

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券報告書  
**【提出先】** 関東財務局長殿  
**【提出日】** 2025年2月10日提出  
**【計算期間】** 第7期（自 2023年11月14日 至 2024年11月11日）  
**【ファンド名】** リスクコントロール世界資産分散ファンド  
**【発行者名】** アセットマネジメントOne株式会社  
**【代表者の役職氏名】** 取締役社長 杉原 規之  
**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号  
**【事務連絡者氏名】** 積木 利浩  
**【連絡場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号  
**【電話番号】** 03-6774-5100  
**【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

当ファンドの信託金限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>

## 1 国内外の8資産に分散投資を行い、中長期的に安定的なリターンの獲得をめざします。

●主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)の8資産にマザーファンド\*1を通じて投資します。\*2\*3

\*1 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド

\*2 一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

\*3 有価証券指数等先物等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)へ直接投資する場合があります。

また、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

## 2 基本資産配分によるポートフォリオの変動リスク\*1を年率2%程度\*2に抑えた安定的な運用をめざします。

●各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産の収益率のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度となるよう最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

●通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

\*1 価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

\*2 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

### 3 基準価額の下落を一定水準(下値目安値\*1)までに抑えることをめざします。

●基本配分比率をもとに分散投資を行いつつ、基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率\*2を機動的に変更します。

下値目安値は、過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

\*1 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)

\*2 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

### 4 年1回決算を行います。

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

#### 運用プロセス

##### 基本配分比率の決定

資産価格に影響を与える「変動要因」および各資産の「トレンド」を勘案し、基本配分比率を決定します。  
基本配分比率は月次で見直します。  
※基本配分比率の決定にあたっては、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。

##### 合計資産比率の機動的な変更

基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に機動的に合計資産比率を変更します。  
下値目安値は毎営業日決定します。

## リスクを抑えるための2つの運用手法により、安定的なリターンをめざします。



当ファンドでは、投資対象資産である国内外の8資産に対して、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目した分散投資を行うことで、特定の要因で大きく基準価額が変動するリスクを回避し、変動を抑えて運用を行うことをめざします。

### 投資対象資産

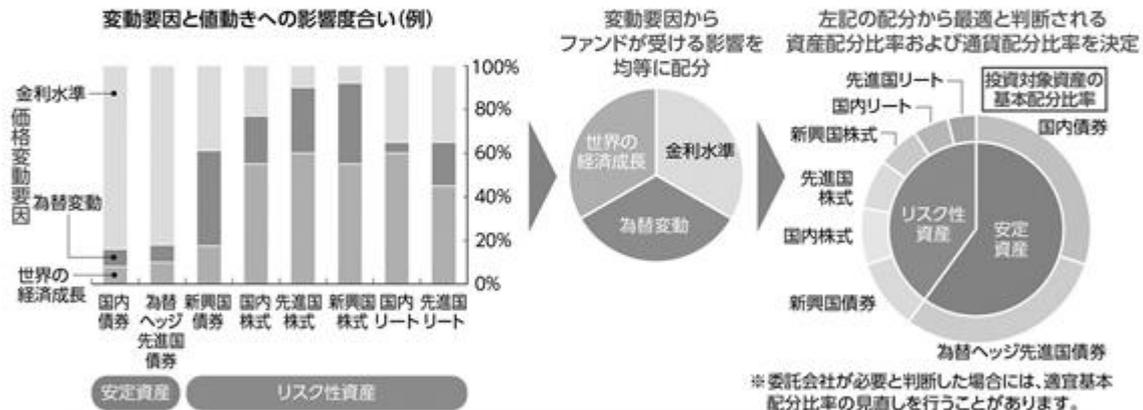
	安定資産			リスク性資産
	国内	先進国	新興国	
債券	国内債券	為替ヘッジ先進国債券	新興国債券	
株式	国内株式	先進国株式	新興国株式	
リート	国内リート	先進国リート		

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

### 当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

資産価格に影響を与える変動要因を判定し、変動要因の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産のトレンドを勘案した上で、基準価額の変動が小さくなるように最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は、月次で決定し、原則月間を通じて維持します。

通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円で為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。



### 価格変動要因が変化した場合

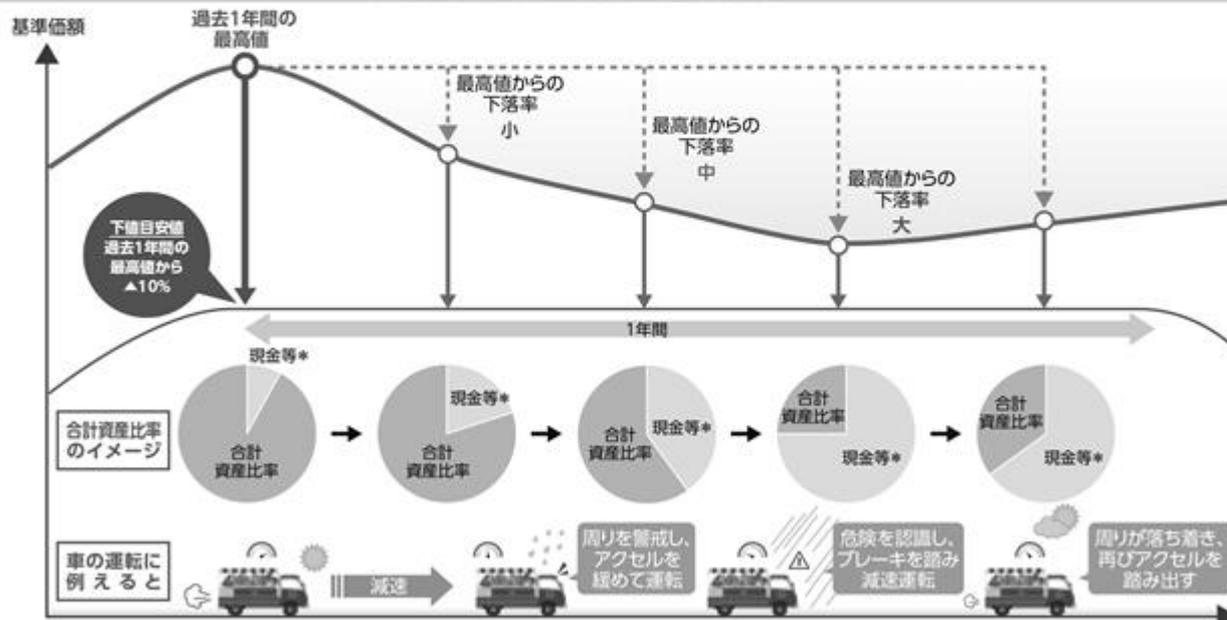


※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。



当ファンドでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等には、現金等の比率を増やすことで基準価額の下落を一定水準（下値目安値）までに抑えることをめざします。

### 下値目安値と合計資産比率変更イメージ



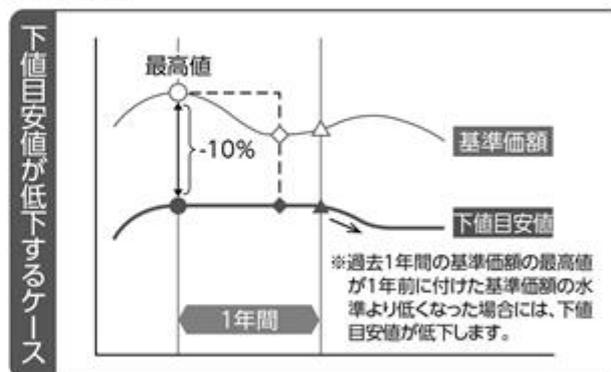
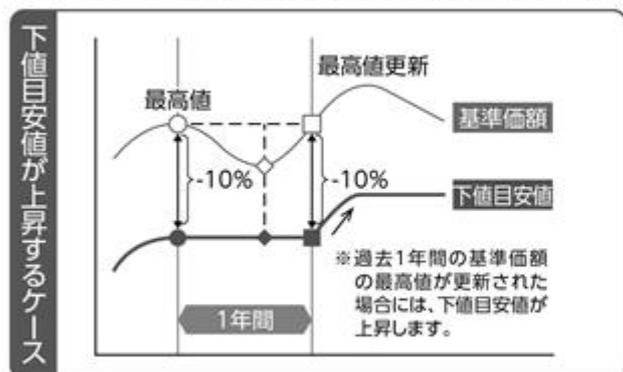
\*現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じて、または直接投資を行います。

\*合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

### 下値目安値について

下値目安値は過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

\*設定後1年に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。



\*下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去1年間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去1年間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

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

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

## ■ 分配方針

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

### < 商品分類 >

#### ・ 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 債券
追加型	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ( ) 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### ・ 商品分類定義

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

## &lt; 属性区分 &gt;

## ・属性区分表

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

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

(注2) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## ・属性区分定義

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

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

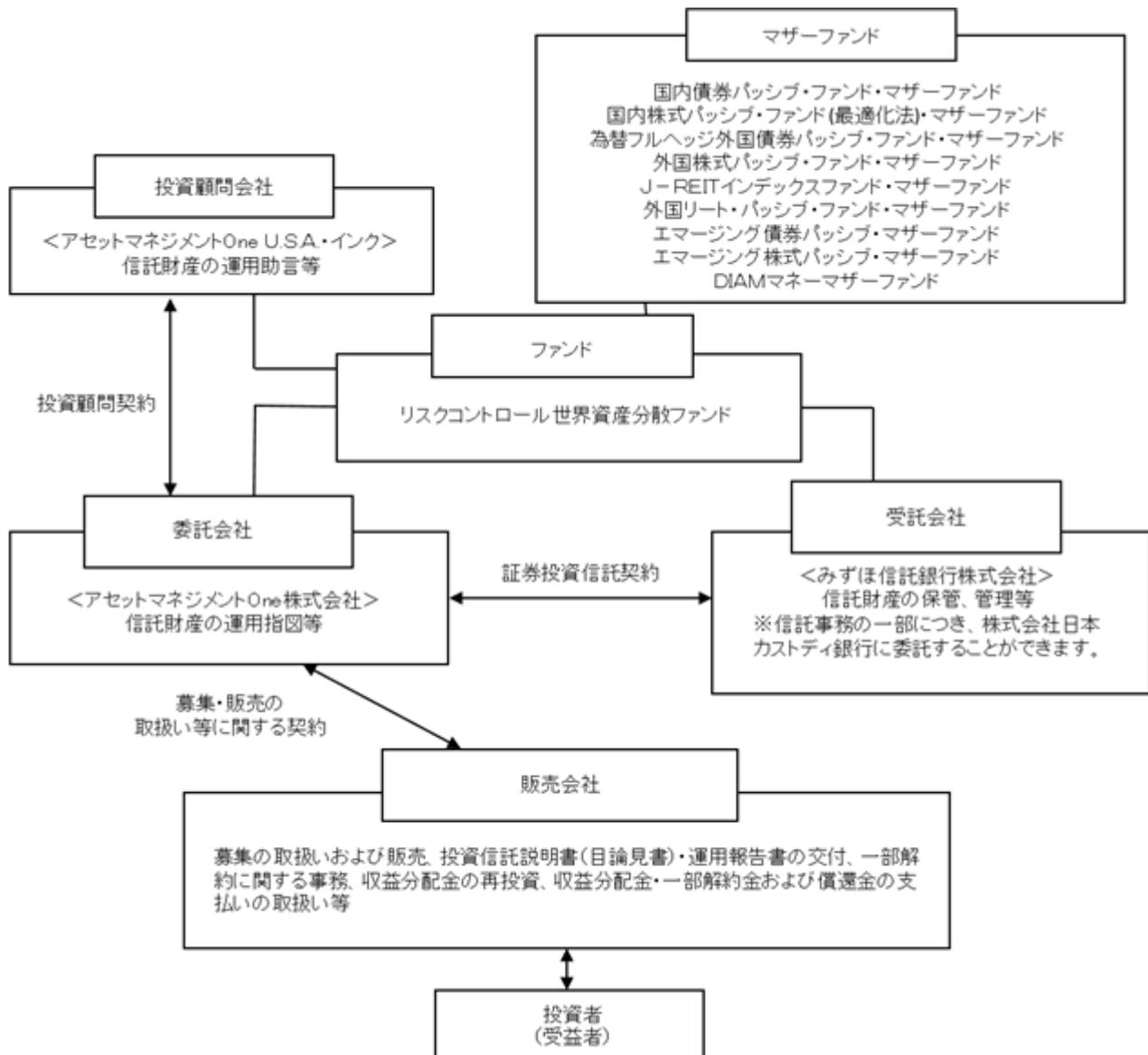
（注2）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（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、債券、株式、不動産投信を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

## （2）【ファンドの沿革】

2018年5月25日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

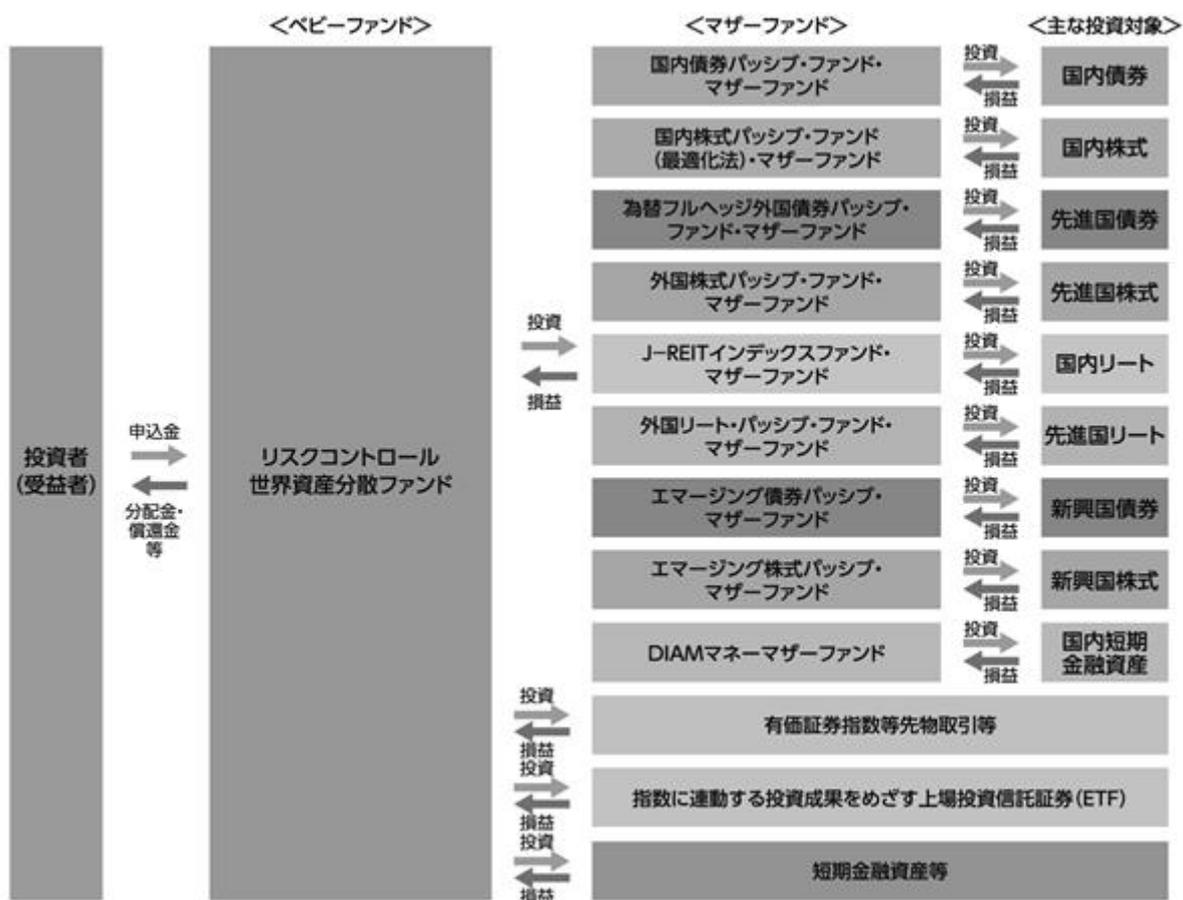
委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

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

## 大株主の状況

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

#### <投資対象>

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

## <投資態度>

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

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

（上記マザーファンドおよびD I A Mマネーマザーファンドを以下「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

上記のほか、D I A Mマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。その後各資産のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度<sup>1</sup>となるよう最終的に基本配分比率を決定します<sup>2</sup>。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜見直しを行うことがあります。

- 1 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は基本資産配分に基づくポートフォリオの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。
- 2 実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

基準価額の下落を一定水準（下値目安値<sup>(\*)</sup>）までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率<sup>(\*\*)</sup>を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去1年間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

（\*\*）合計資産比率とは、「D I A Mマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびE T F等への投資比率の合計をいいます。

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

## (2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限りません。)
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

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

#### 10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~11.の証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。)
  15. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
  18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

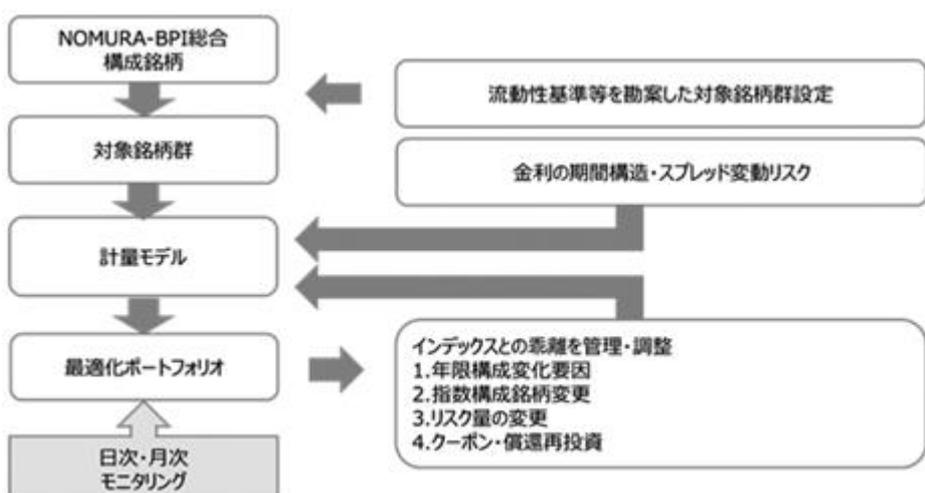
#### 運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

## (参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

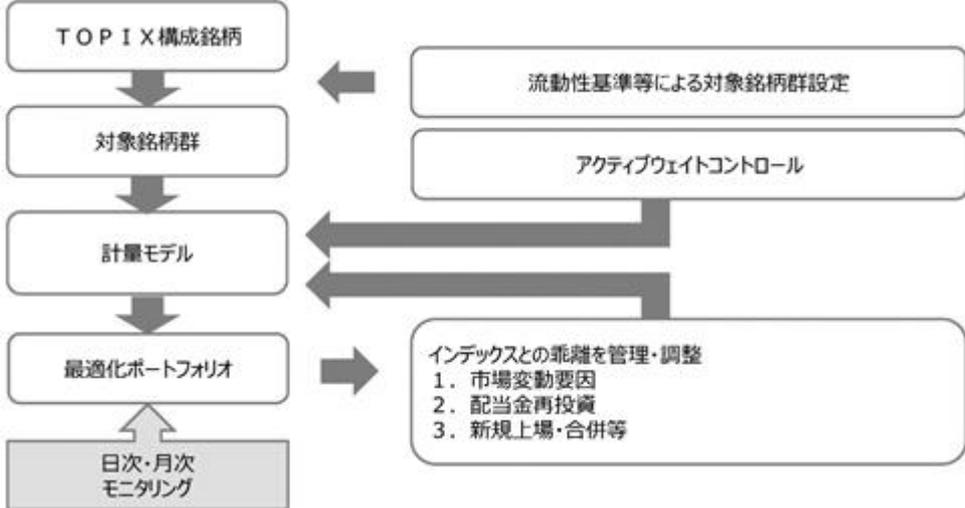
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</li></ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"><p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&amp;コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&amp;コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p></div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 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。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、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</p> 
--------	---

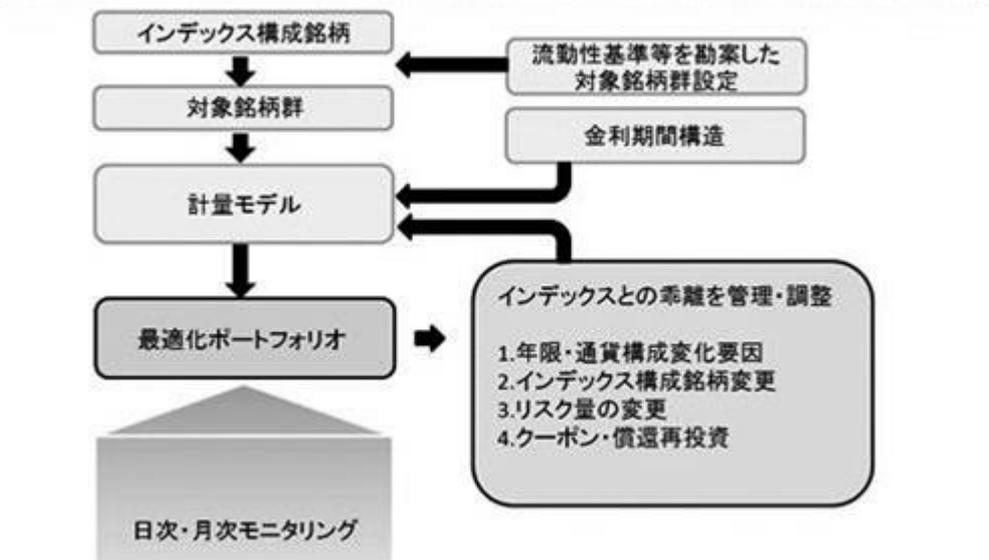
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</li> <li>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下と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

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li><li>3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</li><li>5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li></ol> <div data-bbox="359 683 1364 1982" style="border: 1px solid black; padding: 10px;"><p>東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p><p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p><p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p><p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p><p>本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p><p>JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</p><p>JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。</p><p>以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。</p></div>
------	---

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

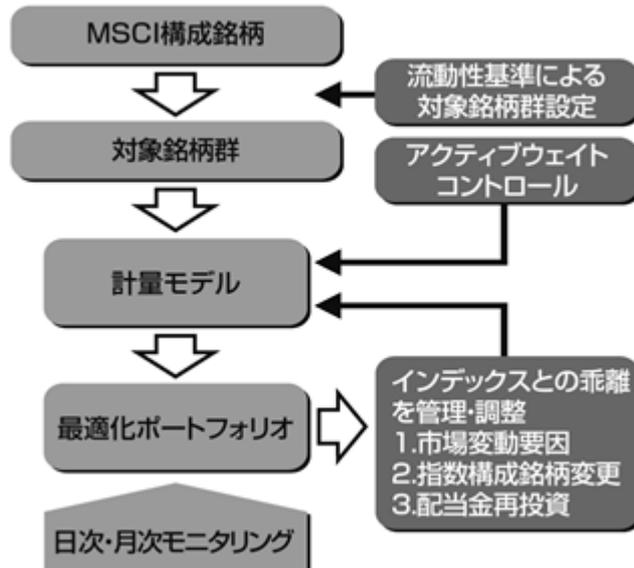
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

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

## 投資態度

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

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

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

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

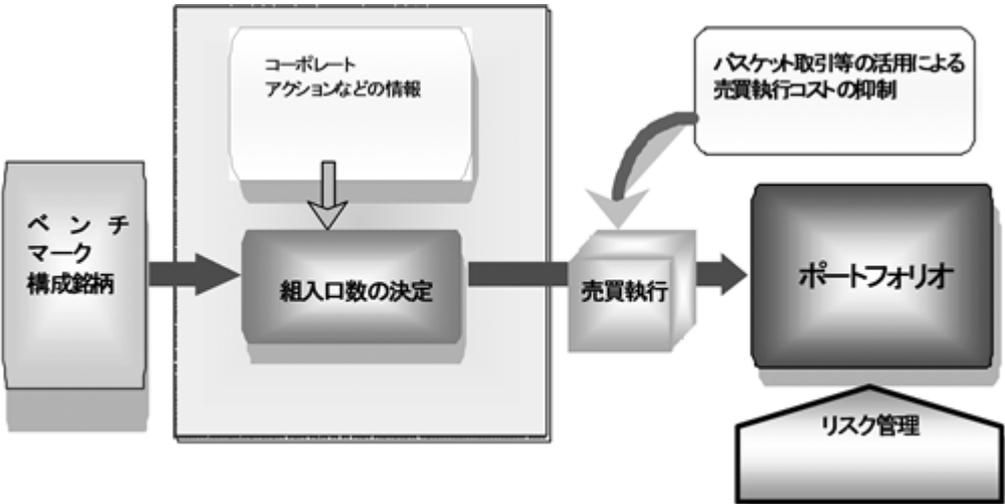
JPXは、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

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

<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
---------------	--

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

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



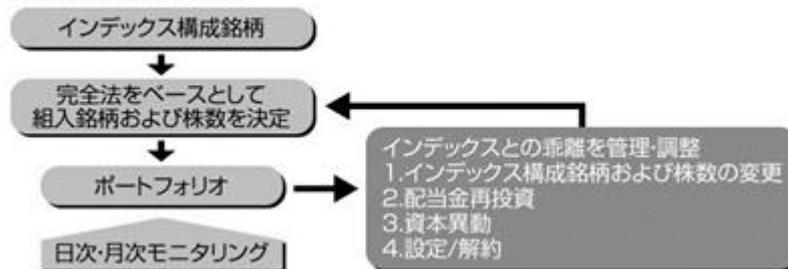
S & P 先進国 R E I T インデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これの使用ライセンスがアセットマネジメントOne株式会社(以下「アセットマネジメントOne」)に付与されています。S&P<sup>®</sup>、S&P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup>およびCDX<sup>®</sup>は、S&P Global, Inc.またはその関連会社(「S&P」)の商標です。Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow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

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

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

## 運用プロセス

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



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

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

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

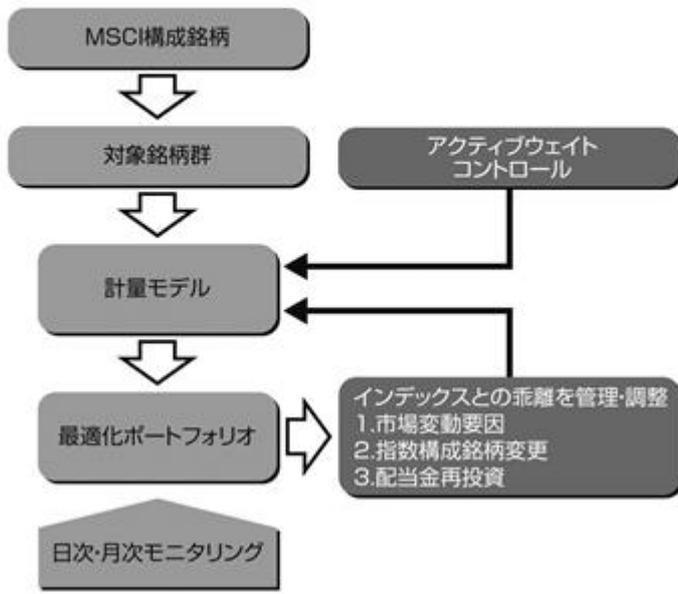
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式<sup>(*)</sup>に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*) DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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

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

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

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

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

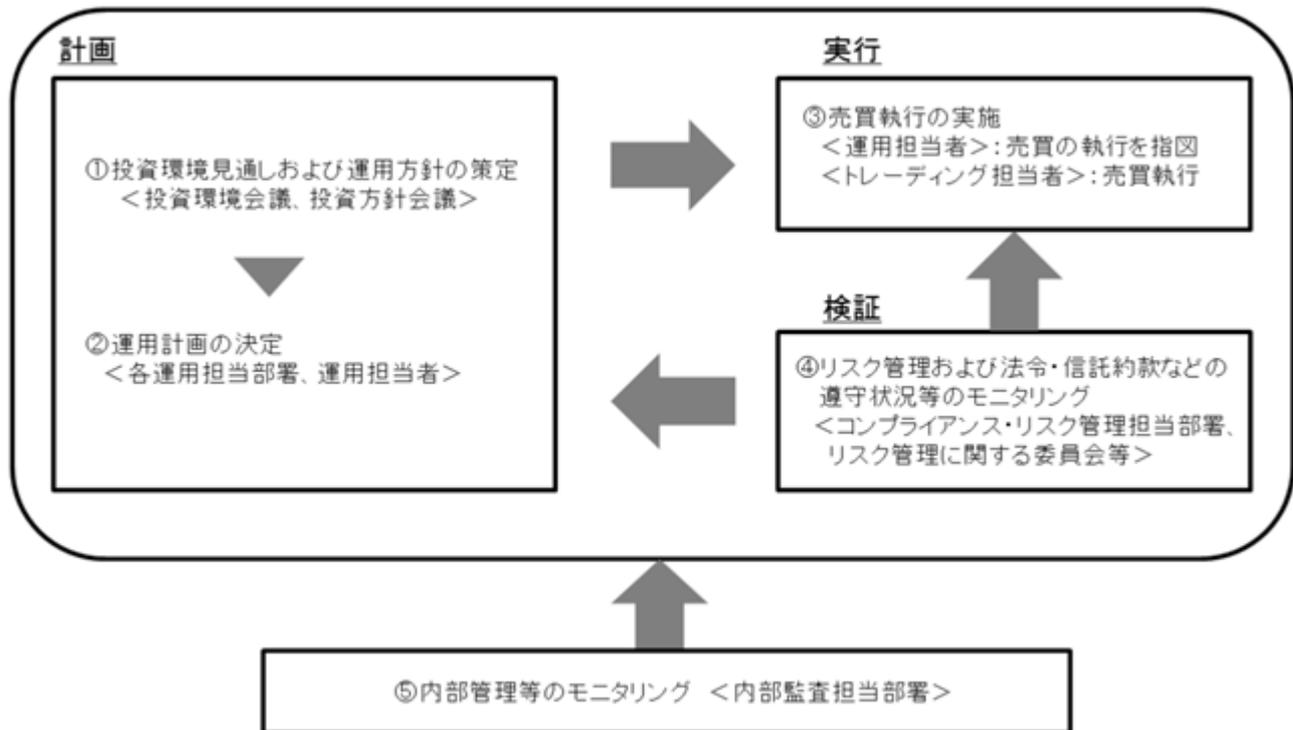
ファンド名	DIAMマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

## 内部管理等のモニタリング

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

#### b. ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2024年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) 【分配方針】

#### 収益分配方針

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

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

#### 収益の分配方式

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

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の支払い

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

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

#### (5)【投資制限】

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

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

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

#### 信用取引の指図範囲(約款第23条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- 1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2.株式分割により取得する株券
- 3.有償増資により取得する株券
- 4.売出しにより取得する株券
- 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
- 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

#### 先物取引等の運用指図(約款第24条)

1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- 2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- 3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2)委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

#### スワップ取引の運用指図(約款第25条)

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

じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第26条)

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

産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第27条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第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次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

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

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

公社債の空売りの指図および範囲(約款第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。)の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

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

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

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第31条)

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

#### 外国為替予約取引の指図(約款第32条)

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

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

る場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、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。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に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およぼします。当ファンドは、公社債、株式およびリート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、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

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

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

#### 不動産投資信託証券（リート）の価格変動リスク

リーートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない資産については、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

為替ヘッジを行う資産については、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、当ファンドは投資環境によっては、為替予約取引の売建を実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があるため、為替相場の影響を受けます。なお、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当程度のコストがかかることにご留意ください。

### 信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。

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

### 流動性リスク

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

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

### カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。当ファンドが実質的に投資を行う株式・債券や通貨の発行者が属する新興国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化等が株式・債券市場や為替市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制等の種々な規制の導入や政策の変更等の要因も株式・債券市場や為替市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## <その他の留意点>

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

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

当ファンドは過去1年間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に10%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

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

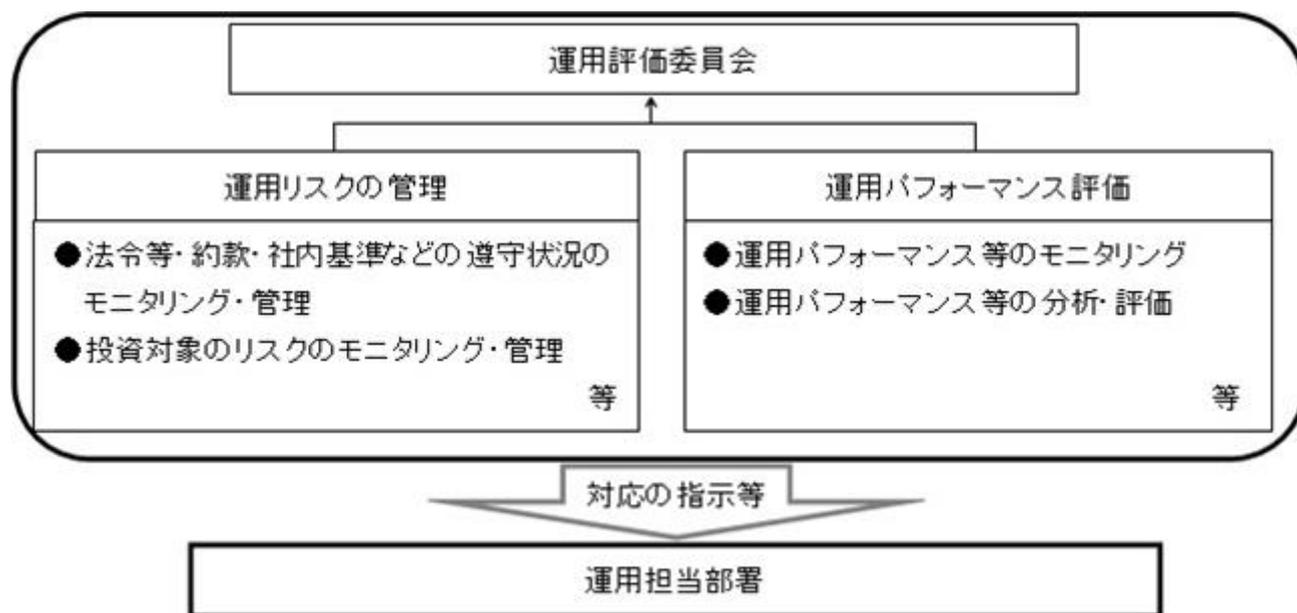
## 注意事項

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

#### <リスク管理体制>

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

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

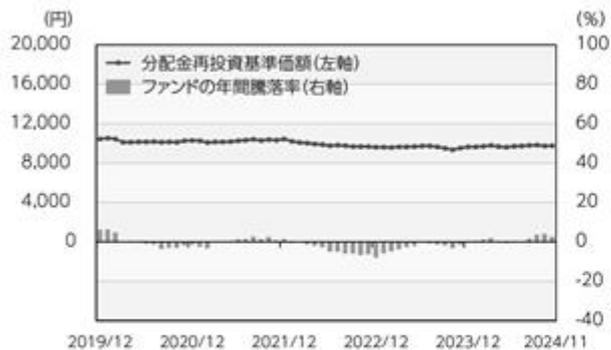


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

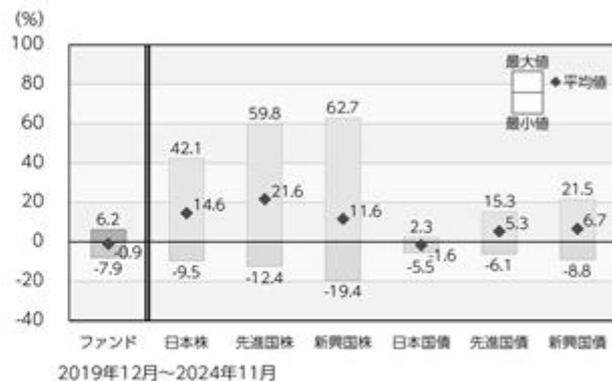
リスク管理体制は2024年11月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## &lt;参考情報&gt;

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に1.1%(税抜1.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

##### (2)【換金(解約)手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.089%(税抜0.99%)

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.48%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.48%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社(アセットマネジメントOne U.S.A.・インク)に対する投資顧問報酬(当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.216%)が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

##### (4)【その他の手数料等】

- ・ 信託財産留保額

ありません。

- ・ その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場

株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2024年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、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

…(参考情報)ファンドの総経費率…

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.11%	1.09%	0.03%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年11月14日~2024年11月11日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

2024年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	40,526,320,950	91.26
内 日本	40,526,320,950	91.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,880,742,052	8.74
純資産総額	44,407,063,002	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。

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	---------	---------

国債証券		278,983,991,182	96.90
内 アメリカ		130,683,330,952	45.39
内 中国		31,138,366,148	10.82
内 フランス		20,762,464,108	7.21
内 イタリア		19,429,622,078	6.75
内 ドイツ		16,296,851,869	5.66
内 イギリス		14,403,764,908	5.00
内 スペイン		12,530,482,355	4.35
内 カナダ		5,404,737,031	1.88
内 ベルギー		4,390,736,361	1.53
内 オランダ		3,726,464,657	1.29
内 オーストラリア		3,587,572,401	1.25
内 オーストリア		3,055,027,016	1.06
内 メキシコ		1,991,471,193	0.69
内 ポルトガル		1,668,855,127	0.58
内 ポーランド		1,407,165,209	0.49
内 フィンランド		1,399,761,985	0.49
内 マレーシア		1,380,810,343	0.48
内 アイルランド		1,319,055,849	0.46
内 シンガポール		1,135,110,709	0.39
内 イスラエル		884,715,567	0.31
内 ニュージーランド		768,564,199	0.27
内 デンマーク		737,250,707	0.26
内 スウェーデン		457,626,268	0.16
内 ノルウェー		424,184,142	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,919,434,906	3.10
純資産総額		287,903,426,088	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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	パミュダ	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。

## J-REITインデックスファンド・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(%)	
投資証券	157,200,796,256	96.98	
内	日本	157,200,796,256	96.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,902,175,361	3.02	
純資産総額	162,102,971,617	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（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	4,749,762,500	2.93
内 日本	4,749,762,500	2.93

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	11,214,146,117	9.88
内 オーストラリア	8,012,716,278	7.06
内 シンガポール	3,144,636,999	2.77
内 香港	56,792,840	0.05
投資証券	101,418,554,465	89.39
内 アメリカ	90,393,521,698	79.68
内 イギリス	4,593,964,186	4.05
内 フランス	1,904,732,797	1.68
内 カナダ	1,411,301,870	1.24
内 ベルギー	933,912,610	0.82
内 香港	869,676,007	0.77
内 スペイン	488,336,778	0.43
内 韓国	184,163,569	0.16
内 ガーンジー	183,648,584	0.16
内 オランダ	142,923,962	0.13
内 イスラエル	140,295,476	0.12
内 ニュージーランド	91,818,316	0.08
内 アイルランド	36,723,136	0.03
内 ドイツ	35,779,993	0.03
内 イタリア	7,755,483	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	817,252,996	0.72
純資産総額	113,449,953,578	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（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	789,506,779	0.70
内 アメリカ	789,506,779	0.70

（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。

## エマージング債券パッシブ・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	125,673,967,450	98.53

内 サウジアラビア	14,516,584,148	11.38
内 メキシコ	12,212,258,749	9.57
内 ポーランド	10,440,412,257	8.19
内 ブラジル	9,728,487,725	7.63
内 アラブ首長国連邦	8,933,178,575	7.00
内 チリ	8,798,620,720	6.90
内 コロンビア	8,660,541,786	6.79
内 ハンガリー	8,572,456,234	6.72
内 ルーマニア	8,316,537,436	6.52
内 ドミニカ共和国	7,109,688,277	5.57
内 ベルギー	5,256,315,884	4.12
内 カタール	4,861,211,997	3.81
内 インドネシア	4,688,816,092	3.68
内 パナマ	3,892,556,359	3.05
内 南アフリカ	3,277,876,723	2.57
内 オマーン	1,854,987,446	1.45
内 フィリピン	1,794,420,432	1.41
内 中国	1,390,463,286	1.09
内 ウルグアイ	1,368,553,324	1.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,880,528,819	1.47
純資産総額	127,554,496,269	100.00

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

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

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	94,364,603,279	94.05
内 インド	18,815,056,709	18.75
内 台湾	17,686,269,343	17.63
内 ケイマン諸島	15,323,003,623	15.27
内 中国	9,862,022,216	9.83
内 韓国	9,424,739,975	9.39
内 サウジアラビア	3,829,043,511	3.82
内 ブラジル	3,512,041,141	3.50
内 南アフリカ	2,680,471,671	2.67
内 インドネシア	1,491,753,480	1.49
内 マレーシア	1,421,770,268	1.42
内 タイ	1,404,741,535	1.40
内 メキシコ	1,292,127,509	1.29
内 アラブ首長国連邦	1,199,180,795	1.20
内 カタール	776,465,253	0.77
内 香港	731,835,073	0.73
内 ポーランド	730,386,948	0.73
内 クエート	688,926,100	0.69
内 トルコ	628,640,236	0.63
内 フィリピン	506,748,248	0.51
内 ギリシャ	419,869,489	0.42
内 チリ	392,538,034	0.39
内 バミューダ	357,301,064	0.36

内	アメリカ	327,733,953	0.33
内	ハンガリー	231,849,161	0.23
内	イギリス	152,570,112	0.15
内	チェコ	131,428,384	0.13
内	ルクセンブルグ	96,851,868	0.10
内	コロンビア	94,054,812	0.09
内	オランダ	58,181,394	0.06
内	エジプト	49,967,026	0.05
内	ペルー	25,695,194	0.03
内	シンガポール	21,339,154	0.02
内	ロシア	0	0.00
内	キプロス	0	0.00
内	イギリス領バージン諸島	0	0.00
投資信託受益証券		474,929,537	0.47
内	メキシコ	343,007,745	0.34
内	ブラジル	131,921,792	0.13
投資証券		76,475,393	0.08
内	メキシコ	76,475,393	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,418,292,775	5.40
純資産総額		100,334,300,984	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）	5,392,645,115	5.37
内 アメリカ	5,392,645,115	5.37

（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	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	14,808,093,589	1.1540 17,090,020,811	1.1620 17,207,004,750	- -	38.75
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	10,949,395,274	1.2115 13,265,192,375	1.2079 13,225,774,551	- -	29.78
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	360,336,140	10.0550 3,623,215,921	9.9161 3,573,129,197	- -	8.05
4	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,255,079,304	2.4673 3,096,782,674	2.4304 3,050,344,740	- -	6.87

5	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	587,750,164	2.2588 1,327,610,071	2.2462 1,320,204,418	- -	2.97
6	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	587,677,541	1.8943 1,113,237,566	1.7753 1,043,303,938	- -	2.35
7	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	292,881,644	2.2560 660,740,989	2.2684 664,372,721	- -	1.50
8	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	92,496,054	4.8854 451,880,223	4.7806 442,186,635	- -	1.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年11月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	91.26
合計	91.26

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(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。

#### 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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27 中国	国債証券	1,351,850,500	103.21 1,395,277,553	103.44 1,398,384,033	2.85 2027/6/4	0.49
2	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証券	1,386,808,000	99.16 1,375,286,899	98.10 1,360,561,574	4 2034/2/15	0.47
3	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 中国	国債証券	1,289,457,400	104.45 1,346,856,498	104.91 1,352,872,012	3.01 2028/5/13	0.47
4	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,296,364,000	102.29 1,326,074,618	101.92 1,321,329,129	4.5 2033/11/15	0.46
5	US T N/B 3.875 08/15/34 アメリカ	国債証券	1,356,660,000	98.09 1,330,751,059	97.02 1,316,278,173	3.875 2034/8/15	0.46
6	CHINA GOVERNMENT BOND 1.85 05/15/27 中国	国債証券	1,227,064,300	100.73 1,236,029,210	100.97 1,238,979,953	1.85 2027/5/15	0.43
7	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,266,216,000	95.32 1,206,969,785	95.02 1,203,226,702	3.5 2033/2/15	0.42
8	CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33 中国	国債証券	1,091,879,250	104.27 1,138,575,972	104.96 1,146,047,925	2.67 2033/5/25	0.40
9	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51 中国	国債証券	879,742,710	127.78 1,124,199,205	129.56 1,139,862,483	3.72 2051/4/12	0.40
10	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,356,660,000	83.53 1,133,246,810	83.14 1,127,988,592	1.375 2031/11/15	0.39
11	CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31 中国	国債証券	1,081,480,400	100.90 1,091,232,233	101.43 1,096,950,544	2.12 2031/6/25	0.38
12	CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30 中国	国債証券	1,050,283,850	103.71 1,089,348,793	103.97 1,092,057,209	2.54 2030/12/25	0.38
13	US T N/B 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証券	1,070,254,000	102.72 1,099,425,804	100.96 1,080,538,476	4.375 2034/5/15	0.38
14	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,085,328,000	99.25 1,077,242,362	99.51 1,080,092,138	4.125 2032/11/15	0.38

15	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,160,698,000	91.09 1,057,388,286	91.54 1,062,560,076	2.875 2032/5/15	0.37
16	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,070,254,000	97.87 1,047,488,123	97.38 1,042,222,535	3.875 2033/8/15	0.36
17	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,183,309,000	86.63 1,025,138,680	85.66 1,013,647,444	1.625 2031/5/15	0.35
18	CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28 中国	国債証券	946,295,350	103.10 975,638,658	103.40 978,486,141	2.55 2028/10/15	0.34
19	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,159,190,600	82.38 954,960,951	82.91 961,199,938	0.875 2030/11/15	0.33
20	US T N/B 4.625 06/30/26 アメリカ	国債証券	949,662,000	100.91 958,363,110	100.50 954,447,402	4.625 2026/6/30	0.33
21	CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34 中国	国債証券	935,896,500	100.17 937,542,429	100.57 941,265,457	2.11 2034/8/25	0.33
22	US T N/B 4.0 07/31/29 アメリカ	国債証券	936,095,400	99.89 935,105,291	99.39 930,391,068	4 2029/7/31	0.32
23	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	964,736,000	94.55 912,224,237	94.40 910,771,080	1.5 2027/1/31	0.32
24	US T N/B 3.75 08/31/26 アメリカ	国債証券	904,440,000	99.64 901,234,017	99.12 896,526,150	3.75 2026/8/31	0.31
25	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証券	883,902,250	101.00 892,760,983	101.29 895,366,992	2.3 2026/5/15	0.31
26	US T N/B 3.5 09/30/26 アメリカ	国債証券	904,440,000	98.87 894,231,088	98.67 892,445,569	3.5 2026/9/30	0.31
27	US T N/B 3.625 08/31/29 アメリカ	国債証券	904,440,000	99.07 896,077,520	97.81 884,708,366	3.625 2029/8/31	0.31
28	US T N/B 0.625 07/31/26 アメリカ	国債証券	931,573,200	92.71 863,680,081	94.16 877,243,561	0.625 2026/7/31	0.30
29	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,055,180,000	82.85 874,306,006	82.96 875,387,225	1.25 2031/8/15	0.30
30	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	919,514,000	94.63 870,148,308	93.96 864,019,895	3.375 2033/5/15	0.30

(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	96.90
合計	96.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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。

#### J - R E I Tインデックスファンド・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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	95,151	118,639.91 11,288,706,770	125,500.00 11,941,450,500	- -	7.37
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	16,756	526,146.38 8,816,108,770	554,000.00 9,282,824,000	- -	5.73
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	84,588	91,192.44 7,713,786,748	91,300.00 7,722,884,400	- -	4.76
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	52,218	141,937.34 7,411,684,333	141,700.00 7,399,290,600	- -	4.56
5	G L P 投資法人 日本	投資証券	54,795	132,606.07 7,266,149,648	127,300.00 6,975,403,500	- -	4.30
6	K D X 不動産投資法人 日本	投資証券	45,638	152,507.18 6,960,122,888	147,300.00 6,722,477,400	- -	4.15
7	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	28,418	250,180.41 7,109,627,074	236,100.00 6,709,489,800	- -	4.14
8	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	89,878	67,242.29 6,043,602,797	63,600.00 5,716,240,800	- -	3.53
9	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	24,465	250,701.30 6,133,407,316	233,000.00 5,700,345,000	- -	3.52
10	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	32,503	159,307.81 5,177,982,000	166,700.00 5,418,250,100	- -	3.34
11	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	36,491	141,719.32 5,171,479,851	136,500.00 4,981,021,500	- -	3.07
12	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	16,032	326,859.84 5,240,217,073	295,000.00 4,729,440,000	- -	2.92
13	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証券	59,929	77,650.35 4,653,508,336	68,200.00 4,087,157,800	- -	2.52
14	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	11,156	331,472.40 3,697,906,158	330,500.00 3,687,058,000	- -	2.27
15	三井不動産ロジスティクス パーク投資法人 日本	投資証券	35,559.63	108,570.40 3,860,723,301	101,200.00 3,598,634,556	- -	2.22
16	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	49,019	79,778.15 3,910,645,451	73,100.00 3,583,288,900	- -	2.21
17	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	29,868	124,496.83 3,718,471,391	114,600.00 3,422,872,800	- -	2.11
18	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証券	5,633	647,336.82 3,646,448,314	581,000.00 3,272,773,000	- -	2.02
19	ラサールロジポート投資法 人 日本	投資証券	20,885	150,179.41 3,136,497,147	143,900.00 3,005,351,500	- -	1.85
20	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証券	10,960	271,348.42 2,973,978,713	263,800.00 2,891,248,000	- -	1.78

