676
未払消費税等	277	1,497
賞与引当金	1,730	1,927
役員賞与引当金	48	52
流動負債計	20,460	26,725
固定負債		
リース債務	6	4
退職給付引当金	2,654	2,719
時効後支払損引当金	108	73
固定負債計	2,769	2,796
負債合計	23,230	29,521
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	57,481	59,294
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	57,358	59,170
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	25,678	27,490
株主資本計	79,034	80,846
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等計	0	0
純資産合計	79,034	80,846
負債・純資産合計	102,265	110,368

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

（単位：百万円）

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

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

重要な会計方針

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

6. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

(2) 運用受託報酬

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

(3) 投資助言報酬

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

(4) 成功報酬

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

注記事項**（貸借対照表関係）**

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（百万円）

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

（損益計算書関係）

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

（百万円）

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

2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

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

（株主資本等変動計算書関係）

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

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

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

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第38期（2023年3月31日現在）

（百万円）

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

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

第39期（2024年3月31日現在）

（百万円）

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

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

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

(百万円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

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

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

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

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

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

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（持分法損益等）

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

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

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

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

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

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

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第40期中間会計期間末 (2024年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		30,451
有価証券		0
金銭の信託		31,850
未収委託者報酬		19,361
未収運用受託報酬		3,548
未収投資助言報酬		315
未収収益		9
前払費用		1,538
その他		2,282
	流動資産計	89,360
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	888
器具備品	1	146
リース資産	1	4
建設仮勘定		0
無形固定資産		
ソフトウェア		3,011
ソフトウェア仮勘定		1,111
電話加入権		0
投資その他の資産		
投資有価証券		183
関係会社株式		3,840
長期差入保証金		764
繰延税金資産		3,085
その他		150
	固定資産計	13,188
資産合計		102,548

（単位：百万円）

	第40期中間会計期間末 (2024年9月30日現在)	
(負債の部)		
流動負債		
預り金		552
リース債務		1
未払金		8,577
未払収益分配金		0
未払償還金		0
未払手数料		8,466
その他未払金		108
未払費用		7,321
未払法人税等		3,650
未払消費税等	2	1,191
契約負債		7
賞与引当金		916
役員賞与引当金		28
	流動負債計	22,247
固定負債		
リース債務		3
退職給付引当金		2,720
時効後支払損引当金		64
	固定負債計	2,787
	負債合計	25,035
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		19,552
資本準備金		2,428
その他資本剰余金		17,124
利益剰余金		55,960
利益準備金		123
その他利益剰余金		55,837
別途積立金		31,680
繰越利益剰余金		24,157
	株主資本計	77,513
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		0
	評価・換算差額等計	0
	純資産合計	77,513
	負債・純資産合計	102,548

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	55,266	
運用受託報酬	8,186	
投資助言報酬	1,200	
その他営業収益	13	
		営業収益計 64,667
営業費用		
支払手数料	24,284	
広告宣伝費	157	
公告費	0	
調査費	18,581	
調査費	6,728	
委託調査費	11,853	
委託計算費	278	
営業雑経費	355	
通信費	19	
印刷費	234	
協会費	33	
諸会費	29	
支払販売手数料	39	
		営業費用計 43,658
一般管理費		
給料	5,154	
役員報酬	89	
給料・手当	5,002	
賞与	63	
交際費	27	
寄付金	5	
旅費交通費	105	
租税公課	298	
不動産賃借料	583	
退職給付費用	210	
固定資産減価償却費	1 790	
福利厚生費	29	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	916	
役員賞与引当金繰入額	28	
機器リース料	0	
事務委託費	1,607	
事務用消耗品費	19	
器具備品費	0	
諸経費	154	
		一般管理費計 9,933
営業利益		11,075

（単位：百万円）

	第40期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	2	
受取配当金	448	
時効成立分配金・償還金	0	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	2	
雑収入	6	
時効後支払損引当金戻入額	7	
	営業外収益計	494
営業外費用		
早期割増退職金	6	
	営業外費用計	6
経常利益		11,563
特別損失		
固定資産除却損	3	
関係会社株式評価損	31	
	特別損失計	35
税引前中間純利益		11,528
法人税、住民税及び事業税		3,685
法人税等調整額		320
法人税等合計		4,006
中間純利益		7,522