21	アクティビア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証 券	7,929	369,437.71 2,929,271,623	321,000.00 2,545,209,000	- -	1.57
22	イオンリート投資法人 日本	投資証 券	20,010	133,129.05 2,663,912,422	126,100.00 2,523,261,000	- -	1.56
23	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証 券	19,183	129,984.13 2,493,485,741	124,900.00 2,395,956,700	- -	1.48
24	フロンティア不動産投資法 人 日本	投資証 券	6,053	447,477.06 2,708,578,677	395,000.00 2,390,935,000	- -	1.47
25	コンフォリア・レジデン シャル投資法人 日本	投資証 券	8,260	320,473.37 2,647,110,062	288,300.00 2,381,358,000	- -	1.47
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証 券	24,093	103,176.07 2,485,821,147	90,900.00 2,190,053,700	- -	1.35
27	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証 券	6,759	284,624.00 1,923,773,651	300,000.00 2,027,700,000	- -	1.25
28	三菱地所物流リート投資法 人 日本	投資証 券	5,633	384,349.86 2,165,042,808	348,000.00 1,960,284,000	- -	1.21
29	森トラストリート投資法人 日本	投資証 券	31,443	69,651.02 2,190,037,185	60,900.00 1,914,878,700	- -	1.18
30	ヒューリックリート投資法 人 日本	投資証 券	14,415	145,409.23 2,096,074,094	132,800.00 1,914,312,000	- -	1.18

(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 (%)
投資証券	96.98
合計	96.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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	PROLOGIS INC アメリカ	投資証 券	446,144	16,919.50 7,548,536,641	17,757.17 7,922,255,744	- -	6.98
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証 券	45,752	120,050.77 5,492,563,152	147,589.53 6,752,516,359	- -	5.95
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証 券	278,878	16,560.45 4,618,345,820	20,998.08 5,855,903,111	- -	5.16
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	148,346	23,220.62 3,444,686,578	29,436.50 4,366,788,097	- -	3.85

5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	147,730	23,033.95 3,402,805,469	27,698.47 4,091,895,711	- -	3.61
6	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	75,929	45,603.41 3,462,621,485	52,964.00 4,021,504,041	- -	3.54
7	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	418,811	8,260.55 3,459,610,506	8,791.15 3,681,833,170	- -	3.25
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	842,599	3,508.92 2,956,616,336	3,748.06 3,158,119,359	- -	2.78
9	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	101,957	24,312.84 2,478,864,843	26,029.78 2,653,918,605	- -	2.34
10	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	141,124	14,499.17 2,046,181,211	18,727.93 2,642,961,465	- -	2.33
11	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	503,819	4,388.29 2,210,907,350	4,914.12 2,475,829,039	- -	2.18
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	68,335	31,583.61 2,158,266,070	35,847.47 2,449,637,504	- -	2.16
13	VENTAS INC アメリカ	投資証券	199,335	8,134.29 1,621,449,713	9,728.75 1,939,282,294	- -	1.71
14	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	164,612	10,487.56 1,726,378,941	11,679.33 1,922,558,725	- -	1.69
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	30,997	42,651.44 1,322,066,984	47,157.50 1,461,741,077	- -	1.29
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	275,043	5,291.91 1,455,503,885	5,217.11 1,434,929,970	- -	1.26
17	MID AMERICA アメリカ	投資証券	56,428	21,883.47 1,234,840,489	24,902.24 1,405,184,050	- -	1.24
18	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	323,155	3,067.54 991,291,425	3,886.07 1,255,805,277	- -	1.11
19	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	75,182	17,469.53 1,313,394,567	16,659.78 1,252,515,940	- -	1.10
20	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	337,446	3,031.74 1,023,049,645	3,352.45 1,131,273,407	- -	1.00
21	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	56,199	18,189.48 1,022,230,778	19,379.13 1,089,087,974	- -	0.96
22	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	131,626	6,935.04 912,832,734	7,787.22 1,025,001,725	- -	0.90
23	UDR INC アメリカ	投資証券	143,982	6,254.92 900,596,621	6,983.78 1,005,539,216	- -	0.89
24	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	51,160	16,985.41 868,973,713	19,148.50 979,637,372	- -	0.86
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	89,473	9,983.95 893,294,053	10,866.84 972,289,365	- -	0.86
26	SEGRO PLC イギリス	投資証券	648,726	1,678.85 1,089,117,070	1,494.38 969,448,322	- -	0.85
27	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	337,035	2,719.86 916,688,072	2,778.13 936,329,808	- -	0.83

28	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	105,019	8,405.95 882,784,736	8,669.05 910,415,739	- -	0.80
29	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	2,493,226	319.76 797,236,922	364.70 909,301,462	- -	0.80
30	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	78,389	9,786.95 767,189,882	11,442.67 896,979,725	- -	0.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年11月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	9.88
投資証券	89.39
合計	99.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年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	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証券	3,467,020,000	93.64 3,246,856,693	94.54 3,277,876,723	7.3 2052/4/20	2.57
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証券	2,864,060,000	103.70 2,970,133,929	103.30 2,958,573,980	5.5 2032/10/25	2.32
3	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,562,580,000	85.93 2,202,216,542	86.84 2,225,369,072	2.783 2031/1/23	1.74
4	COLOMBIA 3.125 04/15/31 コロンビア	国債証券	2,713,320,000	80.05 2,172,228,275	80.85 2,193,789,494	3.125 2031/4/15	1.72
5	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証券	2,110,360,000	104.89 2,213,751,058	102.61 2,165,440,396	6.25 2032/9/22	1.70
6	REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32 ポーランド	国債証券	2,034,990,000	104.02 2,116,960,904	104.18 2,120,144,156	5.75 2032/11/16	1.66
7	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 サウジアラビア	国債証券	2,291,248,000	90.45 2,072,592,394	91.66 2,100,277,061	3.25 2030/10/22	1.65
8	DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32 ドミニカ共和国	国債証券	2,261,100,000	92.20 2,084,781,683	91.75 2,074,559,250	4.875 2032/9/23	1.63
9	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	2,562,580,000	80.75 2,069,464,840	80.42 2,060,831,320	2.125 2031/9/22	1.62
10	REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29 ポーランド	国債証券	1,959,620,000	99.76 1,955,029,967	99.59 1,951,590,457	4.625 2029/3/18	1.53

11	ROMANIA 5.875 01/30/29 ルーマニア	国債証券	1,808,880,000	101.51 1,836,305,635	99.46 1,799,213,797	5.875 2029/1/30	1.41
12	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証券	1,808,880,000	98.51 1,782,090,487	99.17 1,793,871,722	5.25 2029/6/16	1.41
13	REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54 ポーランド	国債証券	1,808,880,000	96.35 1,742,976,472	96.55 1,746,564,084	5.5 2054/3/18	1.37
14	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,658,140,000	107.58 1,783,836,056	104.20 1,727,848,205	7.125 2033/1/17	1.35
15	HUNGARY 6.125 05/22/28 ハンガリー	国債証券	1,658,140,000	102.33 1,696,821,089	102.67 1,702,435,551	6.125 2028/5/22	1.33
16	ROMANIA 6.625 02/17/28 ルーマニア	国債証券	1,658,140,000	103.28 1,712,594,975	102.57 1,700,861,977	6.625 2028/2/17	1.33
17	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33 サウジアラビア	国債証券	1,658,140,000	98.75 1,637,454,552	99.30 1,646,540,067	4.875 2033/7/18	1.29
18	COLOMBIA 3.25 04/22/32 コロンビア	国債証券	1,959,620,000	78.95 1,547,294,094	78.44 1,537,230,375	3.25 2032/4/22	1.21
19	BRAZIL 6.0 10/20/33 ブラジル	国債証券	1,507,400,000	97.48 1,469,492,213	99.11 1,494,040,803	6 2033/10/20	1.17
20	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	1,507,400,000	97.23 1,465,769,229	98.38 1,482,987,657	4.375 2029/4/16	1.16
21	REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27 チリ	国債証券	1,537,548,000	93.77 1,441,764,642	96.01 1,476,243,238	2.75 2027/1/31	1.16
22	UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/07/36 メキシコ	国債証券	1,507,400,000	98.86 1,490,252,411	97.61 1,471,500,922	6 2036/5/7	1.15
23	COLOMBIA 3.0 01/30/30 コロンビア	国債証券	1,658,140,000	81.79 1,356,274,590	84.07 1,394,115,611	3 2030/1/30	1.09
24	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 メキシコ	国債証券	1,658,140,000	82.82 1,373,431,085	83.37 1,382,553,086	2.659 2031/5/24	1.08
25	BRAZIL 6.25 03/18/31 ブラジル	国債証券	1,356,660,000	102.01 1,384,008,758	101.71 1,379,886,399	6.25 2031/3/18	1.08
26	REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33 チリ	国債証券	1,658,140,000	83.33 1,381,892,745	83.04 1,377,080,892	2.55 2033/7/27	1.08
27	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	1,386,808,000	97.77 1,355,887,758	98.79 1,370,096,963	6 2033/2/22	1.07
28	REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34 ポーランド	国債証券	1,356,660,000	98.04 1,330,099,612	99.21 1,345,999,365	5.125 2034/9/18	1.06
29	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	1,356,660,000	97.05 1,316,676,780	98.02 1,329,865,965	5.5 2029/2/22	1.04
30	REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53 ポーランド	国債証券	1,356,660,000	97.34 1,320,639,169	96.68 1,311,703,679	5.5 2053/4/4	1.03

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年11月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.53
合計	98.53

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### エマージング株式パッシブ・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	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,014,722	3,738.18 7,531,399,586	4,653.95 9,376,423,510	- -	9.35
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	531,100	5,863.92 3,114,329,048	7,748.00 4,114,962,800	- -	4.10
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	390,999	8,492.10 3,320,404,198	6,005.09 2,347,988,094	- -	2.34
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,331,468	1,338.21 1,781,794,420	1,615.45 2,150,930,632	- -	2.14
5	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	461,898	2,896.54 1,337,906,680	3,209.73 1,482,571,793	- -	1.48
6	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・ レストラ ン・レ ジャー	405,310	1,901.31 770,620,104	3,335.51 1,351,917,179	- -	1.35
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	497,943	2,618.15 1,303,693,677	2,274.73 1,132,686,876	- -	1.13
8	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	426,305	1,919.65 818,356,600	2,302.56 981,595,611	- -	0.98

9	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,020,546	684.90 698,977,686	905.32 923,922,133	- -	0.92
10	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	271,809	2,542.26 691,010,472	3,323.40 903,330,981	- -	0.90
11	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,846,530	93.27 731,877,101	113.31 889,125,623	- -	0.89
12	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	56,828	16,840.17 956,993,254	14,893.11 846,345,768	- -	0.84
13	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	44,684	19,361.49 865,149,066	17,431.01 778,887,697	- -	0.78
14	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	124,686	4,899.06 610,844,711	5,811.65 724,631,890	- -	0.72
15	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,253,600	318.54 399,327,157	539.45 676,260,161	- -	0.67
16	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	160,490	3,234.16 519,051,272	3,662.21 587,749,687	- -	0.59
17	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 無線通信 サービス	209,477	2,268.95 475,293,691	2,793.11 585,093,560	- -	0.58
18	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	74,076	6,936.47 513,826,680	7,598.37 562,856,930	- -	0.56
19	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	202,185	1,937.60 391,754,232	2,754.41 556,901,194	- -	0.56
20	SAUDI ARABIAN OIL CO サウジアラビア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	476,348	1,163.14 554,063,781	1,103.48 525,645,254	- -	0.52
21	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,680,235	78.78 447,497,228	88.13 500,618,991	- -	0.50
22	TRIP.COM GROUP LTD ケイマン諸島	株式 ホテル・ レストラ ン・レ ジャー	50,700	7,704.32 390,609,346	9,704.37 492,011,559	- -	0.49

23	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS ケイマン諸島	株式 銀行	241,044	2,255.74 543,733,724	2,039.51 491,612,178	- -	0.49
24	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	550,000	593.32 326,328,610	867.77 477,276,800	- -	0.48
25	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小売り	13,874	26,668.16 369,994,076	33,957.24 471,122,817	- -	0.47
26	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	4,517,600	90.48 408,770,891	95.00 429,172,000	- -	0.43
27	BYD CO LTD 中国	株式 自動車	85,500	3,971.21 339,538,788	4,885.11 417,677,247	- -	0.42
28	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	158,800	2,729.54 433,451,011	2,564.58 407,256,574	- -	0.41
29	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	281,389	1,555.48 437,696,975	1,442.02 405,771,301	- -	0.40
30	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	5,850,200	63.78 373,132,021	69.34 405,679,778	- -	0.40

（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	94.05
投資信託受益証券	0.47
投資証券	0.08
合計	94.60

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2024年11月29日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
銀行	外国	16.92
半導体・半導体製造装置		12.17
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.17
コンピュータ・周辺機器		4.76
石油・ガス・消耗燃料		4.34
大規模小売り		4.29
金属・鉱業		3.21
保険		2.89
自動車		2.85
ホテル・レストラン・レジャー		2.81
電子装置・機器・部品		2.46
情報技術サービス		2.35
化学		1.65
無線通信サービス		1.53
電気設備		1.46
不動産管理・開発		1.43
食品		1.34

医薬品	1.25
生活必需品流通・小売り	1.13
金融サービス	1.12
各種電気通信サービス	1.11
コングロマリット	1.08
電力	1.05
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	1.00
飲料	0.95
資本市場	0.90
娯楽	0.86
バイオテクノロジー	0.77
繊維・アパレル・贅沢品	0.71
機械	0.71
建設・土木	0.69
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.68
運送インフラ	0.66
専門小売り	0.65
消費者金融	0.64
自動車用部品	0.62
建設資材	0.62
パーソナルケア用品	0.59
航空宇宙・防衛	0.58
家庭用耐久財	0.44
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.41
旅客航空輸送	0.37
タバコ	0.35
ガス	0.31
海上運輸	0.30
航空貨物・物流サービス	0.23
通信機器	0.23
ソフトウェア	0.22
陸上運輸	0.19
各種消費者サービス	0.16
ヘルスケア機器・用品	0.14
紙製品・林産品	0.13
水道	0.13
商社・流通業	0.10
エネルギー設備・サービス	0.10
総合公益事業	0.08
メディア	0.06
建設関連製品	0.04
家庭用品	0.04
商業サービス・用品	0.03
合計	94.05

(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。

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド  
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド  
該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年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場で評価しています。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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-EU	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。

#### J-REITインデックスファンド・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 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0612月	買建	2,857	4,960,209,120	4,749,762,500	2.93

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

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

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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 (%)
不動産投信指 数先物取引	シカゴ商品 取引所	DJ US REAL ESTATE Dec24	買建	133	766,387,785	789,506,779	0.70

(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。

#### エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年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	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Dec24	買建	662	5,676,581,240	5,392,645,115	5.37

(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 (2018年11月12日)	16,055	16,055	0.9834	0.9834
第2計算期間末 (2019年11月11日)	63,143	63,143	1.0389	1.0389
第3計算期間末 (2020年11月11日)	116,766	116,766	1.0188	1.0188
第4計算期間末 (2021年11月11日)	83,658	83,658	1.0436	1.0436
第5計算期間末 (2022年11月11日)	63,428	63,428	0.9668	0.9668
第6計算期間末 (2023年11月13日)	52,793	52,793	0.9454	0.9454
第7計算期間末 (2024年11月11日)	45,330	45,330	0.9741	0.9741
2023年11月末日	52,471	-	0.9518	-
12月末日	51,648	-	0.9638	-
2024年1月末日	50,963	-	0.9658	-
2月末日	50,607	-	0.9699	-
3月末日	50,466	-	0.9806	-
4月末日	49,280	-	0.9678	-
5月末日	48,361	-	0.9615	-
6月末日	48,184	-	0.9692	-
7月末日	47,538	-	0.9720	-
8月末日	47,015	-	0.9785	-
9月末日	46,773	-	0.9835	-
10月末日	45,436	-	0.9732	-
11月末日	44,407	-	0.9758	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	5.6
第3計算期間	1.9
第4計算期間	2.4
第5計算期間	7.4
第6計算期間	2.2
第7計算期間	3.0

(注) 収益率は期間騰落率です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	17,241,080,294	914,894,367
第2計算期間	48,308,726,995	3,853,963,676
第3計算期間	84,183,367,871	30,357,847,700
第4計算期間	5,948,816,817	40,393,734,727
第5計算期間	3,490,938,507	18,046,893,924
第6計算期間	2,335,400,156	12,097,868,661
第7計算期間	1,322,990,311	10,631,773,844

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2024年11月29日

## 基準価額・純資産の推移 (2018年5月25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:2018年5月25日)

## 分配の推移(税引前)

2020年11月	0円
2021年11月	0円
2022年11月	0円
2023年11月	0円
2024年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	38.75
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	29.78
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.05
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	6.87
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	2.97
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.35
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.50
8	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	1.00

## ■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

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2024年11月29日

### ■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

### ■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	中国	2.85	2027/6/4	0.49
2	US T N/B 4.0 02/15/34	国債証券	アメリカ	4	2034/2/15	0.47
3	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国債証券	中国	3.01	2028/5/13	0.47
4	US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	アメリカ	4.5	2033/11/15	0.46
5	US T N/B 3.875 08/15/34	国債証券	アメリカ	3.875	2034/8/15	0.46

### ■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

### ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	7.37
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.73
3	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.76
4	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.56
5	GLP投資法人	投資証券	日本	4.30

○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。

### ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	6.98
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.95
3	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	5.16
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.85
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.61

### ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	国債証券	南アフリカ	7.3	2052/4/20	2.57
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	国債証券	サウジアラビア	5.5	2032/10/25	2.32
3	PERU 2.783 01/23/31	国債証券	ペルー	2.783	2031/1/23	1.74
4	COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	コロンビア	3.125	2031/4/15	1.72
5	HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証券	ハンガリー	6.25	2032/9/22	1.70

### ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	9.35
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブメディアおよびサービス	4.10
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	2.34
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.14
5	HDFC BANK LTD	株式	インド	銀行	1.48

### 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。

※2018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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時30分までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、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、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日(以下、「海外休業日」という場合があります。)には、お申込みの受付を行いません。

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

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

#### <基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

#### ・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（税抜1.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

#### ・払込期日

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時30分までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、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。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### <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
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
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
不動産投資信託 証券	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の 円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の 円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

す。  
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

信託期間は、2018年5月25日（設定日）から原則として2028年5月11日までです。

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

イ.償還規定

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

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

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

#### ロ. 信託約款の変更等

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

## 八.関係法人との契約の更改

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

また、投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社(アセットマネジメントOne U.S.A.・インク)の間の当該契約は、原則として期間満了の90日前までにいずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、当ファンドの信託終了まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

## 二.公告

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

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

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

## ホ.運用報告書

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1)収益分配金請求権

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

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

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

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

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)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7期計算期間(2023年11月14日から2024年11月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 2023年11月13日現在	第7期 2024年11月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	22,311,158,871	4,145,091,326
親投資信託受益証券	31,012,910,478	41,561,512,703
派生商品評価勘定	317,460	19,408,088
流動資産合計	53,324,386,809	45,726,012,117
資産合計	53,324,386,809	45,726,012,117
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	83,119,717	58,401,130
未払解約金	133,439,272	79,458,861
未払受託者報酬	9,510,511	7,779,503
未払委託者報酬	304,337,686	248,945,359
その他未払費用	763,757	656,229
流動負債合計	531,170,943	395,241,082
負債合計	531,170,943	395,241,082
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	55,843,127,585	46,534,344,052
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,049,911,719	1,203,573,017
（分配準備積立金）	1,042,162,119	1,437,919,850
元本等合計	52,793,215,866	45,330,771,035
純資産合計	52,793,215,866	45,330,771,035
負債純資産合計	53,324,386,809	45,726,012,117

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期		第7期	
	自	2022年11月12日 至 2023年11月13日	自	2023年11月14日 至 2024年11月11日
<b>営業収益</b>				
受取利息		99,768		3,770,985
有価証券売買等損益		927,382,626		2,897,208,954
為替差損益		1,538,854,100		815,991,379
<b>営業収益合計</b>		<b>611,371,706</b>		<b>2,084,988,560</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		5,700,571		457,515
受託者報酬		19,448,712		16,135,592
委託者報酬		622,361,869		516,341,543
その他費用		3,635,460		3,386,476
<b>営業費用合計</b>		<b>651,146,612</b>		<b>536,321,126</b>
営業利益又は営業損失( )		1,262,518,318		1,548,667,434
経常利益又は経常損失( )		1,262,518,318		1,548,667,434
当期純利益又は当期純損失( )		1,262,518,318		1,548,667,434
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( )		74,879,770		238,748,139
期首剰余金又は期首欠損金( )		2,176,773,847		3,049,911,719
剰余金増加額又は欠損金減少額		402,086,366		578,289,238
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		402,086,366		578,289,238
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		87,585,690		41,869,831
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		87,585,690		41,869,831
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		3,049,911,719		1,203,573,017

## (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7期	
	自 2023年11月14日	至 2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年11月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2023年11月13日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期
	2023年11月13日現在	2024年11月11日現在
1. 期首元本額	65,605,596,090円	55,843,127,585円
期中追加設定元本額	2,335,400,156円	1,322,990,311円
期中一部解約元本額	12,097,868,661円	10,631,773,844円
2. 受益権の総数	55,843,127,585口	46,534,344,052口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,049,911,719円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,203,573,017円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 2022年11月12日 至 2023年11月13日	自 2023年11月14日 至 2024年11月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(110,220,050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(754,401,487円)及び分配準備積立金(931,942,069円)より分配対象収益は1,796,563,606円(1万口当たり321.71円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(591,839,407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(651,904,339円)及び分配準備積立金(846,080,443円)より分配対象収益は2,089,824,189円(1万口当たり449.09円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期	第7期
	自 2022年11月12日 至 2023年11月13日	自 2023年11月14日 至 2024年11月11日

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 2023年11月13日現在	第7期 2024年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第6期 2023年11月13日現在	第7期 2024年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	354,324,394	730,976,354
合計	354,324,394	730,976,354

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第6期 2023年11月13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	7,993,112,963	-	8,075,915,220	82,802,257
イギリス・ポンド	3,065,399,673	-	3,095,031,500	29,631,827
オーストラリア・ドル	1,017,664,452	-	1,024,020,920	6,356,468
カナダ・ドル	850,014,682	-	857,259,720	7,245,038
ユーロ	3,060,034,156	-	3,099,603,080	39,568,924
合計	7,993,112,963	-	8,075,915,220	82,802,257

種類	第7期 2024年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	8,500,253,502	-	8,539,246,544	38,993,042
アメリカ・ドル	1,789,012,554	-	1,804,402,194	15,389,640
イギリス・ポンド	2,449,450,015	-	2,473,605,000	24,154,985
オーストラリア・ドル	895,364,100	-	905,550,300	10,186,200
カナダ・ドル	894,942,545	-	903,612,850	8,670,305
ユーロ	2,471,484,288	-	2,452,076,200	19,408,088
合計	8,500,253,502	-	8,539,246,544	38,993,042

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第6期 2023年11月13日現在	第7期 2024年11月11日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9454円 (9,454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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	94,767,468	462,976,988	

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,215,608,577	13,587,709,791	
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	598,816,029	1,352,605,646	
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	367,957,941	3,699,853,892	
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	298,601,965	673,646,033	
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,146,400,321	17,480,460,610	
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	606,769,839	1,149,404,106	
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,278,615,400	3,154,855,637	
親投資信託受益証券 合計	29,607,537,540	41,561,512,703	
合計		41,561,512,703	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,835,669,371
国債証券	445,552,854,850
地方債証券	26,111,884,633
特殊債証券	25,474,059,789
社債証券	21,698,199,600
未収利息	860,764,265
前払費用	111,937,735
流動資産合計	521,645,370,243
資産合計	521,645,370,243
負債の部	
流動負債	
未払解約金	878,919,000
流動負債合計	878,919,000
負債合計	878,919,000
純資産の部	
元本等	
元本	429,845,854,673
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	90,920,596,570
元本等合計	520,766,451,243
純資産合計	520,766,451,243
負債純資産合計	521,645,370,243

## 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11月14日 至 2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	438,127,800,594円
同期中追加設定元本額	632,107,986,794円
同期中一部解約元本額	640,389,932,715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	31,373,961,691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	20,448,888,184円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	7,656,073,711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)	2,547,443,710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)	3,145,450,655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)	23,905,765円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	201,773,930円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	8,525,517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>	12,632,504,116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)	2,668,906,485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>	3,532,630,357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>	179,420,386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(FOFs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)	2,332,755,196円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,125,598,999円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,414,836,384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)	94,286,304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)	604,661,896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>	16,178,157,090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	429,845,854,673円
2. 受益権の総数	429,845,854,673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11月14日 至 2024年11月11日
----	--------------------------------

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	7,657,788,150
地方債証券	368,853,324
特殊債券	536,298,687
社債券	224,632,200
合計	8,787,572,361

(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11月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2115円 (12,115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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	455回 利付国庫債券(2年)	1,700,000,000	1,693,489,000	
	456回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	1,993,540,000	
	457回 利付国庫債券(2年)	3,200,000,000	3,188,320,000	
	459回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	1,993,660,000	
	460回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,494,900,000	
	463回 利付国庫債券(2年)	2,700,000,000	2,696,760,000	
	464回 利付国庫債券(2年)	2,700,000,000	2,696,139,000	
	146回 利付国庫債券(5年)	4,700,000,000	4,685,242,000	
	147回 利付国庫債券(5年)	3,350,000,000	3,331,307,000	
	148回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	1,985,660,000	
	149回 利付国庫債券(5年)	3,180,000,000	3,152,493,000	
	150回 利付国庫債券(5年)	6,370,000,000	6,306,300,000	
	151回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,581,952,000	
	152回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,773,764,700	
	153回 利付国庫債券(5年)	5,210,000,000	5,145,031,300	
	154回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,448,700,000	
	155回 利付国庫債券(5年)	900,000,000	893,943,000	
156回 利付国庫債券(5年)	2,300,000,000	2,277,506,000		

157回 利付国庫債券(5年)	900,000,000	890,073,000	
158回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,464,200,000	
159回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	983,920,000	
160回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,579,936,000	
161回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,090,089,000	
162回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,583,696,000	
163回 利付国庫債券(5年)	3,650,000,000	3,626,567,000	
164回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,476,840,000	
165回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	988,570,000	
166回 利付国庫債券(5年)	500,000,000	496,290,000	
167回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,586,416,000	
168回 利付国庫債券(5年)	1,800,000,000	1,800,000,000	
169回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	995,750,000	
170回 利付国庫債券(5年)	1,900,000,000	1,898,290,000	
171回 利付国庫債券(5年)	2,400,000,000	2,376,360,000	
172回 利付国庫債券(5年)	2,800,000,000	2,784,936,000	
173回 利付国庫債券(5年)	500,000,000	499,055,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	117,942,000	
2回 利付国庫債券(40年)	330,000,000	339,418,200	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	551,210,400	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	730,353,600	
5回 利付国庫債券(40年)	710,000,000	686,925,000	
6回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	883,045,400	
7回 利付国庫債券(40年)	1,030,000,000	917,688,800	
8回 利付国庫債券(40年)	990,000,000	810,463,500	
9回 利付国庫債券(40年)	1,780,000,000	1,045,821,200	
10回 利付国庫債券(40年)	1,730,000,000	1,193,302,100	
11回 利付国庫債券(40年)	1,380,000,000	905,569,800	
12回 利付国庫債券(40年)	1,420,000,000	814,611,400	
13回 利付国庫債券(40年)	2,120,000,000	1,187,284,800	

14回 利付国庫債券(40年)	1,920,000,000	1,140,230,400	
15回 利付国庫債券(40年)	2,170,000,000	1,419,288,500	
16回 利付国庫債券(40年)	2,440,000,000	1,745,405,200	
17回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	743,536,000	
1回 CT利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,669,978,000	
2回 CT利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,505,145,000	
341回 利付国庫債券(10年)	3,620,000,000	3,616,597,200	
342回 利付国庫債券(10年)	3,520,000,000	3,504,864,000	
343回 利付国庫債券(10年)	3,090,000,000	3,072,541,500	
344回 利付国庫債券(10年)	3,570,000,000	3,545,367,000	
345回 利付国庫債券(10年)	5,060,000,000	5,019,418,800	
346回 利付国庫債券(10年)	4,540,000,000	4,498,822,200	
347回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,454,865,000	
348回 利付国庫債券(10年)	5,570,000,000	5,506,502,000	
349回 利付国庫債券(10年)	8,350,000,000	8,242,786,000	
350回 利付国庫債券(10年)	6,800,000,000	6,702,624,000	
351回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,345,328,000	
352回 利付国庫債券(10年)	3,370,000,000	3,310,249,900	
353回 利付国庫債券(10年)	3,690,000,000	3,618,266,400	
354回 利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,407,331,400	
355回 利付国庫債券(10年)	3,730,000,000	3,643,165,600	
356回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,313,538,000	
357回 利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,087,860,000	
358回 利付国庫債券(10年)	4,550,000,000	4,422,873,000	
359回 利付国庫債券(10年)	4,150,000,000	4,027,699,500	

360回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	3,972,777,000	
361回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	3,965,274,000	
362回 利付国庫債券(10年)	4,210,000,000	4,062,565,800	
363回 利付国庫債券(10年)	4,670,000,000	4,495,995,800	
364回 利付国庫債券(10年)	4,110,000,000	3,947,408,400	
365回 利付国庫債券(10年)	3,830,000,000	3,668,259,100	
366回 利付国庫債券(10年)	4,040,000,000	3,887,894,000	
367回 利付国庫債券(10年)	3,970,000,000	3,808,818,000	
368回 利付国庫債券(10年)	4,750,000,000	4,544,372,500	
369回 利付国庫債券(10年)	4,820,000,000	4,709,911,200	
370回 利付国庫債券(10年)	4,850,000,000	4,726,810,000	
371回 利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,432,238,000	
372回 利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,573,504,000	
373回 利付国庫債券(10年)	3,950,000,000	3,847,023,500	
374回 利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,546,594,000	
375回 利付国庫債券(10年)	4,680,000,000	4,739,670,000	
376回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	793,176,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	121,330,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	109,146,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	226,602,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	223,128,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	267,785,000	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	254,092,500	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	164,367,000	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	384,648,800	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	296,636,600	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	273,890,400	

17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	305,669,700	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	448,984,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	314,291,600	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	377,176,800	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	348,015,300	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	331,635,300	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	400,004,500	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	369,926,700	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	701,536,200	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	708,573,200	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	879,617,200	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	969,916,600	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	979,316,800	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	789,372,000	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,073,518,400	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,252,357,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,302,588,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,117,017,400	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,437,582,100	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,401,085,600	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	858,882,500	
39回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,238,943,200	
40回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,035,829,800	
41回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,046,410,800	
42回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	984,230,000	

43回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	696,680,400	
44回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,105,377,300	
45回 利付国庫債券(30年)	1,650,000,000	1,553,986,500	
46回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,446,398,800	
47回 利付国庫債券(30年)	1,340,000,000	1,277,636,400	
48回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,347,137,400	
49回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,186,887,000	
50回 利付国庫債券(30年)	1,750,000,000	1,409,432,500	
51回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,084,383,200	
52回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,041,810,000	
53回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,000,692,000	
54回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,106,322,000	
55回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	849,819,600	
56回 利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	892,517,400	
57回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,036,828,100	
58回 利付国庫債券(30年)	1,660,000,000	1,287,579,000	
59回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	919,270,000	
60回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	811,001,400	
61回 利付国庫債券(30年)	760,000,000	567,036,000	
62回 利付国庫債券(30年)	1,020,000,000	718,284,000	
63回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	987,638,500	
64回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	744,744,000	
65回 利付国庫債券(30年)	900,000,000	605,682,000	
66回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	728,599,600	
67回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	767,294,600	

68回 利付国庫債券(30年)	1,840,000,000	1,288,956,800	
69回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	974,848,000	
70回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,070,235,000	
71回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	944,486,200	
72回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	911,772,000	
73回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	907,515,000	
74回 利付国庫債券(30年)	1,670,000,000	1,272,389,700	
75回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,247,555,200	
76回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,107,955,200	
77回 利付国庫債券(30年)	1,380,000,000	1,213,020,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,085,240,000	
79回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,146,138,000	
80回 利付国庫債券(30年)	1,380,000,000	1,263,610,800	
81回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,306,680,000	
82回 利付国庫債券(30年)	1,710,000,000	1,560,169,800	
83回 利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,693,914,000	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	71,319,500	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	173,017,500	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	603,351,700	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	123,037,200	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	122,876,400	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	607,363,700	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,278,400	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	484,950,700	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	113,700,400	

92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,199,138,400	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	383,072,100	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	695,225,500	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	575,729,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	124,996,800	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	691,673,400	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	167,228,800	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	786,435,000	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	875,915,600	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	244,239,300	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	532,865,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	169,950,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	116,064,300	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	677,312,000	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	531,040,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	636,810,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	726,797,700	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	369,526,500	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	468,278,800	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	492,963,600	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	789,713,200	
113回 利付国庫債券(20年)	2,470,000,000	2,642,282,500	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	573,661,400	
117回 利付国庫債券(20年)	1,870,000,000	2,014,887,600	
118回 利付国庫債券(20年)	955,000,000	1,026,634,550	

119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	500,028,300	
120回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	526,530,000	
121回 利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,115,202,400	
122回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	927,994,200	
123回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,575,744,000	
125回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	985,977,000	
126回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	985,520,900	
127回 利付国庫債券(20年)	840,000,000	904,587,600	
128回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	215,758,000	
130回 利付国庫債券(20年)	1,110,000,000	1,192,195,500	
131回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,174,250,000	
132回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	566,246,700	
133回 利付国庫債券(20年)	2,030,000,000	2,182,595,100	
134回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	968,868,000	
135回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	139,038,900	
136回 利付国庫債券(20年)	560,000,000	594,815,200	
137回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	513,720,000	
138回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,118,787,600	
139回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	722,608,800	
140回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,017,317,000	
141回 利付国庫債券(20年)	1,560,000,000	1,670,666,400	
142回 利付国庫債券(20年)	730,000,000	787,655,400	
143回 利付国庫債券(20年)	2,130,000,000	2,265,148,500	
144回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,107,960,000	
145回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,410,065,000	

146回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,398,748,800	
147回 利付国庫債券(20年)	1,290,000,000	1,368,857,700	
148回 利付国庫債券(20年)	1,730,000,000	1,817,953,200	
149回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	2,402,942,800	
150回 利付国庫債券(20年)	2,330,000,000	2,419,029,300	
151回 利付国庫債券(20年)	2,360,000,000	2,401,111,200	
152回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,273,488,000	
153回 利付国庫債券(20年)	2,560,000,000	2,617,292,800	
154回 利付国庫債券(20年)	2,420,000,000	2,444,635,600	
155回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,250,747,600	
156回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,098,831,200	
157回 利付国庫債券(20年)	2,380,000,000	2,128,910,000	
158回 利付国庫債券(20年)	2,390,000,000	2,206,065,600	
159回 利付国庫債券(20年)	2,440,000,000	2,269,663,600	
160回 利付国庫債券(20年)	2,120,000,000	1,987,796,800	
161回 利付国庫債券(20年)	1,760,000,000	1,623,072,000	
162回 利付国庫債券(20年)	1,930,000,000	1,772,396,200	
163回 利付国庫債券(20年)	2,530,000,000	2,313,558,500	
164回 利付国庫債券(20年)	2,570,000,000	2,308,528,200	
165回 利付国庫債券(20年)	2,370,000,000	2,117,784,600	
166回 利付国庫債券(20年)	2,160,000,000	1,974,218,400	
167回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,723,995,000	
168回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,820,763,000	
169回 利付国庫債券(20年)	2,720,000,000	2,309,633,600	
170回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,350,352,000	

171回	利付国庫債券(20年)	1,590,000,000	1,333,692,000		
172回	利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,338,907,800		
173回	利付国庫債券(20年)	1,960,000,000	1,650,868,800		
174回	利付国庫債券(20年)	2,330,000,000	1,950,489,600		
175回	利付国庫債券(20年)	2,020,000,000	1,710,273,400		
176回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,768,515,000		
177回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,728,594,000		
178回	利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,167,100,000		
179回	利付国庫債券(20年)	1,810,000,000	1,500,309,000		
180回	利付国庫債券(20年)	2,140,000,000	1,860,730,000		
181回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,673,653,000		
182回	利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,588,755,000		
183回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,711,026,000		
184回	利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,423,501,000		
185回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	1,974,368,000		
186回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,107,072,000		
187回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,569,117,000		
188回	利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,887,249,000		
189回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,926,125,000		
190回	利付国庫債券(20年)	200,000,000	198,980,000		
国債証券 合計		468,615,000,000	445,552,854,850		
地方債証券	760回	東京都公募公債	100,000,000	99,036,000	
	783回	東京都公募公債	110,000,000	108,333,500	
	796回	東京都公募公債	200,000,000	193,478,000	
	802回	東京都公募公債	400,000,000	387,640,000	
	813回	東京都公募公債	300,000,000	289,833,000	
	1回	東京都公募公債 30年	200,000,000	220,906,000	
	14回	東京都公募公債 30年	100,000,000	103,124,000	
	9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	206,036,000	

10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	309,726,000	
18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	106,530,000	
21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,346,000	
31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	202,708,000	
28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,115,000	
30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	393,900,000	
30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	392,188,000	
令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	96,246,000	
36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	241,022,500	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	195,636,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	193,016,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	287,601,000	
3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	114,461,000	
11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	106,303,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	324,198,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	106,984,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	98,924,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,057,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	191,720,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	192,360,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	191,548,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	190,680,000	
474回 大阪府公募公債 10年	300,000,000	285,828,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	212,832,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	100,030,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	91,653,000	
190回 大阪府公募公債 5年	300,000,000	296,361,000	

29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	107,790,633	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	387,400,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	193,220,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	193,444,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	96,252,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	110,033,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	203,712,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	307,056,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	101,417,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	100,266,000	
令和元年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	193,572,000	
令和2年度10回 静岡県公募公債	100,000,000	96,551,000	
令和2年度14回 静岡県公募公債	200,000,000	192,302,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	102,144,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	102,465,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	201,048,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	318,984,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	323,913,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	104,819,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	208,868,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	139,668,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	195,032,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	197,469,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	98,448,000	
令和2年7回 広島県公募公債	200,000,000	193,200,000	
27年度2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	77,236,000	
令和2年2回 広島県公募公債	100,000,000	83,413,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	194,018,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	160,752,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	201,138,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	107,663,000	

13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	105,440,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	313,515,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	100,241,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	99,232,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	196,154,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	193,878,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	96,472,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	102,183,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	134,016,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	105,574,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	107,820,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	317,262,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,436,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	190,762,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	101,689,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	99,841,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	90,297,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	192,772,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	104,267,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,998,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,226,000	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,442,000	
160回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,705,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,640,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,415,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	395,832,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,717,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,774,000	

179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	493,790,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,111,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	292,092,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	484,945,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,766,000	
227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	479,205,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	477,440,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	98,059,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	192,780,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	197,468,000	
令和2年2回 大阪市公募公債	300,000,000	290,223,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	212,428,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	193,228,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	104,180,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	100,351,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	103,563,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	216,624,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	212,724,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	295,362,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	138,908,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	386,924,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	113,024,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	105,654,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	104,280,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	105,270,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	272,409,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	196,388,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	213,412,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	104,828,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	105,494,000	

	11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	324,117,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	104,226,000	
	22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	108,532,000	
	30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	180,330,000	
	2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	83,406,000	
	29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	182,314,000	
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	296,178,000	
	30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	90,539,000	
	令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	296,073,000	
	17回 さいたま市公募公債	200,000,000	193,880,000	
	令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	192,780,000	
	30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	195,326,000	
地方債証券 合計		26,639,330,000	26,111,884,633	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	203,418,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	201,928,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	296,997,000	
	125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	411,125,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	69,605,000	
	156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	382,612,000	
	33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,176,000	
	1回 高速道路機構債	300,000,000	345,783,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	165,840,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	228,264,000	
	36回 高速道路機構債	300,000,000	334,812,000	
	50回 高速道路機構債	300,000,000	255,666,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,293,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,990,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,554,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	92,446,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	86,577,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	84,911,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	177,264,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	89,077,000	
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,037,000		

116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,212,000	
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	531,665,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,027,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,004,000	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	300,975,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,397,000	
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	179,852,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	496,500,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	87,705,000	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	298,083,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	179,350,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,047,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	791,920,000	
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	183,462,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	90,424,000	
398回 政保道路債	300,000,000	199,338,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	114,626,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	135,922,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	137,478,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	575,405,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	210,886,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	320,547,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	321,066,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	108,041,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,247,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,442,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	105,699,000	

24回 地方公共団体金融機構債券20年	200,000,000	211,802,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,084,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,638,000	
36回 地方公共団体金融機構債券20年	100,000,000	104,262,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,845,000	
42回 地方公共団体金融機構債券20年	300,000,000	294,390,000	
44回 地方公共団体金融機構債券20年	200,000,000	201,170,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	289,059,000	
83回 地方公共団体金融機構債券10年	400,000,000	397,228,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,038,000	
59回 地方公共団体金融機構債券20年	100,000,000	91,511,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	494,620,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,945,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,691,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,404,000	
77回 地方公共団体金融機構債券20年	300,000,000	243,663,000	
10回 地方公共団体金融機構債券30年	300,000,000	199,371,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,265,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	212,768,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,377,880	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	101,712,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	101,476,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	201,266,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	139,482,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	102,693,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	212,874,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,426,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	377,244,000	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,763,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,555,000	

124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,322,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	251,042,500	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,926,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,296,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	295,911,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	295,920,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	88,698,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,315,000	
325回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,315,000	
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,365,000	13,692,308	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,800,000	87,641,648	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,552,000	130,004,338	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,075,000	18,518,199	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,546,000	15,934,960	
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,091,000	18,468,740	
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,201,000	19,600,380	
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,310,000	23,702,074	
64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,852,000	58,241,922	
76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,967,000	26,245,106	
82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,682,000	31,603,745	
84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,970,000	31,888,156	
86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,484,000	35,259,386	
90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,189,000	36,691,039	
93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,458,000	40,987,679	
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,713,000	46,334,571	

9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,761,000	48,564,247	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,117,000	176,784,680	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,473,000	60,520,160	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,965,000	60,150,127	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,540,000	60,608,223	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	201,042,000	187,292,737	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,358,000	186,565,355	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,448,000	127,768,911	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	205,038,000	190,027,168	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	203,109,000	188,336,882	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	354,210,000	329,156,726	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,414,000	65,368,836	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,804,000	66,744,523	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,886,000	215,668,120	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	315,004,000	287,589,201	
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	242,640,000	221,103,273	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	248,187,000	226,559,984	
1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	754,740,000	688,104,005	
い第851号 利付商工債	300,000,000	297,582,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	296,658,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	197,644,000	
3 7 7 回 利附信金中金債(5年)	300,000,000	297,579,000	
1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	105,924,000	
7 2 回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,264,000	
7 7 回 東日本高速道路社債	300,000,000	294,663,000	
8 7 回 中日本高速道路債券	400,000,000	397,216,000	
7 8 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,979,000	
9 0 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	191,760,000	
特殊債券 合計	26,255,991,000	25,474,059,789	

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	294,990,000	
	11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	99,208,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	397,892,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	82,241,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,182,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	193,798,000	
	79回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,261,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,174,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,038,000	
	91回 中日本高速道路債券	500,000,000	494,505,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	297,648,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	198,592,000	
	61回 西日本高速道路債券	500,000,000	495,355,000	
	62回 西日本高速道路債券	500,000,000	494,500,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,042,000	
	3回 ダイドーグループHD社債	300,000,000	289,287,000	
	9回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	91,568,000	
	14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,026,000	
	30回 東レ社債	300,000,000	296,814,000	
	42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	198,230,000	
	23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	179,172,000	
	40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	98,990,000	
	17回 ダイセル社債	300,000,000	288,978,000	
	16回 武田薬品工業社債	500,000,000	472,920,000	
	4回 ENEOSホールディングス社債	300,000,000	289,545,000	
	14回 プリヂストン社債	300,000,000	292,686,000	
	35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	296,778,000	
	17回 パナソニック社債	100,000,000	99,325,000	
	19回 パナソニック社債	100,000,000	96,425,000	
	23回 パナソニック社債	200,000,000	191,414,000	
	58回 川崎重工業社債	300,000,000	283,053,000	
	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	97,989,000	
	26回 トヨタ自動車社債	200,000,000	198,368,000	
	26回 豊田通商社債	100,000,000	88,607,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	388,364,000		
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	103,633,000		
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	102,434,000		
20回 三井住友信託銀行社債	300,000,000	296,565,000		

28回 芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,348,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	294,969,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	386,792,000	
69回 ホンダファイナンス社債	300,000,000	296,886,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,503,000	
96回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,148,000	
80回 日立キャピタル社債	200,000,000	192,392,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	286,254,000	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	97,327,000	
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	197,814,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	192,164,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	295,692,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	296,097,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	99,453,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	197,980,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	101,365,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	86,085,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	106,178,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,638,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	213,868,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	87,904,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	79,567,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	88,755,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,580,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	59,111,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,441,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	163,364,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	135,142,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,912,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	192,908,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	69,660,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	60,044,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,511,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	162,890,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,395,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	123,243,600	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	58,045,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	288,636,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	192,686,000	

1 2 回	ソフトバンク社債	400,000,000	388,648,000	
3 0 回	光通信社債	200,000,000	187,616,000	
5 2 7 回	中部電力社債	100,000,000	89,002,000	
5 3 2 回	中部電力社債	200,000,000	193,490,000	
5 0 8 回	関西電力社債	300,000,000	297,552,000	
5 3 0 回	関西電力社債	400,000,000	390,292,000	
5 3 1 回	関西電力社債	200,000,000	167,326,000	
5 4 1 回	関西電力社債	300,000,000	284,508,000	
3 9 6 回	中国電力社債	200,000,000	191,250,000	
4 2 5 回	中国電力社債	100,000,000	96,394,000	
3 0 7 回	北陸電力社債	100,000,000	100,519,000	
3 1 1 回	北陸電力社債	100,000,000	100,117,000	
4 8 8 回	東北電力社債	100,000,000	99,087,000	
5 2 1 回	東北電力社債	400,000,000	387,760,000	
5 2 5 回	東北電力社債	200,000,000	196,568,000	
5 3 6 回	東北電力社債	300,000,000	282,945,000	
3 2 0 回	四国電力社債	300,000,000	286,248,000	
4 6 3 回	九州電力社債	100,000,000	87,223,000	
4 6 6 回	九州電力社債	100,000,000	86,051,000	
4 9 1 回	九州電力社債	300,000,000	285,831,000	
4 9 2 回	九州電力社債	100,000,000	79,687,000	
4 9 3 回	九州電力社債	200,000,000	198,114,000	
5 0 7 回	九州電力社債	200,000,000	191,790,000	
3 4 0 回	北海道電力社債	300,000,000	297,588,000	
3 5 0 回	北海道電力社債	200,000,000	173,528,000	
5 4 回	電源開発社債	100,000,000	98,677,000	
7 5 回	電源開発社債	200,000,000	189,110,000	
4 1 回	東京瓦斯社債	200,000,000	179,276,000	
5 2 回	東京瓦斯社債	100,000,000	83,898,000	
5 5 回	東京瓦斯社債	100,000,000	80,595,000	
5 7 回	東京瓦斯社債	300,000,000	169,725,000	
7 回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	196,690,000	
8 回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	177,750,000	
社債券 合計		22,820,000,000	21,698,199,600	
合計			518,836,998,872	

## 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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,836,443,148
株式	574,020,539,510
派生商品評価勘定	239,908,230
未収入金	2,310,000
未収配当金	5,657,961,132
差入委託証拠金	769,927,413
流動資産合計	594,527,089,433
資産合計	594,527,089,433
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,598,380
前受金	252,480,000
未払金	13,981,808,871
未払解約金	903,901,000
流動負債合計	15,143,788,251
負債合計	15,143,788,251
純資産の部	
元本等	
元本	118,594,587,643
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	460,788,713,539
元本等合計	579,383,301,182
純資産合計	579,383,301,182
負債純資産合計	594,527,089,433

## 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11月14日 至 2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	117,226,519,868円
同期中追加設定元本額	38,930,604,523円
同期中一部解約元本額	37,562,536,748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	2,346,467,036円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	5,786,183,750円
One DC 国内株式インデックスファンド	34,191,681,378円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,563,492,459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	3,391,612,557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)	48,841,984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)	449,015,549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)	414,447,715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)	623,126,069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)	1,233,813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)	7,398,261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>	32,994,419,002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	921,325,512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	244,886,317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	3,692,177,616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>	450,419,573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	149,934,326円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	408,038,431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)	1,500,263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>	1,037,802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)	66,431,622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)	2,777,613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)	1,905,994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)	221,307,736円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	358,556,840円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,117,310,848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)	23,864,403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)	90,974,590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	759,982,121円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	42,941,435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	118,594,587,643円
2. 受益権の総数	118,594,587,643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11月14日 至 2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	36,001,538,323	
合計	36,001,538,323	

（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11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2024年11月11日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	12,237,090,000	-	12,471,550,000	234,460,000
合計	12,237,090,000	-	12,471,550,000	234,460,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2024年11月11日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.8854円 (48,854円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年11月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	8,600	3,975.00	34,185,000	
ニッスイ	205,100	952.00	195,255,200	
マルハニチロ	30,500	2,880.00	87,840,000	
雪国まいたけ	17,500	1,037.00	18,147,500	
カネコ種苗	5,800	1,371.00	7,951,800	
サカタのタネ	22,900	3,455.00	79,119,500	
ホクト	18,200	1,776.00	32,323,200	
ホクリヨウ	400	1,060.00	424,000	
ショーボンドホールディングス	26,900	5,341.00	143,672,900	
ミライト・ワン	67,000	2,221.00	148,807,000	

タマホーム	13,000	3,795.00	49,335,000
サンヨーホームズ	300	707.00	212,100
日本アクア	1,100	799.00	878,900
ファーストコーポレーション	700	820.00	574,000
ベステラ	500	936.00	468,000
robot home	39,800	140.00	5,572,000
キャンディル	400	528.00	211,200
住石ホールディングス	22,600	949.00	21,447,400
日鉄鉱業	8,200	4,235.00	34,727,000
三井松島ホールディングス	10,000	3,805.00	38,050,000
I N P E X	619,800	2,008.00	1,244,558,400
石油資源開発	112,500	1,103.00	124,087,500
K & O エナジーグループ	9,300	3,060.00	28,458,000
リョーサン菱洋ホールディングス	26,100	2,353.00	61,413,300
ダイセキ環境ソリューション	500	1,255.00	627,500
第一カッター興業	5,900	1,456.00	8,590,400
明豊ファシリティワークス	900	892.00	802,800
安藤・間	118,700	1,161.00	137,810,700
東急建設	64,200	683.00	43,848,600
コムシスホールディングス	72,800	3,172.00	230,921,600
ビーアールホールディングス	30,100	347.00	10,444,700
高松コンストラクショングループ	15,200	2,912.00	44,262,400
東建コーポレーション	5,200	10,500.00	54,600,000
ソネック	200	851.00	170,200
ヤマウラ	10,400	1,192.00	12,396,800
オリエンタル白石	75,900	377.00	28,614,300
大成建設	130,300	6,973.00	908,581,900
大林組	473,600	2,038.00	965,196,800
清水建設	406,800	1,034.00	420,631,200
長谷工コーポレーション	131,600	1,831.00	240,959,600
松井建設	13,600	836.00	11,369,600
銭高組	200	3,420.00	684,000
鹿島建設	318,100	2,735.50	870,162,550
不動テトラ	9,000	2,062.00	18,558,000
大末建設	700	1,648.00	1,153,600
鉄建建設	9,400	2,360.00	22,184,000
西松建設	22,900	5,223.00	119,606,700
三井住友建設	115,500	388.00	44,814,000
大豊建設	3,900	3,370.00	13,143,000
佐田建設	1,000	852.00	852,000
ナカノフドー建設	1,300	500.00	650,000
奥村組	25,300	4,335.00	109,675,500
東鉄工業	15,800	3,160.00	49,928,000
イチケン	400	2,583.00	1,033,200
富士ピー・エス	600	407.00	244,200
浅沼組	57,500	664.00	38,180,000
戸田建設	176,600	935.00	165,121,000
熊谷組	23,700	3,530.00	83,661,000
北野建設	300	4,120.00	1,236,000
植木組	400	1,568.00	627,200

矢作建設工業	19,400	1,479.00	28,692,600
ピーエス・コンストラクション	10,400	1,053.00	10,951,200
日本ハウスホールディングス	30,600	323.00	9,883,800
大東建託	49,000	17,115.00	838,635,000
新日本建設	20,100	1,540.00	30,954,000
サムティホールディングス	27,400	3,295.00	90,283,000
東亜道路工業	24,800	1,247.00	30,925,600
日本道路	14,400	1,683.00	24,235,200
東亜建設工業	43,200	975.00	42,120,000
日本国土開発	40,800	517.00	21,093,600
若築建設	4,400	3,560.00	15,664,000
東洋建設	41,300	1,296.00	53,524,800
五洋建設	187,700	617.60	115,923,520
世紀東急工業	20,400	1,563.00	31,885,200
福田組	5,400	5,650.00	30,510,000
日本ドライケミカル	400	3,495.00	1,398,000
住友林業	124,000	5,819.00	721,556,000
日本基礎技術	1,100	683.00	751,300
巴コーポレーション	1,800	865.00	1,557,000
大和ハウス工業	432,800	4,506.00	1,950,196,800
ライト工業	29,200	2,145.00	62,634,000
積水ハウス	435,100	3,660.00	1,592,466,000
日特建設	13,800	995.00	13,731,000
北陸電気工事	9,800	1,123.00	11,005,400
ユアテック	27,600	1,426.00	39,357,600
日本リーテック	11,100	1,099.00	12,198,900
四電工	18,000	1,515.00	27,270,000
中電工	22,400	3,475.00	77,840,000
関電工	78,600	2,144.00	168,518,400
きんでん	99,700	3,066.00	305,680,200
東京エネシス	15,300	1,044.00	15,973,200
トーエネック	23,800	913.00	21,729,400
住友電設	11,600	5,030.00	58,348,000
日本電設工業	26,900	1,855.00	49,899,500
エクシオグループ	152,100	1,578.50	240,089,850
新日本空調	9,300	3,910.00	36,363,000
九電工	31,100	5,538.00	172,231,800
三機工業	30,000	2,884.00	86,520,000
日揮ホールディングス	142,000	1,401.00	198,942,000
中外炉工業	4,700	2,808.00	13,197,600
ヤマト	1,500	998.00	1,497,000
太平電業	9,100	5,070.00	46,137,000
高砂熱学工業	34,500	5,637.00	194,476,500
三晃金属工業	200	4,235.00	847,000
NEC ネットズエスアイ	57,200	3,310.00	189,332,000
朝日工業社	13,500	1,357.00	18,319,500
明星工業	24,600	1,339.00	32,939,400
大気社	18,300	4,945.00	90,493,500
ダイダン	18,800	3,655.00	68,714,000
日比谷総合設備	11,600	3,840.00	44,544,000

ニッポン	47,500	2,180.00	103,550,000
日清製粉グループ本社	149,800	1,806.00	270,538,800
日東富士製粉	2,400	6,910.00	16,584,000
昭和産業	12,100	2,746.00	33,226,600
鳥越製粉	1,500	677.00	1,015,500
中部飼料	19,900	1,352.00	26,904,800
フィード・ワン	21,200	814.00	17,256,800
東洋精糖	300	1,393.00	417,900
日本甜菜製糖	7,500	2,306.00	17,295,000
D M三井製糖ホールディングス	14,300	3,230.00	46,189,000
塩水港精糖	2,100	289.00	606,900
ウェルネオシュガー	8,600	2,228.00	19,160,800
L I F U L L	37,300	151.00	5,632,300
M I X I	28,100	2,684.00	75,420,400
ジェイエイシーリクルートメント	54,400	733.00	39,875,200
日本M&Aセンターホールディングス	221,100	676.00	149,463,600
メンバーズ	5,900	1,085.00	6,401,500
中広	300	444.00	133,200
U Tグループ	19,500	2,650.00	51,675,000
アイティメディア	8,000	1,589.00	12,712,000
ケアネット	30,800	660.00	20,328,000
E・Jホールディングス	8,800	1,703.00	14,986,400
オープンアップグループ	45,300	1,896.00	85,888,800
コシダカホールディングス	44,900	1,210.00	54,329,000
アルトナー	700	1,800.00	1,260,000
パソナグループ	18,200	1,961.00	35,690,200
C D S	500	1,840.00	920,000
リンクアンドモチベーション	37,200	546.00	20,311,200
エス・エム・エス	57,500	1,672.00	96,140,000
サニーサイドアップグループ	600	528.00	316,800
パーソルホールディングス	1,402,900	255.10	357,879,790
リニカル	1,200	368.00	441,600
クックパッド	41,600	164.00	6,822,400
エスクリ	700	201.00	140,700
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,100	738.00	811,800
森永製菓	60,100	2,749.00	165,214,900
中村屋	3,500	3,220.00	11,270,000
江崎グリコ	41,200	4,265.00	175,718,000
名糖産業	6,400	1,917.00	12,268,800
井村屋グループ	7,900	2,418.00	19,102,200
不二家	9,800	2,642.00	25,891,600
山崎製パン	96,500	2,892.50	279,126,250
第一屋製パン	300	614.00	184,200
モロゾフ	4,700	4,630.00	21,761,000
亀田製菓	9,100	4,280.00	38,948,000
寿スピリッツ	85,100	2,196.00	186,879,600
カルビー	65,900	3,231.00	212,922,900
森永乳業	55,400	3,011.00	166,809,400
六甲バター	10,500	1,395.00	14,647,500
ヤクルト本社	205,800	3,230.00	664,734,000

明治ホールディングス	192,500	3,347.00	644,297,500
雪印メグミルク	38,800	2,531.00	98,202,800
プリマハム	19,300	2,201.00	42,479,300
日本ハム	62,000	4,939.00	306,218,000
林兼産業	600	460.00	276,000
丸大食品	14,500	1,744.00	25,288,000
S Foods	15,900	2,717.00	43,200,300
柿安本店	5,600	2,746.00	15,377,600
伊藤ハム米久ホールディングス	22,100	3,790.00	83,759,000
学情	7,600	1,714.00	13,026,400
スタジオアリス	7,500	2,052.00	15,390,000
クロスキャット	8,400	1,136.00	9,542,400
エプコ	500	765.00	382,500
システナ	209,700	351.00	73,604,700
N J S	3,700	3,765.00	13,930,500
デジタルアーツ	9,200	6,020.00	55,384,000
日鉄ソリューションズ	50,100	4,251.00	212,975,100
総合警備保障	251,200	1,101.50	276,696,800
キューブシステム	7,700	1,009.00	7,769,300
いちご	121,900	399.00	48,638,100
日本駐車場開発	171,400	227.00	38,907,800
コア	6,500	1,874.00	12,181,000
カカクコム	108,300	2,615.50	283,258,650
アイロムグループ	6,100	2,583.00	15,756,300
セントケア・ホールディング	9,500	720.00	6,840,000
サイネックス	300	757.00	227,100
ルネサンス	11,600	991.00	11,495,600
ディップ	26,300	2,635.00	69,300,500
S B Sホールディングス	13,200	2,450.00	32,340,000
デジタルホールディングス	7,600	1,221.00	9,279,600
新日本科学	15,900	1,490.00	23,691,000
キャリアデザインセンター	300	1,824.00	547,200
エムスリー	297,100	1,392.50	413,711,750
ツカダ・グローバルホールディング	1,300	393.00	510,900
プラス	200	538.00	107,600
ウェルネット	1,500	900.00	1,350,000
ワールドホールディングス	5,900	2,050.00	12,095,000
ディー・エヌ・エー	60,000	2,467.00	148,020,000
博報堂DYホールディングス	170,500	1,221.50	208,265,750
ぐるなび	27,900	314.00	8,760,600
タカミヤ	20,300	447.00	9,074,100
ファンコミュニケーションズ	21,200	412.00	8,734,400
ライク	5,600	1,391.00	7,789,600
A o b a B B T	700	320.00	224,000
エスプール	47,600	362.00	17,231,200
W D Bホールディングス	7,700	1,692.00	13,028,400
手間いらず	2,400	3,280.00	7,872,000
ティア	1,000	427.00	427,000
アドウェイズ	18,500	329.00	6,086,500
バリューコマース	13,300	1,118.00	14,869,400

インフォーマート	141,900	300.00	42,570,000	
サッポロホールディングス	47,500	7,225.00	343,187,500	
アサヒグループホールディングス	1,081,400	1,768.50	1,912,455,900	
麒麟ホールディングス	599,800	2,138.00	1,282,372,400	
宝ホールディングス	97,100	1,223.00	118,753,300	
オエノンホールディングス	46,700	427.00	19,940,900	
養命酒製造	4,800	2,482.00	11,913,600	
飛島ホールディングス	14,700	1,547.00	22,740,900	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	101,500	2,304.50	233,906,750	
ライフドリンク カンパニー	31,500	1,945.00	61,267,500	
サントリー食品インターナショナル	101,300	4,999.00	506,398,700	
ダイドーグループホールディングス	16,300	3,040.00	49,552,000	
伊藤園	48,300	3,268.00	157,844,400	
キーコーヒー	16,100	2,020.00	32,522,000	
ユニカフェ	600	938.00	562,800	
日清オイリオグループ	20,200	5,060.00	102,212,000	
不二製油グループ本社	28,900	3,064.00	88,549,600	
かどや製油	200	3,580.00	716,000	
J-オイルミルズ	16,500	2,100.00	34,650,000	
サンエー	26,200	2,823.00	73,962,600	
カワチ薬品	12,000	2,456.00	29,472,000	
エービーシー・マート	67,700	3,017.00	204,250,900	
ハードオフコーポレーション	6,100	1,870.00	11,407,000	
高千穂交易	6,100	3,920.00	23,912,000	
アスクル	36,500	1,917.00	69,970,500	
ゲオホールディングス	17,300	1,438.00	24,877,400	
アダストリア	21,500	3,540.00	76,110,000	
ジーフット	1,400	282.00	394,800	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	534.00	106,800	
オルバヘルスケアホールディングス	300	2,011.00	603,300	
伊藤忠食品	3,400	6,740.00	22,916,000	
くら寿司	18,100	3,960.00	71,676,000	
キャンドゥ	5,500	3,270.00	17,985,000	
エレマテック	13,900	2,396.00	33,304,400	
IKホールディングス	600	372.00	223,200	
パルグループホールディングス	35,400	3,030.00	107,262,000	
エディオン	67,400	1,783.00	120,174,200	
あらた	23,700	3,470.00	82,239,000	
サーラコーポレーション	32,500	837.00	27,202,500	
ワッツ	700	684.00	478,800	
トーメンデバイス	2,200	6,710.00	14,762,000	
ハローズ	6,200	4,175.00	25,885,000	
JPホールディングス	38,500	675.00	25,987,500	
フジオフードグループ本社	17,400	1,367.00	23,785,800	
あみやき亭	11,200	1,657.00	18,558,400	
東京エレクトロン デバイス	15,400	3,155.00	48,587,000	
ひらまつ	4,000	177.00	708,000	
円谷フィールズホールディングス	25,000	1,920.00	48,000,000	
双日	172,200	3,159.00	543,979,800	

アルフレッサ ホールディングス	144,300	2,194.50	316,666,350	
大黒天物産	4,800	10,700.00	51,360,000	
ハニーズホールディングス	13,800	1,620.00	22,356,000	
ファーマライズホールディングス	400	619.00	247,600	
キッコーマン	477,100	1,753.00	836,356,300	
味の素	338,400	6,171.00	2,088,266,400	
ブルドックソース	7,600	1,788.00	13,588,800	
キュービー	77,300	3,626.00	280,289,800	
ハウス食品グループ本社	48,500	2,843.50	137,909,750	
カゴメ	61,700	3,026.00	186,704,200	
アリアケジャパン	14,400	5,450.00	78,480,000	
ピエトロ	300	1,765.00	529,500	
エバラ食品工業	3,400	2,984.00	10,145,600	
やまみ	200	3,725.00	745,000	
ニチレイ	58,700	4,124.00	242,078,800	
横浜冷凍	39,000	870.00	33,930,000	
東洋水産	66,700	9,647.00	643,454,900	
イートアンドホールディングス	7,500	2,122.00	15,915,000	
大冷	200	1,903.00	380,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,900	1,392.00	10,996,800	
日清食品ホールディングス	185,700	3,800.00	705,660,000	
一正蒲鉾	700	735.00	514,500	
フジッコ	14,800	1,704.00	25,219,200	
ロック・フィールド	17,500	1,450.00	25,375,000	
日本たばこ産業	875,100	4,203.00	3,678,045,300	
ケンコーマヨネーズ	9,000	2,200.00	19,800,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,600	2,016.00	19,353,600	
なとり	9,100	2,131.00	19,392,100	
イフジ産業	300	1,485.00	445,500	
ファーマフーズ	19,000	1,020.00	19,380,000	
北の達人コーポレーション	61,700	156.00	9,625,200	
ユーグレナ	89,500	428.00	38,306,000	
紀文食品	12,600	1,092.00	13,759,200	
ピックルスホールディングス	8,400	1,050.00	8,820,000	
スター・マイカ・ホールディングス	14,800	664.00	9,827,200	
SREホールディングス	5,300	3,730.00	19,769,000	
ADワークスグループ	4,000	204.00	816,000	
片倉工業	13,600	2,045.00	27,812,000	
グンゼ	10,400	5,200.00	54,080,000	
ヒューリック	336,000	1,457.50	489,720,000	
神栄	200	1,530.00	306,000	
ラサ商事	8,500	1,408.00	11,968,000	
アルペン	12,900	2,027.00	26,148,300	
ハブ	600	738.00	442,800	
ラクーンホールディングス	11,000	716.00	7,876,000	
クオールホールディングス	19,100	1,379.00	26,338,900	
アルコニックス	22,200	1,440.00	31,968,000	
神戸物産	119,800	3,675.00	440,265,000	
ソリトンシステムズ	7,600	1,279.00	9,720,400	
ジンズホールディングス	11,700	6,450.00	75,465,000	

ビックカメラ	92,600	1,664.50	154,132,700
DCMホールディングス	80,100	1,398.00	111,979,800
ペッパーフードサービス	45,600	198.00	9,028,800
ハイパー	500	321.00	160,500
MonotaRO	219,400	2,805.00	615,417,000
東京一番フーズ	600	496.00	297,600
DDグループ	1,100	1,334.00	1,467,400
あいホールディングス	24,700	2,329.00	57,526,300
ディーブイエックス	400	911.00	364,400
きちりホールディングス	500	901.00	450,500
J.フロントリテイリング	177,700	1,702.00	302,445,400
ドトール・日レスホールディングス	27,400	2,237.00	61,293,800
マツキヨココカラ&カンパニー	272,700	2,113.50	576,351,450
ブロンコビリー	9,100	3,765.00	34,261,500
ZOZO	115,100	5,200.00	598,520,000
トレジャー・ファクトリー	10,600	1,313.00	13,917,800
物語コーポレーション	27,000	3,450.00	93,150,000
三越伊勢丹ホールディングス	234,900	2,277.00	534,867,300
東洋紡	63,300	943.00	59,691,900
ユニチカ	47,400	251.00	11,897,400
富士紡ホールディングス	5,800	4,850.00	28,130,000
日清紡ホールディングス	111,200	914.50	101,692,400
倉敷紡績	10,300	5,690.00	58,607,000
ダイワボウホールディングス	68,500	3,157.00	216,254,500
シキボウ	10,400	1,000.00	10,400,000
日東紡績	16,500	6,610.00	109,065,000
トヨタ紡織	61,400	1,983.50	121,786,900
マクニカホールディングス	119,900	1,805.00	216,419,500
Hamee	6,300	1,086.00	6,841,800
マーケットエンタープライズ	100	990.00	99,000
ラクト・ジャパン	6,600	2,784.00	18,374,400
ウエルシアホールディングス	80,300	1,903.00	152,810,900
クリエイトSDホールディングス	22,000	2,959.00	65,098,000
グリムス	6,500	2,590.00	16,835,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	21,400	1,133.00	24,246,200
八洲電機	12,600	1,632.00	20,563,200
メディアスホールディングス	9,000	820.00	7,380,000
レスター	13,300	2,604.00	34,633,200
ジオリーブグループ	400	1,055.00	422,000
丸善CHIホールディングス	2,500	318.00	795,000
大光	900	627.00	564,300
OCHIホールディングス	400	1,290.00	516,000
TOKAIホールディングス	84,000	913.00	76,692,000
黒谷	600	545.00	327,000
ミサワ	400	687.00	274,800
ティーライフ	200	1,199.00	239,800
Cominix	300	846.00	253,800
エー・ピーホールディングス	500	912.00	456,000
三洋貿易	15,900	1,458.00	23,182,200

チムニー	600	1,233.00	739,800
シュッピン	15,200	969.00	14,728,800
ビューティガレージ	4,900	1,492.00	7,310,800
オイシックス・ラ・大地	24,900	1,250.00	31,125,000
ウイン・パートナーズ	11,200	1,273.00	14,257,600
ネクステージ	35,300	1,561.00	55,103,300
ジョイフル本田	42,900	2,000.00	85,800,000
エターナルホスピタリティグループ	5,700	3,475.00	19,807,500
ホットランド	11,800	2,380.00	28,084,000
すかいらくホールディングス	211,600	2,374.50	502,444,200
SFPホールディングス	8,700	1,961.00	17,060,700
綿半ホールディングス	12,000	1,625.00	19,500,000
日本毛織	37,600	1,281.00	48,165,600
ダイトウボウ	2,600	101.00	262,600
トーア紡コーポレーション	700	398.00	278,600
ダイドーリミテッド	1,500	866.00	1,299,000
ヨシックスホールディングス	5,100	3,250.00	16,575,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,400	817.00	41,176,800
野村不動産ホールディングス	90,300	3,805.00	343,591,500
三重交通グループホールディングス	30,900	498.00	15,388,200
ディア・ライフ	24,500	879.00	21,535,500
コーセーアールイー	500	708.00	354,000
地主	12,900	2,111.00	27,231,900
プレサンスコーポレーション	19,100	1,959.00	37,416,900
フィル・カンパニー	2,800	882.00	2,469,600
THEグローバル社	1,100	635.00	698,500
ハウスコム	300	1,360.00	408,000
JPMC	8,300	1,150.00	9,545,000
サンセイランディック	500	957.00	478,500
エストラスト	200	681.00	136,200
フージャースホールディングス	22,300	1,035.00	23,080,500
オープンハウスグループ	52,700	5,751.00	303,077,700
東急不動産ホールディングス	433,100	961.80	416,555,580
飯田グループホールディングス	138,000	2,174.00	300,012,000
イーグランド	200	1,354.00	270,800
ムゲンエステート	1,200	1,845.00	2,214,000
帝国繊維	16,500	2,759.00	45,523,500
日本コークス工業	148,800	93.00	13,838,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	444.00	3,996,000
ミタチ産業	500	1,140.00	570,000
B E E N O S	9,600	2,711.00	26,025,600
あさひ	13,000	1,487.00	19,331,000
日本調剤	10,200	1,346.00	13,729,200
コスモス薬品	26,200	7,149.00	187,303,800
シップヘルスケアホールディングス	61,000	2,152.00	131,272,000
トーエル	800	777.00	621,600
ソフトクリエイイトホールディングス	10,500	2,106.00	22,113,000
セブン&アイ・ホールディングス	1,709,300	2,211.00	3,779,262,300

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	116,300	1,185.00	137,815,500	
明治電機工業	5,800	1,410.00	8,178,000	
ツルハホールディングス	32,500	8,500.00	276,250,000	
デリカフーズホールディングス	800	505.00	404,000	
スターティアホールディングス	500	2,220.00	1,110,000	
サンマルクホールディングス	12,600	2,311.00	29,118,600	
フェリシモ	400	845.00	338,000	
トリドールホールディングス	43,300	4,018.00	173,979,400	
帝人	140,700	1,398.50	196,768,950	
東レ	1,070,600	931.60	997,370,960	
クラレ	213,500	2,103.50	449,097,250	
旭化成	991,100	1,147.00	1,136,791,700	
TOKYO BASE	16,600	273.00	4,531,800	
稲葉製作所	8,400	1,799.00	15,111,600	
宮地エンジニアリンググループ	18,100	1,930.00	34,933,000	
トーカロ	43,400	1,929.00	83,718,600	
アルファ	600	1,068.00	640,800	
SUMCO	287,300	1,408.50	404,662,050	
川田テクノロジーズ	9,700	2,429.00	23,561,300	
RS Technologies	11,500	3,870.00	44,505,000	
ジェイテックコーポレーション	300	1,697.00	509,100	
信和	1,200	751.00	901,200	
ピーロット	1,000	1,157.00	1,157,000	
ファーストブラザーズ	400	1,138.00	455,200	
And Doホールディングス	8,700	1,046.00	9,100,200	
シーアールイー	6,400	1,180.00	7,552,000	
ケイアイスター不動産	7,800	3,810.00	29,718,000	
アグレ都市デザイン	300	1,586.00	475,800	
グッドコムアセット	11,600	821.00	9,523,600	
ジェイ・エス・ビー	6,000	2,686.00	16,116,000	
ロードスターキャピタル	8,200	2,384.00	19,548,800	
イノベーションホールディングス	600	935.00	561,000	
グローバル・リンク・マネジメント	300	2,382.00	714,600	
フェイスネットワーク	500	1,584.00	792,000	
霞ヶ関キャピタル	5,900	14,150.00	83,485,000	
住江織物	300	2,020.00	606,000	
日本フェルト	1,000	472.00	472,000	
イチカワ	200	1,562.00	312,400	
エコナックホールディングス	1,500	120.00	180,000	
日東製網	200	1,443.00	288,600	
芦森工業	300	2,440.00	732,000	
アツギ	1,100	922.00	1,014,200	
ウイルプラスホールディングス	300	1,067.00	320,100	
JMホールディングス	11,600	2,812.00	32,619,200	
コメダホールディングス	40,500	2,913.00	117,976,500	
サツドラホールディングス	700	790.00	553,000	
アレンザホールディングス	11,500	1,074.00	12,351,000	
串カツ田中ホールディングス	4,700	1,583.00	7,440,100	
パロックジャパンリミテッド	18,000	782.00	14,076,000	

クスリのアオキホールディングス	51,600	3,280.00	169,248,000
ダイニック	500	740.00	370,000
共和レザー	1,100	632.00	695,200
ピーバンドットコム	300	352.00	105,600
力の源ホールディングス	11,500	1,083.00	12,454,500
FOOD & LIFE COMPANIES	82,500	3,138.00	258,885,000
アセンテック	5,900	611.00	3,604,900
セーレン	28,200	2,638.00	74,391,600
ソトー	500	674.00	337,000
東海染工	200	687.00	137,400
小松マテーレ	21,300	763.00	16,251,900
ワコールホールディングス	30,400	4,609.00	140,113,600
ホギメディカル	19,700	4,540.00	89,438,000
クラウドシアホールディングス	400	334.00	133,600
T S Iホールディングス	48,400	880.00	42,592,000
マツオカコーポレーション	400	1,810.00	724,000
ワールド	22,700	1,918.00	43,538,600
T I S	155,000	3,891.00	603,105,000
テクミラホールディングス	800	324.00	259,200
グリー	49,100	408.00	20,032,800
GMOペパボ	1,800	1,463.00	2,633,400
コーエーテックモホールディングス	110,200	1,632.00	179,846,400
三菱総合研究所	7,200	4,310.00	31,032,000
ボルテージ	400	231.00	92,400
電算	200	1,423.00	284,600
A G S	600	819.00	491,400
ファインデックス	11,700	849.00	9,933,300
ブレインパッド	12,100	815.00	9,861,500
K L a b	36,700	185.00	6,789,500
ポールトゥウィンホールディングス	21,000	447.00	9,387,000
ネクソン	322,200	2,565.50	826,604,100
アイスタイル	49,000	457.00	22,393,000
エムアップホールディングス	17,900	1,371.00	24,540,900
エイチーム	9,800	630.00	6,174,000
セルシス	20,900	1,328.00	27,755,200
エニグモ	16,300	300.00	4,890,000
テクノスジャパン	1,400	723.00	1,012,200
e n i s h	2,200	179.00	393,800
コロブラ	49,800	469.00	23,356,200
オルトプラス	1,500	96.00	144,000
ブロードリーフ	58,900	572.00	33,690,800
クロス・マーケティンググループ	700	691.00	483,700
デジタルハーツホールディングス	10,400	810.00	8,424,000
メディアドゥ	6,600	1,318.00	8,698,800
じげん	36,600	526.00	19,251,600
ブイキューブ	20,000	265.00	5,300,000
エンカレッジ・テクノロジー	400	570.00	228,000
サイバーリンクス	600	759.00	455,400
ディー・エル・イー	1,300	114.00	148,200

フィックスターズ	14,700	1,486.00	21,844,200
CARTA HOLDINGS	8,300	1,455.00	12,076,500
オブティム	15,100	614.00	9,271,400
セレス	6,600	2,200.00	14,520,000
SHIFT	9,700	16,535.00	160,389,500
特種東海製紙	7,100	3,640.00	25,844,000
ティーガイア	12,000	2,668.00	32,016,000
セック	2,500	4,290.00	10,725,000
テクマトリックス	31,700	2,520.00	79,884,000
プロシップ	6,500	1,464.00	9,516,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,300	3,332.00	120,951,600
GMOペイメントゲートウェイ	33,400	8,850.00	295,590,000
ザッパラス	400	369.00	147,600
システムリサーチ	10,000	1,495.00	14,950,000
インターネットイニシアティブ	80,200	3,065.00	245,813,000
さくらインターネット	23,000	5,450.00	125,350,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,600	2,980.00	13,708,000
SRAホールディングス	8,300	4,290.00	35,607,000
システムインテグレータ	600	320.00	192,000
朝日ネット	15,700	642.00	10,079,400
eBASE	20,800	683.00	14,206,400
アバントグループ	18,500	1,963.00	36,315,500
アドソル日進	6,200	1,964.00	12,176,800
ODKソリューションズ	400	561.00	224,400
フリービット	6,400	1,360.00	8,704,000
コムチュア	19,300	2,217.00	42,788,100
アステリア	11,400	508.00	5,791,200
アイル	8,200	3,140.00	25,748,000
王子ホールディングス	554,800	547.40	303,697,520
日本製紙	76,200	860.00	65,532,000
三菱製紙	2,200	475.00	1,045,000
北越コーポレーション	82,300	1,545.00	127,153,500
中越パルプ工業	600	1,206.00	723,600
巴川コーポレーション	500	731.00	365,500
大王製紙	73,900	831.00	61,410,900
阿波製紙	400	446.00	178,400
マークライnz	8,700	2,651.00	23,063,700
メディカル・データ・ビジョン	17,600	503.00	8,852,800
gumi	24,000	327.00	7,848,000
ショーケース	400	334.00	133,600
モバイルファクトリー	300	975.00	292,500
テラスカイ	5,700	1,893.00	10,790,100
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,600	2,037.00	15,481,200
PCIホールディングス	500	973.00	486,500
アイビーシー	200	508.00	101,600
ネオジャパン	3,800	1,864.00	7,083,200
PR TIMES	2,900	1,593.00	4,619,700

ラクス	69,200	2,078.00	143,797,600
ランドコンピュータ	800	739.00	591,200
ダブルスタンダード	5,200	1,637.00	8,512,400
オープンドア	10,200	633.00	6,456,600
マイネット	500	382.00	191,000
アカツキ	7,200	2,215.00	15,948,000
ベネフィットジャパン	100	1,094.00	109,400
Ubicomホールディングス	4,700	1,228.00	5,771,600
カナミックネットワーク	18,500	534.00	9,879,000
ノムラシステムコーポレーション	1,500	119.00	178,500
レンゴー	133,400	901.00	120,193,400
トーモク	8,400	2,297.00	19,294,800
ザ・バック	10,800	3,645.00	39,366,000
チェンジホールディングス	36,200	1,311.00	47,458,200
シンクロ・フード	1,000	477.00	477,000
オークネット	6,800	2,324.00	15,803,200
キャピタル・アセット・プランニング	300	744.00	223,200
セグエグループ	1,500	595.00	892,500
エイトレッド	300	1,576.00	472,800
マクロミル	28,900	826.00	23,871,400
ビーグリー	300	1,358.00	407,400
オロ	6,200	2,456.00	15,227,200
ユーザーローカル	6,200	1,904.00	11,804,800
テモナ	400	197.00	78,800
ニーズウェル	1,800	296.00	532,800
PKSHA Technology	11,700	3,785.00	44,284,500
マネーフォワード	35,800	5,009.00	179,322,200
サインポスト	700	485.00	339,500
レゾナック・ホールディングス	131,500	3,831.00	503,776,500
住友化学	1,178,200	394.50	464,799,900
住友精化	6,900	5,040.00	34,776,000
日産化学	75,300	5,299.00	399,014,700
ラサ工業	5,200	2,805.00	14,586,000
クレハ	30,400	2,857.00	86,852,800
多木化学	5,700	3,670.00	20,919,000
テイカ	10,600	1,596.00	16,917,600
石原産業	24,300	1,399.00	33,995,700
片倉コープアグリ	400	965.00	386,000
日本曹達	31,100	2,466.00	76,692,600
東ソー	195,600	2,046.00	400,197,600
トクヤマ	47,400	2,705.50	128,240,700
セントラル硝子	18,400	3,470.00	63,848,000
東亜合成	70,500	1,541.00	108,640,500
大阪ソーダ	51,100	1,595.00	81,504,500
関東電化工業	31,600	910.00	28,756,000
SUN ASTERISK	10,400	548.00	5,699,200
デンカ	53,200	2,045.50	108,820,600
イビデン	84,700	5,342.00	452,467,400
信越化学工業	1,313,700	5,788.00	7,603,695,600
日本カーバイド工業	7,700	1,699.00	13,082,300

プラスアルファ・コンサルティング	18,500	1,733.00	32,060,500
電算システムホールディングス	6,500	2,555.00	16,607,500
堺化学工業	10,200	2,628.00	26,805,600
第一稀元素化学工業	16,000	727.00	11,632,000
エア・ウォーター	138,300	1,904.50	263,392,350
日本酸素ホールディングス	142,100	4,860.00	690,606,000
日本化学工業	5,400	2,638.00	14,245,200
東邦アセチレン	1,700	349.00	593,300
日本パーカライジング	65,300	1,284.00	83,845,200
高圧ガス工業	21,400	934.00	19,987,600
チタン工業	200	869.00	173,800
四国化成ホールディングス	16,500	2,117.00	34,930,500
戸田工業	3,300	1,685.00	5,560,500
ステラ ケミファ	7,900	4,155.00	32,824,500
保土谷化学工業	4,700	4,315.00	20,280,500
日本触媒	93,800	1,870.00	175,406,000
大日精化工業	10,100	2,873.00	29,017,300
カネカ	36,000	3,724.00	134,064,000
協和キリン	177,300	2,625.00	465,412,500
A P P I E R G R O U P	44,600	1,700.00	75,820,000
三菱瓦斯化学	118,700	2,734.00	324,525,800
三井化学	131,800	3,538.00	466,308,400
東京応化工業	69,900	3,676.00	256,952,400
大阪有機化学工業	12,200	2,870.00	35,014,000
三菱ケミカルグループ	1,070,800	836.70	895,938,360
K H ネオケム	26,400	2,050.00	54,120,000
ビジョナル	17,300	8,261.00	142,915,300
ダイセル	166,600	1,374.00	228,908,400
住友ベークライト	46,200	4,156.00	192,007,200
積水化学工業	291,800	2,350.50	685,875,900
日本ゼオン	113,000	1,461.50	165,149,500
アイカ工業	37,100	3,371.00	125,064,100
U B E	75,500	2,337.50	176,481,250
積水樹脂	20,000	2,187.00	43,740,000
旭有機材	9,700	4,195.00	40,691,500
ニチバン	9,100	1,950.00	17,745,000
リケンテクノス	27,400	1,096.00	30,030,400
大倉工業	6,800	2,719.00	18,489,200
積水化成成品工業	20,700	363.00	7,514,100
群栄化学工業	3,400	2,768.00	9,411,200
タイガースポリマー	800	715.00	572,000
ミライアル	500	1,480.00	740,000
ダイキアクシス	700	717.00	501,900
ダイキョーニシカワ	32,300	606.00	19,573,800
竹本容器	600	864.00	518,400
森六ホールディングス	8,100	2,249.00	18,216,900
恵和	9,500	1,042.00	9,899,000
日本化薬	102,700	1,191.00	122,315,700
カーリット	14,500	1,264.00	18,328,000
ソルクシーズ	1,300	295.00	383,500

CLホールディングス	3,500	834.00	2,919,000
プレステージ・インターナショナル	70,400	675.00	47,520,000
フェイス	300	382.00	114,600
プロトコーポレーション	16,000	1,432.00	22,912,000
ハイマックス	4,500	1,385.00	6,232,500
アミューズ	9,100	1,326.00	12,066,600
野村総合研究所	318,000	4,694.00	1,492,692,000
ドリームインキュベータ	3,600	2,977.00	10,717,200
クイック	10,400	2,027.00	21,080,800
TAC	700	210.00	147,000
CEホールディングス	800	520.00	416,000
日本システム技術	13,700	1,852.00	25,372,400
電通グループ	162,500	4,861.00	789,912,500
インテージホールディングス	16,600	1,590.00	26,394,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,200	844.00	6,076,800
東邦システムサイエンス	6,800	1,462.00	9,941,600
ぴあ	5,100	3,125.00	15,937,500
イオンファンタジー	6,500	2,911.00	18,921,500
ソースネクスト	74,500	240.00	17,880,000
シーティーエス	20,800	917.00	19,073,600
NEXYZ・Group	500	769.00	384,500
メディカルシステムネットワーク	15,100	407.00	6,145,700
日本精化	9,700	2,425.00	23,522,500
扶桑化学工業	13,700	3,585.00	49,114,500
トリケミカル研究所	16,000	3,000.00	48,000,000
シンプレクス・ホールディングス	28,600	2,593.00	74,159,800
HEROZ	5,800	1,089.00	6,316,200
ラクスル	35,400	1,265.00	44,781,000
メルカリ	71,700	1,848.00	132,501,600
IPS	4,400	2,767.00	12,174,800
FIG	1,900	313.00	594,700
システムサポート	5,700	1,786.00	10,180,200
ADEKA	51,000	2,794.00	142,494,000
日油	172,400	2,461.50	424,362,600
ミヨシ油脂	600	1,468.00	880,800
新日本理化	2,400	203.00	487,200
ハリマ化成グループ	11,300	871.00	9,842,300
イーソル	9,900	720.00	7,128,000
東海ソフト	200	1,235.00	247,000
ウイングアーク1st	15,300	3,385.00	51,790,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,000	831.00	4,155,000
サーバーワークス	2,500	2,490.00	6,225,000
東名	300	2,344.00	703,200
ヴィッツ	200	799.00	159,800
トピラシステムズ	500	748.00	374,000
Sansan	48,300	2,278.00	110,027,400
Link-Uグループ	300	474.00	142,200
ギフトィ	13,000	938.00	12,194,000
花王	356,600	6,411.00	2,286,162,600

第一工業製薬	5,300	3,910.00	20,723,000	
石原ケミカル	6,400	2,338.00	14,963,200	
日華化学	600	1,125.00	675,000	
ニイタカ	300	1,936.00	580,800	
三洋化成工業	9,000	4,085.00	36,765,000	
メドレー	16,100	3,720.00	59,892,000	
ベース	7,200	3,035.00	21,852,000	
J M D C	17,800	4,481.00	79,761,800	
武田薬品工業	1,305,100	4,192.00	5,470,979,200	
アステラス製薬	1,286,700	1,729.50	2,225,347,650	
住友ファーマ	130,600	603.00	78,751,800	
塩野義製薬	486,400	2,134.50	1,038,220,800	
わかもと製薬	1,900	236.00	448,400	
日本新薬	38,500	3,971.00	152,883,500	
中外製薬	459,100	7,425.00	3,408,817,500	
科研製薬	25,100	4,042.00	101,454,200	
エーザイ	194,700	5,062.00	985,571,400	
理研ビタミン	12,600	2,725.00	34,335,000	
ロート製薬	155,000	3,411.00	528,705,000	
小野薬品工業	300,100	1,873.50	562,237,350	
久光製薬	32,600	4,375.00	142,625,000	
有機合成薬品工業	1,200	268.00	321,600	
持田製薬	18,400	3,330.00	61,272,000	
参天製薬	278,800	1,700.50	474,099,400	
扶桑薬品工業	5,700	2,652.00	15,116,400	
日本ケミファ	200	1,491.00	298,200	
ツムラ	50,400	4,865.00	245,196,000	
テルモ	978,300	3,160.00	3,091,428,000	
H . U . グループホールディングス	43,900	2,528.50	111,001,150	
キッセイ薬品工業	24,300	3,650.00	88,695,000	
生化学工業	27,900	818.00	22,822,200	
栄研化学	23,200	2,148.00	49,833,600	
鳥居薬品	7,900	4,270.00	33,733,000	
J C R ファーマ	49,700	668.00	33,199,600	
東和薬品	19,700	3,085.00	60,774,500	
富士製薬工業	10,800	1,292.00	13,953,600	
ゼリア新薬工業	23,200	2,221.00	51,527,200	
ネクセラファーマ	68,800	1,194.00	82,147,200	
第一三共	1,384,300	4,906.00	6,791,375,800	
杏林製薬	31,900	1,477.00	47,116,300	
大幸薬品	33,200	362.00	12,018,400	
ダイト	10,900	2,169.00	23,642,100	
大塚ホールディングス	366,100	9,445.00	3,457,814,500	
ペプチドリーム	71,100	2,810.00	199,791,000	
大日本塗料	16,200	1,141.00	18,484,200	
日本ペイントホールディングス	648,200	1,070.00	693,574,000	
関西ペイント	122,700	2,208.00	270,921,600	
神東塗料	1,500	132.00	198,000	
中国塗料	33,100	2,622.00	86,788,200	
日本特殊塗料	1,200	1,168.00	1,401,600	

藤倉化成	18,400	507.00	9,328,800
太陽ホールディングス	25,500	4,195.00	106,972,500
D I C	51,900	3,277.00	170,076,300
サカタインクス	32,500	1,509.00	49,042,500
a r t i e n c e	26,200	3,055.00	80,041,000
アルプス技研	13,200	2,840.00	37,488,000
サニックス	21,600	279.00	6,026,400
日本空調サービス	16,100	1,044.00	16,808,400
オリエンタルランド	895,000	3,904.00	3,494,080,000
フォーカスシステムズ	9,800	1,097.00	10,750,600
ダスキン	32,800	3,835.00	125,788,000
パーク24	112,300	1,900.00	213,370,000
明光ネットワークジャパン	18,200	694.00	12,630,800
ファルコホールディングス	6,100	2,323.00	14,170,300
クレスコ	24,000	1,190.00	28,560,000
フジ・メディア・ホールディングス	140,900	1,648.50	232,273,650
秀英予備校	300	262.00	78,600
田谷	300	339.00	101,700
ラウンドワン	141,800	1,067.00	151,300,600
リゾートトラスト	59,400	2,805.50	166,646,700
オービック	272,400	5,283.00	1,439,089,200
ジャストシステム	21,200	3,335.00	70,702,000
T D C ソフト	24,700	1,254.00	30,973,800
L I N E ヤフー	2,346,100	405.00	950,170,500
ビー・エム・エル	18,400	2,770.00	50,968,000
トレンドマイクロ	77,000	8,250.00	635,250,000
I D ホールディングス	9,900	1,560.00	15,444,000
リソー教育	93,800	286.00	26,826,800
日本オラクル	28,000	15,785.00	441,980,000
早稲田アカデミー	8,300	1,788.00	14,840,400
アルファシステムズ	4,700	3,415.00	16,050,500
フューチャー	36,400	2,096.00	76,294,400
C A C H o l d i n g s	9,000	1,771.00	15,939,000
トーセ	500	626.00	313,000
ユー・エス・エス	309,300	1,315.50	406,884,150
オービックビジネスコンサルタント	24,700	7,205.00	177,963,500
アイティフォー	17,200	1,374.00	23,632,800
東京個別指導学院	17,800	394.00	7,013,200
東計電算	4,000	4,725.00	18,900,000
サイバーエージェント	332,200	1,039.50	345,321,900
楽天グループ	1,059,000	923.60	978,092,400
エクスネット	300	1,403.00	420,900
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,594.00	12,114,400
S B I グローバルアセットマネジメント	29,500	629.00	18,555,500
テー・オー・ダブリュー	29,700	321.00	9,533,700
大塚商会	166,200	3,643.00	605,466,600
サイボウズ	20,100	2,193.00	44,079,300
山田コンサルティンググループ	7,600	2,108.00	16,020,800
セントラルスポーツ	5,700	2,413.00	13,754,100

パラカ	4,700	1,783.00	8,380,100
電通総研	14,300	5,410.00	77,363,000
A C C E S S	15,300	1,270.00	19,431,000
デジタルガレージ	23,400	3,420.00	80,028,000
イーエムシステムズ	24,400	549.00	13,395,600
ウェザーニューズ	4,700	6,240.00	29,328,000
C I J	36,500	429.00	15,658,500
ビジネスエンジニアリング	3,400	4,065.00	13,821,000
日本エンタープライズ	1,400	108.00	151,200
WOWOW	11,000	993.00	10,923,000
スカラ	13,600	460.00	6,256,000
インテリジェント ウェイブ	900	985.00	886,500
フルキャストホールディングス	12,200	1,438.00	17,543,600
エン・ジャパン	24,400	2,354.00	57,437,600
セルソース	9,700	1,164.00	11,290,800
あすか製薬ホールディングス	13,500	2,121.00	28,633,500
サワイグループホールディングス	86,400	2,028.50	175,262,400
富士フイルムホールディングス	884,400	3,474.00	3,072,405,600
コニカミノルタ	329,800	686.90	226,539,620
資生堂	306,200	2,854.00	873,894,800
ライオン	186,700	1,743.50	325,511,450
高砂香料工業	9,800	6,080.00	59,584,000
マンダム	29,200	1,219.00	35,594,800
ミルボン	23,500	3,070.00	72,145,000
コーセー	29,900	7,699.00	230,200,100
コタ	14,800	1,622.00	24,005,600
シーボン	200	1,183.00	236,600
ポーラ・オルビスホールディングス	75,200	1,446.50	108,776,800
ノエビアホールディングス	13,200	4,990.00	65,868,000
アジュバンホールディングス	400	821.00	328,400
新日本製薬	8,400	1,708.00	14,347,200
I - n e	4,900	1,880.00	9,212,000
アクシージア	9,700	566.00	5,490,200
エステー	11,800	1,496.00	17,652,800
アグロ カネショウ	5,200	1,347.00	7,004,400
コニシ	46,300	1,382.00	63,986,600
長谷川香料	28,000	3,285.00	91,980,000
小林製薬	38,500	5,366.00	206,591,000
荒川化学工業	13,700	1,147.00	15,713,900
メック	12,000	3,775.00	45,300,000
日本高純度化学	3,600	3,285.00	11,826,000
タカラバイオ	46,200	1,092.00	50,450,400
J C U	16,200	3,850.00	62,370,000
新田ゼラチン	1,100	872.00	959,200
O A T アグリオ	6,100	2,038.00	12,431,800
デクセリアルズ	128,500	2,532.00	325,362,000
アース製薬	13,500	5,160.00	69,660,000
北興化学工業	13,200	1,299.00	17,146,800
大成ラミック	4,400	2,575.00	11,330,000
クマイ化学工業	58,300	803.00	46,814,900

日本農薬	22,500	678.00	15,255,000
富士興産	500	1,420.00	710,000
ニチレキグループ	15,600	2,408.00	37,564,800
ユシロ化学工業	7,500	1,947.00	14,602,500
ピーピー・カストロール	800	881.00	704,800
富士石油	38,500	294.00	11,319,000
MORESCO	600	1,240.00	744,000
出光興産	685,600	1,015.50	696,226,800
ENEOSホールディングス	2,488,000	762.40	1,896,851,200
コスモエネルギーホールディングス	48,400	7,220.00	349,448,000
ANYCOLOR	19,800	2,250.00	44,550,000
テスホールディングス	31,200	261.00	8,143,200
インフロニア・ホールディングス	150,300	1,135.00	170,590,500
横浜ゴム	74,200	3,144.00	233,284,800
TOYO TIRE	84,200	2,146.00	180,693,200
ブリヂストン	429,300	5,449.00	2,339,255,700
住友ゴム工業	143,900	1,708.00	245,781,200
藤倉コンポジット	14,100	1,406.00	19,824,600
オカモト	7,800	5,370.00	41,886,000
アキレス	8,000	1,514.00	12,112,000
フコク	8,600	1,826.00	15,703,600
ニッタ	14,400	3,705.00	53,352,000
クリエートメディック	500	903.00	451,500
住友理工	28,400	1,645.00	46,718,000
三ツ星ベルト	20,300	4,145.00	84,143,500
バンドー化学	21,900	1,760.00	38,544,000
AGC	142,700	4,725.00	674,257,500
日本板硝子	75,100	349.00	26,209,900
石塚硝子	300	2,433.00	729,900
有沢製作所	22,100	1,525.00	33,702,500
日本山村硝子	700	1,586.00	1,110,200
日本電気硝子	54,500	3,362.00	183,229,000
オハラ	7,000	1,296.00	9,072,000
住友大阪セメント	26,200	3,540.00	92,748,000
太平洋セメント	90,500	3,467.00	313,763,500
リソルホールディングス	200	5,100.00	1,020,000
日本ヒューム	13,000	1,234.00	16,042,000
日本コンクリート工業	28,300	328.00	9,282,400
三谷セキサン	6,200	6,480.00	40,176,000
アジアパイルホールディングス	20,900	758.00	15,842,200
東海カーボン	135,200	965.00	130,468,000
日本カーボン	8,400	4,455.00	37,422,000
東洋炭素	10,300	4,960.00	51,088,000
ノリタケ	16,200	3,965.00	64,233,000
TOTO	106,400	4,217.00	448,688,800
日本碍子	170,700	2,036.50	347,630,550
日本特殊陶業	119,900	4,850.00	581,515,000
ダントーホールディングス	500	328.00	164,000
MARUWA	6,100	48,100.00	293,410,000
品川リフラクトリーズ	18,000	1,641.00	29,538,000