(3) 中間株主資本等変動計算書

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490
当中間期変動額							
剰余金の配当							10,855
中間純利益							7,522
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	3,333
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,157

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	59,294	80,846	0	0	80,846
当中間期変動額					
剰余金の配当	10,855	10,855			10,855
中間純利益	7,522	7,522			7,522
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)			0	0	0
当中間期変動額 合計	3,333	3,333	0	0	3,333
当中間期末残高	55,960	77,513	0	0	77,513

重要な会計方針

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

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第40期中間会計期間末 (2024年9月30日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 ... 685百万円 器具備品 ... 609百万円 リース資産 ... 4百万円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

項目	第40期中間会計期間 (自2024年4月1日至2024年9月30日)
1.減価償却実施額	有形固定資産 ... 76百万円 無形固定資産 ... 713百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金（財 産）の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2024年3月15日 みなし株主総会	普通株式	575	14,390	2024年4月1日	2024年4月1日
	A種種類 株式				
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類 株式				

会社法第319条第1項に基づき、2024年3月15日に決議があったものとみなされた株主総会での配当決議は当社の子会社であったAsset Management One USA Inc.（以下「AM-One USA」という）の全株式の現物配当であります。

本現物配当は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）の子会社である米州みずほLLC（以下「米州みずほ」という）が、2024年10月1日に米国外国銀行規制上の中間持株会社へ移行することに伴う規制上の対応として実施したものです。

当社が100%保有していたAM-One USAの議決権は、本現物配当後、米州みずほが議決権の51%を、第一生命ホールディングス株式会社（以下「DL」という）が議決権の49%をそれぞれ保有します。当社を通じてMHFGとDLが間接的に保有していたAM-One USA株式の議決権比率と同等となります。

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

（金融商品関係）

第40期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2024年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 有価証券	0	0	-
(2) 金銭の信託	31,850	31,850	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	0	0	-
資産計	31,852	31,852	-

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	0	-	0
金銭の信託	-	31,850	-	31,850
投資有価証券				
其他有価証券	-	0	-	0
資産計	-	31,852	-	31,852

（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

有価証券

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。

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（銀行預金・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せん。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券（その他有価証券）	
非上場株式	182
関係会社株式	
非上場株式	3,840

（有価証券関係）

第40期中間会計期間末
(2024年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額3,840百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

区分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

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

（持分法損益等）

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2024年4月1日から2024年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	57,453百万円
資産合計	57,453百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	1,750百万円
負債合計	1,750百万円
純資産	55,702百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額45,734百万円及び顧客関連資産の金額15,385百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	3,629百万円
経常利益	3,629百万円
税引前中間純利益	3,629百万円
中間純利益	3,101百万円
1株当たり中間純利益	77,541円29銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額1,723百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第40期中間会計期間
(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

委託者報酬	55,266百万円
運用受託報酬	8,186百万円
投資助言報酬	1,200百万円
成功報酬	- 百万円
その他営業収益	13百万円
合計	64,667百万円

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第40期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,937,834円09銭
1株当たり中間純利益金額	188,050円89銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
中間純利益金額	7,522百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,522百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

委託会社は2024年12月25日付でPayPayアセットマネジメント株式会社実施した第三者割当増資を引き受け、同社への出資比率が23.4%から49.9%に引き上がりました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。

(注) 資本金の額は2024年3月末日現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産を保管・管理し、受益権設定にかかる振替機関への通知等を行います。

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受け付けならびに収益分配金の再投資、償還金および一部解約金の支払い等を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法
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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2024年7月12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」に掲げられている動的パッケージファンド<DC年金>の2023年5月9日から2024年5月8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、動的パッケージファンド<DC年金>の2024年5月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第40期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年1月10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

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」に掲げられている動的パッケージファンド<DC年金>の2024年5月9日から2024年11月8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、動的パッケージファンド<DC年金>の2024年11月8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5月9日から2024年11月8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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。