黒崎播磨	9,900	2,431.00	24,066,900
ヨータイ	7,500	1,553.00	11,647,500
東京窯業	2,000	417.00	834,000
ニッカトー	800	495.00	396,000
フジインコーポレーテッド	39,500	2,487.00	98,236,500
クニミネ工業	500	1,008.00	504,000
エーアンドエーマテリアル	400	1,172.00	468,800
ニチアス	37,200	6,020.00	223,944,000
日本製鉄	764,100	3,170.00	2,422,197,000
神戸製鋼所	303,500	1,663.50	504,872,250
中山製鋼所	31,300	740.00	23,162,000
合同製鐵	8,500	3,930.00	33,405,000
JFEホールディングス	454,600	1,802.00	819,189,200
東京製鐵	42,100	1,512.00	63,655,200
共英製鋼	14,800	1,705.00	25,234,000
大和工業	28,400	7,965.00	226,206,000
東京鐵鋼	6,700	6,400.00	42,880,000
大阪製鐵	7,000	3,125.00	21,875,000
淀川製鋼所	14,000	5,230.00	73,220,000
中部鋼鈹	9,900	2,234.00	22,116,600
丸一鋼管	46,100	3,220.00	148,442,000
モリ工業	3,500	4,980.00	17,430,000
大同特殊鋼	95,200	1,186.00	112,907,200
日本高周波鋼業	700	388.00	271,600
日本冶金工業	10,200	4,060.00	41,412,000
山陽特殊製鋼	15,000	1,880.00	28,200,000
愛知製鋼	8,700	4,825.00	41,977,500
日本金属	500	640.00	320,000
ミガロホールディングス	500	1,599.00	799,500
大平洋金属	14,000	1,353.00	18,942,000
新日本電工	90,400	291.00	26,306,400
栗本鐵工所	7,000	4,045.00	28,315,000
虹技	300	1,143.00	342,900
日本鑄鉄管	200	1,115.00	223,000
日本製鋼所	44,700	5,832.00	260,690,400
三菱製鋼	11,200	1,370.00	15,344,000
日亜鋼業	2,100	305.00	640,500
日本精線	12,000	1,281.00	15,372,000
エンビプロ・ホールディングス	14,900	495.00	7,375,500
大紀アルミニウム工業所	21,700	1,085.00	23,544,500
日本輕金属ホールディングス	44,100	1,515.00	66,811,500
三井金属鈹業	37,800	4,859.00	183,670,200
東邦亜鉛	11,900	1,042.00	12,399,800
三菱マテリアル	107,900	2,457.00	265,110,300
住友金属鈹山	190,800	4,330.00	826,164,000
DOWAホールディングス	40,800	5,270.00	215,016,000
古河機械金属	19,900	1,668.00	33,193,200
エス・サイエンス	10,100	22.00	222,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,100	1,989.00	51,912,900
東邦チタニウム	31,300	1,019.00	31,894,700

U A C J	21,300	5,120.00	109,056,000
C Kサンエツ	2,800	3,600.00	10,080,000
古河電気工業	49,100	5,431.00	266,662,100
住友電気工業	521,000	2,702.50	1,408,002,500
フジクラ	161,800	5,908.00	955,914,400
S W C C	20,200	5,900.00	119,180,000
カナレ電気	300	1,444.00	433,200
平河ヒューテック	9,600	1,592.00	15,283,200
いよぎんホールディングス	188,600	1,633.50	308,078,100
しずおかフィナンシャルグループ	317,400	1,349.00	428,172,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	121,300	1,593.50	193,291,550
楽天銀行	66,800	3,598.00	240,346,400
京都フィナンシャルグループ	181,200	2,374.50	430,259,400
リョービ	16,000	1,800.00	28,800,000
アーレスティ	1,800	558.00	1,004,400
A R E ホールディングス	61,000	1,871.00	114,131,000
東洋製罐グループホールディングス	96,300	2,200.00	211,860,000
ホッカンホールディングス	8,100	1,722.00	13,948,200
コロナ	8,500	955.00	8,117,500
横河ブリッジホールディングス	25,900	2,783.00	72,079,700
駒井ハルテック	300	1,597.00	479,100
高田機工	400	1,055.00	422,000
三和ホールディングス	150,300	4,496.00	675,748,800
文化シャッター	39,600	1,860.00	73,656,000
三協立山	18,900	740.00	13,986,000
アルインコ	11,400	965.00	11,001,000
東洋シャッター	400	792.00	316,800
L I X I L	220,000	1,727.50	380,050,000
日本フィルコン	1,100	541.00	595,100
ノーリツ	21,400	1,785.00	38,199,000
長府製作所	16,800	1,962.00	32,961,600
リンナイ	80,200	3,328.00	266,905,600
ユニプレス	26,200	995.00	26,069,000
ダイニチ工業	700	610.00	427,000
日東精工	22,000	600.00	13,200,000
三洋工業	200	3,030.00	606,000
岡部	26,900	793.00	21,331,700
ジーテクト	16,800	1,505.00	25,284,000
東プレ	26,500	1,712.00	45,368,000
高周波熱錬	22,400	989.00	22,153,600
東京製綱	8,900	1,160.00	10,324,000
サンコール	16,700	357.00	5,961,900
モリテックスチール	1,700	172.00	292,400
パイオラックス	20,200	2,517.00	50,843,400
エイチワン	15,500	903.00	13,996,500
日本発条	133,500	1,897.00	253,249,500
中央発條	9,700	1,257.00	12,192,900
アドパネクス	200	840.00	168,000
三浦工業	68,500	3,635.00	248,997,500
タクマ	50,000	1,669.00	83,450,000

テクノプロ・ホールディングス	87,400	2,915.00	254,771,000	
アトラグループ	500	134.00	67,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,800	863.00	6,731,400	
Keep E r 技研	9,300	3,900.00	36,270,000	
楽待	500	695.00	347,500	
三機サービス	300	923.00	276,900	
Gunosy	12,000	719.00	8,628,000	
デザインワン・ジャパン	400	112.00	44,800	
イー・ガーディアン	7,200	1,817.00	13,082,400	
リブセンス	900	162.00	145,800	
ジャパンマテリアル	46,100	1,800.00	82,980,000	
ベクトル	20,400	962.00	19,624,800	
ウチヤマホールディングス	800	307.00	245,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,600	1,207.00	15,208,200	
キャリアリンク	5,500	2,529.00	13,909,500	
IBJ	11,400	639.00	7,284,600	
アサンテ	7,400	1,680.00	12,432,000	
バリューHR	13,600	1,826.00	24,833,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	12,100	2,553.00	30,891,300	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,000	999.00	5,994,000	
E R Iホールディングス	500	1,890.00	945,000	
アビスト	300	3,040.00	912,000	
シグマクシス・ホールディングス	22,000	1,951.00	42,922,000	
ウィルグループ	12,700	995.00	12,636,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,700	145.00	246,500	
メドピア	12,100	578.00	6,993,800	
レアジョブ	400	397.00	158,800	
リクルートホールディングス	1,173,000	9,936.00	11,654,928,000	
エラン	19,800	768.00	15,206,400	
ツガミ	31,600	1,375.00	43,450,000	
オークマ	25,800	3,125.00	80,625,000	
芝浦機械	19,400	3,725.00	72,265,000	
アマダ	205,200	1,532.00	314,366,400	
アイダエンジニアリング	33,000	782.00	25,806,000	
F U J I	64,200	2,270.00	145,734,000	
牧野フライス製作所	16,300	6,820.00	111,166,000	
オーエスジー	65,100	1,794.50	116,821,950	
ダイジェット工業	200	721.00	144,200	
旭ダイヤモンド工業	36,800	829.00	30,507,200	
D M G 森精機	93,100	2,696.00	250,997,600	
ソディック	39,000	711.00	27,729,000	
ディスコ	71,200	44,700.00	3,182,640,000	
日東工器	5,700	2,698.00	15,378,600	
日進工具	12,200	746.00	9,101,200	
パンチ工業	1,700	433.00	736,100	
富士ダイス	10,900	785.00	8,556,500	
土木管理総合試験所	600	306.00	183,600	
日本郵政	1,683,800	1,487.50	2,504,652,500	

ベルシステム24ホールディングス	16,100	1,289.00	20,752,900
鎌倉新書	12,900	544.00	7,017,600
S MN	400	293.00	117,200
一蔵	300	440.00	132,000
グローバルキッズCOMPANY	300	665.00	199,500
エアトリ	11,000	1,011.00	11,121,000
アトラエ	10,500	817.00	8,578,500
ストライク	7,400	3,930.00	29,082,000
ソラスト	41,500	483.00	20,044,500
セラク	4,700	1,364.00	6,410,800
インソース	32,600	1,078.00	35,142,800
豊田自動織機	124,700	10,980.00	1,369,206,000
豊和工業	900	1,164.00	1,047,600
石川製作所	400	1,519.00	607,600
リケンNPR	18,500	2,356.00	43,586,000
東洋機械金属	1,400	622.00	870,800
津田駒工業	300	367.00	110,100
エンシュウ	400	619.00	247,600
島精機製作所	23,500	1,072.00	25,192,000
オプトラン	24,200	1,897.00	45,907,400
イワキ	9,800	3,050.00	29,890,000
フリー	13,900	1,089.00	15,137,100
ヤマシンフィルタ	31,300	632.00	19,781,600
日阪製作所	17,900	956.00	17,112,400
やまびこ	24,100	2,479.00	59,743,900
野村マイクロ・サイエンス	24,400	2,020.00	49,288,000
平田機工	7,100	5,400.00	38,340,000
PEGASUS	16,300	443.00	7,220,900
マルマエ	6,400	1,671.00	10,694,400
タツモ	10,500	3,530.00	37,065,000
ナブテスコ	92,600	2,404.50	222,656,700
三井海洋開発	18,600	3,540.00	65,844,000
レオン自動機	15,500	1,454.00	22,537,000
S MC	44,100	66,830.00	2,947,203,000
ホソカワミクロン	10,300	3,750.00	38,625,000
ユニオンツール	6,500	5,820.00	37,830,000
瑞光	9,400	1,251.00	11,759,400
オイレス工業	20,000	2,180.00	43,600,000
日精エー・エス・ピー機械	5,100	4,730.00	24,123,000
サトーホールディングス	18,400	2,107.00	38,768,800
技研製作所	13,900	1,727.00	24,005,300
日本エアーテック	6,900	1,222.00	8,431,800
カワタ	500	800.00	400,000
日精樹脂工業	9,700	923.00	8,953,100
オカダアイヨン	500	2,122.00	1,061,000
ワイエイシイホールディングス	7,500	2,175.00	16,312,500
小松製作所	745,600	4,204.00	3,134,502,400
住友重機械工業	87,500	3,319.00	290,412,500
日立建機	58,800	3,420.00	201,096,000
日工	22,000	703.00	15,466,000

巴工業	5,800	3,885.00	22,533,000
井関農機	13,900	1,002.00	13,927,800
TOWA	45,300	1,860.00	84,258,000
丸山製作所	300	2,208.00	662,400
北川鉄工所	5,800	1,239.00	7,186,200
シンニッタン	2,000	202.00	404,000
ローツェ	77,100	2,205.00	170,005,500
タカキタ	500	397.00	198,500
クボタ	772,200	1,946.00	1,502,701,200
荏原実業	7,100	4,630.00	32,873,000
東洋エンジニアリング	21,200	749.00	15,878,800
三菱化工機	5,200	3,255.00	16,926,000
月島ホールディングス	19,900	1,472.00	29,292,800
帝国電機製作所	10,100	2,933.00	29,623,300
東京機械製作所	400	359.00	143,600
新東工業	32,800	973.00	31,914,400
澁谷工業	13,900	4,050.00	56,295,000
アイチコーポレーション	24,400	1,186.00	28,938,400
小森コーポレーション	36,300	1,112.00	40,365,600
鶴見製作所	11,200	4,005.00	44,856,000
日本ギア工業	700	467.00	326,900
酒井重工業	5,800	2,533.00	14,691,400
荏原製作所	303,200	2,565.00	777,708,000
西島製作所	12,800	2,888.00	36,966,400
北越工業	14,800	1,716.00	25,396,800
ダイキン工業	192,300	19,000.00	3,653,700,000
オルガノ	22,900	8,980.00	205,642,000
トーヨーカネツ	5,500	4,510.00	24,805,000
栗田工業	82,600	6,563.00	542,103,800
椿本チエイン	66,900	1,902.00	127,243,800
大同工業	700	806.00	564,200
日機装	37,900	1,037.00	39,302,300
木村化工機	11,300	950.00	10,735,000
レイズネクスト	20,900	1,442.00	30,137,800
アネスト岩田	25,100	1,440.00	36,144,000
ダイフク	249,200	3,300.00	822,360,000
サムコ	3,500	3,190.00	11,165,000
加藤製作所	900	1,266.00	1,139,400
油研工業	300	2,466.00	739,800
タダノ	84,900	1,077.00	91,437,300
フジテック	47,500	5,610.00	266,475,000
CKD	40,900	2,673.00	109,325,700
平和	49,200	2,110.00	103,812,000
理想科学工業	11,800	3,765.00	44,427,000
SANKYO	170,700	2,118.00	361,542,600
日本金銭機械	17,800	965.00	17,177,000
マースグループホールディングス	9,900	3,170.00	31,383,000
フクシマガリレイ	10,800	5,570.00	60,156,000
オーイズミ	600	369.00	221,400
ダイコク電機	6,500	3,335.00	21,677,500

竹内製作所	26,700	5,030.00	134,301,000
アマノ	41,900	4,377.00	183,396,300
JUKI	23,100	395.00	9,124,500
サンデン	3,000	153.00	459,000
ジャノメ	12,900	961.00	12,396,900
ブラザー工業	197,400	2,791.00	550,943,400
マックス	18,200	3,425.00	62,335,000
モリタホールディングス	23,100	2,110.00	48,741,000
グローリー	38,800	2,581.00	100,142,800
新晃工業	14,900	4,445.00	66,230,500
大和冷機工業	22,700	1,491.00	33,845,700
セガサミーホールディングス	131,900	2,813.00	371,034,700
TPR	18,700	2,352.00	43,982,400
ツバキ・ナカシマ	36,400	632.00	23,004,800
ホシザキ	95,200	5,079.00	483,520,800
大豊工業	12,900	604.00	7,791,600
日本精工	273,400	677.10	185,119,140
NTN	349,500	244.00	85,278,000
ジェイテクト	131,400	1,085.00	142,569,000
不二越	10,900	3,275.00	35,697,500
ミネベアミツミ	256,800	2,591.00	665,368,800
日本トムソン	40,200	487.00	19,577,400
THK	85,200	2,625.50	223,692,600
ユーシン精機	13,800	672.00	9,273,600
前澤給装工業	10,500	1,293.00	13,576,500
イーグル工業	16,300	1,990.00	32,437,000
前澤工業	1,000	1,208.00	1,208,000
PILLAR	13,800	4,810.00	66,378,000
キッツ	49,500	1,124.00	55,638,000
日立製作所	3,803,600	4,095.00	15,575,742,000
三菱電機	1,502,400	2,721.50	4,088,781,600
富士電機	89,800	8,766.00	787,186,800
東洋電機製造	600	1,127.00	676,200
安川電機	160,600	4,367.00	701,340,200
シンフォニアテクノロジー	14,700	6,440.00	94,668,000
明電舎	24,900	4,200.00	104,580,000
オリジン	300	1,182.00	354,600
山洋電気	6,400	8,650.00	55,360,000
デンヨー	11,200	2,610.00	29,232,000
PHCホールディングス	27,600	984.00	27,158,400
KOKUSAI ELECTRIC	103,400	2,953.00	305,340,200
ソシオネクスト	147,200	2,560.00	376,832,000
ベイカレント	110,400	5,418.00	598,147,200
Orchestra Holdings	3,300	865.00	2,854,500
アイモバイル	19,000	524.00	9,956,000
ディスラプターズ	800	171.00	136,800
MS-Japan	8,200	1,064.00	8,724,800
船場	300	1,246.00	373,800

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	58,500	2,934.00	171,639,000	
フルテック	200	1,158.00	231,600	
グリーンズ	600	1,589.00	953,400	
ツナググループ・ホールディングス	500	609.00	304,500	
GAMEWITH	700	231.00	161,700	
MS&Consulting	200	471.00	94,200	
エル・ティー・エス	2,000	1,812.00	3,624,000	
ミダックホールディングス	9,100	1,895.00	17,244,500	
キュービーネットホールディングス	8,600	1,004.00	8,634,400	
オープングループ	23,800	198.00	4,712,400	
三櫻工業	20,200	708.00	14,301,600	
マキタ	183,700	4,672.00	858,246,400	
東芝テック	22,200	3,640.00	80,808,000	
芝浦メカトロニクス	10,700	10,310.00	110,317,000	
マブチモーター	64,800	2,299.50	149,007,600	
ニデック	652,100	2,910.00	1,897,611,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,400	373.00	3,506,200	
トレックス・セミコンダクター	7,000	1,529.00	10,703,000	
東光高岳	8,000	1,989.00	15,912,000	
ダブル・スコープ	45,400	359.00	16,298,600	
宮越ホールディングス	6,600	1,833.00	12,097,800	
ダイヘン	14,000	7,240.00	101,360,000	
ヤーマン	28,600	800.00	22,880,000	
JVCケンウッド	116,500	1,476.50	172,012,250	
ミマキエンジニアリング	12,200	1,565.00	19,093,000	
I-PEX	8,000	2,399.00	19,192,000	
大崎電気工業	31,800	764.00	24,295,200	
オムロン	135,200	5,449.00	736,704,800	
日東工業	19,800	2,945.00	58,311,000	
I D E C	21,900	2,641.00	57,837,900	
正興電機製作所	500	1,264.00	632,000	
不二電機工業	300	1,108.00	332,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	65,900	2,715.00	178,918,500	
サクサ	400	2,439.00	975,600	
テクノメディカ	2,800	1,840.00	5,152,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	6,000	609.00	3,654,000	
日本電気	208,800	13,330.00	2,783,304,000	
富士通	1,359,300	2,846.50	3,869,247,450	
沖電気工業	71,600	976.00	69,881,600	
電気興業	6,000	1,831.00	10,986,000	
サンケン電気	15,100	5,728.00	86,492,800	
ナカヨ	300	1,131.00	339,300	
アイホン	9,000	2,858.00	25,722,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,125,300	1,993.00	2,242,722,900	
セイコーエプソン	189,400	2,719.00	514,978,600	
ワコム	103,900	711.00	73,872,900	
アルバック	32,400	7,357.00	238,366,800	
アクセル	7,400	1,369.00	10,130,600	

E I Z O	19,200	2,256.00	43,315,200
ジャパンディスプレイ	636,200	22.00	13,996,400
日本信号	33,600	917.00	30,811,200
京三製作所	34,300	558.00	19,139,400
能美防災	19,900	3,005.00	59,799,500
ホーチキ	9,400	2,348.00	22,071,200
星和電機	700	527.00	368,900
エレコム	35,200	1,462.00	51,462,400
パナソニック ホールディングス	1,745,100	1,424.50	2,485,894,950
シャープ	213,400	872.80	186,255,520
アンリツ	104,100	1,170.00	121,797,000
富士通ゼネラル	41,800	1,938.00	81,008,400
ソニーグループ	5,121,400	2,975.00	15,236,165,000
T D K	1,275,600	2,028.00	2,586,916,800
帝国通信工業	6,500	2,778.00	18,057,000
タムラ製作所	58,800	523.00	30,752,400
アルプスアルパイン	120,000	1,594.00	191,280,000
池上通信機	500	641.00	320,500
日本電波工業	13,900	971.00	13,496,900
鈴木	7,900	1,861.00	14,701,900
メイコー	14,500	8,290.00	120,205,000
日本トリム	3,300	3,610.00	11,913,000
フォスター電機	15,000	1,872.00	28,080,000
S M K	3,500	2,359.00	8,256,500
ヨコオ	13,200	1,533.00	20,235,600
ティアック	2,400	83.00	199,200
ホシデン	36,800	2,250.00	82,800,000
ヒロセ電機	21,600	18,900.00	408,240,000
日本航空電子工業	38,500	2,829.00	108,916,500
T O A	15,000	913.00	13,695,000
マクセル	30,000	1,771.00	53,130,000
古野電気	17,400	2,675.00	46,545,000
スミダコーポレーション	19,800	954.00	18,889,200
アイコム	5,700	2,851.00	16,250,700
リオン	6,100	2,445.00	14,914,500
横河電機	161,700	3,616.00	584,707,200
新電元工業	5,700	2,434.00	13,873,800
アズビル	402,400	1,291.50	519,699,600
東亜ディーケーケー	800	749.00	599,200
日本光電工業	130,900	2,226.50	291,448,850
チノー	6,100	2,185.00	13,328,500
共和電業	1,700	420.00	714,000
日本電子材料	9,000	2,214.00	19,926,000
堀場製作所	27,600	9,524.00	262,862,400
アドバンテスト	460,900	9,824.00	4,527,881,600
小野測器	700	537.00	375,900
エスベック	13,100	2,671.00	34,990,100
キーエンス	146,300	67,680.00	9,901,584,000
日置電機	7,700	8,150.00	62,755,000
シスメックス	378,600	3,160.00	1,196,376,000

日本マイクロニクス	24,100	3,675.00	88,567,500
メガチップス	11,200	5,740.00	64,288,000
OBARA GROUP	9,100	4,245.00	38,629,500
IMAGICA GROUP	14,700	477.00	7,011,900
澤藤電機	200	976.00	195,200
デンソー	1,551,300	2,325.00	3,606,772,500
原田工業	800	544.00	435,200
コーセル	15,600	1,247.00	19,453,200
イリソ電子工業	14,800	2,806.00	41,528,800
オブテックスグループ	26,800	1,753.00	46,980,400
千代田インテグレ	5,100	3,335.00	17,008,500
レーザーテック	67,000	20,050.00	1,343,350,000
スタンレー電気	91,600	2,599.00	238,068,400
ウシオ電機	64,700	2,184.50	141,337,150
岡谷電機産業	1,200	226.00	271,200
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	955.00	1,623,500
エノモト	500	1,533.00	766,500
日本セラミック	13,500	2,656.00	35,856,000
遠藤照明	800	1,351.00	1,080,800
古河電池	10,700	1,375.00	14,712,500
山一電機	11,900	2,594.00	30,868,600
図研	13,500	3,720.00	50,220,000
日本電子	33,800	5,890.00	199,082,000
カシオ計算機	116,900	1,080.50	126,310,450
ファナック	707,600	4,230.00	2,993,148,000
日本シイエムケイ	42,800	432.00	18,489,600
エンプラス	4,400	5,700.00	25,080,000
大真空	17,800	539.00	9,594,200
ローム	264,900	1,545.50	409,402,950
浜松ホトニクス	234,900	1,765.00	414,598,500
三井ハイテック	64,800	801.00	51,904,800
新光電気工業	51,600	5,420.00	279,672,000
京セラ	908,800	1,533.00	1,393,190,400
協栄産業	200	2,231.00	446,200
太陽誘電	64,100	2,362.00	151,404,200
村田製作所	1,306,400	2,691.50	3,516,175,600
双葉電子工業	27,700	504.00	13,960,800
日東電工	464,000	2,620.00	1,215,680,000
北陸電気工業	600	1,558.00	934,800
東海理化電機製作所	41,300	2,116.00	87,390,800
ニチコン	38,500	1,111.00	42,773,500
日本ケミコン	18,000	1,144.00	20,592,000
KOA	24,300	1,026.00	24,931,800
三井E&S	79,000	1,230.00	97,170,000
カナデビア	121,100	951.00	115,166,100
三菱重工業	2,583,100	2,326.00	6,008,290,600
川崎重工業	110,100	6,669.00	734,256,900
IHI	118,300	9,175.00	1,085,402,500
名村造船所	41,700	1,830.00	76,311,000
サノヤスホールディングス	2,400	159.00	381,600

スプリックス	500	797.00	398,500	
マネジメントソリューションズ	7,400	1,866.00	13,808,400	
プロレド・パートナーズ	3,700	477.00	1,764,900	
and factory	500	237.00	118,500	
テノ・ホールディングス	200	510.00	102,000	
フロンティア・マネジメント	4,600	1,177.00	5,414,200	
ピアラ	300	263.00	78,900	
コプロ・ホールディングス	600	1,430.00	858,000	
ギークス	300	437.00	131,100	
アンビスホールディングス	32,300	1,114.00	35,982,200	
カーブスホールディングス	41,100	789.00	32,427,900	
フォーラムエンジニアリング	17,500	966.00	16,905,000	
FAST FITNESS JAPAN	5,200	1,315.00	6,838,000	
Macbee Planet	4,300	2,764.00	11,885,200	
日本車輛製造	5,600	2,230.00	12,488,000	
三菱ロジスネクスト	23,300	1,263.00	29,427,900	
近畿車輛	300	1,425.00	427,500	
一家ホールディングス	500	668.00	334,000	
フルサト・マルカホールディングス	12,500	2,246.00	28,075,000	
ヤマエグループホールディングス	16,700	2,137.00	35,687,900	
ジャパクラフトホールディングス	1,200	141.00	169,200	
FPG	51,300	2,939.00	150,770,700	
島根銀行	500	505.00	252,500	
じもとホールディングス	1,500	301.00	451,500	
全国保証	37,800	5,459.00	206,350,200	
めぶきフィナンシャルグループ	723,100	651.40	471,027,340	
ジャパンインベストメントアドバイザー	23,400	1,145.00	26,793,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,400	4,155.00	76,452,000	
九州フィナンシャルグループ	253,500	774.90	196,437,150	
かんぽ生命保険	167,600	2,655.50	445,061,800	
ゆうちょ銀行	1,187,100	1,431.00	1,698,740,100	
あんしん保証	700	175.00	122,500	
富山第一銀行	45,800	1,130.00	51,754,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	766,200	851.60	652,495,920	
ジェイリース	10,700	1,328.00	14,209,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	88,700	1,871.00	165,957,700	
イントラスト	600	763.00	457,800	
日本モーゲージサービス	1,000	420.00	420,000	
CASA	700	844.00	590,800	
SBIアルヒ	14,700	829.00	12,186,300	
プレミアグループ	24,300	2,357.00	57,275,100	
日産自動車	1,924,200	368.60	709,260,120	
いすゞ自動車	451,700	1,860.50	840,387,850	
トヨタ自動車	7,774,300	2,653.50	20,629,105,050	
日野自動車	220,000	371.80	81,796,000	
三菱自動車工業	570,600	457.00	260,764,200	

エフテック	1,200	511.00	613,200
レシップホールディングス	900	529.00	476,100
GMB	300	1,132.00	339,600
ファルテック	200	442.00	88,400
武蔵精密工業	35,800	2,316.00	82,912,800
日産車体	22,300	952.00	21,229,600
新明和工業	42,000	1,369.00	57,498,000
極東開発工業	19,700	2,497.00	49,190,900
トピー工業	11,800	1,845.00	21,771,000
ティラド	3,200	3,500.00	11,200,000
曙ブレーキ工業	89,200	114.00	10,168,800
タチエス	26,900	1,728.00	46,483,200
NOK	56,800	2,272.50	129,078,000
フタバ産業	44,000	642.00	28,248,000
カヤバ	12,500	4,715.00	58,937,500
市光工業	26,400	452.00	11,932,800
大同メタル工業	28,500	478.00	13,623,000
プレス工業	57,200	546.00	31,231,200
ミクニ	2,000	334.00	668,000
太平洋工業	33,500	1,350.00	45,225,000
河西工業	2,800	137.00	383,600
アイシン	309,700	1,608.00	497,997,600
マツダ	449,200	1,002.50	450,323,000
今仙電機製作所	1,000	519.00	519,000
本田技研工業	3,465,100	1,379.50	4,780,105,450
スズキ	1,181,900	1,642.50	1,941,270,750
SUBARU	453,500	2,390.50	1,084,091,750
安永	800	524.00	419,200
ヤマハ発動機	617,400	1,389.00	857,568,600
小糸製作所	151,500	1,947.00	294,970,500
TBK	1,900	276.00	524,400
エクセディ	23,900	3,995.00	95,480,500
ミツバ	27,500	823.00	22,632,500
豊田合成	41,800	2,569.50	107,405,100
愛三工業	27,700	1,410.00	39,057,000
盟和産業	200	1,210.00	242,000
日本プラスト	1,300	359.00	466,700
ヨロズ	15,100	1,170.00	17,667,000
エフ・シー・シー	25,600	2,870.00	73,472,000
新家工業	300	4,260.00	1,278,000
シマノ	63,600	21,475.00	1,365,810,000
テイ・エス テック	59,500	1,692.50	100,703,750
三十三フィナンシャルグループ	13,000	1,938.00	25,194,000
第四北越フィナンシャルグループ	45,300	2,733.00	123,804,900
ひろぎんホールディングス	202,700	1,156.50	234,422,550
マーキュリアホールディングス	700	899.00	629,300
おきなわフィナンシャルグループ	11,300	2,429.00	27,447,700
ダイレクトマーケティングミックス	18,100	232.00	4,199,200
ポピンズ	2,700	1,354.00	3,655,800
LITALICO	13,800	1,043.00	14,393,400

コンフィデンス・インターワークス	300	1,657.00	497,100	
十六フィナンシャルグループ	20,100	4,400.00	88,440,000	
北國フィナンシャルホールディングス	14,100	4,660.00	65,706,000	
ネットプロテクションズホールディングス	48,000	355.00	17,040,000	
プロクレアホールディングス	16,400	1,727.00	28,322,800	
F Pパートナー	6,300	3,055.00	19,246,500	
あいちフィナンシャルグループ	26,800	2,408.00	64,534,400	
ジャムコ	8,800	1,281.00	11,272,800	
小野建	17,000	1,444.00	24,548,000	
はるやまホールディングス	800	522.00	417,600	
南陽	700	1,112.00	778,400	
ノジマ	50,500	2,330.00	117,665,000	
佐島電機	10,800	1,914.00	20,671,200	
カップ・クリエイト	24,300	1,566.00	38,053,800	
エコートレーディング	400	912.00	364,800	
伯東	8,800	4,540.00	39,952,000	
コンドーテック	11,800	1,352.00	15,953,600	
中山福	1,000	362.00	362,000	
ライトオン	1,300	203.00	263,900	
ナガイレーベン	19,500	2,265.00	44,167,500	
三菱食品	14,300	4,785.00	68,425,500	
良品計画	184,200	2,710.00	499,182,000	
パリミキホールディングス	2,400	331.00	794,400	
松田産業	11,700	3,180.00	37,206,000	
第一興商	59,900	1,866.00	111,773,400	
メディカルホールディングス	167,800	2,467.50	414,046,500	
アドヴァングループ	13,300	969.00	12,887,700	
S P K	6,300	2,021.00	12,732,300	
萩原電気ホールディングス	6,700	3,225.00	21,607,500	
アルビス	5,100	2,672.00	13,627,200	
アズワン	48,000	2,881.00	138,288,000	
スズデン	6,600	1,788.00	11,800,800	
尾家産業	400	2,013.00	805,200	
シモジマ	10,300	1,302.00	13,410,600	
ドウシシャ	14,300	2,068.00	29,572,400	
小津産業	400	1,648.00	659,200	
コナカ	2,100	220.00	462,000	
高速	9,200	2,514.00	23,128,800	
ハウス オブ ローゼ	200	1,459.00	291,800	
G - 7ホールディングス	16,900	1,456.00	24,606,400	
たけびし	6,600	2,072.00	13,675,200	
イオン北海道	38,200	876.00	33,463,200	
コジマ	29,900	1,035.00	30,946,500	
ヒマラヤ	600	858.00	514,800	
コーナン商事	17,000	3,580.00	60,860,000	
ネットワンシステムズ	61,400	4,540.00	278,756,000	
エコス	5,800	2,054.00	11,913,200	
ワタミ	18,600	1,126.00	20,943,600	
マルシェ	700	202.00	141,400	

リックス	3,500	2,662.00	9,317,000
システムソフト	50,700	60.00	3,042,000
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	312,600	3,718.00	1,162,246,800
丸文	13,900	1,078.00	14,984,200
西松屋チェーン	34,200	2,228.00	76,197,600
ゼンショーホールディングス	87,900	7,948.00	698,629,200
ハビネット	11,800	4,090.00	48,262,000
幸楽苑	11,400	1,284.00	14,637,600
ハークスレイ	600	718.00	430,800
橋本総業ホールディングス	6,100	1,179.00	7,191,900
日本ライフライン	41,500	1,311.00	54,406,500
サイゼリヤ	23,000	5,600.00	128,800,000
タカショー	12,600	484.00	6,098,400
V Tホールディングス	60,100	452.00	27,165,200
アルゴグラフィックス	13,600	4,910.00	66,776,000
魚力	5,400	2,411.00	13,019,400
I D O M	52,500	1,032.00	54,180,000
日本エム・ディ・エム	11,500	625.00	7,187,500
ポブラ	500	215.00	107,500
フジ・コーポレーション	7,100	1,904.00	13,518,400
ユナイテッドアローズ	16,500	2,383.00	39,319,500
進和	9,400	2,746.00	25,812,400
エスケイジャパン	400	663.00	265,200
ダイトロン	6,700	2,790.00	18,693,000
ハイデイ日高	25,000	2,752.00	68,800,000
シークス	22,200	1,140.00	25,308,000
京都きもの友禅ホールディングス	900	69.00	62,100
コロワイド	87,400	1,700.00	148,580,000
田中商事	500	680.00	340,000
オーハシテクニカ	7,400	1,710.00	12,654,000
壱番屋	61,000	1,028.00	62,708,000
白銅	4,600	2,436.00	11,205,600
トップカルチャー	600	145.00	87,000
P L A N T	400	1,515.00	606,000
スギホールディングス	83,100	2,608.50	216,766,350
ダイコー通産	200	1,238.00	247,600
薬王堂ホールディングス	7,600	2,100.00	15,960,000
島津製作所	210,500	4,648.00	978,404,000
J M S	13,500	442.00	5,967,000
クボテック	400	217.00	86,800
長野計器	9,500	2,480.00	23,560,000
ブイ・テクノロジー	7,100	2,433.00	17,274,300
スター精密	24,800	1,963.00	48,682,400
東京計器	10,200	3,635.00	37,077,000
愛知時計電機	7,000	2,010.00	14,070,000
インターアクション	8,800	1,040.00	9,152,000
オーバル	1,500	379.00	568,500
東京精密	30,100	8,433.00	253,833,300
マニー	58,500	1,818.50	106,382,250

ニコン	230,600	1,965.00	453,129,000
トプコン	83,000	1,580.50	131,181,500
オリンパス	837,300	2,550.00	2,135,115,000
理研計器	20,800	4,015.00	83,512,000
S C R E E Nホールディングス	61,000	9,922.00	605,242,000
キヤノン電子	13,900	2,490.00	34,611,000
タムロン	20,100	4,335.00	87,133,500
H O Y A	287,900	20,885.00	6,012,791,500
シード	1,300	499.00	648,700
ノーリツ鋼機	13,900	3,935.00	54,696,500
A & Dホロンホールディングス	18,200	2,144.00	39,020,800
朝日インテック	178,400	2,485.00	443,324,000
キヤノン	729,500	5,044.00	3,679,598,000
リコー	385,200	1,631.00	628,261,200
シチズン時計	134,400	913.00	122,707,200
リズム	300	4,115.00	1,234,500
大研医器	1,300	505.00	656,500
メニコン	54,600	1,676.00	91,509,600
シンシア	100	477.00	47,700
K Y O R I T S U	2,300	146.00	335,800
中本パックス	500	1,670.00	835,000
パラマウントベッドホールディングス	33,700	2,556.00	86,137,200
トランザクション	9,600	2,281.00	21,897,600
粧美堂	400	483.00	193,200
ニホンフラッシュ	12,500	891.00	11,137,500
前田工織	26,000	1,746.00	45,396,000
永大産業	1,900	215.00	408,500
アートネイチャー	15,100	865.00	13,061,500
フルヤ金属	13,900	3,605.00	50,109,500
バンダイナムコホールディングス	397,000	3,400.00	1,349,800,000
アイフィスジャパン	500	567.00	283,500
S H O E I	41,200	2,309.00	95,130,800
フランスベッドホールディングス	21,100	1,237.00	26,100,700
マーベラス	27,100	553.00	14,986,300
パイロットコーポレーション	23,000	5,031.00	115,713,000
萩原工業	9,700	1,438.00	13,948,600
エイベックス	27,500	1,437.00	39,517,500
フジシールインターナショナル	32,900	2,535.00	83,401,500
タカラトミー	61,300	4,380.00	268,494,000
広済堂ホールディングス	55,200	501.00	27,655,200
エステールホールディングス	400	603.00	241,200
レック	18,700	1,211.00	22,645,700
タカノ	600	713.00	427,800
三光合成	18,400	618.00	11,371,200
プロネクサス	15,200	1,290.00	19,608,000
ホクシン	900	102.00	91,800
ウッドワン	600	800.00	480,000
きもと	2,600	320.00	832,000
T O P P A Nホールディングス	191,600	4,732.00	906,651,200
大日本印刷	303,200	2,757.00	835,922,400

共同印刷	4,300	4,040.00	17,372,000
N I S S H A	25,000	1,802.00	45,050,000
光村印刷	100	1,473.00	147,300
Z A C R O S	11,500	4,390.00	50,485,000
ヴィア・ホールディングス	3,400	115.00	391,000
T A K A R A & C O M P A N Y	8,600	2,703.00	23,245,800
前澤化成工業	10,300	1,845.00	19,003,500
未来工業	5,300	3,660.00	19,398,000
アシックス	540,000	2,718.50	1,467,990,000
ツツミ	3,400	2,142.00	7,282,800
ウェブロックホールディングス	600	609.00	365,400
J S P	12,000	1,995.00	23,940,000
ニチハ	18,300	2,993.00	54,771,900
ローランド	10,700	3,990.00	42,693,000
エフピコ	32,300	2,659.00	85,885,700
小松ウオール工業	10,700	1,524.00	16,306,800
ヤマハ	267,400	1,107.50	296,145,500
河合楽器製作所	4,600	2,759.00	12,691,400
クリナップ	14,300	707.00	10,110,100
ピジョン	93,100	1,445.50	134,576,050
天馬	12,100	3,020.00	36,542,000
キングジム	13,100	861.00	11,279,100
象印マホービン	43,600	1,611.00	70,239,600
リンテック	29,500	3,230.00	95,285,000
信越ポリマー	31,700	1,672.00	53,002,400
東リ	4,400	447.00	1,966,800
イトーキ	29,300	1,627.00	47,671,100
任天堂	923,400	8,250.00	7,618,050,000
三菱鉛筆	20,200	2,666.00	53,853,200
松風	14,700	2,120.00	31,164,000
タカラスタANDARD	33,600	1,633.00	54,868,800
コクヨ	73,100	2,766.50	202,231,150
ナカバヤシ	15,800	522.00	8,247,600
ニフコ	54,900	3,691.00	202,635,900
立川ブラインド工業	6,800	1,362.00	9,261,600
グローブライト	14,400	1,969.00	28,353,600
オカムラ	43,900	2,007.00	88,107,300
バルカー	11,200	3,260.00	36,512,000
M U T O Hホールディングス	200	2,377.00	475,400
伊藤忠商事	1,040,100	7,923.00	8,240,712,300
丸紅	1,283,400	2,468.50	3,168,072,900
スクロール	23,100	1,027.00	23,723,700
高島	1,200	1,180.00	1,416,000
ヨンドシーホールディングス	14,600	1,828.00	26,688,800
三陽商会	7,600	2,610.00	19,836,000
長瀬産業	69,100	3,309.00	228,651,900
ナイガイ	500	239.00	119,500
蝶理	8,300	3,865.00	32,079,500
豊田通商	464,900	2,721.50	1,265,225,350
オンワードホールディングス	95,100	524.00	49,832,400

三共生興	20,100	590.00	11,859,000
兼松	64,700	2,622.50	169,675,750
美津濃	14,500	7,470.00	108,315,000
ツカモトコーポレーション	200	1,093.00	218,600
ルックホールディングス	4,700	2,530.00	11,891,000
三井物産	2,317,800	3,223.00	7,470,269,400
日本紙パルプ商事	74,000	647.00	47,878,000
東京エレクトロン	309,500	23,260.00	7,198,970,000
カメイ	16,400	1,907.00	31,274,800
東都水産	100	5,580.00	558,000
OUGホールディングス	300	2,524.00	757,200
スターゼン	10,600	2,919.00	30,941,400
セイコーグループ	22,700	3,840.00	87,168,000
山善	52,000	1,307.00	67,964,000
椿本興業	8,500	1,925.00	16,362,500
住友商事	927,300	3,290.00	3,050,817,000
BIPROGY	49,600	4,628.00	229,548,800
内田洋行	6,300	6,540.00	41,202,000
三菱商事	2,971,100	2,721.50	8,085,848,650
第一実業	14,600	2,718.00	39,682,800
キヤノンマーケティングジャパン	30,500	4,722.00	144,021,000
西華産業	7,400	4,055.00	30,007,000
佐藤商事	10,800	1,405.00	15,174,000
東京産業	15,700	706.00	11,084,200
ユアサ商事	13,400	4,710.00	63,114,000
神鋼商事	3,300	6,110.00	20,163,000
トルク	1,200	221.00	265,200
阪和興業	25,400	4,945.00	125,603,000
正栄食品工業	10,200	4,450.00	45,390,000
カナデン	11,600	1,450.00	16,820,000
RYODEN	12,600	2,343.00	29,521,800
ニプロ	121,900	1,371.00	167,124,900
岩谷産業	153,700	1,987.00	305,401,900
ナイス	500	1,646.00	823,000
ニチモウ	500	1,850.00	925,000
極東貿易	9,200	1,575.00	14,490,000
アステナホールディングス	29,200	511.00	14,921,200
三愛オブリ	36,000	1,918.00	69,048,000
稲畑産業	41,800	3,465.00	144,837,000
G S Iクレオス	8,300	2,098.00	17,413,400
明和産業	22,900	641.00	14,678,900
クワザワホールディングス	600	590.00	354,000
キムラタン	10,500	31.00	325,500
ゴールドウイン	25,900	8,796.00	227,816,400
ユニ・チャーム	305,500	4,100.00	1,252,550,000
キング	600	736.00	441,600
ワキタ	22,900	1,553.00	35,563,700
ヤマトインターナショナル	1,300	323.00	419,900
東邦ホールディングス	41,700	4,366.00	182,062,200
サンゲツ	38,900	2,817.00	109,581,300

ミツウロコグループホールディングス	19,700	1,711.00	33,706,700
シナネンホールディングス	4,400	6,380.00	28,072,000
伊藤忠エネクス	38,400	1,633.00	62,707,200
サンリオ	125,600	4,726.00	593,585,600
サンワテクノス	7,000	2,184.00	15,288,000
新光商事	20,900	975.00	20,377,500
トーヨー	6,600	2,724.00	17,978,400
三信電気	6,300	1,971.00	12,417,300
東陽テクニカ	14,300	1,566.00	22,393,800
モスフードサービス	22,800	3,610.00	82,308,000
加賀電子	31,500	2,745.00	86,467,500
都築電気	8,800	2,435.00	21,428,000
ソーダニッカ	15,100	1,144.00	17,274,400
立花エレテック	9,200	2,515.00	23,138,000
木曽路	23,400	2,172.00	50,824,800
SRSホールディングス	25,500	1,150.00	29,325,000
千趣会	31,300	312.00	9,765,600
リテールパートナーズ	23,000	1,236.00	28,428,000
上新電機	15,300	2,410.00	36,873,000
日本瓦斯	74,000	2,056.00	152,144,000
ロイヤルホールディングス	27,200	2,510.00	68,272,000
東天紅	100	860.00	86,000
いなげや	10,700	1,149.00	12,294,300
チヨダ	14,800	1,380.00	20,424,000
ライフコーポレーション	16,200	3,345.00	54,189,000
リンガーハット	19,900	2,286.00	45,491,400
MrMaxHD	19,400	660.00	12,804,000
テンアライド	2,600	269.00	699,400
AOKIホールディングス	33,100	1,168.00	38,660,800
オークワ	24,700	900.00	22,230,000
コメリ	20,900	3,255.00	68,029,500
青山商事	33,000	1,326.00	43,758,000
しまむら	36,200	7,822.00	283,156,400
はせがわ	900	307.00	276,300
高島屋	215,000	1,218.00	261,870,000
松屋	26,200	859.00	22,505,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	75,300	2,061.00	155,193,300
近鉄百貨店	8,800	2,111.00	18,576,800
丸井グループ	102,800	2,398.00	246,514,400
クレディセゾン	91,200	3,525.00	321,480,000
アクシアル リテイリング	42,200	895.00	37,769,000
井筒屋	700	416.00	291,200
イオン	572,300	3,869.00	2,214,228,700
イズミ	23,500	3,171.00	74,518,500
フォーバル	6,100	1,399.00	8,533,900
平和堂	25,800	2,183.00	56,321,400
フジ	28,400	2,044.00	58,049,600
ヤオコー	18,300	9,071.00	165,999,300
ゼビオホールディングス	21,100	1,092.00	23,041,200
ケーズホールディングス	104,000	1,402.50	145,860,000

PAL TAC	24,100	4,256.00	102,569,600
三谷産業	27,000	322.00	8,694,000
Olympicグループ	700	462.00	323,400
日産東京販売ホールディングス	2,500	409.00	1,022,500
あおぞら銀行	99,300	2,649.00	263,045,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,446,400	1,763.00	16,654,003,200
りそなホールディングス	1,778,900	1,169.50	2,080,423,550
三井住友トラストグループ	512,700	3,593.00	1,842,131,100
三井住友フィナンシャルグループ	3,004,800	3,547.00	10,658,025,600
千葉銀行	446,000	1,258.50	561,291,000
群馬銀行	256,200	972.00	249,026,400
武蔵野銀行	22,000	2,929.00	64,438,000
千葉興業銀行	34,000	1,220.00	41,480,000
筑波銀行	63,200	232.00	14,662,400
七十七銀行	46,200	4,395.00	203,049,000
秋田銀行	9,600	2,135.00	20,496,000
山形銀行	16,000	1,009.00	16,144,000
岩手銀行	9,100	2,436.00	22,167,600
東邦銀行	124,100	267.00	33,134,700
東北銀行	800	1,066.00	852,800
ふくおかフィナンシャルグループ	125,300	3,843.00	481,527,900
スルガ銀行	97,000	1,069.00	103,693,000
八十二銀行	337,100	948.80	319,840,480
山梨中央銀行	16,100	1,779.00	28,641,900
大垣共立銀行	27,400	1,873.00	51,320,200
福井銀行	13,000	1,896.00	24,648,000
清水銀行	5,700	1,511.00	8,612,700
富山銀行	200	1,544.00	308,800
滋賀銀行	21,900	3,570.00	78,183,000
南都銀行	21,800	3,155.00	68,779,000
百五銀行	135,600	606.00	82,173,600
紀陽銀行	51,400	1,987.00	102,131,800
ほくほくフィナンシャルグループ	81,000	1,764.50	142,924,500
山陰合同銀行	90,200	1,251.00	112,840,200
鳥取銀行	600	1,222.00	733,200
百十四銀行	14,100	2,820.00	39,762,000
四国銀行	21,300	1,044.00	22,237,200
阿波銀行	20,100	2,790.00	56,079,000
大分銀行	8,700	3,240.00	28,188,000
宮崎銀行	9,400	2,925.00	27,495,000
佐賀銀行	8,400	2,149.00	18,051,600
琉球銀行	33,000	1,045.00	34,485,000
セブン銀行	515,900	324.50	167,409,550
みずほフィナンシャルグループ	1,944,100	3,421.00	6,650,766,100
高知銀行	500	883.00	441,500
山口フィナンシャルグループ	141,200	1,561.00	220,413,200
芙蓉総合リース	13,400	11,205.00	150,147,000
みずほリース	108,200	1,035.00	111,987,000
東京センチュリー	107,600	1,527.00	164,305,200
SBIホールディングス	231,700	3,535.00	819,059,500

日本証券金融	52,800	2,054.00	108,451,200
アイフル	238,500	314.00	74,889,000
日本アジア投資	1,100	219.00	240,900
名古屋銀行	9,000	6,600.00	59,400,000
北洋銀行	196,400	428.00	84,059,200
大光銀行	500	1,415.00	707,500
愛媛銀行	21,200	1,023.00	21,687,600
トマト銀行	600	1,141.00	684,600
京葉銀行	64,700	755.00	48,848,500
栃木銀行	65,900	262.00	17,265,800
北日本銀行	5,100	2,678.00	13,657,800
東和銀行	26,400	602.00	15,892,800
福島銀行	1,600	228.00	364,800
大東銀行	700	710.00	497,000
リコーリース	13,800	5,150.00	71,070,000
イオンフィナンシャルサービス	82,700	1,241.00	102,630,700
アコム	342,700	366.10	125,462,470
ジャックス	17,200	3,885.00	66,822,000
オリエントコーポレーション	47,100	833.00	39,234,300
オリックス	863,700	3,402.00	2,938,307,400
三菱HCキャピタル	722,100	1,053.50	760,732,350
ジャフコグループ	42,800	2,050.00	87,740,000
九州リースサービス	600	1,101.00	660,600
トモニホールディングス	137,600	428.00	58,892,800
大和証券グループ本社	1,030,000	1,046.00	1,077,380,000
野村ホールディングス	2,422,200	906.30	2,195,239,860
岡三証券グループ	113,900	614.00	69,934,600
丸三証券	48,000	974.00	46,752,000
東洋証券	42,900	566.00	24,281,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	171,000	472.00	80,712,000
光世証券	400	407.00	162,800
水戸証券	39,600	524.00	20,750,400
いちよし証券	29,200	864.00	25,228,800
松井証券	99,200	840.00	83,328,000
SOMPOホールディングス	704,300	3,473.00	2,446,033,900
日本取引所グループ	856,800	1,918.50	1,643,770,800
マネックスグループ	141,000	874.00	123,234,000
極東証券	17,900	1,307.00	23,395,300
岩井コスモホールディングス	16,400	2,222.00	36,440,800
アイザワ証券グループ	20,900	1,724.00	36,031,600
フィデアホールディングス	14,900	1,403.00	20,904,700
池田泉州ホールディングス	199,700	361.00	72,091,700
アニコムホールディングス	48,900	638.00	31,198,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1,055,700	3,631.00	3,833,246,700
マネーパートナーズグループ	1,600	474.00	758,400
スパークス・グループ	16,000	1,324.00	21,184,000
小林洋行	600	256.00	153,600
第一生命ホールディングス	677,500	4,198.00	2,844,145,000

東京海上ホールディングス	1,406,200	5,963.00	8,385,170,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	800	583.00	466,400	
イー・ギャランティ	23,500	1,547.00	36,354,500	
アサックス	600	737.00	442,200	
NECキャピタルソリューション	7,100	3,760.00	26,696,000	
T&Dホールディングス	386,700	2,581.50	998,266,050	
アドバンスクリエイト	11,200	768.00	8,601,600	
三井不動産	1,999,200	1,317.50	2,633,946,000	
三菱地所	834,400	2,193.00	1,829,839,200	
平和不動産	23,400	4,220.00	98,748,000	
東京建物	125,700	2,645.00	332,476,500	
京阪神ビルディング	24,200	1,523.00	36,856,600	
住友不動産	234,500	4,865.00	1,140,842,500	
太平洋興発	700	730.00	511,000	
テーオーシー	25,600	592.00	15,155,200	
レオパレス21	126,000	513.00	64,638,000	
スターツコーポレーション	23,600	3,720.00	87,792,000	
フジ住宅	18,100	753.00	13,629,300	
空港施設	20,200	581.00	11,736,200	
明和地所	11,500	993.00	11,419,500	
ゴールドクレスト	9,800	3,020.00	29,596,000	
リログループ	83,700	1,745.00	146,056,500	
エスリード	6,800	4,510.00	30,668,000	
日神グループホールディングス	23,100	510.00	11,781,000	
日本エスコン	37,800	1,002.00	37,875,600	
MIRARTHホールディングス	84,300	493.00	41,559,900	
AVANTIA	900	770.00	693,000	
イオンモール	87,200	2,028.50	176,885,200	
毎日コムネット	600	728.00	436,800	
ファースト住建	600	1,001.00	600,600	
ランド	903,700	8.00	7,229,600	
カチタス	38,800	2,111.00	81,906,800	
東祥	12,700	660.00	8,382,000	
トーセイ	24,000	2,513.00	60,312,000	
穴吹興産	400	1,994.00	797,600	
サンフロンティア不動産	24,000	1,841.00	44,184,000	
FJネクストホールディングス	15,200	1,099.00	16,704,800	
インテリックス	400	756.00	302,400	
ランドビジネス	700	190.00	133,000	
サンネクスタグループ	500	1,009.00	504,500	
グランディハウス	13,600	567.00	7,711,200	
東武鉄道	154,100	2,639.00	406,669,900	
相鉄ホールディングス	48,300	2,527.00	122,054,100	
東急	410,200	2,011.50	825,117,300	
京浜急行電鉄	180,900	1,228.00	222,145,200	
小田急電鉄	241,800	1,631.50	394,496,700	
京王電鉄	77,300	4,140.00	320,022,000	
京成電鉄	84,800	4,317.00	366,081,600	
富士急行	18,000	2,494.00	44,892,000	
東日本旅客鉄道	806,500	3,011.00	2,428,371,500	

西日本旅客鉄道	373,800	2,719.00	1,016,362,200	
東海旅客鉄道	563,400	3,193.00	1,798,936,200	
西武ホールディングス	159,200	3,539.00	563,408,800	
鴻池運輸	24,900	2,575.00	64,117,500	
西日本鉄道	42,200	2,215.50	93,494,100	
ハマキョウレックス	50,000	1,250.00	62,500,000	
サカイ引越センター	18,500	2,426.00	44,881,000	
近鉄グループホールディングス	156,400	3,537.00	553,186,800	
阪急阪神ホールディングス	194,800	3,990.00	777,252,000	
南海電気鉄道	65,100	2,503.00	162,945,300	
京阪ホールディングス	80,500	3,367.00	271,043,500	
神戸電鉄	3,900	2,335.00	9,106,500	
名古屋鉄道	161,500	1,770.00	285,855,000	
山陽電気鉄道	11,000	2,034.00	22,374,000	
ヤマトホールディングス	177,500	1,616.50	286,928,750	
山九	35,200	5,295.00	186,384,000	
日新	9,900	4,280.00	42,372,000	
丸運	900	457.00	411,300	
丸全昭和運輸	9,000	6,030.00	54,270,000	
センコーグループホールディングス	85,800	1,461.00	125,353,800	
トナミホールディングス	3,200	5,800.00	18,560,000	
ニッコンホールディングス	83,000	1,919.00	159,277,000	
日本石油輸送	200	2,779.00	555,800	
福山通運	15,600	3,730.00	58,188,000	
セイノーホールディングス	71,900	2,362.50	169,863,750	
神奈川中央交通	4,300	3,485.00	14,985,500	
A Z - C O M丸和ホールディングス	45,400	1,060.00	48,124,000	
日本郵船	302,500	4,873.00	1,474,082,500	
商船三井	277,600	5,288.00	1,467,948,800	
川崎汽船	332,200	2,160.00	717,552,000	
N Sユナイテッド海運	9,200	4,050.00	37,260,000	
明海グループ	1,800	698.00	1,256,400	
飯野海運	53,700	1,122.00	60,251,400	
共栄タンカー	300	1,196.00	358,800	
九州旅客鉄道	111,900	3,967.00	443,907,300	
S Gホールディングス	245,100	1,492.00	365,689,200	
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	52,200	7,411.00	386,854,200	
I D & E ホールディングス	9,100	4,255.00	38,720,500	
日本航空	334,700	2,431.00	813,655,700	
A N Aホールディングス	397,200	2,851.50	1,132,615,800	
ビーウィズ	3,000	1,587.00	4,761,000	
サンウェルズ	5,800	1,228.00	7,122,400	
T R Eホールディングス	34,500	1,793.00	61,858,500	
人・夢・技術グループ	6,200	1,651.00	10,236,200	
西本W i s m e t t a cホールディングス	9,400	1,353.00	12,718,200	
シルバーライフ	4,400	727.00	3,198,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,158.00	215,800	
Genky Drug Stores	13,700	3,015.00	41,305,500	

コア商事ホールディングス	11,300	607.00	6,859,100
K P Pグループホールディングス	32,100	649.00	20,832,900
ナルミヤ・インターナショナル	300	1,226.00	367,800
ブックオフグループホールディングス	11,200	1,394.00	15,612,800
ギフトホールディングス	7,600	3,620.00	27,512,000
三菱倉庫	174,200	1,025.50	178,642,100
三井倉庫ホールディングス	15,000	7,910.00	118,650,000
住友倉庫	43,300	2,709.00	117,299,700
澁澤倉庫	6,700	3,145.00	21,071,500
ヤマタネ	6,200	3,120.00	19,344,000
東陽倉庫	400	1,452.00	580,800
乾汽船	18,500	1,424.00	26,344,000
日本トランスシティ	29,500	959.00	28,290,500
ケイヒン	300	1,959.00	587,700
中央倉庫	8,600	1,568.00	13,484,800
川西倉庫	300	1,052.00	315,600
安田倉庫	9,900	1,629.00	16,127,100
ファイズホールディングス	300	915.00	274,500
N I S S Oホールディングス	13,100	780.00	10,218,000
大栄環境	32,700	3,070.00	100,389,000
G E N O V A	5,100	1,778.00	9,067,800
日本管財ホールディングス	15,700	2,591.00	40,678,700
東洋埠頭	500	1,240.00	620,000
上組	67,400	3,107.00	209,411,800
サンリツ	400	780.00	312,000
キムラユニティー	800	1,448.00	1,158,400
キューソー流通システム	9,700	1,999.00	19,390,300
東海運	900	316.00	284,400
エーアイティー	9,100	1,762.00	16,034,200
内外トランスライン	5,900	2,816.00	16,614,400
ショーエイコーポレーション	500	578.00	289,000
日本コンセプト	5,300	1,799.00	9,534,700
T B Sホールディングス	73,800	3,844.00	283,687,200
日本テレビホールディングス	129,900	2,278.50	295,977,150
朝日放送グループホールディングス	13,800	616.00	8,500,800
テレビ朝日ホールディングス	35,500	2,007.00	71,248,500
スカパーJ S A Tホールディングス	114,000	852.00	97,128,000
テレビ東京ホールディングス	9,000	3,025.00	27,225,000
日本B S放送	600	873.00	523,800
ビジョン	22,100	1,007.00	22,254,700
スマートバリュー	500	291.00	145,500
U - N E X T H O L D I N G S	16,400	4,875.00	79,950,000
ワイヤレスゲート	800	242.00	193,600
日本通信	117,900	146.00	17,213,400
クロップス	200	987.00	197,400
日本電信電話	43,630,000	151.20	6,596,856,000
K D D I	1,078,700	4,898.00	5,283,472,600
ソフトバンク	23,468,400	190.60	4,473,077,040
光通信	16,900	31,870.00	538,603,000
エムティーアイ	10,000	1,066.00	10,660,000

GMOインターネットグループ	47,800	2,683.50	128,271,300	
ファイバーゲート	7,800	1,023.00	7,979,400	
アイドママーケティングコミュニケーション	500	211.00	105,500	
KADOKAWA	77,500	3,000.00	232,500,000	
学研ホールディングス	26,800	988.00	26,478,400	
ゼンリン	25,000	821.00	20,525,000	
昭文社ホールディングス	700	396.00	277,200	
インプレスホールディングス	1,600	138.00	220,800	
東京電力ホールディングス	1,230,400	604.10	743,284,640	
中部電力	539,000	1,682.00	906,598,000	
関西電力	616,000	2,458.00	1,514,128,000	
中国電力	254,000	1,090.50	276,987,000	
北陸電力	149,500	1,009.50	150,920,250	
東北電力	385,000	1,303.00	501,655,000	
四国電力	136,300	1,351.50	184,209,450	
九州電力	337,100	1,650.00	556,215,000	
北海道電力	153,100	964.10	147,603,710	
沖縄電力	37,500	993.00	37,237,500	
電源開発	110,000	2,689.50	295,845,000	
エフオン	10,800	375.00	4,050,000	
イーレックス	28,400	683.00	19,397,200	
レノバ	40,000	890.00	35,600,000	
東京瓦斯	284,800	3,730.00	1,062,304,000	
大阪瓦斯	291,500	3,285.00	957,577,500	
東邦瓦斯	57,600	3,780.00	217,728,000	
北海道瓦斯	43,600	540.00	23,544,000	
広島ガス	31,100	380.00	11,818,000	
西部ガスホールディングス	15,200	1,793.00	27,253,600	
静岡ガス	33,300	996.00	33,166,800	
メタウォーター	19,900	1,792.00	35,660,800	
M&A総研ホールディングス	16,200	2,278.00	36,903,600	
アイネット	8,900	1,653.00	14,711,700	
松竹	8,400	11,070.00	92,988,000	
東宝	91,800	6,103.00	560,255,400	
エイチ・アイ・エス	48,100	1,808.00	86,964,800	
東映	24,200	5,160.00	124,872,000	
ラックランド	6,300	1,982.00	12,486,600	
NTTデータグループ	383,500	2,667.00	1,022,794,500	
共立メンテナンス	47,300	2,557.50	120,969,750	
イチネンホールディングス	14,600	1,955.00	28,543,000	
建設技術研究所	7,700	4,780.00	36,806,000	
スペース	10,900	1,172.00	12,774,800	
アインホールディングス	21,400	4,850.00	103,790,000	
燦ホールディングス	12,700	1,158.00	14,706,600	
ピー・シー・エー	9,600	1,958.00	18,796,800	
スバル興業	5,800	3,140.00	18,212,000	
東京テアトル	600	1,099.00	659,400	
タナベコンサルティンググループ	6,500	1,193.00	7,754,500	
ビジネスブレイン太田昭和	6,300	1,920.00	12,096,000	

ナガワ	4,000	6,680.00	26,720,000
東京都競馬	11,000	4,205.00	46,255,000
カナモト	23,300	2,737.00	63,772,100
D T S	26,500	4,030.00	106,795,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	73,700	5,542.00	408,445,400
シーイーシー	18,500	1,956.00	36,186,000
カブコン	291,600	3,307.00	964,321,200
ニシオホールディングス	12,600	3,580.00	45,108,000
アイ・エス・ビー	6,900	1,369.00	9,446,100
アゴーラ ホスピタリティグループ	10,700	56.00	599,200
日本空港ビルデング	50,900	5,607.00	285,396,300
トランス・コスモス	19,100	3,475.00	66,372,500
乃村工藝社	65,600	772.00	50,643,200
S C S K	119,900	3,031.00	363,416,900
藤田観光	6,700	8,630.00	57,821,000
K N T - C Tホールディングス	8,900	1,339.00	11,917,100
トーカイ	13,400	2,194.00	29,399,600
白洋舎	300	2,300.00	690,000
セコム	306,200	5,258.00	1,609,999,600
N S W	6,500	2,915.00	18,947,500
セントラル警備保障	8,100	2,802.00	22,696,200
アイネス	11,400	1,686.00	19,220,400
丹青社	31,900	796.00	25,392,400
メイテックグループホールディングス	55,500	2,930.00	162,615,000
T K C	26,100	3,915.00	102,181,500
富士ソフト	40,600	9,044.00	367,186,400
応用地質	14,000	2,584.00	36,176,000
船井総研ホールディングス	30,200	2,435.00	73,537,000
N S D	56,500	3,450.00	194,925,000
進学会ホールディングス	600	212.00	127,200
丸紅建材リース	200	2,933.00	586,600
オオバ	1,100	1,028.00	1,130,800
コナミグループ	55,000	14,880.00	818,400,000
いであ	400	2,426.00	970,400
学究社	6,000	1,929.00	11,574,000
イオンディライト	16,100	4,360.00	70,196,000
ナック	15,300	570.00	8,721,000
福井コンピュータホールディングス	10,200	2,795.00	28,509,000
ダイセキ	36,200	3,885.00	140,637,000
ステップ	5,500	2,009.00	11,049,500
泉州電業	10,600	5,540.00	58,724,000
GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS	8,700	4,220.00	36,714,000
トラスコ中山	32,500	2,272.00	73,840,000
ヤマダホールディングス	475,700	454.60	216,253,220
オートバックスセブン	53,900	1,410.00	75,999,000
モリト	12,200	1,446.00	17,641,200
アークランズ	46,100	1,668.00	76,894,800

ニトリホールディングス	56,400	17,510.00	987,564,000	
グルメ杵屋	12,700	1,045.00	13,271,500	
愛眼	1,300	145.00	188,500	
ケーユーホールディングス	9,000	1,061.00	9,549,000	
吉野家ホールディングス	60,400	3,240.00	195,696,000	
加藤産業	19,100	4,145.00	79,169,500	
北恵	400	940.00	376,000	
イノテック	10,500	1,389.00	14,584,500	
イエローハット	27,200	2,460.00	66,912,000	
松屋フーズホールディングス	7,300	6,260.00	45,698,000	
JBC Cホールディングス	9,700	4,590.00	44,523,000	
J Kホールディングス	11,800	1,017.00	12,000,600	
サガミホールディングス	24,800	1,825.00	45,260,000	
日伝	8,800	2,985.00	26,268,000	
ミロク情報サービス	13,400	1,890.00	25,326,000	
北沢産業	1,100	362.00	398,200	
杉本商事	13,800	1,336.00	18,436,800	
因幡電機産業	43,100	3,867.00	166,667,700	
王将フードサービス	30,700	3,105.00	95,323,500	
ミニストップ	13,000	1,746.00	22,698,000	
アークス	26,000	2,477.00	64,402,000	
パローホールディングス	29,600	2,103.00	62,248,800	
東テク	15,500	2,866.00	44,423,000	
ミスミグループ本社	233,700	2,501.50	584,600,550	
アルテック	900	213.00	191,700	
ベルク	7,700	6,660.00	51,282,000	
大 庄	9,300	1,045.00	9,718,500	
タキヒヨー	500	1,270.00	635,000	
ファーストリテイリング	87,100	49,480.00	4,309,708,000	
ソフトバンクグループ	723,500	9,513.00	6,882,655,500	
蔵王産業	300	2,461.00	738,300	
スズケン	50,900	4,877.00	248,239,300	
サンドラッグ	52,100	3,692.00	192,353,200	
サックスパー ホールディングス	14,700	945.00	13,891,500	
ジェコス	9,200	986.00	9,071,200	
ヤマザワ	400	1,162.00	464,800	
やまや	400	2,851.00	1,140,400	
ベルーナ	37,300	731.00	27,266,300	
合計	276,449,600		574,020,539,510	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,345,646,558
コール・ローン	1,132,717,379
国債証券	193,961,193,598
派生商品評価勘定	577,759,823
未収入金	48,783
未収利息	1,354,889,159
前払費用	449,032,247
流動資産合計	200,821,287,547
資産合計	200,821,287,547
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	754,088,155
未払金	3,567,801,045
未払解約金	434,185,000
流動負債合計	4,756,074,200
負債合計	4,756,074,200
純資産の部	
元本等	
元本	169,884,633,449
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	26,180,579,898
元本等合計	196,065,213,347
純資産合計	196,065,213,347
負債純資産合計	200,821,287,547

## 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11月14日 至 2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	225,046,892,131円
同期中追加設定元本額	365,356,242,227円
同期中一部解約元本額	420,518,500,909円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	14,637,358,739円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,709,715,086円
たわらノーロード バランス(標準型)	5,585,332,359円
たわらノーロード バランス(積極型)	3,174,925,499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)	50,481,239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)	1,704,536,867円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	1,869,882,488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)	107,464,787円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	173,393円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,911,097円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	18,510,339円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	176,006,265円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	10,269,981円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	91,804円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	363,578円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	2,202,866円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	655,086円
投資のソムリエ	44,593,483,959円
投資のソムリエ<DC年金>	5,418,859,771円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	7,800,011,360円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	21,333,209,320円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,806,079,364円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	4,991,548,165円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	753,232,646円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	399,585,927円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	77,819,554円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,538,556,518円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	15,146,400,321円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,144,456,881円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	936,778,076円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	434,163,949円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	263,384,779円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	69,409,606円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	6,483,394円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	478,390円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	18,098,674,359円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	6,775,074,655円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	798,756,424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)	22,920,403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)	278,997,206円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	29,051,294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)	172,964,320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)	307,063,273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)	637,308,062円
計	169,884,633,449円
2. 受益権の総数	169,884,633,449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11月14日 至 2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	132,210,915	
合計	132,210,915	

(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6月25日から2024年11月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年11月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建					
アメリカ・ドル	198,378,658,415	-	198,546,240,480	167,582,065	
イギリス・ポンド	91,258,011,021	-	91,816,626,032	558,615,011	
イスラエル・シェケル	10,075,667,019	-	10,181,126,432	105,459,413	
オーストラリア・ドル	594,408,888	-	596,269,632	1,860,744	
オフショア・人民元	2,492,124,939	-	2,522,222,135	30,097,196	
カナダ・ドル	24,804,023,959	-	24,696,016,111	108,007,848	
シンガポール・ドル	3,805,572,240	-	3,834,590,006	29,017,766	
スウェーデン・クローナ	796,509,966	-	798,450,100	1,940,134	
デンマーク・クローネ	317,215,698	-	315,498,291	1,717,407	
ニュージーランド・ドル	537,667,420	-	533,735,195	3,932,225	
ノルウェー・クローネ	537,125,964	-	541,768,006	4,642,042	
ポーランド・ズロチ	305,469,340	-	307,937,868	2,468,528	
	979,245,669	-	977,151,411	2,094,258	

マレーシア・リングgit	983,474,098	-	979,439,120	4,034,978
メキシコ・ペソ	1,430,945,139	-	1,434,177,441	3,232,302
ユーロ	59,461,197,055	-	59,011,232,700	449,964,355
買建	3,419,112,970	-	3,410,366,703	8,746,267
アメリカ・ドル	1,678,308,440	-	1,681,877,767	3,569,327
イギリス・ポンド	178,811,078	-	179,533,392	722,314
オーストラリア・ドル	42,056,742	-	42,373,254	316,512
オフショア・人民元	363,645,112	-	361,428,336	2,216,776
カナダ・ドル	64,402,522	-	64,714,692	312,170
ユーロ	1,091,889,076	-	1,080,439,262	11,449,814
合計	201,797,771,385	-	201,956,607,183	176,328,332

## (注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額	1.1541円
(1万口当たり純資産額)	(11,541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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,922,857.600	
		US T N/B 0.375 01/31/26	1,000,000.000	953,417.970	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,100,000.000	2,797,326.160	
		US T N/B 0.375 09/30/27	2,820,000.000	2,528,857.020	
		US T N/B 0.375 12/31/25	1,080,000.000	1,033,003.130	
		US T N/B 0.5 02/28/26	3,900,000.000	3,712,998.040	
		US T N/B 0.5 04/30/27	400,000.000	365,453.120	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,600,000.000	2,367,828.110	

US T N/B 0.5 06/30/27	2,500,000.000	2,270,410.150	
US T N/B 0.5 08/31/27	1,400,000.000	1,264,101.560	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,692,148.430	
US T N/B 0.625 03/31/27	1,000,000.000	919,453.120	
US T N/B 0.625 05/15/30	3,690,000.000	3,044,682.430	
US T N/B 0.625 07/31/26	4,180,000.000	3,929,526.540	
US T N/B 0.625 08/15/30	5,590,000.000	4,570,480.080	
US T N/B 0.625 11/30/27	2,300,000.000	2,065,552.740	
US T N/B 0.625 12/31/27	1,860,000.000	1,665,571.870	
US T N/B 0.75 01/31/28	1,870,000.000	1,676,535.350	
US T N/B 0.75 03/31/26	3,030,000.000	2,886,015.820	
US T N/B 0.75 04/30/26	4,862,000.000	4,618,710.090	
US T N/B 0.75 05/31/26	4,890,000.000	4,632,128.880	
US T N/B 0.75 08/31/26	2,380,000.000	2,236,177.330	
US T N/B 0.875 06/30/26	2,216,000.000	2,097,842.190	
US T N/B 0.875 09/30/26	2,310,000.000	2,169,775.790	
US T N/B 0.875 11/15/30	5,190,000.000	4,282,763.630	
US T N/B 1.0 07/31/28	3,970,000.000	3,534,618.150	
US T N/B 1.125 02/15/31	5,000,000.000	4,164,648.450	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,026,093.750	
US T N/B 1.125 02/29/28	2,720,000.000	2,463,512.480	
US T N/B 1.125 05/15/40	1,000,000.000	625,449.220	
US T N/B 1.125 08/15/40	1,760,000.000	1,090,718.740	
US T N/B 1.125 08/31/28	2,970,000.000	2,649,912.880	
US T N/B 1.125 10/31/26	2,770,000.000	2,608,128.120	
US T N/B 1.25 03/31/28	3,500,000.000	3,175,634.770	
US T N/B 1.25 04/30/28	2,000,000.000	1,810,585.940	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,100,000.000	2,065,054.700	
US T N/B 1.25 05/31/28	2,140,000.000	1,932,896.490	
US T N/B 1.25 06/30/28	2,070,000.000	1,865,304.480	
US T N/B 1.25 08/15/31	7,000,000.000	5,779,101.580	
US T N/B 1.25 09/30/28	2,250,000.000	2,012,651.370	
US T N/B 1.25 11/30/26	2,650,000.000	2,495,554.680	
US T N/B 1.25 12/31/26	2,830,000.000	2,659,647.270	
US T N/B 1.375 08/15/50	2,300,000.000	1,192,855.460	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,750,000.000	1,663,388.660	
US T N/B 1.375 10/31/28	3,600,000.000	3,229,382.800	
US T N/B 1.375 11/15/31	4,000,000.000	3,307,734.350	
US T N/B 1.375 11/15/40	1,930,000.000	1,241,758.980	
US T N/B 1.375 12/31/28	2,500,000.000	2,233,642.570	
US T N/B 1.5 01/31/27	3,400,000.000	3,205,296.890	
US T N/B 1.5 02/15/30	2,200,000.000	1,920,617.180	
US T N/B 1.5 08/15/26	2,730,000.000	2,603,524.230	
US T N/B 1.5 11/30/28	2,340,000.000	2,105,177.340	
US T N/B 1.625 02/15/26	2,300,000.000	2,224,800.780	
US T N/B 1.625 05/15/26	2,422,000.000	2,328,620.540	
US T N/B 1.625 05/15/31	4,850,000.000	4,134,435.550	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,400,000.000	3,030,250.000	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,000,000.000	953,203.120	

US T N/B 1.625 10/31/26	1,330,000.000	1,265,006.630	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,300,000.000	2,382,300.780	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,600,000.000	1,518,750.000	
US T N/B 1.75 01/31/29	3,600,000.000	3,259,195.300	
US T N/B 1.75 08/15/41	3,200,000.000	2,154,249.980	
US T N/B 1.75 11/15/29	1,500,000.000	1,338,281.250	
US T N/B 1.75 12/31/26	1,500,000.000	1,425,117.170	
US T N/B 1.875 02/15/32	5,980,000.000	5,095,380.440	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,100,000.000	3,550,277.310	
US T N/B 1.875 02/15/51	2,950,000.000	1,743,092.780	
US T N/B 1.875 02/28/27	1,500,000.000	1,423,359.370	
US T N/B 1.875 02/28/29	2,200,000.000	1,999,378.890	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,000,000.000	1,925,156.240	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,921,328.120	
US T N/B 1.875 11/15/51	4,400,000.000	2,582,078.130	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,500,000.000	2,149,355.460	
US T N/B 2.0 08/15/51	3,300,000.000	2,004,492.200	
US T N/B 2.0 11/15/26	3,900,000.000	3,734,097.660	
US T N/B 2.0 11/15/41	2,700,000.000	1,885,306.640	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,200,000.000	2,129,445.310	
US T N/B 2.25 02/15/27	1,900,000.000	1,819,621.080	
US T N/B 2.25 02/15/52	2,270,000.000	1,461,622.850	
US T N/B 2.25 03/31/26	1,000,000.000	972,578.120	
US T N/B 2.25 05/15/41	2,300,000.000	1,696,160.150	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,900,000.000	2,752,847.630	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,100,000.000	744,089.840	
US T N/B 2.25 08/15/49	1,790,000.000	1,170,666.990	
US T N/B 2.25 11/15/25	1,500,000.000	1,469,066.010	
US T N/B 2.25 11/15/27	1,940,000.000	1,833,300.000	
US T N/B 2.375 02/15/42	2,100,000.000	1,553,097.650	
US T N/B 2.375 03/31/29	1,700,000.000	1,575,853.520	
US T N/B 2.375 04/30/26	800,000.000	778,343.750	
US T N/B 2.375 05/15/27	2,000,000.000	1,913,125.000	
US T N/B 2.375 05/15/29	1,820,000.000	1,685,170.700	
US T N/B 2.375 05/15/51	2,880,000.000	1,918,575.010	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,880,000.000	1,931,737.490	
US T N/B 2.5 02/15/45	1,110,000.000	802,712.100	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,000,000.000	714,882.810	
US T N/B 2.5 02/28/26	1,000,000.000	977,265.620	
US T N/B 2.5 03/31/27	3,900,000.000	3,750,855.450	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,800,000.000	1,282,886.700	
US T N/B 2.625 01/31/26	780,000.000	764,460.930	
US T N/B 2.625 02/15/29	2,500,000.000	2,346,728.520	
US T N/B 2.625 05/31/27	3,300,000.000	3,174,316.390	
US T N/B 2.625 07/31/29	1,600,000.000	1,492,656.250	
US T N/B 2.625 12/31/25	1,400,000.000	1,373,804.680	
US T N/B 2.75 02/15/28	2,400,000.000	2,294,015.610	
US T N/B 2.75 04/30/27	2,000,000.000	1,931,796.880	
US T N/B 2.75 05/31/29	2,400,000.000	2,255,906.250	

US T N/B 2.75 07/31/27	2,650,000.000	2,551,246.100	
US T N/B 2.75 08/15/32	6,080,000.000	5,474,374.960	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,080,000.000	842,779.680	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,200,000.000	1,622,628.890	
US T N/B 2.75 11/15/42	500,000.000	388,593.750	
US T N/B 2.75 11/15/47	1,200,000.000	883,664.060	
US T N/B 2.875 04/30/29	1,650,000.000	1,561,054.680	
US T N/B 2.875 05/15/28	3,440,000.000	3,291,045.310	
US T N/B 2.875 05/15/32	3,700,000.000	3,371,263.650	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,590,000.000	1,251,131.250	
US T N/B 2.875 05/15/49	2,000,000.000	1,492,460.940	
US T N/B 2.875 05/15/52	2,300,000.000	1,703,078.120	
US T N/B 2.875 08/15/28	2,900,000.000	2,765,705.080	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,500,000.000	1,154,648.430	
US T N/B 2.875 11/15/46	750,000.000	570,292.960	
US T N/B 2.875 11/30/25	1,140,000.000	1,122,814.020	
US T N/B 3.0 02/15/47	890,000.000	690,706.050	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,300,000.000	1,771,000.000	
US T N/B 3.0 02/15/49	2,300,000.000	1,759,589.830	
US T N/B 3.0 05/15/42	500,000.000	406,894.530	
US T N/B 3.0 05/15/45	600,000.000	472,710.930	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,000,000.000	774,375.000	
US T N/B 3.0 08/15/48	1,710,000.000	1,311,757.030	
US T N/B 3.0 08/15/52	2,100,000.000	1,596,164.050	
US T N/B 3.0 10/31/25	500,000.000	493,698.740	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,500,000.000	1,186,259.760	
US T N/B 3.0 11/15/45	1,000,000.000	785,117.190	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,000,000.000	833,671.880	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,260,000.000	1,034,725.780	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,520,000.000	1,982,678.890	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,000,000.000	1,617,617.180	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,000,000.000	2,914,921.860	
US T N/B 3.125 08/31/29	1,500,000.000	1,429,951.160	
US T N/B 3.125 11/15/28	2,710,000.000	2,602,817.380	
US T N/B 3.125 11/15/41	580,000.000	485,953.900	
US T N/B 3.25 05/15/42	2,050,000.000	1,730,728.500	
US T N/B 3.25 06/30/27	1,890,000.000	1,845,481.630	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,000,000.000	2,879,531.250	
US T N/B 3.375 05/15/33	6,100,000.000	5,706,716.770	
US T N/B 3.375 05/15/44	600,000.000	506,343.750	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,300,000.000	1,972,025.380	
US T N/B 3.375 09/15/27	2,500,000.000	2,445,996.100	
US T N/B 3.375 11/15/48	1,850,000.000	1,517,144.520	
US T N/B 3.5 01/31/28	2,900,000.000	2,839,054.700	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,500,000.000	2,417,138.660	
US T N/B 3.5 02/15/33	3,400,000.000	3,217,050.780	
US T N/B 3.5 02/15/39	400,000.000	363,375.000	
US T N/B 3.5 04/30/28	2,800,000.000	2,736,671.860	
US T N/B 3.5 04/30/30	2,200,000.000	2,124,460.930	

US T N/B 3.5 09/30/26	3,000,000.000	2,958,867.180	
US T N/B 3.5 09/30/29	3,000,000.000	2,908,828.140	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,000,000.000	877,109.380	
US T N/B 3.625 02/15/53	3,950,000.000	3,397,154.270	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,000,000.000	2,945,859.360	
US T N/B 3.625 03/31/30	1,100,000.000	1,069,191.400	
US T N/B 3.625 05/15/26	2,800,000.000	2,772,875.000	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,880,000.000	3,339,149.220	
US T N/B 3.625 05/31/28	2,650,000.000	2,599,484.370	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,300,000.000	1,144,710.940	
US T N/B 3.625 08/31/29	3,000,000.000	2,927,343.750	
US T N/B 3.625 09/30/31	1,500,000.000	1,444,921.870	
US T N/B 3.75 04/15/26	650,000.000	645,023.430	
US T N/B 3.75 05/31/30	1,000,000.000	977,343.750	
US T N/B 3.75 06/30/30	2,500,000.000	2,442,138.670	
US T N/B 3.75 08/15/27	2,500,000.000	2,470,410.150	
US T N/B 3.75 08/31/26	3,000,000.000	2,972,988.270	
US T N/B 3.75 08/31/31	1,000,000.000	970,859.380	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,000,000.000	894,843.750	
US T N/B 3.75 12/31/28	3,700,000.000	3,634,960.950	
US T N/B 3.75 12/31/30	2,390,000.000	2,328,102.720	
US T N/B 3.875 01/15/26	1,600,000.000	1,591,812.490	
US T N/B 3.875 02/15/43	1,400,000.000	1,283,734.360	
US T N/B 3.875 05/15/43	1,900,000.000	1,738,240.230	
US T N/B 3.875 08/15/33	7,900,000.000	7,659,605.430	
US T N/B 3.875 08/15/34	3,000,000.000	2,898,984.360	
US T N/B 3.875 08/15/40	700,000.000	654,882.810	
US T N/B 3.875 09/30/29	1,000,000.000	985,371.090	
US T N/B 3.875 10/15/27	3,000,000.000	2,973,164.070	
US T N/B 3.875 11/30/27	2,900,000.000	2,872,529.280	
US T N/B 3.875 11/30/29	1,100,000.000	1,083,435.550	
US T N/B 3.875 12/31/27	2,800,000.000	2,773,148.440	
US T N/B 3.875 12/31/29	1,000,000.000	984,550.780	
US T N/B 4.0 01/15/27	4,630,000.000	4,607,392.580	
US T N/B 4.0 01/31/29	2,600,000.000	2,578,925.770	
US T N/B 4.0 01/31/31	1,500,000.000	1,480,781.250	
US T N/B 4.0 02/15/26	2,400,000.000	2,390,906.250	
US T N/B 4.0 02/15/34	5,200,000.000	5,081,984.380	
US T N/B 4.0 02/28/30	2,200,000.000	2,178,171.860	
US T N/B 4.0 02/29/28	1,600,000.000	1,589,968.750	
US T N/B 4.0 06/30/28	2,800,000.000	2,780,640.630	
US T N/B 4.0 07/31/29	3,210,000.000	3,183,229.110	
US T N/B 4.0 07/31/30	1,000,000.000	989,023.440	
US T N/B 4.0 10/31/29	1,400,000.000	1,386,984.360	
US T N/B 4.0 11/15/42	2,000,000.000	1,870,156.240	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,170,000.000	3,839,576.360	
US T N/B 4.0 12/15/25	1,900,000.000	1,892,949.210	
US T N/B 4.125 02/15/27	2,190,000.000	2,184,781.640	
US T N/B 4.125 03/31/29	3,000,000.000	2,989,980.480	

US T N/B 4.125 03/31/31	2,500,000.000	2,484,228.520	
US T N/B 4.125 06/15/26	1,700,000.000	1,695,517.570	
US T N/B 4.125 07/31/28	1,300,000.000	1,296,292.970	
US T N/B 4.125 07/31/31	3,000,000.000	2,979,023.430	
US T N/B 4.125 08/15/44	1,500,000.000	1,413,515.620	
US T N/B 4.125 08/15/53	1,950,000.000	1,836,389.640	
US T N/B 4.125 08/31/30	2,500,000.000	2,487,011.720	
US T N/B 4.125 09/30/27	1,380,000.000	1,377,520.300	
US T N/B 4.125 10/31/27	2,000,000.000	1,995,820.320	
US T N/B 4.125 11/15/32	6,200,000.000	6,145,386.740	
US T N/B 4.25 01/31/26	3,700,000.000	3,696,386.720	
US T N/B 4.25 02/15/54	3,400,000.000	3,276,683.590	
US T N/B 4.25 02/28/29	2,700,000.000	2,704,324.210	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,400,000.000	2,401,828.120	
US T N/B 4.25 03/15/27	2,000,000.000	2,001,406.240	
US T N/B 4.25 05/15/39	700,000.000	688,925.760	
US T N/B 4.25 06/30/29	3,100,000.000	3,106,175.780	
US T N/B 4.25 06/30/31	1,000,000.000	1,000,292.970	
US T N/B 4.25 08/15/54	1,600,000.000	1,543,500.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	800,000.000	782,171.870	
US T N/B 4.25 12/31/25	1,000,000.000	998,750.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	300,000.000	301,335.930	
US T N/B 4.375 05/15/34	7,100,000.000	7,141,601.590	
US T N/B 4.375 05/15/40	800,000.000	795,062.490	
US T N/B 4.375 05/15/41	500,000.000	495,351.560	
US T N/B 4.375 07/15/27	2,100,000.000	2,108,449.220	
US T N/B 4.375 07/31/26	3,500,000.000	3,504,990.230	
US T N/B 4.375 08/15/26	1,700,000.000	1,702,888.670	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,700,000.000	2,640,832.030	
US T N/B 4.375 08/31/28	2,500,000.000	2,513,378.900	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,194,117.190	
US T N/B 4.375 11/30/28	2,300,000.000	2,313,746.080	
US T N/B 4.375 11/30/30	2,700,000.000	2,721,304.670	
US T N/B 4.375 12/15/26	1,970,000.000	1,975,001.940	
US T N/B 4.5 02/15/36	430,000.000	440,901.160	
US T N/B 4.5 02/15/44	2,500,000.000	2,481,640.620	
US T N/B 4.5 03/31/26	3,000,000.000	3,007,265.640	
US T N/B 4.5 04/15/27	2,400,000.000	2,415,187.480	
US T N/B 4.5 05/15/27	2,000,000.000	2,013,281.240	
US T N/B 4.5 05/15/38	400,000.000	406,359.370	
US T N/B 4.5 05/31/29	3,000,000.000	3,037,675.760	
US T N/B 4.5 07/15/26	1,400,000.000	1,404,730.470	
US T N/B 4.5 08/15/39	530,000.000	535,010.150	
US T N/B 4.5 11/15/25	1,700,000.000	1,702,277.790	
US T N/B 4.5 11/15/33	4,600,000.000	4,669,269.510	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,000,000.000	1,021,875.000	
US T N/B 4.625 02/28/26	4,000,000.000	4,014,375.000	
US T N/B 4.625 03/15/26	2,032,000.000	2,039,620.000	
US T N/B 4.625 04/30/29	3,000,000.000	3,051,152.340	

	US T N/B 4.625 04/30/31	2,000,000.000	2,043,164.060	
	US T N/B 4.625 05/15/44	2,000,000.000	2,017,187.490	
	US T N/B 4.625 05/15/54	2,800,000.000	2,872,625.000	
	US T N/B 4.625 05/31/31	1,500,000.000	1,532,138.670	
	US T N/B 4.625 06/15/27	2,500,000.000	2,525,585.950	
	US T N/B 4.625 06/30/26	3,300,000.000	3,317,015.620	
	US T N/B 4.625 09/15/26	1,500,000.000	1,509,316.410	
	US T N/B 4.625 09/30/28	3,000,000.000	3,043,300.770	
	US T N/B 4.625 09/30/30	2,500,000.000	2,551,562.500	
	US T N/B 4.625 10/15/26	2,000,000.000	2,013,320.320	
	US T N/B 4.625 11/15/26	1,510,000.000	1,520,853.120	
	US T N/B 4.75 02/15/41	500,000.000	517,675.780	
	US T N/B 4.75 11/15/43	2,000,000.000	2,052,539.050	
	US T N/B 4.75 11/15/53	3,030,000.000	3,166,705.080	
	US T N/B 4.875 04/30/26	3,500,000.000	3,528,164.080	
	US T N/B 4.875 05/31/26	3,500,000.000	3,529,531.250	
	US T N/B 4.875 10/31/28	3,500,000.000	3,583,398.420	
	US T N/B 4.875 10/31/30	2,500,000.000	2,584,912.100	
	US T N/B 4.875 11/30/25	2,000,000.000	2,010,399.140	
	US T N/B 5.0 05/15/37	300,000.000	320,220.700	
	US T N/B 5.0 10/31/25	1,000,000.000	1,005,898.820	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,810,000.000	2,872,346.870	
	US T N/B 6.125 11/15/27	500,000.000	527,382.810	
アメリカ・ドル	小計	648,252,000.000 (99,273,311,280)	592,912,880.440 (90,798,678,513)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	300,000.000	286,383.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	980,000.000	864,335.500	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,850,000.000	1,426,276.000	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,350,000.000	1,254,739.950	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,000,000.000	803,028.490	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,350,000.000	1,160,568.000	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	970,000.000	276,450.000	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,050,000.000	711,165.000	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,350,000.000	520,270.890	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	610,000.000	291,684.070	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,480,000.000	1,109,023.200	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,250,000.000	1,070,456.870	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	1,750,000.000	1,397,042.500	

UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,600,000.000	1,023,091.200	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	420,000.000	145,398.120	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	910,000.000	842,141.300	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,030,000.000	477,920.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,030,000.000	615,791.310	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	840,000.000	802,187.400	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	850,000.000	460,378.700	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	890,000.000	430,208.200	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	700,000.000	636,615.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	400,000.000	198,192.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,350,000.000	582,255.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	780,000.000	437,526.960	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	800,000.000	400,880.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,150,000.000	839,975.640	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	870,000.000	517,941.530	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,650,000.000	1,321,815.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	1,650,000.000	1,523,676.410	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,000,000.000	824,767.080	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,000,000.000	769,358.000	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,300,000.000	1,191,905.000	
UK TREASURY 3.75 03/07/27	1,930,000.000	1,901,255.150	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	803,160.000	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,620,000.000	1,333,422.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,000,000.000	858,876.750	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	400,000.000	392,080.800	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	850,000.000	725,135.000	
UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,050,000.000	2,037,240.800	
UK TREASURY 4.125 07/22/29	1,250,000.000	1,239,750.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	800,000.000	782,327.200	

	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,020,000.000	1,018,134.370	
	UK TREASURY 4.25 07/31/34	750,000.000	738,975.220	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	877,493.240	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,000,000.000	1,000,310.400	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	800,000.000	756,006.400	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	960,000.000	877,315.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	250,000.000	226,787.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	620,000.000	558,047.430	
	UK TREASURY 4.375 07/31/54	700,000.000	642,511.800	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,480,000.000	1,486,797.640	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,207,718.400	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	770,000.000	741,656.680	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	1,630,000.000	1,654,898.250	
	UK TREASURY 4.75 10/22/43	1,300,000.000	1,284,393.500	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,400,000.000	1,438,699.640	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	610,000.000	617,146.150	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	500,000.000	533,650.500	
	イギリス・ボンド 小計	62,290,000.000 (12,317,847,500)	50,947,236.840 (10,074,816,085)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,100,000.000	1,045,451.000	
	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	1,650,000.000	1,593,480.900	
	ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	1,320,000.000	1,232,052.360	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	710,000.000	587,892.780	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,370,000.000	1,077,928.330	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,725,000.000	1,183,141.270	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	640,000.000	416,808.960	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,000,000.000	942,816.000	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,900,000.000	1,743,286.100	

	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,390,000.000	1,141,427.690	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27	1,000,000.000	976,772.000	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,075,000.000	1,134,204.550	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,080,000.000	1,114,133.400	
イスラエル・シュケル 小計		15,960,000.000 (651,653,184)	14,189,395.340 (579,358,687)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	600,000.000	576,534.000	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,420,000.000	1,330,241.800	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,440,000.000	1,146,628.800	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,330,000.000	1,096,239.200	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,730,000.000	1,379,675.000	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,190,000.000	996,470.300	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,010,000.000	527,078.600	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,300,000.000	1,062,555.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,200,000.000	1,128,144.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,140,000.000	1,043,316.600	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	730,000.000	556,778.300	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	800,000.000	676,472.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	720,000.000	693,000.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	400,000.000	380,032.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,220,000.000	1,141,346.600	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	660,000.000	484,261.800	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,100,000.000	975,678.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,650,000.000	1,590,781.500	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	430,000.000	361,999.800	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,180,000.000	1,078,154.200	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	700,000.000	639,835.000	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	800,000.000	750,880.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,280,000.000	1,282,764.800	
AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	300,000.000	292,977.000		
AUSTRALIAN 4.25 12/21/35	650,000.000	629,512.000		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,610,000.000	1,610,595.700		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	840,000.000	852,969.600		
AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	380,000.000	364,834.200		
オーストラリア・ドル 小計		27,810,000.000 (2,806,029,000)	24,649,755.800 (2,487,160,360)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	7,500,000.000	7,527,123.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 06/15/26	5,000,000.000	5,027,373.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.85 05/15/27	29,000,000.000	29,263,314.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.87 09/15/31	10,500,000.000	10,437,346.500	

CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29	25,000,000.000	25,188,852.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 03/15/26	35,000,000.000	35,268,618.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27	24,500,000.000	24,801,276.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	22,000,000.000	22,279,380.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34	15,000,000.000	15,014,295.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31	22,000,000.000	22,219,967.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	18,500,000.000	18,730,637.650	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34	20,000,000.000	20,273,546.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	23,000,000.000	23,431,109.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	4,500,000.000	4,540,668.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	42,500,000.000	43,030,820.750	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	13,000,000.000	13,256,742.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	13,000,000.000	13,332,660.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	5,000,000.000	5,093,703.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26	22,000,000.000	22,390,852.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	15,000,000.000	15,366,715.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	4,400,000.000	4,502,701.280	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 09/25/28	2,500,000.000	2,570,960.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	30,500,000.000	31,235,879.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	22,500,000.000	23,225,238.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	20,500,000.000	21,223,012.450	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	25,500,000.000	26,295,661.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	14,500,000.000	15,070,132.750	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	23,000,000.000	23,882,415.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	14,500,000.000	14,962,577.550	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	12,000,000.000	12,474,189.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	22,500,000.000	23,499,796.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	24,100,000.000	25,187,442.610	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	20,000,000.000	20,899,680.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	8,000,000.000	8,170,892.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	10,500,000.000	10,996,023.150	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	8,400,000.000	8,763,679.680	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	2,300,000.000	2,416,310.080	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	14,000,000.000	14,676,198.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	7,500,000.000	7,870,077.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	35,000,000.000	36,187,196.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	15,000,000.000	15,961,662.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	7,000,000.000	7,426,096.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	32,000,000.000	33,479,820.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	9,000,000.000	10,369,406.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	32,000,000.000	33,509,017.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	19,500,000.000	20,839,813.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	40,200,000.000	41,082,036.240	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	6,800,000.000	7,928,260.760	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	10,000,000.000	10,679,254.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	6,000,000.000	7,117,023.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	6,700,000.000	6,891,263.560	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	16,500,000.000	17,389,303.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	7,900,000.000	9,514,452.690	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	7,500,000.000	9,323,043.750	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.69 05/17/28	10,000,000.000	10,794,555.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	19,300,000.000	24,673,861.120	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	15,500,000.000	20,031,821.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	13,500,000.000	17,456,454.450	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	4,000,000.000	5,300,145.600	
	オフショア・人民元 小計	972,600,000.000 (20,689,049,940)	1,020,352,360.220 (21,704,833,371)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,550,000.000	1,493,660.070	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,570,000.000	1,348,676.180	
	CANADA 1.0 06/01/27	460,000.000	438,322.480	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,110,000.000	1,070,484.070	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,350,000.000	1,296,918.840	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,320,000.000	1,198,932.350	
	CANADA 1.5 06/01/26	300,000.000	293,048.780	
	CANADA 1.5 06/01/31	1,550,000.000	1,402,799.980	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,500,000.000	1,347,617.230	
	CANADA 1.75 12/01/53	1,450,000.000	1,055,691.180	
	CANADA 2.0 06/01/28	380,000.000	367,879.270	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,500,000.000	1,385,930.400	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,520,000.000	1,187,434.450	
	CANADA 2.25 06/01/29	260,000.000	252,671.840	
	CANADA 2.25 12/01/29	500,000.000	482,373.580	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,100,000.000	1,049,539.240	
	CANADA 2.75 06/01/33	700,000.000	678,832.730	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,100,000.000	1,092,048.580	
	CANADA 2.75 12/01/48	450,000.000	415,403.560	
	CANADA 2.75 12/01/55	1,500,000.000	1,369,067.720	
	CANADA 2.75 12/01/64	510,000.000	467,997.720	
	CANADA 3.0 04/01/26	650,000.000	648,794.740	
	CANADA 3.0 06/01/34	1,200,000.000	1,182,264.260	
	CANADA 3.25 09/01/28	350,000.000	353,179.270	
	CANADA 3.25 11/01/26	400,000.000	401,300.870	
	CANADA 3.25 12/01/33	1,180,000.000	1,187,184.920	
	CANADA 3.25 12/01/34	300,000.000	301,616.230	
	CANADA 3.5 03/01/28	900,000.000	914,199.460	
	CANADA 3.5 03/01/34	400,000.000	410,283.030	
	CANADA 3.5 09/01/29	1,600,000.000	1,634,410.530	
	CANADA 3.5 12/01/45	440,000.000	459,706.670	
	CANADA 4.0 03/01/29	1,470,000.000	1,528,809.550	
	CANADA 4.0 05/01/26	1,020,000.000	1,032,419.890	
	CANADA 4.0 06/01/41	400,000.000	441,071.300	
	CANADA 4.0 08/01/26	1,300,000.000	1,318,822.250	
	CANADA 4.5 02/01/26	800,000.000	812,621.970	
	CANADA 5.0 06/01/37	700,000.000	828,245.740	

	CANADA 5.75 06/01/29	550,000.000	615,229.940	
	CANADA 5.75 06/01/33	650,000.000	773,601.810	
カナダ・ドル 小計		35,990,000.000 (3,961,419,300)	34,539,092.680 (3,801,717,931)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	140,000.000	137,032.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	350,000.000	339,941.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	140,000.000	130,060.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	310,000.000	259,780.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	280,000.000	232,820.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	510,000.000	505,716.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	420,000.000	395,640.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	240,000.000	225,464.400	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	180,000.000	179,550.000	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	350,000.000	345,100.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	360,000.000	355,127.400	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	360,000.000	354,083.580	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	440,000.000	442,420.000	
	SINGAPORE 2.875 08/01/28	300,000.000	301,800.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	200,860.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	500,000.000	503,250.000	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	200,000.000	202,300.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	427,000.000	451,552.500	
	SINGAPORE 3.375 05/01/34	200,000.000	208,873.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	300,000.000	312,750.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	720,000.000	732,096.000		
シンガポール・ドル 小計		6,927,000.000 (799,237,260)	6,816,215.880 (786,454,988)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,200,000.000	3,710,196.000	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,930,000.000	3,777,064.050	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,090,000.000	1,968,612.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,100,000.000	4,032,309.000	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	4,320,000.000	4,187,332.800	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	800,000.000	808,441.840	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	2,620,000.000	2,988,463.700	
スウェーデン・クローナ 小計		22,060,000.000 (312,149,000)	21,472,420.190 (303,834,746)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	4,310,000.000	3,756,197.450	
	DENMARK 0.25 11/15/52	3,460,000.000	2,002,754.380	
	DENMARK 0.5 11/15/27	2,830,000.000	2,720,917.520	
	DENMARK 0.5 11/15/29	2,640,000.000	2,463,198.040	
	DENMARK 1.75 11/15/25	4,250,000.000	4,240,789.590	
	DENMARK 2.25 11/15/26	500,000.000	504,111.250	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,750,000.000	1,770,777.750	
	DENMARK 4.5 11/15/39	5,130,000.000	6,540,697.150	
デンマーク・クローネ 小計		24,870,000.000 (547,140,000)	23,999,443.130 (527,987,749)	

ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	840,000.000	738,705.410	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	570,000.000	541,431.650	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	830,000.000	696,619.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	360,000.000	229,518.960	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	740,000.000	626,229.040	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	630,000.000	509,548.560	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	250,000.000	164,373.650	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	300,000.000	286,962.540	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	470,000.000	437,064.850	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	350,000.000	341,219.240	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	350,000.000	354,735.850	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	340,000.000	344,801.100	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	280,000.000	276,303.000	
	NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	220,000.000	215,041.620	
ニュージーランド・ドル 小計		6,530,000.000 (596,580,800)	5,762,554.470 (526,466,976)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	620,000.000	526,867.940	
	NORWAY 1.375 08/19/30	2,910,000.000	2,552,393.010	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,250,000.000	4,116,576.560	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,350,000.000	1,288,799.430	
	NORWAY 1.75 09/06/29	1,020,000.000	930,660.750	
	NORWAY 2.0 04/26/28	3,660,000.000	3,451,746.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,850,000.000	2,544,574.050	
	NORWAY 3.0 08/15/33	1,490,000.000	1,401,471.650	
	NORWAY 3.5 10/06/42	1,660,000.000	1,605,161.900	
NORWAY 3.625 04/13/34	3,390,000.000	3,333,556.500		
ノルウェー・クローネ 小計		23,200,000.000 (322,712,000)	21,751,807.790 (302,567,646)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,480,000.000	1,354,787.560	
	POLAND 04/25/26	400,000.000	374,700.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	1,670,000.000	1,322,465.480	
	POLAND 1.75 04/25/32	900,000.000	695,581.650	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,190,000.000	2,105,614.920	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,350,000.000	2,206,645.300	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,310,000.000	1,213,934.420	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,000,000.000	3,563,620.000	
	POLAND 3.75 05/25/27	1,370,000.000	1,331,386.890	
	POLAND 4.75 07/25/29	2,200,000.000	2,145,487.300	
	POLAND 5.0 10/25/34	780,000.000	740,787.840	
	POLAND 5.75 04/25/29	2,700,000.000	2,746,687.590	
	POLAND 6.0 10/25/33	3,660,000.000	3,753,511.890	
POLAND 7.5 07/25/28	1,800,000.000	1,937,877.300		

ポーランド・ズロチ 小計		26,810,000.000 (1,016,015,889)	25,493,088.140 (966,109,012)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,400,000.000	1,305,428.690	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,400,000.000	1,400,213.920	
	MALAYSIA 3.519 04/20/28	700,000.000	698,972.770	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	900,000.000	882,405.480	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	1,100,000.000	1,105,970.580	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,446,268.950	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,100,000.000	1,094,732.900	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	710,000.000	706,713.450	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,230,000.000	1,244,481.770	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	370,000.000	373,470.710	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,300,000.000	1,314,341.990	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	790,000.000	797,265.940	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	770,000.000	776,032.020	
	MALAYSIA 4.054 04/18/39	700,000.000	702,191.980	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	850,000.000	830,466.770	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	800,000.000	818,619.920	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,050,000.000	1,076,456.430	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	500,000.000	507,110.000	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,400,000.000	1,455,725.170	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,100,000.000	1,142,996.360	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	520,000.000	539,097.670	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,220,000.000	1,288,775.420	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	900,000.000	965,379.690	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	200,000.000	215,524.140		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,288,350.360		
MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,130,000.000	1,231,255.450		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,180,000.000	1,306,610.340		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	750,000.000	827,970.450		
マレーシア・リングgit 小計		26,770,000.000 (932,516,888)	27,342,829.320 (952,471,054)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	9,000,000.000	8,596,620.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	20,700,000.000	18,884,874.330	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	2,000,000.000	1,758,480.000	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	15,780,000.000	13,674,159.000	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	16,190,000.000	13,064,929.120	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	13,000,000.000	12,379,380.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	3,200,000.000	3,232,709.630	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	24,150,000.000	22,893,610.740	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	11,730,000.000	11,150,612.720	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	20,190,000.000	18,319,023.380	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	18,870,000.000	15,220,777.490	

	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,891,000.000	6,854,458.750	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	13,596,000.000	11,090,073.380	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	18,701,000.000	17,864,153.620	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	10,300,000.000	9,198,396.970	
	メキシコ・ペソ 小計	205,298,000.000 (1,562,338,310)	184,182,259.130 (1,401,645,410)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	750,000.000	656,791.870	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	480,000.000	407,853.600	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	450,000.000	409,647.930	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	120,000.000	74,652.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	600,000.000	437,340.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,000,000.000	922,076.030	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	700,000.000	670,425.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	950,000.000	901,801.270	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	620,000.000	364,229.070	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	770,000.000	747,835.560	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	350,000.000	154,486.500	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	640,000.000	564,961.600	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	290,000.000	218,314.530	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	90,390.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	500,000.000	398,671.250	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	170,000.000	169,090.670	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	297,489.270	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	410,000.000	396,074.960	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	800,000.000	808,209.360	
	AUSTRIA 2.9 02/20/34	580,000.000	583,596.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	620,000.000	627,115.120	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	120,000.000	120,297.620	
	AUSTRIA 3.45 10/20/30	400,000.000	418,600.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	280,000.000	322,522.530	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	800,000.000	898,337.990	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	850,000.000	877,262.900	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	280,000.000	308,310.100	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	750,000.000	699,438.750	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	600,000.000	497,598.660	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	950,000.000	827,117.500	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	500,000.000	416,550.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	480,000.000	313,672.200	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	120,000.000	49,871.940	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	470,000.000	451,586.570	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	650,000.000	611,390.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,150,000.000	1,068,738.120	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	800,000.000	783,152.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	800,000.000	718,906.400	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	300,000.000	265,779.000	

BELGIUM 1.4 06/22/53	470,000.000	295,154.360	
BELGIUM 1.45 06/22/37	500,000.000	414,325.870	
BELGIUM 1.6 06/22/47	400,000.000	287,961.700	
BELGIUM 1.7 06/22/50	580,000.000	409,617.890	
BELGIUM 1.9 06/22/38	300,000.000	258,552.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	530,000.000	381,918.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	450,000.000	341,179.420	
BELGIUM 2.7 10/22/29	600,000.000	603,632.400	
BELGIUM 2.75 04/22/39	400,000.000	380,256.600	
BELGIUM 2.85 10/22/34	400,000.000	396,337.600	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,300,000.000	1,314,556.750	
BELGIUM 3.0 06/22/34	640,000.000	644,800.960	
BELGIUM 3.3 06/22/54	440,000.000	422,545.200	
BELGIUM 3.45 06/22/43	500,000.000	507,595.750	
BELGIUM 3.5 06/22/55	420,000.000	416,692.080	
BELGIUM 3.75 06/22/45	600,000.000	633,579.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	650,000.000	702,128.630	
BELGIUM 4.25 03/28/41	750,000.000	842,130.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	660,000.000	678,747.100	
BELGIUM 5.0 03/28/35	930,000.000	1,093,683.900	
BELGIUM 5.5 03/28/28	760,000.000	833,892.900	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,180,000.000	1,144,246.000	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,490,000.000	1,416,451.730	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	700,000.000	672,245.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,960,000.000	1,916,586.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	700,000.000	684,600.000	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,200,000.000	1,195,500.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,040,000.000	1,042,371.200	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	1,350,000.000	1,362,231.000	
BUNDESOBL 2.5 10/11/29	800,000.000	810,544.000	
BUNDESSCHAT 2.5 03/19/26	1,200,000.000	1,203,420.000	
BUNDESSCHAT 2.7 09/17/26	700,000.000	705,985.000	
BUNDESSCHAT 2.9 06/18/26	1,000,000.000	1,009,900.000	
BUNDESSCHAT 3.1 12/12/25	800,000.000	806,120.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,200,000.000	1,073,220.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,400,000.000	1,224,384.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,380,000.000	1,177,225.560	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,270,000.000	985,723.200	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,100,000.000	828,971.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,350,000.000	1,194,520.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	820,000.000	724,224.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,500,000.000	1,295,790.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,200,000.000	1,037,995.830	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,070,000.000	558,953.820	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	760,000.000	395,215.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	660,000.000	325,861.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	900,000.000	844,929.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,950,000.000	1,795,860.300	

DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,350,000.000	1,295,932.500	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,350,000.000	1,250,775.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,450,000.000	1,355,170.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,300,000.000	1,272,180.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,510,000.000	1,435,843.900	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,570,000.000	1,505,556.990	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,550,000.000	1,493,123.520	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,350,000.000	1,222,571.470	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,050,000.000	864,591.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,170,000.000	1,663,370.100	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	900,000.000	865,287.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	2,120,000.000	1,778,552.800	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	550,000.000	461,582.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	700,000.000	696,325.000	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	1,600,000.000	1,580,912.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,960,000.000	1,961,274.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	800,000.000	800,064.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	1,700,000.000	1,715,453.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,450,000.000	1,423,856.500	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,330,000.000	1,310,400.110	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	1,200,000.000	1,172,592.000	
DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	400,000.000	398,884.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,310,000.000	1,339,121.300	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34	1,300,000.000	1,325,779.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,300,000.000	1,416,038.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,550,000.000	1,793,582.500	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	890,000.000	1,069,254.900	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	800,000.000	871,312.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,580,000.000	1,899,381.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	920,000.000	1,173,064.400	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	690,000.000	816,504.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	800,000.000	883,040.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	500,000.000	595,830.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	820,000.000	910,856.000	
FINLAND 0.0 09/15/26	150,000.000	143,760.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	280,000.000	241,216.360	
FINLAND 0.125 04/15/36	260,000.000	189,550.140	
FINLAND 0.125 04/15/52	150,000.000	70,777.800	

FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	253,178.400	
FINLAND 0.25 09/15/40	200,000.000	130,691.050	
FINLAND 0.5 04/15/26	500,000.000	487,234.500	
FINLAND 0.5 04/15/43	190,000.000	121,972.400	
FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	475,674.500	
FINLAND 0.5 09/15/28	520,000.000	483,735.200	
FINLAND 0.5 09/15/29	500,000.000	454,525.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	300,000.000	267,038.400	
FINLAND 1.125 04/15/34	400,000.000	344,297.000	
FINLAND 1.375 04/15/47	310,000.000	227,126.920	
FINLAND 1.5 09/15/32	200,000.000	182,780.860	
FINLAND 2.5 04/15/30	100,000.000	99,670.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	370,000.000	348,793.080	
FINLAND 2.75 04/15/38	260,000.000	252,731.180	
FINLAND 2.75 07/04/28	400,000.000	405,392.200	
FINLAND 2.95 04/15/55	250,000.000	239,700.000	
FINLAND 3.0 09/15/33	170,000.000	172,767.090	
FINLAND 3.0 09/15/34	200,000.000	202,607.260	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,900,000.000	2,814,149.850	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,350,000.000	2,224,972.140	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,150,000.000	1,732,685.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,000,000.000	1,749,257.010	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,880,000.000	2,442,808.800	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	2,600,000.000	2,133,628.240	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	1,830,000.000	1,752,867.800	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,030,000.000	2,946,538.650	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,980,000.000	2,708,156.950	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,810,000.000	1,190,303.060	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	280,000.000	101,218.600	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,220,000.000	719,438.570	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	2,330,000.000	2,199,838.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,200,000.000	3,006,016.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,000,000.000	1,037,688.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,950,000.000	986,173.500	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,740,000.000	2,546,850.550	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,920,000.000	1,852,786.130	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	800,000.000	788,135.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,200,000.000	1,873,216.400	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,190,000.000	1,783,536.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,350,000.000	1,048,140.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,070,000.000	2,834,177.950	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,870,000.000	1,240,354.170	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	350,000.000	219,212.700	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,410,000.000	1,161,658.810	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,900,000.000	1,449,504.300	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,300,000.000	2,144,865.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,130,000.000	3,093,965.200	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,300,000.000	1,133,921.750	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	2,500,000.000	2,504,368.750	

FRANCE OAT 2.5 09/24/27	1,200,000.000	1,200,013.200	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,050,000.000	3,060,394.700	
FRANCE OAT 2.75 02/25/30	1,300,000.000	1,300,048.750	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,190,000.000	3,213,151.420	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	2,150,000.000	2,149,880.670	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	850,000.000	758,078.450	
FRANCE OAT 3.0 06/25/49	500,000.000	460,115.750	
FRANCE OAT 3.0 11/25/34	1,100,000.000	1,089,078.100	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,500,000.000	1,457,895.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/55	1,050,000.000	978,374.510	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,320,000.000	2,356,736.040	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	2,300,000.000	2,382,734.910	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	850,000.000	911,765.840	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,470,000.000	1,586,403.420	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,200,000.000	1,295,368.800	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	1,410,000.000	1,609,751.880	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,980,000.000	2,264,660.640	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	1,990,000.000	2,223,050.890	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,110,000.000	2,527,727.250	
IRISH 0.0 10/18/31	430,000.000	362,167.760	
IRISH 0.2 05/15/27	650,000.000	618,395.700	
IRISH 0.2 10/18/30	400,000.000	351,585.940	
IRISH 0.35 10/18/32	230,000.000	194,326.650	
IRISH 0.4 05/15/35	280,000.000	220,961.220	
IRISH 0.55 04/22/41	260,000.000	181,407.850	
IRISH 0.9 05/15/28	650,000.000	620,814.800	
IRISH 1.0 05/15/26	340,000.000	333,646.760	
IRISH 1.1 05/15/29	300,000.000	283,885.270	
IRISH 1.5 05/15/50	395,000.000	298,754.390	
IRISH 1.7 05/15/37	350,000.000	308,657.120	
IRISH 2.0 02/18/45	580,000.000	500,785.920	
IRISH 2.4 05/15/30	780,000.000	779,678.640	
IRISH 2.6 10/18/34	250,000.000	248,658.250	
IRISH 3.0 10/18/43	300,000.000	304,910.540	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,450,000.000	1,399,250.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	700,000.000	669,970.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,230,000.000	1,132,092.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	900,000.000	812,970.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,500,000.000	1,461,192.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	500,000.000	460,250.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	900,000.000	759,006.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	700,000.000	674,170.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	850,000.000	738,439.280	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,100,000.000	801,570.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,350,000.000	1,139,940.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,300,000.000	1,153,880.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,600,000.000	1,524,480.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,400,000.000	1,199,215.850	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	850,000.000	820,165.000	

ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,860,000.000	1,810,896.000	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	900,000.000	825,169.540	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,030,000.000	820,498.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	240,000.000	157,656.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	800,000.000	788,080.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,300,000.000	1,165,450.000	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,050,000.000	963,413.060	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	300,000.000	188,020.500	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	500,000.000	371,200.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,650,000.000	1,613,970.600	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	500,000.000	496,785.360	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	600,000.000	590,412.000	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	750,000.000	744,067.500	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	150,000.000	93,930.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	300,000.000	204,720.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	800,000.000	792,000.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	600,000.000	518,280.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	800,000.000	742,250.800	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,190,000.000	882,861.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	400,000.000	399,562.980	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	800,000.000	752,800.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	800,000.000	798,640.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	630,000.000	506,772.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	750,000.000	566,475.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.000	993,700.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.000	999,801.950	
ITALY BTPS 2.95 02/15/27	1,050,000.000	1,055,565.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	480,000.000	432,048.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	900,000.000	902,808.540	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,000,000.000	905,762.250	
ITALY BTPS 3.1 08/28/26	200,000.000	201,400.000	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	1,030,000.000	967,479.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,200,000.000	1,062,509.100	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	800,000.000	784,930.000	
ITALY BTPS 3.35 07/01/29	700,000.000	710,640.000	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,250,000.000	1,274,875.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	710,000.000	643,607.190	
ITALY BTPS 3.45 07/15/27	1,100,000.000	1,120,790.000	
ITALY BTPS 3.45 07/15/31	1,200,000.000	1,214,280.000	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	700,000.000	706,300.000	
ITALY BTPS 3.5 02/15/31	1,200,000.000	1,219,320.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	940,000.000	963,777.110	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,110,000.000	1,142,412.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,523,491.500	
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	900,000.000	929,340.000	
ITALY BTPS 3.85 02/01/35	400,000.000	407,680.000	
ITALY BTPS 3.85 07/01/34	1,300,000.000	1,331,070.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,350,000.000	1,297,108.680	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	820,000.000	837,548.000	

ITALY BTPS 3.85 12/15/29	800,000.000	830,880.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,850,000.000	1,910,680.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,000,000.000	1,038,800.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	350,000.000	367,150.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	1,044,000.000	
ITALY BTPS 4.05 10/30/37	650,000.000	668,525.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	800,000.000	837,040.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	300,000.000	307,230.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	600,000.000	632,160.000	
ITALY BTPS 4.3 10/01/54	550,000.000	554,149.480	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	930,000.000	992,961.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,440,000.000	1,545,696.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	900,000.000	944,640.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,500,000.000	1,534,650.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	950,000.000	998,830.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,100,000.000	1,176,252.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	900,000.000	985,554.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,930,000.000	2,159,284.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	860,000.000	963,716.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,040,000.000	1,165,216.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,290,000.000	1,427,772.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,020,000.000	1,190,034.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,370,000.000	1,596,872.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,370,000.000	1,517,686.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	500,000.000	544,500.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	500,000.000	487,006.120	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	640,000.000	610,705.600	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	700,000.000	636,519.800	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	900,000.000	627,403.500	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,420,000.000	690,840.640	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	600,000.000	524,739.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	680,000.000	579,313.620	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	700,000.000	636,262.900	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	970,000.000	699,895.490	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	850,000.000	826,285.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	700,000.000	604,023.610	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,100,000.000	1,058,612.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,010,000.000	956,560.900	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	390,000.000	331,752.130	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	800,000.000	804,852.320	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	820,000.000	818,533.020	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	400,000.000	397,927.600	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	500,000.000	494,750.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,010,000.000	1,008,170.890	

NETHERLANDS 3.25 01/15/44	470,000.000	502,902.580	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	750,000.000	848,081.250	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	750,000.000	840,075.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	720,000.000	790,560.000	
PORTUGUESE 0.3 10/17/31	600,000.000	516,061.540	
PORTUGUESE 0.475 10/18/30	750,000.000	669,731.250	
PORTUGUESE 0.7 10/15/27	600,000.000	575,173.200	
PORTUGUESE 1.0 04/12/52	400,000.000	234,035.700	
PORTUGUESE 1.15 04/11/42	300,000.000	216,824.110	
PORTUGUESE 1.65 07/16/32	900,000.000	839,385.000	
PORTUGUESE 1.95 06/15/29	600,000.000	588,390.000	
PORTUGUESE 2.125 10/17/28	800,000.000	795,860.800	
PORTUGUESE 2.25 04/18/34	500,000.000	477,540.000	
PORTUGUESE 3.5 06/18/38	400,000.000	416,025.800	
PORTUGUESE 4.1 02/15/45	300,000.000	332,580.000	
PORTUGUESE 4.1 04/15/37	600,000.000	665,340.000	
PORTUGUESE 4.125 04/14/27	700,000.000	732,510.310	
SPAIN 0.0 01/31/26	400,000.000	388,134.930	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,300,000.000	1,231,620.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,950,000.000	1,796,047.500	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,690,000.000	1,423,994.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	800,000.000	712,286.000	
SPAIN 0.5 10/31/31	800,000.000	684,612.800	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,080,000.000	977,694.570	
SPAIN 0.7 04/30/32	650,000.000	557,163.750	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,800,000.000	1,718,190.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,100,000.000	1,007,215.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	760,000.000	567,309.220	
SPAIN 1.0 07/30/42	400,000.000	268,920.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,030,000.000	580,007.420	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,150,000.000	832,035.920	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,700,000.000	1,556,520.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,690,000.000	1,654,778.710	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,050,000.000	1,011,530.100	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,000,000.000	958,300.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,230,000.000	1,170,768.120	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,800,000.000	1,747,310.400	
SPAIN 1.45 10/31/71	250,000.000	125,933.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,440,000.000	1,407,456.000	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,100,000.000	972,131.860	
SPAIN 1.9 10/31/52	880,000.000	608,024.340	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,140,000.000	1,132,731.930	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,060,000.000	1,018,256.510	
SPAIN 2.15 10/31/25	550,000.000	548,183.850	

	SPAIN 2.35 07/30/33	1,610,000.000	1,532,237.000	
	SPAIN 2.5 05/31/27	1,100,000.000	1,099,670.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	900,000.000	877,602.150	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,200,000.000	1,024,026.890	
	SPAIN 2.8 05/31/26	1,100,000.000	1,105,060.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,070,000.000	958,714.110	
	SPAIN 3.1 07/30/31	500,000.000	508,605.150	
	SPAIN 3.15 04/30/33	1,800,000.000	1,825,609.500	
	SPAIN 3.25 04/30/34	1,650,000.000	1,675,659.480	
	SPAIN 3.45 07/30/43	1,100,000.000	1,079,273.250	
	SPAIN 3.45 07/30/66	890,000.000	826,708.980	
	SPAIN 3.45 10/31/34	900,000.000	926,586.000	
	SPAIN 3.5 05/31/29	1,000,000.000	1,036,440.000	
	SPAIN 3.55 10/31/33	720,000.000	749,592.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	1,100,000.000	1,159,334.000	
	SPAIN 4.0 10/31/54	300,000.000	312,517.650	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,180,000.000	1,292,666.990	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,000,000.000	1,152,680.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	880,000.000	1,030,216.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,300,000.000	1,422,395.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	600,000.000	734,153.400	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,200,000.000	1,437,307.440	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,650,000.000	1,745,242.450	
	SPAIN 6.0 01/31/29	800,000.000	908,790.000	
	ユーロ 小計	379,235,000.000 (62,209,709,400)	358,126,621.980 (58,747,091,070)	
国債証券 合計		207,997,709,750.800 (207,997,709,751)	193,961,193,598 (193,961,193,598)	
合計			193,961,193,598 (193,961,193,598)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 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 276銘柄	46.31	46.81
イギリス・ポンド	国債証券 59銘柄	5.14	5.19
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	0.30	0.30
オーストラリア・ドル	国債証券 28銘柄	1.27	1.28
オフショア・人民元	国債証券 59銘柄	11.07	11.19
カナダ・ドル	国債証券 39銘柄	1.94	1.96
シンガポール・ドル	国債証券 21銘柄	0.40	0.41
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.15	0.16
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.27	0.27
ニュージーランド・ドル	国債証券 14銘柄	0.27	0.27
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.15	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.49	0.50

マレーシア・リングgit	国債証券	28銘柄	0.49	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.71	0.72
ユーロ	国債証券	384銘柄	29.96	30.29

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

（単位：円）

2024年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	14,612,733,613
コール・ローン	969,401,759
株式	1,708,887,568,979
投資信託受益証券	2,616,682,988
投資証券	30,614,454,671
派生商品評価勘定	693,452,222
未収入金	50,465,298
未収配当金	1,034,664,414
差入委託証拠金	14,255,621,324
流動資産合計	1,773,735,045,268
資産合計	
1,773,735,045,268	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	97,867,854
未払金	47,927,519,061
未払解約金	220,426,000
流動負債合計	48,245,812,915
負債合計	
48,245,812,915	
純資産の部	
元本等	
元本	171,602,700,587
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,553,886,531,766
元本等合計	1,725,489,232,353
純資産合計	
1,725,489,232,353	
負債純資産合計	
1,773,735,045,268	

## 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11月14日 至 2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	158,641,305,618円
同期中追加設定元本額	44,202,127,377円
同期中一部解約元本額	31,240,732,408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	3,892,691,924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	70,338,990,912円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,910,182,017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)	39,888,455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)	239,585,482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)	240,382円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	13,746,199円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,113,352円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	15,470,267円
たわらノーロード 全世界株式	6,628,444,760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>	58,356,118,682円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3,719,115,102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	666,257,190円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	973,809,237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)	132,514,718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)	295,833,410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>	189,378,627円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	339,140,606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>	114,175,826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)	12,529,719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)	21,254,229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)	444,219,519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)	1,443,907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)	71,851,212円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	152,852,612円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	544,353,552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)	3,869,724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)	44,763,143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>	2,707,380,629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>	965,437,931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	171,602,700,587円
2. 受益権の総数	171,602,700,587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11月14日 至 2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	229,528,771,556	
投資信託受益証券	271,470,195	
投資証券	3,476,742,741	
合計	233,276,984,492	

（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11月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2024年11月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	43,862,715,046	-	43,862,521,407	193,639
アメリカ・ドル	34,491,755,054	-	34,492,275,122	520,068
イギリス・ポンド	1,603,311,412	-	1,603,343,916	32,504
オーストラリア・ドル	783,420,360	-	783,198,977	221,383
カナダ・ドル	1,444,300,368	-	1,444,304,257	3,889

シンガポール・ドル	80,750,250	-	80,759,000	8,750
スイス・フラン	1,170,731,200	-	1,170,863,190	131,990
スウェーデン・クローナ	396,236,400	-	396,172,000	64,400
デンマーク・クローネ	307,970,600	-	307,976,200	5,600
ニュージーランド・ドル	59,378,800	-	59,377,045	1,755
ユーロ	3,318,071,502	-	3,317,425,850	645,652
香港・ドル	206,789,100	-	206,825,850	36,750
合計	43,862,715,046	-	43,862,521,407	193,639

## (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11日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	26,135,376,227	-	26,731,154,234	595,778,007
合計	26,135,376,227	-	26,731,154,234	595,778,007

## (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。

## (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11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	10.0551円 (100,551円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

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	1,581,425	208.180	329,221,056.500	
	ABBOTT LABORATORIES	294,539	116.590	34,340,302.010	
	AES CORP	109,122	13.600	1,484,059.200	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	155,051	213.720	33,137,499.720	
	ADVANCED MICRO DEVICES	273,710	147.950	40,495,394.500	
	ADOBE INC	75,061	494.680	37,131,175.480	
	CHUBB LTD	64,673	281.360	18,196,395.280	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	37,905	312.990	11,863,885.950	
	ALLSTATE CORP	43,830	196.900	8,630,127.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	109,936	219.490	24,129,852.640	
	AMGEN INC	90,672	325.280	29,493,788.160	
	HESS CORP	47,477	142.180	6,750,279.860	
	AMERICAN EXPRESS CO	97,349	287.600	27,997,572.400	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	86,607	96.400	8,348,914.800	
	AFLAC INC	89,636	108.270	9,704,889.720	
	AMERICAN INTL GROUP	108,150	75.580	8,173,977.000	
	ANALOG DEVICES	83,181	225.800	18,782,269.800	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	114,610	84.620	9,698,298.200	
	VALERO ENERGY CORP	56,511	136.690	7,724,488.590	
	ANSYS INC	14,299	342.180	4,892,831.820	
	APPLE INC	2,459,350	226.960	558,174,076.000	
	APPLIED MATERIALS INC	141,091	192.030	27,093,704.730	
	ALBEMARLE CORP	18,991	100.840	1,915,052.440	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	52.130	4,248,803.520	
	AMEREN CORP	44,814	90.190	4,041,774.660	
	AUTODESK INC	36,571	305.560	11,174,634.760	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	69,110	304.730	21,059,890.300	
	AUTOZONE INC	2,840	3,110.120	8,832,740.800	
	AVERY DENNISON CORP	13,185	205.110	2,704,375.350	
	BALL CORP	51,188	60.260	3,084,588.880	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	223,286	463.410	103,472,965.260	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	123,730	77.060	9,534,633.800	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	80,219	34.640	2,778,786.160	
	BECTON DICKINSON & CO	47,568	231.640	11,018,651.520	
AMETEK INC	39,830	190.920	7,604,343.600		
VERIZON COMM INC	712,006	40.480	28,822,002.880		
WR BERKLEY CORP	55,630	60.550	3,368,396.500		
BEST BUY CO INC	35,626	89.200	3,177,839.200		

BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	369.250	1,115,504.250	
YUM! BRANDS INC	48,345	137.210	6,633,417.450	
FIRSTENERGY CORP	96,001	41.540	3,987,881.540	
BOEING CO	124,217	151.680	18,841,234.560	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	248,327	88.250	21,914,857.750	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	21,827	108.560	2,369,539.120	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	29,288	177.900	5,210,335.200	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,710	1,310.030	4,860,211.300	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	338,213	54.140	18,310,851.820	
ONEOK INC	94,258	107.160	10,100,687.280	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,940	138.770	1,795,683.800	
UNITED RENTALS INC	11,385	875.010	9,961,988.850	
SEMPRA	107,707	91.250	9,828,263.750	
FEDEX CORP	39,466	286.280	11,298,326.480	
VERISIGN INC	14,698	183.560	2,697,964.880	
AMPHENOL CORP	205,492	73.870	15,179,694.040	
BROWN-FORMAN CORP	37,107	40.770	1,512,852.390	
QUANTA SERVICES INC	25,373	330.980	8,397,955.540	
CSX CORP	330,543	36.000	11,899,548.000	
COTERRA ENERGY INC	134,560	24.580	3,307,484.800	
CAMPBELL SOUP CO	38,172	45.590	1,740,261.480	
CONSTELLATION BRANDS INC	28,149	234.380	6,597,562.620	
CARDINAL HEALTH INC	42,364	120.560	5,107,403.840	
CARLISLE COS INC	8,519	450.850	3,840,791.150	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	168,166	24.070	4,047,755.620	
CATERPILLAR INC	82,724	393.370	32,541,139.880	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	16,645	176.030	2,930,019.350	
JPMORGAN CHASE & CO	484,710	236.980	114,866,575.800	
CHURCH & DWIGHT CO INC	43,274	106.450	4,606,517.300	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	25,734	148.690	3,826,388.460	
CINTAS CORP	61,973	225.720	13,988,545.560	
CISCO SYSTEMS INC	679,008	58.060	39,423,204.480	
CLOROX COMPANY	21,216	165.160	3,504,034.560	
COCA-COLA CO/THE	687,778	63.920	43,962,769.760	
COPART INC	142,034	56.120	7,970,948.080	
COLGATE-PALMOLIVE CO	132,059	92.570	12,224,701.630	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	40,263	280.800	11,305,850.400	
MOLINA HEALTHCARE INC	9,939	329.650	3,276,391.350	
NRG ENERGY, INC.	34,874	96.140	3,352,786.360	
COMCAST CORP-CL A	663,486	43.910	29,133,670.260	

CONAGRA BRANDS INC	73,639	28.440	2,094,293.160	
CONSOLIDATED EDISON INC	60,171	98.130	5,904,580.230	
CMS ENERGY CORP	49,050	67.250	3,298,612.500	
COOPER COS INC	31,884	103.750	3,307,965.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	59.560	1,812,768.160	
CORNING INC	136,980	48.720	6,673,665.600	
HEICO CORP-CL A	14,337	202.690	2,905,966.530	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	10,995	283.480	3,116,862.600	
CUMMINS INC	23,003	356.460	8,199,649.380	
DR HORTON INC	49,181	168.790	8,301,260.990	
DANAHER CORP	112,892	245.390	27,702,567.880	
MOODY'S CORP	27,822	477.180	13,276,101.960	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	82,266	80.310	6,606,782.460	
TARGET CORP	77,092	149.780	11,546,839.760	
DEERE & CO	44,349	394.060	17,476,166.940	
MORGAN STANLEY	206,445	129.530	26,740,820.850	
REPUBLIC SERVICES INC	35,619	211.590	7,536,624.210	
COSTAR GROUP INC	66,181	77.390	5,121,747.590	
DECKERS OUTDOOR CORP	25,044	175.610	4,397,976.840	
THE WALT DISNEY CO	308,867	99.020	30,584,010.340	
DOLLAR TREE INC	35,355	61.410	2,171,150.550	
DOVER CORP	24,373	201.500	4,911,159.500	
OMNICOM GROUP	30,586	104.460	3,195,013.560	
DTE ENERGY CO	33,700	117.800	3,969,860.000	
DUKE ENERGY CORP	130,605	113.230	14,788,404.150	
DARDEN RESTAURANTS INC	20,935	168.440	3,526,291.400	
EBAY INC	84,227	61.890	5,212,809.030	
BANK OF AMERICA CORP	1,189,453	45.130	53,680,013.890	
CITIGROUP INC	323,405	68.630	22,195,285.150	
EASTMAN CHEMICAL CO	21,268	101.470	2,158,063.960	
EATON CORP PLC	67,762	366.670	24,846,292.540	
CADENCE DESIGN SYS INC	45,352	301.250	13,662,290.000	
ECOLAB INC	43,435	250.040	10,860,487.400	
REVVITY INC	21,035	122.470	2,576,156.450	
ELECTRONIC ARTS INC	41,850	157.910	6,608,533.500	
SALESFORCE INC	163,986	321.950	52,795,292.700	
ERIE INDEMNITY CO	4,050	427.420	1,731,051.000	
EMERSON ELECTRIC CO	96,074	127.260	12,226,377.240	
ATMOS ENERGY CORP	24,532	144.190	3,537,269.080	
ENTERGY CORP	39,010	148.980	5,811,709.800	
EOG RESOURCES INC	93,097	134.120	12,486,169.640	
EQUIFAX INC	20,304	270.930	5,500,962.720	
EQT CORP	90,040	41.220	3,711,448.800	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	37,953	63.900	2,425,196.700	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	120.060	2,691,144.900	
EXXON MOBIL CORP	757,083	121.110	91,690,322.130	
NEXTERA ENERGY INC	348,097	76.970	26,793,026.090	

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,019	477.460	2,873,831.740	
FAIR ISAAC CORP	4,212	2,332.290	9,823,605.480	
ASSURANT INC	8,766	209.390	1,835,512.740	
FASTENAL CO	95,215	83.330	7,934,265.950	
FIFTH THIRD BANCORP	120,431	46.260	5,571,138.060	
M&T BANK CORP	28,540	209.410	5,976,561.400	
FISERV INC	98,698	210.700	20,795,668.600	
FORD MOTOR CO	675,985	10.970	7,415,555.450	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	21.040	998,916.080	
FREEPORT-MCMORAN INC	244,611	46.360	11,340,165.960	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,770	2,165.650	3,833,200.500	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	37,290	294.770	10,991,973.300	
GENERAL DYNAMICS CORP	39,325	309.470	12,169,907.750	
GENERAL MILLS INC	94,669	65.520	6,202,712.880	
GENUINE PARTS CO	23,115	122.410	2,829,507.150	
GILEAD SCIENCES INC	207,279	96.565	20,015,896.630	
GARTNER INC	12,872	547.400	7,046,132.800	
MCKESSON CORP	21,558	613.000	13,215,054.000	
NVIDIA CORP	4,153,709	147.630	613,212,059.670	
GRACO INC	27,006	87.810	2,371,396.860	
GE AEROSPACE	185,365	184.810	34,257,305.650	
VW GRAINGER INC	7,565	1,202.350	9,095,777.750	
HALLIBURTON CO	155,027	29.230	4,531,439.210	
MONSTER BEVERAGE CORP	124,258	54.140	6,727,328.120	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	54,522	589.260	32,127,633.720	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	31,942	260.600	8,324,085.200	
HENRY SCHEIN INC	20,863	68.000	1,418,684.000	
HEICO CORP	6,878	259.470	1,784,634.660	
HERSHEY FOODS CORP	24,324	175.670	4,272,997.080	
HP INC	164,781	36.820	6,067,236.420	
F5 INC	10,684	241.310	2,578,156.040	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	93.400	1,692,875.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	410.000	3,122,150.000	
JUNIPER NETWORKS INC	50,704	38.910	1,972,892.640	
HOLOGIC INC	38,399	78.760	3,024,305.240	
HOME DEPOT INC	167,305	405.900	67,909,099.500	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29,668	67.070	1,989,832.760	
HORMEL FOODS CORP	49,054	30.320	1,487,317.280	
CENTERPOINT ENERGY INC	115,509	30.390	3,510,318.510	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,672	630.950	3,578,748.400	
HUBBELL INC	8,750	467.930	4,094,387.500	
HUMANA INC	19,544	288.120	5,631,017.280	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,365	192.130	2,952,077.450	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	240,636	17.290	4,160,596.440	
BIOGEN INC	25,797	173.040	4,463,912.880	
IDEX CORP	12,292	228.510	2,808,844.920	
ILLINOIS TOOL WORKS	50,275	271.950	13,672,286.250	
INTUIT INC	47,306	684.220	32,367,711.320	
IDEXX LABORATORIES INC	14,376	433.280	6,228,833.280	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	38,409	410.580	15,769,967.220	
INTEL CORP	724,665	26.200	18,986,223.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	92.280	3,782,834.040	
INTERNATIONAL PAPER CO	53,419	57.380	3,065,182.220	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	63,859	29.830	1,904,913.970	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	179.770	2,131,532.890	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	135.750	2,658,799.500	
INCYTE CORP	28,067	83.380	2,340,226.460	
EMCOR GROUP INC	7,710	514.150	3,964,096.500	
JOHNSON & JOHNSON	406,354	155.470	63,175,856.380	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	51,256	117.430	6,018,992.080	
KLA CORPORATION	22,406	687.410	15,402,108.460	
DEVON ENERGY CORP	106,971	38.870	4,157,962.770	
KELLANOVA	47,714	81.000	3,864,834.000	
KEYCORP	166,503	18.970	3,158,561.910	
KIMBERLY-CLARK CORP	55,965	133.610	7,477,483.650	
KROGER CO	118,023	59.910	7,070,757.930	
LAM RESEARCH CORP	224,098	78.200	17,524,463.600	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8,555	489.240	4,185,448.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	15,558	240.590	3,743,099.220	
AKAMAI TECHNOLOGIES	27,653	89.370	2,471,348.610	
LENNAR CORP	40,713	172.580	7,026,249.540	
ELI LILLY & CO	136,483	831.540	113,491,073.820	
BATH & BODY WORKS INC	34,638	30.000	1,039,140.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	121,332	132.440	16,069,210.080	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	47,654	136.680	6,513,348.720	
LOCKHEED MARTIN CORP	35,987	564.560	20,316,820.720	
LOEWS CORP	30,289	83.110	2,517,318.790	
LOWE'S COS INC	96,208	271.100	26,081,988.800	
DOMINION ENERGY INC	142,221	57.790	8,218,951.590	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	36.690	1,482,312.690	
MCCORMICK & CO INC	40,279	77.490	3,121,219.710	
MCDONALD'S CORPORATION	121,760	298.970	36,402,587.200	
S&P GLOBAL INC	54,046	502.820	27,175,409.720	

EVEREST GROUP LTD	8,130	368.290	2,994,197.700	
MARKEL GROUP INC	2,404	1,650.740	3,968,378.960	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	103,592	66.230	6,860,898.160	
MARSH & MCLENNAN COS	82,976	225.360	18,699,471.360	
MASCO CORP	34,561	80.950	2,797,712.950	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	10,701	619.580	6,630,125.580	
METLIFE INC	103,317	81.020	8,370,743.340	
MEDTRONIC PLC	213,060	87.720	18,689,623.200	
CVS HEALTH CORP	214,005	55.540	11,885,837.700	
MERCK & CO. INC.	429,049	102.920	44,157,723.080	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	69,835	70.410	4,917,082.350	
MICROSOFT CORP	1,192,031	422.540	503,680,778.740	
MICRON TECH INC	188,151	111.900	21,054,096.900	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	92,397	72.870	6,732,969.390	
3M CO	94,148	134.340	12,647,842.320	
ENTEGRIS INC	23,675	105.030	2,486,585.250	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	215.390	1,652,902.860	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	27,968	504.600	14,112,652.800	
ILLUMINA INC	27,148	151.090	4,101,791.320	
XCEL ENERGY INC	96,398	67.370	6,494,333.260	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	17,037	125.740	2,142,232.380	
NETAPP INC	32,785	124.010	4,065,667.850	
NEWMONT CORP	192,440	45.040	8,667,497.600	
NVR INC	570	9,306.940	5,304,955.800	
NIKE INC-CL B	201,444	75.880	15,285,570.720	
NORDSON CORP	8,735	261.440	2,283,678.400	
NORFOLK SOUTHERN CORP	38,420	271.670	10,437,561.400	
EVERSOURCE ENERGY	57,685	61.400	3,541,859.000	
NISOURCE INC	69,366	35.970	2,495,095.020	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	105.180	3,457,056.240	
NORTHROP GRUMMAN CORP	23,196	528.990	12,270,452.040	
WELLS FARGO & CO	589,487	70.040	41,287,669.480	
NUCOR CORP	40,395	158.840	6,416,341.800	
CHENIERE ENERGY INC	38,886	205.670	7,997,683.620	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	62,919	185.210	11,653,227.990	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	115,423	50.530	5,832,324.190	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	33,427	226.110	7,558,178.970	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,986	1,217.700	12,159,952.200	
ORACLE CORP	279,665	189.250	52,926,601.250	
PACCAR INC	90,022	114.380	10,296,716.360	
PTC INC	20,087	192.830	3,873,376.210	

EXELON CORP	172,366	38.110	6,568,868.260	
PARKER HANNIFIN CORP	21,835	695.580	15,187,989.300	
PAYCHEX INC	55,583	148.570	8,257,966.310	
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,452	220.510	2,525,280.520	
PPL CORPORATION	135,783	33.060	4,488,985.980	
PEPSICO INC	230,950	165.110	38,132,154.500	
PENTAIR PLC	30,201	104.350	3,151,474.350	
PFIZER INC	962,220	26.720	25,710,518.400	
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	39.670	1,599,454.730	
CONOCOPHILLIPS	197,032	111.590	21,986,800.880	
PG&E CORP	347,639	20.600	7,161,363.400	
ALTRIA GROUP INC	290,614	54.050	15,707,686.700	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	67,693	203.970	13,807,341.210	
BROWN & BROWN INC	40,458	112.430	4,548,692.940	
GARMIN LTD	25,779	212.720	5,483,708.880	
PPG INDUSTRIES INC	37,839	125.520	4,749,551.280	
COSTCO WHOLESALE CORP	74,836	943.800	70,630,216.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	37,719	117.620	4,436,508.780	
QUEST DIAGNOSTICS	19,786	159.370	3,153,294.820	
PROCTER & GAMBLE CO	398,105	167.710	66,766,189.550	
PROGRESSIVE CORP	99,272	261.520	25,961,613.440	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	85,682	85.820	7,353,229.240	
PULTE GROUP INC	33,950	132.700	4,505,165.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	43,206	110.880	4,790,681.280	
QUALCOMM INC	189,162	170.910	32,329,677.420	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	32,000	158.730	5,079,360.000	
EXACT SCIENCES CORP	29,779	51.480	1,533,022.920	
RELIANCE INC	10,527	320.620	3,375,166.740	
REGENERON PHARMACEUTICALS	18,431	828.420	15,268,609.020	
RESMED INC	24,715	252.380	6,237,571.700	
US BANCORP	265,109	50.210	13,311,122.890	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	65,415	101.850	6,662,517.750	
ROSS STORES INC	57,180	143.400	8,199,612.000	
ROLLINS INC	45,708	50.180	2,293,627.440	
ROPER TECHNOLOGIES INC	18,125	567.620	10,288,112.500	
ROCKWELL AUTOMATION INC	19,881	272.140	5,410,415.340	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	41,808	225.270	9,418,088.160	
RPM INTERNATIONAL INC	22,264	134.770	3,000,519.280	
ACCENTURE PLC-CL A	105,955	355.530	37,670,181.150	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	226,602	66.200	15,001,052.400	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	17,682	316.300	5,592,816.600	
AXON ENTERPRISE INC	12,002	603.180	7,239,366.360	

THE TRAVELERS COMPANIES INC	39,040	256.890	10,028,985.600	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	93,547	88.070	8,238,684.290	
BOOKING HOLDINGS INC	5,737	4,943.270	28,359,539.990	
SCHLUMBERGER LTD	244,939	43.180	10,576,466.020	
SCHWAB (CHARLES) CORP	256,323	73.900	18,942,269.700	
POOL CORP	6,305	372.580	2,349,116.900	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	35,309	108.180	3,819,727.620	
SEI INVESTMENTS CO	20,388	80.110	1,633,282.680	
ELEVANCE HEALTH INC	39,750	422.620	16,799,145.000	
CENCORA INC	29,520	248.410	7,333,063.200	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	42,607	85.450	3,640,768.150	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	40,720	386.670	15,745,202.400	
CENTENE CORP	88,199	60.150	5,305,169.850	
SMITH (A.O.) CORP	19,563	74.860	1,464,486.180	
SNAP-ON INC	9,624	359.270	3,457,614.480	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	61,857	121.890	7,539,749.730	
EDISON INTERNATIONAL	63,206	83.100	5,252,418.600	
SOUTHERN CO	184,910	88.640	16,390,422.400	
TRUIST FINANCIAL CORP	229,384	45.220	10,372,744.480	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	31.780	626,066.000	
AT&T INC	1,213,193	22.340	27,102,731.620	
CHEVRON CORP	295,246	156.930	46,332,954.780	
STANLEY BLACK & DECKER INC	26,546	90.170	2,393,652.820	
STATE STREET CORP	49,873	94.780	4,726,962.940	
STARBUCKS CORP	192,907	97.550	18,818,077.850	
STEEL DYNAMICS INC	25,751	148.550	3,825,311.050	
STRYKER CORP	58,012	375.960	21,810,191.520	
NETFLIX INC	72,847	795.040	57,916,278.880	
GEN DIGITAL INC	92,583	29.530	2,733,975.990	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	59.600	1,633,040.000	
SYNOPSIS INC	25,583	561.550	14,366,133.650	
SYSCO CORP	83,870	77.390	6,490,699.300	
INTUITIVE SURGICAL INC	60,146	536.450	32,265,321.700	
TELEFLEX INC	9,358	195.550	1,829,956.900	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	183,707	17.110	3,143,226.770	
TERADYNE INC	24,830	110.890	2,753,398.700	
TEXAS INSTRUMENTS INC	153,910	220.290	33,904,833.900	
TEXTRON INC	29,841	87.560	2,612,877.960	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	64,573	551.740	35,627,507.020	
TORO CO	18,011	84.810	1,527,512.910	

DAVITA INC	9,106	149.660	1,362,803.960	
TRACTOR SUPPLY CO	18,106	288.560	5,224,667.360	
BIO-TECHNE CORP	25,934	75.960	1,969,946.640	
TRIMBLE INC	43,160	72.650	3,135,574.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,817	623.220	4,248,490.740	
TYSON FOODS INC	47,194	59.590	2,812,290.460	
MARATHON OIL CORP	92,952	28.500	2,649,132.000	
UNION PACIFIC CORP	102,566	241.490	24,768,663.340	
RTX CORP	225,287	123.550	27,834,208.850	
UNITEDHEALTH GROUP INC	155,633	615.810	95,840,357.730	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,903	207.500	2,054,872.500	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	11.070	900,278.820	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	43,742	516.740	22,603,241.080	
VULCAN MATERIALS CO	23,048	292.310	6,737,160.880	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	139,773	9.070	1,267,741.110	
WALMART INC	746,634	84.830	63,336,962.220	
WASTE MANAGEMENT INC	68,368	224.120	15,322,636.160	
WATERS CORP	9,995	384.510	3,843,177.450	
WATSCO INC	5,565	528.500	2,941,102.500	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	12,974	324.100	4,204,873.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	19,624	115.450	2,265,590.800	
WESTERN DIGITAL CORP	53,991	69.610	3,758,313.510	
WABTEC CORP	28,400	200.690	5,699,596.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,319	89.160	2,257,442.040	
WYNN RESORTS LTD	15,379	84.300	1,296,449.700	
NASDAQ INC	71,851	78.690	5,653,955.190	
CME GROUP INC	59,971	225.660	13,533,055.860	
WILLIAMS COS INC	199,751	56.310	11,247,978.810	
WILLIAMS-SONOMA INC	22,865	129.800	2,967,877.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	9,703	202.940	1,969,126.820	
LKQ CORP	43,882	38.370	1,683,752.340	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	57.750	2,340,261.000	
WEC ENERGY GROUP INC	56,102	97.590	5,474,994.180	
MICROSTRATEGY INC-CL A	27,056	270.420	7,316,483.520	
CARMAX INC	27,022	75.540	2,041,241.880	
TJX COMPANIES INC	190,716	117.830	22,472,066.280	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	9,012	399.310	3,598,581.720	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	4.630	722,506.870	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	40.810	960,177.680	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	21,812	277.430	6,051,303.160	
CBRE GROUP INC	52,609	136.080	7,159,032.720	

REGIONS FINANCIAL CORP	152,588	25.620	3,909,304.560	
DOMINO'S PIZZA INC	5,925	459.730	2,723,900.250	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,931	761.300	6,037,870.300	
CRH PLC	113,508	100.670	11,426,850.360	
WESTLAKE CORP	6,030	132.150	796,864.500	
T-MOBILE US INC	89,605	235.310	21,084,952.550	
LAS VEGAS SANDS CORP	59,474	50.380	2,996,300.120	
MOSAIC CO/THE	48,502	27.730	1,344,960.460	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	274.680	1,682,689.680	
CELANESE CORP	19,797	84.800	1,678,785.600	
DEXCOM INC	68,840	69.960	4,816,046.400	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	178.350	3,487,455.900	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	180.760	3,972,743.280	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	83.710	2,592,414.990	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,417	551.990	9,062,019.830	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	97,187	156.420	15,201,990.540	
LIVE NATION	27,355	123.000	3,364,665.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	234,186	58.810	13,772,478.660	
TRANSDIGM GROUP INC	9,498	1,350.980	12,831,608.040	
MASTERCARD INC	139,984	524.760	73,458,003.840	
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	28.900	682,704.700	
OWENS CORNING	15,643	190.440	2,979,052.920	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,679	198.420	4,103,127.180	
AERCAP HOLDINGS NV	33,912	97.520	3,307,098.240	
FIRST SOLAR INC	16,384	193.930	3,177,349.120	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	20,698	225.210	4,661,396.580	
SUPER MICRO COMPUTER INC	84,100	24.520	2,062,132.000	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	110.390	2,328,566.660	
DELTA AIR LINES INC	30,555	61.050	1,865,382.750	
INSULET CORP	12,022	268.000	3,221,896.000	
DISCOVER FINANCIAL	43,392	175.150	7,600,108.800	
LULULEMON ATHLETICA INC	19,016	308.530	5,867,006.480	
MERCADOLIBRE INC	7,746	1,872.010	14,500,589.460	
ULTA BEAUTY INC	7,914	385.260	3,048,947.640	
MSCI INC	13,320	594.000	7,912,080.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	262,615	126.240	33,152,517.600	
VISA INC	265,790	307.870	81,828,767.300	
KEURIG DR PEPPER INC	197,495	32.880	6,493,635.600	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	31,751	136.090	4,320,993.590	
MARATHON PETROLEUM CORP	59,718	153.750	9,181,642.500	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	79.050	1,694,041.500	

KINDER MORGAN INC/DELAWARE	339,285	26.880	9,119,980.800	
XYLEM INC	39,414	124.370	4,901,919.180	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	46,489	85.300	3,965,511.700	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	202.660	1,313,439.460	
EPAM SYSTEMS INC	9,031	233.450	2,108,286.950	
HCA HEALTHCARE INC	32,407	354.160	11,477,263.120	
VERISK ANALYTICS INC	23,047	284.980	6,567,934.060	
CORPAY INC	11,338	366.010	4,149,821.380	
NXP SEMICONDUCTOR NV	43,768	233.890	10,236,897.520	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	21,225	183.500	3,894,787.500	
TARGA RESOURCES CORP	36,212	192.280	6,962,843.360	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,578	196.860	3,460,405.080	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	40,549	74.780	3,032,254.220	
DOLLAR GENERAL CORP	35,900	76.950	2,762,505.000	
FORTINET INC	111,202	92.040	10,235,032.080	
HYATT HOTELS CORP	6,647	155.170	1,031,414.990	
TESLA INC	484,986	321.220	155,787,202.920	
ENPHASE ENERGY INC	21,539	66.900	1,440,959.100	
GENERAL MOTORS CO	195,076	55.580	10,842,324.080	
ALLY FINANCIAL INC	47,540	37.560	1,785,602.400	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	312.250	3,714,213.750	
APTIV PLC	43,097	56.250	2,424,206.250	
PHILLIPS 66	70,901	126.450	8,965,431.450	
META PLATFORMS INC	370,050	589.340	218,085,267.000	
IQVIA HOLDINGS INC	30,188	219.230	6,618,115.240	
DIAMONDBACK ENERGY INC	32,925	181.880	5,988,399.000	
SERVICENOW INC	34,771	1,008.080	35,051,949.680	
PALO ALTO NETWORKS INC	54,949	391.400	21,507,038.600	
WORKDAY INC	34,894	256.540	8,951,706.760	
ABBVIE INC	298,381	199.500	59,527,009.500	
ZOETIS INC	77,646	176.820	13,729,365.720	
NEWS CORP/NEW-CL A	74,964	29.520	2,212,937.280	
CDW CORP	22,475	199.870	4,492,078.250	
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	113.650	7,172,451.500	
TWILIO INC	25,710	92.290	2,372,775.900	
SNAP INC	174,273	12.010	2,093,018.730	
TRADE DESK INC A	73,200	125.130	9,159,516.000	
OKTA INC	25,106	76.750	1,926,885.500	
BAKER HUGHES CO	166,560	43.015	7,164,578.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	27,172	81.200	2,206,366.400	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	10.660	1,726,514.920	
BROADCOM INC	747,036	183.640	137,185,691.040	
ARES MANAGEMENT CORP	32,721	170.380	5,575,003.980	

MONGODB INC	12,304	290.040	3,568,652.160	
BURLINGTON STORES INC	10,565	263.290	2,781,658.850	
VEEVA SYSTEMS INC	25,024	235.000	5,880,640.000	
EVERGY INC	45,274	62.510	2,830,077.740	
ALLEGION PLC	13,423	143.780	1,929,958.940	
DAYFORCE INC	29,460	81.140	2,390,384.400	
STERIS PLC	17,428	219.190	3,820,043.320	
DOCUSIGN INC	31,974	79.380	2,538,096.120	
WIX.COM LTD	8,997	172.500	1,551,982.500	
KKR & CO INC	105,595	152.200	16,071,559.000	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	9,649	94.510	911,926.990	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	44,913	81.460	3,658,612.980	
MODERNA INC	52,618	46.830	2,464,100.940	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	42,257	247.650	10,464,946.050	
CIGNA GROUP	48,437	319.770	15,488,699.490	
DELL TECHNOLOGIES INC	47,920	134.230	6,432,301.600	
DOW INC	113,128	46.490	5,259,320.720	
OVINTIV INC	48,592	43.170	2,097,716.640	
AMCOR PLC	265,013	10.220	2,708,432.860	
PINTEREST INC	105,039	29.180	3,065,038.020	
FOX CORP-A	36,501	44.600	1,627,944.600	
FOX CORP-B	27,507	41.560	1,143,190.920	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	38,708	330.030	12,774,801.240	
AVANTOR INC	107,376	22.590	2,425,623.840	
DYNATRACE INC	46,540	52.890	2,461,500.600	
CLOUDFLARE INC	52,012	91.250	4,746,095.000	
TRADEWEB MARKETS INC	20,579	131.930	2,714,987.470	
CARRIER GLOBAL CORP	135,070	76.680	10,357,167.600	
OTIS WORLDWIDE CORP	66,367	100.030	6,638,691.010	
UBER TECHNOLOGIES INC	318,552	72.040	22,948,486.080	
CORTEVA INC	116,431	58.330	6,791,420.230	
MATCH GROUP INC	44,764	30.560	1,367,987.840	
BLACKSTONE INC	121,482	177.460	21,558,195.720	
CARLYLE GROUP INC	42,691	52.330	2,234,020.030	
DATADOG INC	47,899	124.450	5,961,030.550	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	104.780	3,236,654.200	
VERTIV HOLDINGS CO	57,675	125.750	7,252,631.250	
INGERSOLL RAND INC	69,666	102.610	7,148,428.260	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	70,281	85.940	6,039,949.140	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	228.750	2,045,253.750	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	118,889	10.590	1,259,034.510	
DRAFTKINGS INC	75,786	40.130	3,041,292.180	
CHORD ENERGY CORP	10,665	132.010	1,407,886.650	
AON PLC	32,567	383.780	12,498,563.260	

WARNER BROS DISCOVERY INC	398,011	9.180	3,653,740.980	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	3,255	1,374.060	4,472,565.300	
BENTLEY SYSTEMS INC	27,315	48.580	1,326,962.700	
COINBASE GLOBAL INC	32,033	270.740	8,672,614.420	
AIRBNB INC	73,863	134.610	9,942,698.430	
CONSTELLATION ENERGY CORP	52,525	239.370	12,572,909.250	
MONDAY.COM LTD	6,356	324.310	2,061,314.360	
SOLVENTUM CORP	21,683	72.430	1,570,499.690	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	39,050	30.820	1,203,521.000	
APPLOVIN CORP	35,297	290.010	10,236,482.970	
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	26.210	1,629,554.330	
ROBLOX CORP	78,921	52.400	4,135,460.400	
VIATRIS INC	184,148	12.960	2,386,558.080	
EXPAND ENERGY CORP	36,772	92.490	3,401,042.280	
BLACKROCK INC	25,071	1,039.280	26,055,788.880	
HF SINCLAIR CORP	25,560	41.810	1,068,663.600	
SNOWFLAKE INC	52,402	120.890	6,334,877.780	
DOORDASH INC	51,630	171.400	8,849,382.000	
ARISTA NETWORKS INC	45,204	400.450	18,101,941.800	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	65,347	162.000	10,586,214.000	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	40.050	636,514.650	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	337,084	58.390	19,682,334.760	
FNF GROUP	46,461	60.230	2,798,346.030	
JACOBS SOLUTIONS INC	21,170	146.430	3,099,923.100	
MARVELL TECHNOLOGY INC	147,444	93.800	13,830,247.200	
APA CORP	67,758	21.770	1,475,091.660	
LINDE PLC	80,865	459.480	37,155,850.200	
ROBINHOOD MARKETS INC	87,606	30.540	2,675,487.240	
U-HAUL HOLDING CO	16,864	67.300	1,134,947.200	
ASPEN TECHNOLOGY INC	5,007	245.000	1,226,715.000	
TOAST INC	56,667	37.480	2,123,879.160	
GE VERNOVA INC	46,675	341.180	15,924,576.500	
GRAB HOLDINGS LTD	369,622	4.230	1,563,501.060	
CATALENT INC	27,357	59.410	1,625,279.370	
SYNCHRONY FINANCIAL	70,641	63.790	4,506,189.390	
VERALTO CORP	40,316	105.550	4,255,353.800	
SAMSARA INC	33,531	52.720	1,767,754.320	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	32,552	81.450	2,651,360.400	
BUNGE GLOBAL SA	21,715	87.120	1,891,810.800	
KENVUE INC	312,155	23.680	7,391,830.400	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	45.810	3,344,725.530	
CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	294.610	2,003,053.390	

	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	30,674	165.420	5,074,093.080	
	HUBSPOT INC	7,895	656.560	5,183,541.200	
	QORVO INC	14,144	70.350	995,030.400	
	TE CONNECTIVITY PLC	52,304	155.060	8,110,258.240	
	SMURFIT WESTROCK PLC	90,859	52.390	4,760,103.010	
	FERGUSON ENTERPRISES INC	34,901	207.460	7,240,561.460	
	LABCORP HOLDINGS INC	15,164	242.390	3,675,601.960	
	GODADDY INC	22,398	177.840	3,983,260.320	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	30,382	248.040	7,535,951.280	
	TRANSUNION	31,262	106.620	3,333,154.440	
	ALBERTSONS COS INC	54,086	19.260	1,041,696.360	
	BLOCK INC	95,972	74.560	7,155,672.320	
	DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	84.170	5,743,339.950	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	35,323	77.890	2,751,308.470	
	KRAFT HEINZ CO	152,849	33.000	5,044,017.000	
	FORTIVE CORP	61,764	75.200	4,644,652.800	
	WASTE CONNECTIONS INC	43,910	184.040	8,081,196.400	
	ALPHABET INC-CL A	991,958	178.350	176,915,709.300	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	206,262	22.040	4,546,014.480	
	PAYPAL HOLDINGS INC	168,916	83.010	14,021,717.160	
	SEA LTD ADR	63,450	93.560	5,936,382.000	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	57,347	47.360	2,715,953.920	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	73.890	1,653,214.860	
	ALPHABET INC-CL C	853,628	179.860	153,533,532.080	
	PURE STORAGE INC	50,378	52.910	2,665,499.980	
	ZSCALER INC	16,171	195.730	3,165,149.830	
	ATLISSIAN CORP PLC	27,526	237.800	6,545,682.800	
	ROKU INC	19,331	73.820	1,427,014.420	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	16,164	393.710	6,363,928.440	
	VISTRA CORP	59,614	141.900	8,459,226.600	
アメリカ・ドル	小計	62,130,206		8,699,524,256.300 (1,332,245,144,607)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	16.890	1,035,272.550	
	ASHTREAD GROUP	71,219	62.860	4,476,826.340	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	26.250	1,195,635.000	
	BARCLAYS PLC	2,537,586	2.515	6,382,028.790	
	BARRATT REDROW PLC	285,009	4.228	1,205,018.050	
	BT GROUP PLC	1,171,195	1.400	1,639,673.000	
	BUNZL PLC	53,979	34.760	1,876,310.040	
	AVIVA PLC	429,205	4.562	1,958,033.210	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	36.040	741,450.920	
	DIAGEO PLC	378,748	23.200	8,786,953.600	
	SCHRODERS PLC	110,366	3.024	333,746.780	

DCC PLC	17,471	48.480	846,994.080	
NATIONAL GRID PLC	790,592	9.758	7,714,596.730	
KINGFISHER PLC	336,026	2.898	973,803.340	
BAE SYSTEMS PLC	513,661	13.775	7,075,680.270	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	340,141	27.330	9,296,053.530	
HALMA PLC	62,208	25.380	1,578,839.040	
NEXT PLC	21,907	98.620	2,160,468.340	
IMPERIAL BRANDS PLC	140,692	23.670	3,330,179.640	
ANGLO AMERICAN PLC	206,873	23.720	4,907,027.560	
COMPASS GROUP PLC	290,317	26.110	7,580,176.870	
HSBC HOLDINGS PLC	3,132,825	6.900	21,616,492.500	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	949,467	2.169	2,059,393.920	
CENTRICA PLC	793,776	1.149	912,048.620	
UNILEVER PLC	420,296	45.370	19,068,829.520	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,134	10.460	1,204,301.640	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	22.640	1,246,173.520	
PEARSON PLC	116,743	12.040	1,405,585.720	
PERSIMMON PLC	56,989	13.140	748,835.460	
PRUDENTIAL PLC	474,188	6.426	3,047,132.080	
RIO TINTO PLC	193,036	49.460	9,547,560.560	
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.720	2,579,690.160	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	114,964	47.660	5,479,184.240	
RELX PLC	316,084	36.930	11,672,982.120	
RENTOKIL INITIAL PLC	418,475	4.036	1,688,965.100	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,452,324	5.532	8,034,256.360	
NATWEST GROUP PLC	1,148,741	3.808	4,374,405.720	
SSE PLC	183,547	17.190	3,155,172.930	
BP PLC	2,765,335	3.733	10,322,995.550	
SAGE GROUP PLC(THE)	186,583	10.415	1,943,261.940	
SMITHS GROUP PLC	77,205	15.340	1,184,324.700	
SPIRAX GROUP PLC	17,230	65.250	1,124,257.500	
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	9.240	3,349,758.720	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,385,556	0.530	5,504,344.680	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.375	783,561.620	
TESCO PLC	1,122,991	3.452	3,876,564.930	
3I GROUP PLC	161,058	33.870	5,455,034.460	
SMITH & NEPHEW PLC	156,657	9.176	1,437,484.630	
GSK PLC	708,892	13.810	9,789,798.520	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	80,360	107.450	8,634,682.000	
WPP PLC	176,061	8.462	1,489,828.180	
ASTRAZENECA PLC	262,661	99.030	26,011,318.830	
WHITBREAD PLC	31,475	30.290	953,377.750	
INTERTEK GROUP PLC	29,397	46.100	1,355,201.700	

	INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	92.580	2,487,994.920	
	SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.492	662,391.040	
	ADMIRAL GROUP PLC	40,084	25.150	1,008,112.600	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	15,910	42.820	681,266.200	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	34,042	18.310	623,309.020	
	EXPERIAN PLC	153,056	38.790	5,937,042.240	
	MONDI PLC	67,554	12.035	813,012.390	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,623	10.900	715,290.700	
	INFORMA PLC	223,961	8.282	1,854,845.000	
	GLENORE PLC	1,805,454	3.948	7,127,932.390	
	ENTAIN PLC	96,924	7.480	724,991.520	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	28.060	870,842.100	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	4.904	666,100.510	
	M&G PLC	454,395	1.942	882,435.090	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	16.690	468,571.750	
	WISE PLC	96,207	8.210	789,859.470	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.207	461,159.690	
	HALEON PLC	1,339,534	3.633	4,866,527.020	
	SHELL PLC	1,065,124	25.645	27,315,104.980	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	7.776	1,113,429.880	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	5.062	1,094,019.680	
	イギリス・ポンド 小計	45,189,868		317,315,811.750 (62,749,201,774)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	41.770	7,827,865.080	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	39.700	9,491,595.100	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	868.600	2,892,438.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	244,057	23.500	5,735,339.500	
	ICL GROUP LTD	103,067	15.550	1,602,691.850	
	NICE LTD	10,202	715.000	7,294,430.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	162.600	4,787,594.400	
	AZRIELI GROUP	4,672	290.200	1,355,814.400	
	イスラエル・シュケル 小計	821,259		40,987,768.330 (1,673,546,976)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	38.720	1,096,008.320	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	588,905	32.140	18,927,406.700	
	FORTESCUE LTD	272,505	19.550	5,327,472.750	
	TELSTRA GROUP LTD	843,086	3.880	3,271,173.680	
	ASX LTD	31,215	65.570	2,046,767.550	
	BHP GROUP LTD	859,598	43.400	37,306,553.200	
	AMPOL LTD	58,214	28.300	1,647,456.200	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	28.810	2,639,687.440	
	CSL LIMITED	80,345	285.290	22,921,625.050	
	REA GROUP LTD	9,317	234.190	2,181,948.230	

TRANSURBAN GROUP	520,681	12.790	6,659,509.990	
COCHLEAR LTD	10,446	292.920	3,059,842.320	
ORIGIN ENERGY LTD	326,442	9.910	3,235,040.220	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	278,827	149.320	41,634,447.640	
RIO TINTO LIMITED	61,394	123.310	7,570,494.140	
APA GROUP	222,829	6.800	1,515,237.200	
ARISTOCRAT LEISU	96,033	64.410	6,185,485.530	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	444,982	7.780	3,461,959.960	
PRO MEDICUS LTD	11,011	203.990	2,246,133.890	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	69,336	48.470	3,360,715.920	
ORICA LTD	91,188	17.640	1,608,556.320	
BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	22.260	1,704,826.620	
MACQUARIE GROUP LTD	62,407	228.530	14,261,871.710	
SUNCORP GROUP LTD	199,628	18.650	3,723,062.200	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	526,873	39.650	20,890,514.450	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	8.440	950,841.960	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	255,447	18.250	4,661,907.750	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	191,685	16.790	3,218,391.150	
REECE LTD	31,558	23.800	751,080.400	
SANTOS LTD	582,512	6.790	3,955,256.480	
SONIC HEALTHCARE	88,200	27.170	2,396,394.000	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	33.530	1,321,752.600	
WESFARMERS LTD	195,200	68.420	13,355,584.000	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	319,683	24.070	7,694,769.810	
WOOLWORTHS GROUP LTD	203,840	29.850	6,084,624.000	
SEEK LTD	58,513	25.110	1,469,261.430	
MINERAL RESOURCES LTD	28,865	38.470	1,110,436.550	
BRAMBLES LTD	220,767	19.150	4,227,688.050	
PILBARA MINERALS LTD	404,496	2.980	1,205,398.080	
CAR GROUP LTD	58,310	39.590	2,308,492.900	
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	28,600	44.510	1,272,986.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	11.480	1,548,766.800	
XERO LTD	23,149	157.000	3,634,393.000	
LOTTERY CORP LTD	366,780	4.990	1,830,232.200	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	4.730	1,105,117.200	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	511,608	32.130	16,437,965.040	
MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.720	1,535,433.720	
SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.800	2,594,404.400	
COLES GROUP LTD	230,734	17.770	4,100,143.180	

	WISETECH GLOBAL LTD	27,325	127.090	3,472,734.250	
オーストラリア・ドル	小計	11,305,169		310,727,852.180 (31,352,440,285)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	83,530	116.670	9,745,445.100	
	BARRICK GOLD CORP	302,207	25.620	7,742,543.340	
	BANK OF MONTREAL	120,115	129.300	15,530,869.500	
	BANK OF NOVA SCOTIA	207,973	75.050	15,608,373.650	
	NATIONAL BANK OF CANADA	56,424	133.910	7,555,737.840	
	BCE INC	14,197	39.490	560,639.530	
	BROOKFIELD CORP	228,204	79.440	18,128,525.760	
	SAPUTO INC	34,582	26.710	923,685.220	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	17,471	159.980	2,795,010.580	
	CGI INC	34,495	154.810	5,340,170.950	
	CCL INDUSTRIES INC	27,743	81.190	2,252,454.170	
	CAE INC	55,407	26.240	1,453,879.680	
	CAMECO CORP	73,563	73.120	5,378,926.560	
	ROGERS COMM-CL B	62,818	50.550	3,175,449.900	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	161,399	89.550	14,453,280.450	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	363,414	47.570	17,287,603.980	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	154.000	1,372,294.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	34.640	565,671.200	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	87,929	154.150	13,554,255.350	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,175	68.530	1,451,122.750	
	OPEN TEXT CORP	40,459	40.690	1,646,276.710	
	EMPIRE CO LTD	20,608	41.140	847,813.120	
	KINROSS GOLD CORP	192,737	14.550	2,804,323.350	
	RB GLOBAL INC	31,137	127.820	3,979,931.340	
	FORTIS INC	82,632	61.470	5,079,389.040	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	117,480	19.090	2,242,693.200	
	TELUS CORP	31,890	21.810	695,520.900	
	GREAT WEST LIFECO INC	43,551	49.090	2,137,918.590	
	IMPERIAL OIL LTD	32,165	101.860	3,276,326.900	
	ENBRIDGE INC	361,385	58.930	21,296,418.050	
	IGM FINANCIAL INC	12,478	44.380	553,773.640	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	302,871	44.240	13,399,013.040	
	LOBLAW CO LTD	24,803	185.510	4,601,204.530	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	125,335	77.030	9,654,555.050	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	55,589	60.380	3,356,463.820	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	96,171	82.460	7,930,260.660	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,425	1,835.680	6,287,204.000	
	METRO INC	35,059	85.740	3,005,958.660	
	EMERA INC	44,643	50.190	2,240,632.170	
	ONEX CORP	10,157	111.120	1,128,645.840	

PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	31.490	1,743,695.770	
POWER CORP OF CANADA	89,864	46.570	4,184,966.480	
QUEBECOR INC-B	30,598	32.780	1,003,002.440	
ROYAL BANK OF CANADA	238,132	172.040	40,968,229.280	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	158,520	108.040	17,126,500.800	
STANTEC INC	18,358	112.160	2,059,033.280	
SUNCOR ENERGY INC	221,204	54.480	12,051,193.920	
LUNDIN MINING CORP	119,660	13.890	1,662,077.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	82,129	67.780	5,566,703.620	
THOMSON REUTERS CORP	27,621	234.030	6,464,142.630	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	118.650	1,553,959.050	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	299,353	78.910	23,621,945.230	
TC ENERGY CORP	177,069	67.820	12,008,819.580	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	125.620	1,017,773.240	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	233.110	2,293,569.290	
INTACT FINANCIAL CORP	31,315	266.230	8,336,992.450	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	82,315	90.230	7,427,282.450	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,326	4,357.000	14,491,382.000	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	34,326	170.390	5,848,807.140	
TOURMALINE OIL CORP	59,089	62.290	3,680,653.810	
KEYERA CORP	39,997	43.690	1,747,468.930	
PARKLAND CORP	24,129	32.980	795,774.420	
ALTAGAS LTD	47,249	33.490	1,582,369.010	
PEMBINA PIPELINE CORP	94,699	57.000	5,397,843.000	
DOLLARAMA INC	49,948	151.000	7,542,148.000	
MEG ENERGY CORP	47,181	26.130	1,232,839.530	
CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	22.430	5,086,383.810	
ARC RESOURCES LTD	96,301	24.860	2,394,042.860	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	73,200	29.120	2,131,584.000	
TMX GROUP LTD	46,884	45.040	2,111,655.360	
BRP INC	4,307	68.810	296,364.670	
IVANHOE MINES LTD	98,820	18.590	1,837,063.800	
NUTRIEN LTD	90,212	67.210	6,063,148.520	
TFI INTERNATIONAL INC	14,528	202.680	2,944,535.040	
WSP GLOBAL INC	20,394	241.250	4,920,052.500	
IA FINANCIAL CORP INC	16,448	127.990	2,105,179.520	
GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	62.800	2,239,887.600	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28,942	43.580	1,261,292.360	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	67,223	78.490	5,276,333.270	
AIR CANADA	41,858	22.540	943,479.320	

	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	51,117	94.670	4,839,246.390	
	SHOPIFY INC	201,125	121.250	24,386,406.250	
	FIRSTSERVICE CORP	7,857	261.670	2,055,941.190	
	HYDRO ONE LTD	56,437	44.610	2,517,654.570	
カナダ・ドル 小計		6,883,042		505,859,685.900 (55,679,975,627)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	289,800	4.680	1,356,264.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	5.010	812,622.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	327,981	42.400	13,906,394.400	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	11.450	1,601,855.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.790	601,342.470	
	KEPPEL LTD	249,600	6.410	1,599,936.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	531,098	16.060	8,529,433.880	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	3.250	4,357,697.500	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.450	1,573,800.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	218,866	35.690	7,811,327.540	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.140	811,690.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.790	1,130,759.100	
シンガポール・ドル 小計		4,929,258		44,093,121.890 (5,087,464,404)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	69.560	1,650,937.040	
	NESTLE SA-REGISTERED	442,856	78.980	34,976,766.880	
	CIE FINANC RICHEMONT	92,164	119.300	10,995,165.200	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	119,501	263.100	31,440,713.100	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,599	256.600	1,949,903.400	
	SIKA INHABER	25,179	240.100	6,045,477.900	
	SGS SA-REG	27,911	88.780	2,477,938.580	
	NOVARTIS AG-REG SHS	332,978	92.860	30,920,337.080	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,117	169.200	1,373,396.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	717	1,413.000	1,013,121.000	
	CLARIANT AG-REG	45,795	11.620	532,137.900	
	SWISSCOM AG-REG	4,457	519.000	2,313,183.000	
	ABB LTD	261,937	50.000	13,096,850.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	26,454	24.800	656,059.200	
	GEBERIT AG	6,081	519.800	3,160,903.800	
	LONZA GROUP AG-REG	12,043	549.200	6,614,015.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	161	10,310.000	1,659,910.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	101,400.000	2,028,000.000	
	GIVAUDAN-REG	1,589	3,904.000	6,203,456.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	24,695	516.800	12,762,376.000	
ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	285.000	1,370,850.000		

HOLCIM LTD	86,530	90.720	7,850,001.600	
TEMENOS GROUP	10,930	59.500	650,335.000	
BACHEM HOLDING AG	4,673	75.800	354,213.400	
SONOVA HOLDING AG	8,100	323.600	2,621,160.000	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,251	208.700	1,721,983.700	
STRAUMANN HOLDING AG	19,254	112.900	2,173,776.600	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	161.900	696,170.000	
THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	32.050	296,750.950	
HELVETIA HOLDING AG	7,946	149.100	1,184,748.600	
SCHINDLER NAMEN	4,209	251.500	1,058,563.500	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	725.600	3,267,376.800	
BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	87.200	427,541.600	
EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	650.000	809,250.000	
SWISS PRIME SITE AG	13,356	94.750	1,265,481.000	
AVOLTA AG	12,933	34.800	450,068.400	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,730	1,235.000	4,606,550.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	55.440	1,780,400.160	
SWISS RE LTD	49,210	118.350	5,824,003.500	
BKW AG	3,194	150.000	479,100.000	
SIG GROUP AG	50,969	18.480	941,907.120	
ALCON INC	82,167	81.020	6,657,170.340	
SANDOZ GROUP AG	65,523	40.140	2,630,093.220	
GALDERMA GROUP AG	9,843	83.380	820,709.340	
UBS GROUP AG	559,306	28.210	15,778,022.260	
VAT GROUP AG	5,180	360.500	1,867,390.000	
スイス・フラン 小計	2,530,426		239,454,265.170 (41,847,027,381)	
スウェーデン・ クローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	456,651	181.200	82,745,161.200	
ATLAS COPCO AB-B SHS	266,320	158.550	42,225,036.000	
ERICSSON LM-B SHS	465,668	88.400	41,165,051.200	
GETINGE AB-B SHS	38,925	194.300	7,563,127.500	
LUNDBERGS B	14,872	537.000	7,986,264.000	
SKF AB-B SHS	66,600	211.200	14,065,920.000	
SANDVIK AB	169,218	211.800	35,840,372.400	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	250,203	153.750	38,468,711.250	
SKANSKA AB-B SHS	70,728	226.900	16,048,183.200	
SWEDBANK AB	132,581	216.700	28,730,302.700	
SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	92,795	139.550	12,949,542.250	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	260,610	111.300	29,005,893.000	
TRELLEBORG AB-B SHS	37,154	371.000	13,784,134.000	
VOLVO AB-A SHS	24,198	286.200	6,925,467.600	
VOLVO AB-B SHS	282,769	283.600	80,193,288.400	
HOLMEN AB-B SHS	19,972	415.000	8,288,380.000	
TELE2 AB-B SHS	100,027	111.250	11,128,003.750	

INDUSTRIVARDEN A	15,292	370.600	5,667,215.200	
INDUSTRIVARDEN C	31,300	370.000	11,581,000.000	
SAAB AB-B	47,156	233.000	10,987,348.000	
SECURITAS AB-B SHS	76,085	141.750	10,785,048.750	
INVESTOR AB-B SHS	288,459	302.750	87,330,962.250	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	158.800	16,621,437.200	
ASSA ABLOY AB-B	172,830	332.500	57,465,975.000	
TELIA CO AB	344,810	30.740	10,599,459.400	
BOLIDEN AB	53,939	332.800	17,950,899.200	
ALFA LAVAL AB	44,407	475.600	21,119,969.200	
FASTIGHETS AB BALDER	117,966	87.020	10,265,401.320	
INDUTRADE AB	39,178	292.200	11,447,811.600	
HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	66.920	3,196,701.480	
NIBE INDUSTRIER AB	212,832	49.120	10,454,307.840	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	325.400	11,838,377.400	
HEXAGON AB-B SHS	333,533	101.650	33,903,629.450	
SAGAX AB	44,607	252.200	11,249,885.400	
EPIROC AB-A	125,482	211.600	26,551,991.200	
EPIROC AB-B	61,487	189.100	11,627,191.700	
ESSITY AB-B	99,980	295.500	29,544,090.000	
EQT AB	55,194	310.400	17,132,217.600	
ADDTECH AB	47,848	304.000	14,545,792.000	
VOLVO CAR AB	143,747	22.835	3,282,462.740	
BEIJER REF AB	50,493	170.300	8,598,957.900	
LIFCO AB	39,631	324.600	12,864,222.600	
EVOLUTION AB	33,386	977.200	32,624,799.200	
INVESTMENT AB LATOUR	27,638	285.200	7,882,357.600	
スウェーデン・クローナ 小計	5,445,390		984,232,349.680 (13,926,887,748)	
デンマーク・クローネ				
CARLSBERG AS-B	15,167	737.000	11,178,079.000	
A P MOLLER A/S	663	11,215.000	7,435,545.000	
AP MOLLER MAERSK A	543	10,770.000	5,848,110.000	
DANSKE BANK A/S	113,672	205.000	23,302,760.000	
GENMAB A/S	11,219	1,592.000	17,860,648.000	
NOVONESIS (NOVOZYMES) B	59,656	423.700	25,276,247.200	
ROCKWOOL AS	1,677	3,054.000	5,121,558.000	
NOVO NORDISK A/S-B	545,450	745.700	406,742,065.000	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	169,829	104.500	17,747,130.500	
COLOPLAST-B	21,291	912.000	19,417,392.000	
DSV A/S	34,993	1,482.500	51,877,122.500	
DEMANT A/S	17,700	262.200	4,640,940.000	
TRYG A/S	58,222	159.900	9,309,697.800	
ZEALAND PHARMA A/S	11,566	847.000	9,796,402.000	
PANDORA A/S	12,473	1,064.500	13,277,508.500	
ORSTED A/S	31,744	378.800	12,024,627.200	
デンマーク・クローネ 小計	1,105,865		640,855,832.700 (14,098,828,319)	

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	229,726	7.400	1,699,972.400	
	FISHER & PAYKEL	95,209	37.630	3,582,714.670	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	3.040	950,677.920	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	175,979	6.650	1,170,260.350	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.880	1,407,131.040	
ニュージーランド・ドル 小計		1,052,945		8,810,756.380 (804,950,703)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	195.450	14,290,913.100	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	69.340	15,336,759.880	
	TELENOR ASA	86,976	131.300	11,419,948.800	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	14,874	1,130.000	16,807,620.000	
	ORKLA ASA	116,068	101.700	11,804,115.600	
	EQUINOR ASA	141,333	250.650	35,425,116.450	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	321.300	9,450,718.200	
	AKER BP ASA	55,995	223.700	12,526,081.500	
	SALMAR ASA	12,897	543.500	7,009,519.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	194.900	5,013,022.900	
	DNB BANK ASA	143,909	228.900	32,940,770.100	
ノルウェー・クローネ 小計		921,487		172,024,586.030 (2,392,861,992)	
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	25,025	87.900	2,199,697.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	24,704	77.650	1,918,265.600	
	AIR LIQUIDE	93,549	161.500	15,108,163.500	
	AIRBUS SE	101,352	142.300	14,422,389.600	
	AXA SA	309,476	33.860	10,478,857.360	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	124,161	28.420	3,528,655.620	
	ADIDAS AG	28,260	219.000	6,188,940.000	
	GENERALI	175,811	25.210	4,432,195.310	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	198.700	619,944.000	
	DANONE	112,535	65.520	7,373,293.200	
	SAFRAN SA	58,358	219.800	12,827,088.400	
	INTESA SANPAOLO	2,497,503	3.835	9,577,924.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	53,290	67.580	3,601,338.200	
	ACCOR SA	31,427	44.010	1,383,102.270	
	BOUYGUES	29,123	29.910	871,068.930	
	BNP PARIBAS	169,516	59.760	10,130,276.160	
	THALES SA	15,023	161.100	2,420,205.300	
	CAPGEMINI SA	25,063	162.100	4,062,712.300	
	LOTUS BAKERIES NV	77	12,280.000	945,560.000	
	UNICREDIT SPA	248,386	39.985	9,931,714.210	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	109.500	1,358,128.500	
	D'IETEREN TRDG	4,146	199.800	828,370.800	
	COMMERZBANK AG	179,069	15.805	2,830,185.540	
EIFFAGE	12,706	83.720	1,063,746.320		

FRESENIUS SE & CO KGAA	68,521	33.850	2,319,435.850	
PUBLICIS GROUPE	40,360	103.100	4,161,116.000	
IBERDROLA SA	1,034,264	13.210	13,662,627.440	
ENI SPA	382,505	13.930	5,328,294.650	
JERONIMO MARTINS	45,606	18.680	851,920.080	
KESKO OYJ-B	56,685	19.730	1,118,395.050	
KBC GROUPE	40,769	68.840	2,806,537.960	
HANNOVER RUECK SE	9,638	238.600	2,299,626.800	
WARTSILA OYJ	77,148	18.560	1,431,866.880	
L'OREAL	41,234	334.700	13,801,019.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	46,768	598.400	27,985,971.200	
GEA GROUP AG	25,513	46.000	1,173,598.000	
BOLLORE	114,808	5.795	665,312.360	
MEDIOBANCA SPA	86,792	15.345	1,331,823.240	
MICHELIN(CGDE)-B	109,281	31.390	3,430,330.590	
CONTINENTAL AG	17,635	56.500	996,377.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	176,018	35.430	6,236,317.740	
OMV AG	23,354	37.620	878,577.480	
VERBUND AG	10,663	71.800	765,603.400	
PERNOD-RICARD	33,037	112.650	3,721,618.050	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	36.980	862,040.780	
RENAULT SA	27,902	40.690	1,135,332.380	
REPSOL SA	195,049	11.490	2,241,113.010	
MERCK KGAA	20,216	150.850	3,049,583.600	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	76,705	86.100	6,604,300.500	
RWE AG	114,655	30.150	3,456,848.250	
SEB SA	2,596	95.450	247,788.200	
SOCIETE GENERALE-A	116,635	26.550	3,096,659.250	
VINCI S.A.	82,885	100.250	8,309,221.250	
SODEXO	12,910	83.200	1,074,112.000	
SOFINA	2,281	222.600	507,750.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	91,287	240.750	21,977,345.250	
VIVENDI SE	135,782	9.304	1,263,315.720	
SAP SE	176,829	221.400	39,149,940.600	
TELEFONICA S.A	755,720	4.205	3,177,802.600	
TOTALENERGIES SE	363,897	56.840	20,683,905.480	
E.ON SE	374,168	11.910	4,456,340.880	
VOEST-ALPINE AG	18,032	19.670	354,689.440	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	70.200	1,255,597.200	
SIEMENS AG-REG	128,644	183.080	23,552,143.520	
UPM-KYMMENE OYJ	86,201	26.240	2,261,914.240	
ING GROEP NV-CVA	562,986	14.990	8,439,160.140	
PUMA AG	17,210	45.740	787,185.400	
BAYER AG	173,835	24.080	4,185,946.800	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	10.145	973,717.100	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	29,704	77.960	2,315,723.840	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	129,331	52.360	6,771,771.160	
BASF SE	156,165	43.385	6,775,218.520	
BEIERSDORF AG	15,743	124.850	1,965,513.550	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	116.250	2,509,372.500	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	39.700	1,335,190.400	
ASM INTERNATIONAL NV	7,821	508.800	3,979,324.800	
ORANGE	344,524	9.882	3,404,586.160	
SAMPO OYJ-A SHS	82,999	40.050	3,324,109.950	
RANDSTAD NV	15,584	42.000	654,528.000	
ALLIANZ SE	65,977	287.000	18,935,399.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	3.414	1,725,575.570	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	162,715	32.390	5,270,338.850	
HERMES INTL	5,272	2,068.000	10,902,496.000	
ENDESA S.A.	50,946	19.300	983,257.800	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	6.310	685,562.570	
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	53.480	3,025,577.520	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	22,488	470.000	10,569,360.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	98,225	24.140	2,371,151.500	
DASSAULT SYSTEMES SA	111,221	32.660	3,632,477.860	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	42.980	1,497,251.280	
RHEINMETALL STAMM	7,339	546.000	4,007,094.000	
HEINEKEN NV	47,066	72.580	3,416,050.280	
AKZO NOBEL	34,237	58.820	2,013,820.340	
ASML HOLDING NV	67,811	621.500	42,144,536.500	
AEGON LTD	232,433	6.144	1,428,068.350	
VOLKSWAGEN AG PFD	33,164	84.140	2,790,418.960	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	950,968	9.102	8,655,710.730	
KERING	12,764	221.000	2,820,844.000	
ACCIONA S.A.	5,005	112.200	561,561.000	
FORTUM OYJ	73,699	13.680	1,008,202.320	
AGEAS	24,086	48.040	1,157,091.440	
UCB SA	22,227	184.400	4,098,658.800	
NEMETSCHEK SE	10,222	104.400	1,067,176.800	
CARREFOUR SA	90,642	15.080	1,366,881.360	
NOKIA OYJ	934,221	4.216	3,938,675.730	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	141,413	24.870	3,516,941.310	
WOLTERS KLUWER-CVA	41,015	161.850	6,638,277.750	
SANOFI	193,631	95.740	18,538,231.940	
STMICROELECTRONICS NV	110,999	24.660	2,737,235.340	
ELISA OYJ	20,242	43.760	885,789.920	
BANCO SANTANDER SA	2,590,110	4.434	11,484,547.740	

RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	16.440	1,078,283.160	
QIAGEN N.V.	34,544	40.750	1,407,668.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	338,007	15.522	5,246,544.650	
BMW VORZUG	7,821	63.150	493,896.150	
ENEL SPA	1,353,187	6.678	9,036,582.780	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	578,390	28.520	16,495,682.800	
SARTORIUS AG	4,533	228.300	1,034,883.900	
LEONARDO SPA	64,915	24.710	1,604,049.650	
CTS EVENTIM AG	11,578	87.700	1,015,390.600	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	219,873	28.785	6,329,044.300	
RATIONAL AG	860	872.500	750,350.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	7,150	58.050	415,057.500	
BECHTLE AG	14,521	32.840	476,869.640	
KONINKLIJKE KPN NV	600,608	3.618	2,172,999.740	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	45.580	1,050,072.040	
TELEPERFORMANCE	9,581	94.680	907,129.080	
DEUTSCHE BOERSE AG	32,080	212.200	6,807,376.000	
EURAZEO	5,673	69.350	393,422.550	
BANCO SABADELL	905,307	1.765	1,597,866.850	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	66.050	853,233.900	
HEINEKEN HOLDING NV-A	25,357	61.850	1,568,330.450	
INDITEX	185,535	52.000	9,647,820.000	
ESSILORLUXOTTICA	50,566	227.700	11,513,878.200	
SNAM SPA	317,518	4.218	1,339,290.920	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	13.190	2,201,687.990	
TENARIS SA	76,002	17.235	1,309,894.470	
TELECOM ITALIA SPA	1,970,516	0.223	439,425.060	
TERNA SPA	207,655	7.738	1,606,834.390	
BIOMERIEUX	9,417	102.300	963,359.100	
GRIFOLS SA	53,226	11.130	592,405.380	
NESTE OYJ	66,248	12.830	849,961.840	
RECORDATI SPA	18,197	51.500	937,145.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	156,478	6.024	942,623.470	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	314.500	2,733,634.000	
KONE OYJ	54,590	49.630	2,709,301.700	
ELIA GROUP	4,078	86.800	353,970.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,801	181.700	872,341.700	
ENGIE	302,123	15.185	4,587,737.750	
ALSTOM	70,027	20.200	1,414,545.400	
IPSEN SA	5,964	110.300	657,829.200	
ARKEMA SA	10,489	79.750	836,497.750	
LEGRAND SA	45,141	98.480	4,445,485.680	
AMPLIFON SPA	20,249	24.370	493,468.130	
ADP	6,104	105.400	643,361.600	
ORION OYJ	22,095	45.110	996,705.450	
METSO CORPORATION	102,831	8.812	906,146.770	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	15.785	1,256,249.220	
SYMRISE AG	22,612	107.650	2,434,181.800	
REXEL SA	33,916	27.000	915,732.000	
PRYSMIAN SPA	45,653	62.160	2,837,790.480	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	109.500	265,975.500	
CAIXABANK	670,111	5.504	3,688,290.940	
BUREAU VERITAS SA	54,064	29.000	1,567,856.000	
GETLINK	65,097	15.390	1,001,842.830	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	10.830	429,821.040	
AMADEUS IT GROUP SA	75,491	68.000	5,133,388.000	
BRENTAG SE	21,559	61.000	1,315,099.000	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	18.315	784,541.340	
EDENRED	42,160	29.810	1,256,789.600	
TALANX AG	10,349	73.050	755,994.450	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	86.820	1,034,460.300	
VONOVIA SE	120,979	30.170	3,649,936.430	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	8.690	1,426,515.640	
KNORR-BREMSE AG	10,342	73.650	761,688.300	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	52.200	2,347,016.400	
FERRARI NV	20,905	421.700	8,815,638.500	
ASR NEDERLAND NV	27,365	44.870	1,227,867.550	
AIB GROUP PLC	293,677	5.340	1,568,235.180	
NORDEA BANK ABP	541,540	10.685	5,786,354.900	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	39.640	685,494.520	
MONCLER SPA	43,309	48.790	2,113,046.110	
NEXI SPA	83,576	5.728	478,723.320	
PROSUS NV	232,662	38.440	8,943,527.280	
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	64.600	1,186,766.600	
JDE PEET'S BV	14,385	18.850	271,157.250	
EXOR NV	16,552	94.650	1,566,646.800	
SIEMENS ENERGY AG	111,218	39.520	4,395,335.360	
INPOST SA	36,721	17.480	641,883.080	
EURONEXT NV	14,077	99.850	1,405,588.450	
IMCD NV	9,332	152.900	1,426,862.800	
NN GROUP NV	43,478	45.130	1,962,162.140	
FINCOBANK SPA	96,393	14.840	1,430,472.120	
ARGENX SE	9,669	554.400	5,360,493.600	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	141,064	23.710	3,344,627.440	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	83,468	37.570	3,135,892.760	
DSM-FIRMENICH AG	32,472	104.800	3,403,065.600	
SYENQO SA	11,217	77.380	867,971.460	
ZALANDO SE	31,321	27.200	851,931.200	
STELLANTIS NV	363,425	12.538	4,556,622.650	
FERROVIAL SE	84,753	36.000	3,051,108.000	
AENA SME SA	11,603	199.300	2,312,477.900	
CELLNEX TELECOM SAU	84,967	33.050	2,808,159.350	

	BANCO BPM SPA	202,727	6.716	1,361,514.530	
	ABN AMRO BANK NV	75,982	15.220	1,156,446.040	
	SCOUT24 SE	15,599	83.550	1,303,296.450	
	COVESTRO AG	34,369	57.480	1,975,530.120	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	151,636	53.300	8,082,198.800	
	POSTE ITALIANE SPA	88,762	13.290	1,179,646.980	
	AMUNDI SA	11,288	67.450	761,375.600	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	44,691	9.755	435,960.700	
	ADYEN NV	3,621	1,272.600	4,608,084.600	
	DELIVERY HERO SE	34,547	37.150	1,283,421.050	
ユーロ	小計	31,097,941		846,420,389.970 (138,846,800,771)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	281,796	66.300	18,683,074.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	53.800	5,020,293.200	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	209,391	339.400	71,067,305.400	
	MTR CORP	338,941	28.200	9,558,136.200	
	HANG SENG BANK LTD	122,096	95.650	11,678,482.400	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	26.050	7,762,170.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	50.600	10,768,692.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	23.250	4,696,500.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,947,406	6.080	11,840,228.480	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	36.300	12,229,615.200	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	26.050	17,726,894.750	
	SINO LAND CO	659,200	7.930	5,227,456.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	248,565	83.250	20,693,036.250	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	65.950	3,496,669.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	109.600	23,581,097.600	
	AIA GROUP LTD	1,903,316	61.950	117,910,426.200	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	9.640	7,684,391.040	
	SANDS CHINA LTD	335,800	20.800	6,984,640.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	22.000	3,080,000.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	22.650	5,801,457.750	
	WH GROUP LTD	1,550,000	6.220	9,641,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	427,945	41.250	17,652,731.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	379,695	33.100	12,567,904.500	
香港・ドル	小計	11,689,103		415,352,202.620 (8,182,438,392)	
合計		185,101,959		1,708,887,568.979 (1,708,887,568,979)	

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2024年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル	小計	2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券 合計			2,968	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,164,321.900	
		GOODMAN GROUP	295,264.000	10,540,924.800	
		GPT GROUP	349,447.000	1,582,994.910	
		MIRVAC GROUP	700,332.000	1,470,697.200	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,839,561.760	
		STOCKLAND	369,843.000	1,864,008.720	
		VICINITY CENTRES	919,737.000	1,940,645.070	
	オーストラリア・ドル	小計	3,624,066.000	21,403,154.360 (2,159,578,275)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,201,431.000	2,366,819.070	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,594,913.580	
シンガポール・ドル	小計	1,812,509.000	3,961,732.650 (457,104,713)		
投資信託受益証券 合計			5,436,575	2,616,682,988 (2,616,682,988)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,674.000	3,155,942.960	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,884,775.200	
		AMERICAN TOWER CORP	79,561.000	16,055,409.800	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,590,623.790	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,527.000	5,499,436.250	
		BXP INC	24,473.000	2,028,811.700	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	2,051,440.740	
		CROWN CASTLE INC	72,473.000	7,671,267.050	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	54,719.000	9,957,763.620	
		EQUINIX INC	15,799.000	14,551,826.940	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,125.000	2,437,548.750	
		EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	3,978,267.120	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,587.000	3,530,095.420	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	36,738.000	6,160,962.600	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	41,252.000	2,053,112.040	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	117,820.000	2,681,583.200			

	HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	1,988,574.150	
	INVITATION HOMES INC	96,467.000	3,250,937.900	
	IRON MOUNTAIN INC	48,519.000	5,808,209.490	
	KIMCO REALTY	111,968.000	2,791,362.240	
	MID AMERICA	20,193.000	3,213,514.020	
	PROLOGIS INC	157,805.000	18,278,553.150	
	PUBLIC STORAGE	26,190.000	8,889,409.800	
	REALTY INCOME CORP	142,885.000	8,217,316.350	
	REGENCY CENTERS CORP	27,176.000	2,017,546.240	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	18,280.000	4,093,257.600	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	53,666.000	9,607,287.320	
	SUN COMMUNITIES INC	21,879.000	2,741,876.280	
	UDR INC	50,449.000	2,243,971.520	
	VENTAS INC	68,228.000	4,445,054.200	
	VICI PROPERTIES INC	184,246.000	5,783,481.940	
	WELLTOWER INC	100,158.000	13,841,835.600	
	WEYERHAEUSER CO	131,923.000	4,207,024.470	
	WP CAREY INC	42,337.000	2,401,778.010	
アメリカ・ドル	小計	2,154,695.000	189,109,857.460 (28,960,283,569)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	719,575.850	
	SEGRO PLC	207,676.000	1,619,872.800	
イギリス・ポンド	小計	329,021.000	2,339,448.650 (462,625,971)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	24,471.000	1,108,536.300	
カナダ・ドル	小計	24,471.000	1,108,536.300 (122,016,591)	
ユーロ	COVIVIO	15,284.000	809,287.800	
	GECINA SA	8,697.000	847,957.500	
	KLEPIERRE	36,407.000	1,045,609.040	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	18,477.000	1,366,189.380	
	WAREHOUSES DE PAUW	31,043.000	658,111.600	
ユーロ	小計	109,908.000	4,727,155.320 (775,442,559)	
香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	14,928,222.400	
香港・ドル	小計	410,116.000	14,928,222.400 (294,085,981)	
投資証券	合計	3,028,211	30,614,454,671 (30,614,454,671)	
合計			33,231,137,659 (33,231,137,659)	

(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	572銘柄 77.21	-	-	-	78.14
	投資証券	34銘柄 -	-	-	1.68	
イギリス・ポンド	株式	75銘柄 3.64	-	-	-	3.63
	投資証券	2銘柄 -	-	-	0.03	
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	50銘柄 1.82	-	-	-	1.92
	投資信託受益証 券	7銘柄 -	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式	84銘柄 3.23	-	-	-	3.20
	新株予約権証券	1銘柄 -	0.00	-	-	
	投資証券	1銘柄 -	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式	12銘柄 0.29	-	-	-	0.32
	投資信託受益証 券	2銘柄 -	-	0.03	-	
スイス・フラン	株式	46銘柄 2.43	-	-	-	2.40
スウェーデン・クロー ナ	株式	44銘柄 0.81	-	-	-	0.80
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄 0.82	-	-	-	0.81
ニュージーランド・ド ル	株式	5銘柄 0.05	-	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄 0.14	-	-	-	0.14
ユーロ	株式	213銘柄 8.05	-	-	-	8.01
	投資証券	5銘柄 -	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	23銘柄 0.47	-	-	-	0.49
	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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,055,212,512
投資証券	156,238,651,822
未収配当金	2,002,885,546
前払金	190,133,350
差入委託証拠金	258,512,862
流動資産合計	164,745,396,092
資産合計	164,745,396,092
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	183,305,120
未払金	3,279,556,414
未払解約金	138,226,000
流動負債合計	3,601,087,534
負債合計	3,601,087,534
純資産の部	
元本等	
元本	71,341,932,935
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	89,802,375,623
元本等合計	161,144,308,558
純資産合計	161,144,308,558
負債純資産合計	164,745,396,092

## 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11月14日 至 2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	80,768,851,376円
同期中追加設定元本額	35,140,345,677円
同期中一部解約元本額	44,567,264,118円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	150,273円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	745,483円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,794,334円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	1,962,207円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	2,129,306円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,095,729円
たわらノーロード 国内リート	5,930,850,905円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,304,000,986円
たわらノーロード バランス(堅実型)	52,882,029円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,234,249,559円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,615,232,034円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	433,848,574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)	1,125,453,506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)	883,611,668円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	1,057,175,399円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	5,235,548円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	97,098,942円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	19,611,851円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	33,645,672円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,297,766円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	470,391,578円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,539,059円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	157,600,544円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	260,250,579円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	547,573,765円
投資のソムリエ	1,129,020,890円
投資のソムリエ<DC年金>	137,657,340円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	231,764,784円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	241,186,775円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	656,265,781円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	13,908,837円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,376,848円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,411,068円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	42,967,119円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	598,816,029円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	141,651,060円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	15,857,293円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	8,017,808円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,864,455円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,283,681円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	59,380,499円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	8,494円
Jリートインデックスファンド(DC)	84,796,496円
MHAM J-REITインデックスファンド(隔月決算型)	20,788,398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)	64,497,873円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	377,553,426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)	64,878,521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)	98,234,089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)	38,910,529円
固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)	201,439,141円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	81,510,692円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	373,399,888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)	65,344,934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)	164,873,707円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	94,305,057円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	155,424,188円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	108,269,634円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	81,510,692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)	44,975,434円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	108,275,807円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-12(適格機関投資家限定)	155,857,047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)	399,349,950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)	106,911,680円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)24-04(適格機関投資家限定)	227,870,152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)	403,706,647円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,081,946,137円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	20,309,292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)	33,252,247円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	432,163,523円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	107,756,807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)	584,523円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	36,629,999円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	6,625,439,442円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	29,086,869,000円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,590,927,227円
たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>	4,257,468,538円
計	71,341,932,935円
2. 受益権の総数	71,341,932,935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11月14日 至 2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	5,804,409,907
合計	5,804,409,907

（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6月7日から2024年11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2024年11月11日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	4,959,894,850	-	4,776,904,000	182,990,850	
合計	4,959,894,850	-	4,776,904,000	182,990,850	

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,2588円 (22,588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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	6,919	961,741,000	
	GLP投資法人	53,984	6,974,732,800	
	KDX不動産投資法人	44,963	6,596,072,100	
	NTT都市開発リート投資法人	16,335	1,782,148,500	
	Oneリート投資法人	2,803	637,682,500	
	SOSILA物流リート投資法人	8,019	870,863,400	
	いちごオフィスリート投資法人	11,727	921,742,200	
	いちごホテルリート投資法人	2,660	354,578,000	
	アクティビア・プロパティーズ 投資法人	7,812	2,534,994,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	15,795	4,793,782,500	
	イオンリート投資法人	19,714	2,495,792,400	
	インヴィンシブル投資法人	88,549	5,605,151,700	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,557	403,363,800	
	オリックス不動産投資法人	32,023	5,133,286,900	
	グローバル・ワン不動産投資法人	11,639	1,160,408,300	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	8,138	2,361,647,600	
	サムティ・レジデンシャル投資 法人	4,379	399,802,700	
	サンケイリアルエステート投資 法人	5,149	405,226,300	
	ザイマックス・リート投資法人	2,752	299,968,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資 法人	59,043	4,044,445,500	
	ジャパンエクセレント投資法人	13,801	1,632,658,300	
	ジャパンリアルエステイト投資 法人	16,509	9,311,076,000	
	スターアジア不動産投資法人	29,617	1,489,735,100	
スターツプロシード投資法人	2,786	478,634,800		
タカラレーベン不動産投資法人	10,496	885,862,400		

トーセイ・リート投資法人	3,494	433,954,800	
ヒューリックリート投資法人	14,201	1,871,691,800	
フロンティア不動産投資法人	5,963	2,415,015,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	3,963	419,285,400	
マリモ地方創生リート投資法人	2,918	318,353,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	35,951	4,993,593,900	
ラサールロジポート投資法人	20,576	2,967,059,200	
阪急阪神リート投資法人	7,663	922,625,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	35,033	3,482,342,822	
三菱地所物流リート投資法人	5,550	1,967,475,000	
産業ファンド投資法人	29,426	3,369,277,000	
森トラストリート投資法人	30,979	1,902,110,600	
森ヒルズリート投資法人	18,899	2,409,622,500	
星野リゾート・リート投資法人	6,797	1,543,598,700	
積水ハウス・リート投資法人	48,294	3,549,609,000	
大和ハウスリート投資法人	24,103	5,594,306,300	
大和証券オフィス投資法人	6,659	2,037,654,000	
大和証券リビング投資法人	23,737	2,171,935,500	
投資法人みらい	22,131	871,961,400	
東海道リート投資法人	2,746	290,801,400	
東急リアル・エステート投資法人	10,775	1,671,202,500	
日本アコモデーションファンド投資法人	5,549	3,279,459,000	
日本ビルファンド投資法人	93,744	12,177,345,600	
日本プライムリアルティ投資法人	10,991	3,703,967,000	
日本プロロジスリート投資法人	27,997	6,878,862,900	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	2,594	183,914,600	
日本リート投資法人	5,220	1,654,740,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	10,798	2,961,891,400	
日本都市ファンド投資法人	83,336	7,691,912,800	
福岡リート投資法人	9,068	1,288,562,800	
平和不動産リート投資法人	11,785	1,420,092,500	
野村不動産マスターファンド投資法人	51,446	7,259,030,600	
投資証券 合計	1,151,555	156,238,651,822	
合計		156,238,651,822	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	682,315,623
コール・ローン	130,073,854
投資信託受益証券	10,476,041,297
投資証券	95,580,309,591
派生商品評価勘定	3,719,340
未収入金	2,242,045
未収配当金	81,221,565
差入委託証拠金	403,778,710
流動資産合計	107,359,702,025
資産合計	107,359,702,025
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,296,201
未払金	8,083,172,633
未払解約金	53,872,000
流動負債合計	8,143,340,834
負債合計	8,143,340,834
純資産の部	
元本等	
元本	43,978,375,279
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	55,237,985,912
元本等合計	99,216,361,191
純資産合計	99,216,361,191
負債純資産合計	107,359,702,025

## 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11月14日 至 2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	47,736,993,571円
同期中追加設定元本額	19,745,796,089円
同期中一部解約元本額	23,504,414,381円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	4,928,037,792円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,599,457円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,928,596円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	31,388,382円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	33,885,631円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	37,394,480円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	19,155,287円
たわらノーロード 先進国リート	16,084,356,512円
たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	299,234,647円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	4,339,669,254円

たわらノーロード バランス(堅実型)	26,738,691円
たわらノーロード バランス(標準型)	633,513,249円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,522,762,955円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	1,255,966円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	517,897,625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)	661,673,247円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	1,186,022,822円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	8,688円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	37,249,079円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	13,040,975円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	37,997,721円
One DC 先進国リートインデックスファンド	2,902,750,895円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	15,502,839円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	593,141,268円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	79,425,412円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	175,989,685円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	302,675,299円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	589,286,578円
投資のソムリエ	3,862,651,110円
投資のソムリエ<DC年金>	470,223,102円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	257,028,279円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	267,952,984円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	731,940,332円
ワールドアセットバランス(基本コース)	217,042,386円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	631,754,955円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	71,283,561円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	37,901,970円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,729,187円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	219,189,846円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	298,601,965円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	151,755,450円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	81,074,467円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	41,240,708円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	24,979,279円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,542,249円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	67,757,170円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	45,777円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	250,172,861円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	413,434,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	217,802円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	647,540円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	125,270円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	25,708,994円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	711,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	501,108円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	5,202円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	69,204,581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)	5,921,184円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	572,716円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,990,130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)	33,591,661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)	70,722,777円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	577,569,620円
計	43,978,375,279円
2. 受益権の総数	43,978,375,279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11月14日 至 2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券	304,180,972	
投資証券	8,806,580,526	
合計	9,110,761,498	

（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6月25日から2024年11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	8,103,573,105	-	8,103,616,470	43,365
イギリス・ポンド	6,522,874,680	-	6,522,941,820	67,140
オーストラリア・ドル	336,103,600	-	336,130,800	27,200
カナダ・ドル	514,610,400	-	514,532,370	78,030
シンガポール・ドル	165,082,350	-	165,088,500	6,150
シンガポール・ドル	213,411,375	-	213,434,500	23,125
ニュージーランド・ドル	165,082,350	-	165,088,500	6,150
ニュージーランド・ドル	9,135,200	-	9,134,930	270
ユーロ	262,448,800	-	262,441,600	7,200
韓国・ウォン	10,977,000	-	10,970,000	7,000
香港・ドル	68,929,700	-	68,941,950	12,250
合計	8,103,573,105	-	8,103,616,470	43,365

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 不動産投信関連

種類	2024年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	1,353,391,595	-	1,350,771,369	2,620,226
合計	1,353,391,595	-	1,350,771,369	2,620,226

## （注）時価の算定方法

## 不動産投信指数先物取引

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

2024年11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2560円 (22,560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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益 証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	364,600.000	211,468.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	291,800.000	65,655.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	81,383.000	
		PRIME US REIT	349,360.000	57,295.040	
	アメリカ・ドル	小計	1,917,460.000	415,801.040 (63,675,771)	
	オーストラリ ア・ドル	ABACUS GROUP	168,642.000	204,056.820	
		ABACUS STORAGE KING	224,215.000	266,815.850	
		ARENA REIT	161,827.000	645,689.730	
		BWP TRUST	262,595.000	892,823.000	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	341,038.000	612,163.210	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		253,124.000	764,434.480		

	CENTURIA OFFICE REIT	185,985.000	220,392.220	
	CHARTER HALL GROUP	217,505.000	3,260,399.950	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	311,030.000	1,197,465.500	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	215,555.000	724,264.800	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	151,479.000	395,360.190	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	520,520.000	205,605.400	
	DEXUS	494,247.000	3,509,153.700	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	93,159.000	245,008.170	
	GOODMAN GROUP	796,580.000	28,437,906.000	
	GPT GROUP	879,307.000	3,983,260.710	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	107,536.000	272,066.080	
	HEALTHCO REIT	202,023.000	225,255.640	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	826,473.000	1,033,091.250	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	305,650.920	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	177,159.000	859,221.150	
	MIRVAC GROUP	1,811,786.000	3,804,750.600	
	NATIONAL STORAGE REIT	636,696.000	1,572,639.120	
	REGION RE LTD	543,503.000	1,173,966.480	
	RURAL FUNDS GROUP	167,254.000	311,092.440	
	SCENTRE GROUP	2,374,877.000	8,169,576.880	
	STOCKLAND	1,093,297.000	5,510,216.880	
	VICINITY CENTRES	1,776,981.000	3,749,429.910	
	WAYPOINT REIT LTD	280,044.000	694,509.120	
	オーストラリア・ドル 小計	15,360,294.000	73,246,266.200 (7,390,548,260)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	271,895.000	342,587.700	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,187,216.000	1,062,558.320	
	CAPITALAND CHINA TRUST	484,280.000	353,524.400	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,475,309.000	4,876,358.730	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,612,360.000	4,208,259.600	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	295,200.000	256,824.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	0.000	
	ESR LOGOS REIT	2,738,840.000	739,486.800	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	464,500.000	283,345.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	549,200.000	1,158,812.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,361,464.000	1,361,464.000	
	KEPPEL DC REIT	624,800.000	1,349,568.000	
	KEPPEL REIT	1,113,200.000	979,616.000	

		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	716,600.000	404,879.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	954,920.000	2,167,668.400	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,556,820.000	1,992,729.600	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,075,900.000	1,334,116.000	
		OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	965,900.000	280,111.000	
		PARKWAY LIFE REIT	163,900.000	588,401.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	242,300.000	164,764.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	589,000.000	291,555.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,020,290.000	1,142,724.800	
	シンガポール・ドル 小計		20,576,294.000	25,339,353.350 (2,923,654,590)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	143,340.000	232,210.800	
	ユーロ 小計		143,340.000	232,210.800 (38,091,860)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	733,000.000	3,049,280.000	
	香港・ドル 小計		733,000.000	3,049,280.000 (60,070,816)	
投資信託受益証券 合計			38,730,388	10,476,041,297 (10,476,041,297)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	48,780.000	1,219,500.000	
		AGREE REALTY CORP	46,000.000	3,487,260.000	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	29,467.000	581,089.240	
		ALEXANDER'S INC.	860.000	197,963.400	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	71,080.000	8,105,963.200	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,384.000	78,824.320	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	20,299.000	567,154.060	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	68,686.000	1,791,330.880	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	143,850.000	5,316,696.000	
		AMERICOLD REALTY TRUST	119,860.000	2,728,013.600	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	55,529.000	474,217.660	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	103,254.000	1,644,836.220	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	28,050.000	314,160.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	64,771.000	15,140,221.250	

BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	76,895.370	
BRANDYWINE REALTY TRUST	71,263.000	386,245.460	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	137,953.000	3,964,769.220	
BROADSTONE NET LEASE INC	87,002.000	1,534,715.280	
BRT APARTMENTS CORP	3,973.000	74,891.050	
BXP INC	66,422.000	5,506,383.800	
CAMDEN PROPERTY TRUST	48,736.000	5,933,120.640	
CARETRUST REIT INC	77,203.000	2,388,660.820	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	7,096.000	195,849.600	
CENTERSPACE	6,824.000	508,115.040	
CHATHAM LODGING TRUST	19,711.000	177,004.780	
CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	92,013.540	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	99,470.000	586,873.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9,794.000	184,029.260	
COPT DEFENCE PROPERTIES	51,820.000	1,665,494.800	
COUSINS PROPERTIES INC	69,933.000	2,213,379.450	
CTO REALTY GROUTH INC	9,457.000	194,246.780	
CUBESMART	102,993.000	5,034,297.840	
CURBLINE PROPERTIES CORP	43,783.000	1,065,678.220	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	87,415.000	809,462.900	
DIGITAL REALTY TRUST INC	140,276.000	25,527,426.480	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	91,922.000	241,754.860	
DOUGLAS EMMETT INC	77,331.000	1,490,941.680	
EAST GROUP	22,272.000	3,919,872.000	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	42,440.000	574,637.600	
ELME COMMUNITIES	36,740.000	648,828.400	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	59,385.000	645,514.950	
EPR PROPERTIES	34,939.000	1,582,387.310	
EQUINIX INC	43,261.000	39,845,976.660	
EQUITY COMMONWEALTH	49,891.000	1,003,806.920	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	85,238.000	6,088,550.340	
EQUITY RESIDENTIAL	155,660.000	11,445,679.800	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	80,489.000	2,663,381.010	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	29,311.000	8,929,889.260	
EXTRA SPACE STORAGE INC	96,640.000	16,206,528.000	
FARMLAND PARTNERS INC	16,653.000	204,831.900	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,441.000	3,938,328.350	

FIRST INDUSTRIAL RT	60,654.000	3,248,021.700	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	42,940.000	1,204,467.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,375.000	90,895.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	125,375.000	6,239,913.750	
GETTY REALTY CORP	20,740.000	663,472.600	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	17,424.000	299,692.800	
GLADSTONE LAND CORP	13,328.000	172,064.480	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,662.000	238,891.520	
GLOBAL NET LEASE INC	81,327.000	641,670.030	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	166,516.000	2,960,654.480	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	321,419.000	7,315,496.440	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	48,882.000	1,651,722.780	
HOST HOTELS & RESORTS INC	321,027.000	5,781,696.270	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	54,055.000	246,490.800	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	103,344.000	2,159,889.600	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	100,534.940	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	13,068.000	1,390,043.160	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	35,245.000	1,090,480.300	
INVITATION HOMES INC	260,061.000	8,764,055.700	
IRON MOUNTAIN INC	133,765.000	16,013,008.150	
JBG SMITH PROPERTIES	35,927.000	625,129.800	
KILROY REALTY CORP	48,616.000	2,019,508.640	
KIMCO REALTY	307,832.000	7,674,251.760	
KITE REALTY GROUP TRUST	100,784.000	2,766,520.800	
LAMAR ADVERTISING CO	40,176.000	5,165,830.080	
LINEAGE INC	27,347.000	1,841,000.040	
LTC PROPERTIES INC	18,096.000	710,810.880	
LXP INDUSTRIAL TRUST	136,136.000	1,320,519.200	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	277,704.000	1,363,526.640	
MID AMERICA	53,359.000	8,491,551.260	
MODIV INC	3,617.000	60,620.920	
NATIONAL HEALTH INVS INC	20,049.000	1,627,978.800	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	32,301.000	1,410,907.680	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	5,763.000	184,934.670	
NETSTREIT CORP	34,333.000	554,134.620	

NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	15,887.000	96,434.090	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	9,412.000	433,893.200	
NNN REIT INC	84,131.000	3,605,854.660	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	32,419.680	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	117,936.000	4,876,653.600	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,397.000	213,847.270	
ORION OFFICE REIT INC	20,368.000	82,897.760	
OUTFRONT MEDIA INC	63,870.000	1,128,582.900	
PARAMOUNT GROUP INC	82,249.000	430,984.760	
PARK HOTELS & RESORTS INC	96,500.000	1,419,515.000	
PEAKSTONE REALTY TRUST	16,612.000	230,740.680	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	50,167.000	649,662.650	
PHILLIPS EDISON & CO INC	56,308.000	2,194,322.760	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	51,068.000	525,489.720	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,802.000	372,061.800	
POSTAL REALTY TRUST INC	9,772.000	141,596.280	
PROLOGIS INC	421,845.000	48,862,306.350	
PUBLIC STORAGE	71,797.000	24,369,337.740	
REALTY INCOME CORP	396,956.000	22,828,939.560	
REGENCY CENTERS CORP	74,669.000	5,543,426.560	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	59,216.000	1,026,213.280	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	100,237.000	4,321,217.070	
RLJ LODGING TRUST	65,887.000	640,421.640	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	27,459.000	3,089,137.500	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	107,787.000	2,107,235.850	
SAFEHOLD INC	18,489.000	391,966.800	
SAUL CENTERS INC	5,700.000	238,431.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	69,326.000	220,456.680	
SIMON PROPERTY GROUP INC	139,687.000	25,006,766.740	
SITE CENTERS CORP	19,291.000	305,955.260	
SL GREEN	29,770.000	2,403,332.100	
STAG INDUSTRIAL INC	83,470.000	3,120,108.600	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	45,247.000	296,367.850	
SUN COMMUNITIES INC	53,523.000	6,707,502.360	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	87,485.000	945,712.850	

	TANGER INC	50,403.000	1,790,818.590	
	TERRENO REALTY CORP	44,470.000	2,757,140.000	
	THE MACERICH COMPANY	99,457.000	1,941,400.640	
	UDR INC	137,156.000	6,100,698.880	
	UMH PROPERTIES INC	28,778.000	556,566.520	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,726.000	243,641.300	
	URBAN EDGE PROPERTIES	56,142.000	1,318,775.580	
	VENTAS INC	188,475.000	12,279,146.250	
	VERIS RESIDENTIAL INC	33,532.000	606,593.880	
	VICI PROPERTIES INC	477,544.000	14,990,106.160	
	VORNADO REALTY TRUST	75,937.000	3,474,877.120	
	WELLTOWER INC	263,692.000	36,442,234.400	
	WHITESTONE REIT	18,939.000	273,479.160	
	WP CAREY INC	100,032.000	5,674,815.360	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	42,470.000	640,872.300	
アメリカ・ドル	小計	10,227,386.000	553,239,038.230 (84,723,026,320)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	175,713.000	108,239.200	
	AEW UK REIT PLC	76,762.000	74,459.140	
	ASSURA PLC	1,397,442.000	540,810.050	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	293,891.000	281,253.680	
	BIG YELLOW GROUP PLC	90,781.000	1,094,818.860	
	BRITISH LAND CO PLC	458,326.000	1,771,888.310	
	CARE REIT PLC	169,602.000	143,144.080	
	CLS HOLDINGS PLC	80,477.000	71,222.140	
	CUSTODIAN REIT PLC	186,443.000	145,239.090	
	DERWENT LONDON PLC	51,879.000	1,120,586.400	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	244,328.000	222,338.480	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	190,159.000	593,296.080	
	HAMMERSON PLC	212,210.000	612,862.480	
	HELICAL PLC	38,338.000	74,605.740	
	HOME REIT PLC	286,621.000	0.000	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	341,918.000	2,027,573.740	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	147,597.000	63,466.710	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	938,358.000	1,794,140.490	
	NEWRIVER REIT PLC	153,885.000	122,492.460	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	233,467.000	161,559.160	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	625,381.000	595,988.090	

	PRS REIT PLC/THE	210,972.000	224,896.150	
	REGIONAL REIT LTD	80,094.000	99,636.930	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	101,513.000	811,596.430	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	203,492.000	99,711.080	
	SEGRO PLC	617,931.000	4,819,861.800	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	901,211.000	1,213,030.000	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	519,308.000	361,957.670	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	252,776.000	223,201.200	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	156,311.000	100,507.970	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,141,233.000	1,579,466.470	
	UNITE GROUP PLC	191,022.000	1,651,385.190	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	190,244.000	212,692.790	
	WAREHOUSE REIT PLC	182,285.000	153,483.970	
	WORKSPACE GROUP PLC	59,696.000	334,297.600	
イギリス・ボンド 小計		11,432,706.000	23,505,709.630 (4,648,254,079)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	253,300.000	499,001.000	
	REIT 1 LTD	86,702.000	1,512,082.880	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	95,498.000	778,308.700	
イスラエル・シュケル 小計		435,500.000	2,789,392.580 (113,892,015)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	26,298.000	483,357.240	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,895.000	170,999.950	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,548.000	752,810.760	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	37,925.000	1,718,002.500	
	CHOICE PROPERTIES REIT	75,190.000	1,050,404.300	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	21,726.000	319,806.720	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,105.000	337,101.250	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	63,673.000	826,475.540	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	2,585.000	52,992.500	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	49,580.000	888,473.600	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,379.000	1,093,522.950	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	61,557.000	658,659.900	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	30,077.000	326,034.680	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,128.000	517,555.200	

	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,386.000	103,551.720	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,000.000	145,520.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	118,241.900	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	51,343.000	261,335.870	
	PRIMARIS REIT	20,442.000	325,845.480	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	68,718.000	1,301,518.920	
	SLATE GROCERY REIT	12,169.000	169,027.410	
	SMARTCENTRES REIT	33,583.000	839,910.830	
	カナダ・ドル 小計	681,762.000	12,461,149.220 (1,371,598,695)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	476,521.000	993,546.280	
	ニュージーランド・ドル 小計	476,521.000	993,546.280 (90,770,388)	
ユーロ	AEDIFICA	21,984.000	1,291,560.000	
	ALTAREA	2,270.000	236,080.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	15,092.000	186,537.120	
	CARMILA SA	24,586.000	413,044.800	
	COFINIMMO SA	17,680.000	1,028,976.000	
	COVIVIO	24,765.000	1,311,306.750	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,931.000	490,831.950	
	GECINA SA	23,942.000	2,334,345.000	
	HAMBORNER REIT AG	30,630.000	197,257.200	
	ICADE	13,300.000	312,550.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	46,145.970	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	156,462.000	858,194.070	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	222,735.000	192,888.510	
	KLEPIERRE	101,261.000	2,908,215.920	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	20,964.000	172,324.080	
	MERCIALYS	36,398.000	379,631.140	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	181,600.000	1,846,872.000	
	MONTEA SCA	9,714.000	635,295.600	
	NSI NV	7,519.000	148,425.060	
	RETAIL ESTATES	5,100.000	310,590.000	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	12,972.000	529,906.200	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	45,958.000	3,398,134.520	
	WAREHOUSES DE PAUW	81,424.000	1,726,188.800	

	WERELDHAVE NV	14,819.000	210,133.420	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	16,600.000	498,000.000	
ユーロ 小計		1,129,261.000	21,663,434.110 (3,553,669,731)	
韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	71,792.000	337,781,360.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	21,537.000	107,577,315.000	
	JR REIT XXVII	87,309.000	261,927,000.000	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	27,629.000	124,606,790.000	
	LOTTE REIT CO LTD	60,665.000	198,071,225.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	45,243.000	257,432,670.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	16,132.000	1,129,240.000	
	SK REITS CO LTD	66,611.000	302,413,940.000	
韓国・ウォン 小計		396,918.000	1,590,939,540.000 (174,526,068)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	748,070.000	1,361,487.400	
	LINK REIT	1,179,520.000	42,934,528.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	342,000.000	649,800.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	908,000.000	971,560.000	
香港・ドル 小計		3,177,590.000	45,917,375.400 (904,572,295)	
投資証券 合計		27,957,644	95,580,309,591 (95,580,309,591)	
合計			106,056,350,888 (106,056,350,888)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 5銘柄	0.06	-	79.94
	投資証券 136銘柄	-	85.39	
イギリス・ポンド	投資証券 36銘柄	-	4.68	4.38
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-	0.11	0.11
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	7.45	-	6.97
カナダ・ドル	投資証券 22銘柄	-	1.38	1.29
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 22銘柄	2.95	-	2.76
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-	0.09	0.09
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄	0.04	-	3.39
	投資証券 25銘柄	-	3.58	

韓国・ウォン	投資証券	8銘柄	-	0.18	0.16
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.06	-	0.91
	投資証券	4銘柄	-	0.91	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2024年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	582,741,022
コール・ローン	11,539,892,777
国債証券	120,293,503,292
派生商品評価勘定	5,186,475
未収入金	11,096,564,216
未収利息	985,313,934
前払費用	251,291,435
流動資産合計	144,754,493,151
資産合計	144,754,493,151
負債の部	
流動負債	
未払金	19,512,887,467
未払解約金	5,304,000
流動負債合計	19,518,191,467
負債合計	19,518,191,467
純資産の部	
元本等	
元本	50,755,519,162
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	74,480,782,522
元本等合計	125,236,301,684
純資産合計	125,236,301,684
負債純資産合計	144,754,493,151

## 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11月14日 至 2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,140,270,331円
同期中追加設定元本額	44,562,501,333円
同期中一部解約元本額	36,947,252,502円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,961,048,926円
たわらノーロード バランス(堅実型)	193,493,639円
たわらノーロード バランス(標準型)	685,745,656円
たわらノーロード バランス(積極型)	345,498,985円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	593,498円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	5,283,698円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	68,521,889円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	8,396,631円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,206,849円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	62,340,964円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	259,013,945円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	429,785,428円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	859,414,724円
投資のソムリエ	7,804,861,960円
クルーズコントロール	145,005,640円
投資のソムリエ<DC年金>	952,352,312円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	375,026,270円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	961,779,014円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,623,947,777円
ワールドアセットバランス(基本コース)	292,343,538円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	859,527,990円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	95,997,554円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	50,936,168円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	9,623,364円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	299,257,693円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,278,615,400円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	228,024,945円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	109,432,686円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	55,343,689円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	33,575,872円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	8,845,599円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	2,019,324円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	14,647,966円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	62,657円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	23,931,291,798円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	140,529,198円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,168,436,675円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2(適格機関投資家限定)	768,825,223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)	4,030,113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)	64,981,936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)	28,676,620円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,560,175,349円
計	50,755,519,162円
2. 受益権の総数	50,755,519,162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11月14日 至 2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	942,869,403	
合計	942,869,403	

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち		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	11,274,020,000	-	11,279,206,475	5,186,475
合計	11,274,020,000	-	11,279,206,475	5,186,475

## (注)時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,4674円 (24,674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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	3,000,000.000	2,697,300.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	7,000,000.000	5,902,933.750	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	7,000,000.000	5,860,361.500	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	3,000,000.000	2,970,642.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	5,000,000.000	4,556,937.500	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,336,840.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	6,000,000.000	5,584,278.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	5,000,000.000	3,489,890.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	2,000,000.000	1,596,478.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 4.875 04/30/29	4,000,000.000	4,046,547.040	
		ABU DHABI GOVT INT'L 5.5 04/30/54	3,000,000.000	3,062,692.500	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	4,000,000.000	3,940,762.960	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	9,000,000.000	7,976,977.470	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	9,000,000.000	8,194,691.880	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	9,000,000.000	8,653,219.650	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	5,000,000.000	3,657,990.150	
		BRAZIL 6.0 10/20/33	10,000,000.000	9,923,636.000	
		BRAZIL 6.125 01/22/32	7,000,000.000	7,069,110.020	
		BRAZIL 6.125 03/15/34	2,000,000.000	1,980,752.940	
		BRAZIL 6.25 03/18/31	9,000,000.000	9,174,017.340	
BRAZIL 7.125 05/13/54	5,000,000.000	4,987,172.950			

CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	4,000,000.000	3,416,393.760	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,783,205.800	
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	2,000,000.000	1,996,818.460	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	11,000,000.000	9,257,742.450	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	18,000,000.000	14,560,671.600	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	10,000,000.000	7,841,158.300	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	3,000,000.000	1,800,753.720	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	3,000,000.000	3,013,107.990	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	4,000,000.000	4,161,242.800	
COLOMBIA 8.0 11/14/35	5,000,000.000	5,133,837.200	
COLOMBIA 8.75 11/14/53	3,000,000.000	3,131,904.720	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	6,000,000.000	5,601,090.840	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	12,000,000.000	11,069,008.200	
DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41	1,000,000.000	882,152.520	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	11,000,000.000	10,821,167.280	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	6,000,000.000	5,337,099.480	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	6,200,000.000	6,142,186.360	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	4,000,000.000	3,882,681.880	
HUNGARY 2.125 09/22/31	19,000,000.000	15,330,577.500	
HUNGARY 3.125 09/21/51	6,000,000.000	3,752,562.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	9,000,000.000	8,947,971.000	
HUNGARY 6.125 05/22/28	11,000,000.000	11,338,250.000	
HUNGARY 6.25 09/22/32	14,000,000.000	14,492,800.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	5,200,000.000	4,359,893.200	
INDONESIA 3.05 03/12/51	4,000,000.000	2,763,750.000	
INDONESIA 3.4 09/18/29	3,200,000.000	3,022,102.400	
INDONESIA 3.85 10/15/30	7,400,000.000	7,036,530.500	
INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,196,891.990	
INDONESIA 4.2 10/15/50	5,000,000.000	4,264,312.500	
INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,592,342.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	1,000,000.000	1,003,137.500	
INDONESIA 7.75 01/17/38	3,500,000.000	4,353,128.500	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	3,000,000.000	3,028,626.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	8,000,000.000	8,220,636.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	3,000,000.000	3,135,039.750	
PANAMA 2.252 09/29/32	10,000,000.000	7,488,840.500	

PANAMA 3.16 01/23/30	6,000,000.000	5,196,612.600	
PANAMA 4.5 01/19/63	8,000,000.000	5,243,407.760	
PANAMA 4.5 04/01/56	5,000,000.000	3,317,938.900	
PANAMA 6.4 02/14/35	5,000,000.000	4,836,176.350	
PERU 2.78 12/01/60	5,000,000.000	2,819,578.150	
PERU 2.783 01/23/31	14,000,000.000	12,179,615.980	
PERU 3.0 01/15/34	10,000,000.000	8,278,148.100	
PERU 3.55 03/10/51	10,000,000.000	7,105,172.700	
PERU 5.875 08/08/54	1,000,000.000	994,742.290	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	7,000,000.000	4,663,491.000	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	10,000,000.000	7,274,250.000	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	2,200,000.000	1,917,531.220	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	5,200,000.000	4,460,929.660	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	8,000,000.000	6,636,438.720	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	10,200,000.000	9,772,880.100	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	3,000,000.000	1,879,593.480	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	5,000,000.000	3,735,106.150	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	4,000,000.000	2,904,508.160	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	4,200,000.000	3,725,009.140	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	7,000,000.000	5,023,532.640	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	4,000,000.000	3,495,990.120	
REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29	5,000,000.000	5,010,948.950	
REPUBLIC OF CHILE 4.95 01/05/36	2,000,000.000	1,953,566.040	
REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	10,000,000.000	9,979,687.500	
REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	10,000,000.000	9,828,675.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34	9,000,000.000	8,913,341.250	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	10,000,000.000	9,648,680.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	8,000,000.000	7,744,376.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	6,000,000.000	6,157,905.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	13,500,000.000	14,053,520.250	

REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	5,000,000.000	4,923,600.000	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	5,000,000.000	5,260,800.000	
ROMANIA 3.0 02/14/31	10,000,000.000	8,463,972.500	
ROMANIA 4.0 02/14/51	8,000,000.000	5,480,000.000	
ROMANIA 5.875 01/30/29	10,000,000.000	10,033,695.000	
ROMANIA 6.375 01/30/34	5,000,000.000	5,011,700.000	
ROMANIA 6.625 02/17/28	11,000,000.000	11,359,315.000	
ROMANIA 7.125 01/17/33	11,000,000.000	11,646,178.500	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	10,000,000.000	8,139,585.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	2,000,000.000	1,967,445.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	12,200,000.000	11,174,815.700	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	3,000,000.000	1,941,099.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	4,400,000.000	3,098,749.500	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	10,000,000.000	9,842,940.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	7,000,000.000	6,882,503.250	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	3,187,190.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30	4,000,000.000	3,976,384.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	4,000,000.000	4,016,692.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	11,000,000.000	10,885,256.250	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	2,000,000.000	1,765,245.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	16,000,000.000	16,498,896.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54	4,000,000.000	3,901,447.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	23,000,000.000	22,051,825.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	3,000,000.000	2,968,200.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	5,000,000.000	4,813,420.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	3,000,000.000	2,950,110.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	8,000,000.000	6,983,200.000	
STATE OF QATAR 4.75 05/29/34	6,000,000.000	6,070,764.000	

STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	9,000,000.000	8,493,228.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	5,000,000.000	3,372,202.500	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	5,000,000.000	4,790,877.500	
UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	4,000,000.000	4,037,382.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	11,000,000.000	9,165,768.700	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	8,000,000.000	7,138,717.760	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	5,000,000.000	4,096,982.200	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	4,000,000.000	2,358,648.160	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	4,000,000.000	2,427,565.720	
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	7,000,000.000	5,411,945.210	
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	4,000,000.000	2,867,343.200	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	8,000,000.000	5,972,965.280	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	6,000,000.000	5,820,259.860	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	4,000,000.000	3,734,681.160	
UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	3,000,000.000	2,769,433.890	
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	1,000,000.000	795,073.480	
UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/07/36	7,000,000.000	6,824,975.360	
UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	5,000,000.000	4,679,316.100	
UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	8,000,000.000	8,059,277.840	
UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54	3,000,000.000	2,827,406.160	
アメリカ・ドル 小計	872,200,000.000 (133,568,708,000)	785,513,277.340 (120,293,503,292)	
国債証券 合計	133,568,708,000 (133,568,708,000)	120,293,503,292 (120,293,503,292)	
合計		120,293,503,292 (120,293,503,292)	

(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 135銘柄	96.05	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2024年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,952,039,308
コール・ローン	132,720,014
株式	98,664,995,084
投資信託受益証券	515,527,204
投資証券	80,922,500
派生商品評価勘定	55,959,199
未収入金	14,847,318
未収配当金	128,826,524
差入委託証拠金	1,101,887,153
流動資産合計	103,647,724,304
資産合計	103,647,724,304
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,161,099
未払解約金	2,102,000
流動負債合計	74,263,099
負債合計	74,263,099
純資産の部	
元本等	
元本	54,675,783,422
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	48,897,677,783
元本等合計	103,573,461,205
純資産合計	103,573,461,205
負債純資産合計	103,647,724,304

## 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11月14日 至 2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	57,474,248,034円
同期中追加設定元本額	20,716,353,971円
同期中一部解約元本額	23,514,818,583円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	10,631,200,897円
たわらノーロード 新興国株式< ラップ専用 >	5,958,412,593円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,900,110円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	9,685,673円

MITO ラップ型ファンド(積極型)	23,879,176円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	24,752,780円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	27,860,995円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,544,215円
たわらノーロード 新興国株式	15,219,241,198円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	5,368,932,575円
たわらノーロード バランス(堅実型)	31,281,743円
たわらノーロード バランス(標準型)	149,471,437円
たわらノーロード バランス(積極型)	296,811,692円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	93,091円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	491,029円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	103,627,416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)	131,888,893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)	237,839,526円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	11,703円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	8,945,999円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,709,218円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,060,500円
たわらノーロード 全世界株式	4,183,233,061円
One DC 新興国株式インデックスファンド	1,745,628,791円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	385,770,348円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	338,707,275円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	582,696,627円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,156,605,194円
投資のソムリエ	2,717,167,129円
クルーズコントロール	187,079,989円
投資のソムリエ<DC年金>	330,627,570円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	488,663,985円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	385,731,037円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,056,685,343円
ワールドアセットバランス(基本コース)	390,904,444円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,125,099,372円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	42,079,720円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	22,329,099円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,823,198円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	103,729,910円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	606,769,839円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	300,260,187円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	38,277,962円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	24,259,011円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,714,381円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,877,686円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	14,274,795円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	28,249円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	48,969,024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)	1,385,158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)	85,155,078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)	37,607,501円
計	54,675,783,422円

2. 受益権の総数

54,675,783,422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11月14日 至 2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	10,738,038,871

投資信託受益証券	26,867,625
投資証券	6,207,346
合計	10,704,963,900

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

#### 通貨関連

種類	2024年11月11日現在			評価損益（円）
	契約額等（円）	時価（円）		
		うち 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	2,726,269,722	-	2,726,314,062	44,340
	2,726,269,722	-	2,726,314,062	44,340
合計	2,726,269,722	-	2,726,314,062	44,340

（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11月11日現在			評価損益（円）
	契約額等（円）	時価（円）		
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	7,055,568,300	-	7,039,322,060	16,246,240
合計	7,055,568,300	-	7,039,322,060	16,246,240

（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11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8943円 (18,943円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年11月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	14,076	12.180	171,445.680	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	5,400	185.000	999,000.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,986	107.110	748,270.460	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	219,522	1.590	349,039.980	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	2.220	197,580.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	61,882	1.669	103,281.050	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	71,084	0.000	0.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	16,003	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC GDR	7,413	0.000	0.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,953	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC	7,574	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	107,951	0.000	0.000	
	SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000	
	TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000	
	VTB BANK PJSC	60,800	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,573	13.970	427,104.810	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	35,582	11.200	398,518.400	
	VK CO LTD GDR	9,858	0.000	0.000	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	897,112	0.000	0.000	
PHOSAGRO PJSC GDR	18,163	0.000	0.000		
H WORLD GROUP LTD ADR	16,409	37.000	607,133.000		
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000		

	QIFU TECHNOLOGY INC ADR	10,000	31.200	312,000.000	
	PAGSEGURO DIGITAL LTD	15,706	8.120	127,532.720	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	59,863	11.390	681,839.570	
	STONECO LTD	20,058	11.300	226,655.400	
	AUTOHOME INC ADR	4,983	27.900	139,025.700	
	XP INC	29,992	17.070	511,963.440	
	KANZHUN LTD ADR	21,614	14.890	321,832.460	
	KE HOLDINGS INC ADR	52,192	20.990	1,095,510.080	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,782	40.030	231,453.460	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS	239,195	15.230	3,642,939.850	
	INTER & CO INC	19,206	6.410	123,110.460	
	PDD HOLDINGS INC ADR	56,021	117.810	6,599,834.010	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	31,586	49.310	1,557,505.660	
	IQIYI INC ADR	33,439	2.340	78,247.260	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
アメリカ・ドル	小計	3,468,948		19,650,823.450 (3,009,327,103)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	118,172	12.620	1,491,330.640	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	243,692	6.360	1,549,881.120	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	284,657	17.640	5,021,349.480	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	230,790	9.500	2,192,505.000	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	350,911	13.300	4,667,116.300	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	532,492	8.830	4,701,904.360	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	323,840	7.900	2,558,336.000	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	151,332	19.200	2,905,574.400	
	ADNOC DRILLING CO PJSC	250,812	5.260	1,319,271.120	
	MULTIPLY GROUP	279,807	2.250	629,565.750	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC - FOREIGN CO	250,589	2.430	608,931.270	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	268,290	3.600	965,844.000	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	3,285,384		28,611,609.440 (1,194,820,810)	
インド・ル ピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	491,698	1,283.750	631,217,307.500	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	118,378	310.450	36,750,450.100	
	ASIAN PAINTS LTD	30,691	2,769.450	84,997,189.950	
	BANK OF BARODA	82,954	256.600	21,285,996.400	

EICHER MOTORS LTD	11,149	4,785.250	53,350,752.250	
GRASIM INDUSTRIES LTD	21,488	2,544.850	54,683,736.800	
HDFC BANK LTD	343,894	1,754.450	603,344,828.300	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,480	2,974.900	224,545,452.000	
SHREE CEMENT LTD	759	24,533.000	18,620,547.000	
ICICI BANK LTD	419,311	1,258.850	527,849,652.350	
INDUSIND BANK LTD	21,721	1,053.800	22,889,589.800	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	77,008	383.050	29,497,914.400	
STATE BANK OF INDIA LTD	144,138	843.150	121,529,954.700	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	19,695	827.400	16,295,643.000	
TATA STEEL LTD	609,848	147.570	89,995,269.360	
TATA MOTORS LTD	162,221	805.450	130,660,904.450	
JSW STEEL LTD	47,396	996.400	47,225,374.400	
TATA COMMUNICATIONS LTD	8,325	1,774.650	14,773,961.250	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	46,699	992.950	46,369,772.050	
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,047	10,488.300	21,469,550.100	
TATA POWER CO LTD	116,480	432.750	50,406,720.000	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,690	5,747.150	49,942,733.500	
NESTLE INDIA LTD	27,443	2,295.650	62,999,522.950	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	82,126	239.040	19,631,399.040	
GAIL INDIA LTD	184,426	204.170	37,654,256.420	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	88,970	1,745.800	155,323,826.000	
VEDANTA LTD	110,399	457.900	50,551,702.100	
SUPREME INDUSTRIES LTD	5,257	4,597.850	24,170,897.450	
AXIS BANK LTD	184,556	1,160.950	214,260,288.200	
TITAN COMPANY LTD	28,558	3,186.250	90,992,927.500	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	253,743	262.550	66,620,224.650	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,612	2,870.900	33,336,890.800	
BHARAT ELECTRONICS LTD	294,208	297.750	87,600,432.000	
LUPIN LTD	17,611	2,104.600	37,064,110.600	
NMDC LTD	81,582	235.970	19,250,904.540	
MPHASIS LTD	7,850	2,858.350	22,438,047.500	
BAJAJ FINANCE LTD	22,600	6,895.950	155,848,470.000	
INFOSYS LTD	268,642	1,829.950	491,601,427.900	
WIPRO LTD	105,400	569.000	59,972,600.000	
TATA ELXSI LTD	2,960	6,940.800	20,544,768.000	
MRF LTD	175	119,354.300	20,887,002.500	
INDIAN OIL CORP LTD	231,980	140.340	32,556,073.200	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	66,717	2,507.700	167,306,220.900	
TRENT LTD	14,859	6,298.950	93,596,098.050	

APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,212	7,421.400	60,944,536.800	
CUMMINS INDIA LTD	11,753	3,655.350	42,961,328.550	
HCL TECHNOLOGIES LTD	75,976	1,837.500	139,605,900.000	
DABUR INDIA LTD	46,381	531.500	24,651,501.500	
HERO MOTOCORP LTD	9,704	4,768.900	46,277,405.600	
SRF LTD	11,493	2,305.950	26,502,283.350	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,405	2,829.050	18,120,065.250	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	47,940	1,283.650	61,538,181.000	
BHARTI AIRTEL LTD	205,855	1,569.900	323,171,764.500	
PUNJAB NATIONAL BANK LTD	175,051	104.790	18,343,594.290	
ORACLE FINANCIAL SERVICES SOFTWARE LTD	1,746	11,518.150	20,110,689.900	
UNITED SPIRITS LTD	22,698	1,448.650	32,881,457.700	
UNION BANK OF INDIA LTD	119,319	117.520	14,022,368.880	
CANARA BANK	149,548	103.690	15,506,632.120	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	77,006	1,809.600	139,350,057.600	
DIVI'S LABORATORIES LTD	10,063	5,949.850	59,873,340.550	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,122	11,303.000	114,408,966.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	21,722	1,327.550	28,837,041.100	
HAVELLS INDIA LTD	19,728	1,660.650	32,761,303.200	
TVS MOTOR COMPANY LTD	19,342	2,467.900	47,734,121.800	
JINDAL STEEL & POWER LTD	27,284	928.050	25,320,916.200	
JINDAL STAINLESS LTD	27,489	710.300	19,525,436.700	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	218,936	176.080	38,550,250.880	
SHRIRAM FINANCE LTD	22,941	3,007.950	69,005,380.950	
PETRONET LNG LTD	61,507	328.900	20,229,652.300	
CIPLA LTD/INDIA	42,866	1,592.600	68,268,391.600	
LARSEN & TOUBRO LTD	54,568	3,660.300	199,735,250.400	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,165	11,043.350	101,212,302.750	
ASHOK LEYLAND LTD	121,319	221.890	26,919,472.910	
BOSCH LTD	592	35,119.400	20,790,684.800	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	73,032	4,147.000	302,863,704.000	
ADANI ENTERPRISES LTD	12,036	2,929.100	35,254,647.600	
NTPC LTD	350,103	397.650	139,218,457.950	
YES BANK LTD	1,178,292	20.160	23,754,366.720	
AMBUJA CEMENTS LTD	48,912	564.900	27,630,388.800	
BHARAT FORGE LTD	21,319	1,420.050	30,274,045.950	
SUZLON ENERGY LTD	778,252	62.500	48,640,750.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	108,877	650.450	70,819,044.650	
ITC LTD	243,422	478.050	116,367,887.100	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,991	3,125.700	37,480,268.700	

UNITED PHOSPHORUS LTD	38,855	557.600	21,665,548.000	
SUNDARAM FINANCE LTD	5,486	4,553.000	24,977,758.000	
PHOENIX MILLS LTD	16,344	1,476.900	24,138,453.600	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,201	3,199.850	26,241,969.850	
THERMAX LTD	3,487	5,131.000	17,891,797.000	
SIEMENS INDIA LTD	7,243	7,174.350	51,963,817.050	
INFO EDGE INDIA LTD	6,037	7,654.600	46,210,820.200	
GMR INFRASTRUCTURE LTD	191,362	80.290	15,364,454.980	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	50,227	716.250	35,975,088.750	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	33,447	1,251.050	41,843,869.350	
TECH MAHINDRA LTD	44,064	1,681.350	74,087,006.400	
INDIAN HOTELS CO LTD	70,981	732.900	52,021,974.900	
TORRENT POWER LTD	13,970	1,694.100	23,666,577.000	
VODAFONE IDEA LTD	1,888,461	7.880	14,881,072.680	
MARICO LTD	39,330	629.850	24,772,000.500	
POWER FINANCE CORP LTD	120,494	449.400	54,150,003.600	
PAGE INDUSTRIES LTD	508	48,002.900	24,385,473.200	
ABB LTD/INDIA	4,375	7,045.450	30,823,843.750	
DLF LTD	58,079	786.000	45,650,094.000	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	373,975	316.250	118,269,593.750	
NHPC LTD	249,136	82.350	20,516,349.600	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	8,682	5,668.700	49,215,653.400	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,728	1,362.100	58,199,808.800	
REC LTD	107,503	514.550	55,315,668.650	
BAJAJ FINSERV LTD	29,864	1,739.750	51,955,894.000	
BAJAJ AUTO LTD	5,635	9,910.400	55,845,104.000	
JUBILANT FOODWORKS LTD	30,266	607.250	18,379,028.500	
ADANI POWER LTD	63,076	589.000	37,151,764.000	
OIL INDIA LTD	39,185	508.550	19,927,531.750	
MUTHOOT FINANCE LTD	9,935	1,804.550	17,928,204.250	
PRESTIGE ESTATES PROJECTS LTD	11,287	1,579.850	17,831,766.950	
JSW ENERGY LTD	28,936	712.050	20,603,878.800	
COAL INDIA LTD	148,409	424.050	62,932,836.450	
INDUS TOWERS LTD	96,139	326.200	31,360,541.800	
PI INDUSTRIES LTD	6,463	4,562.450	29,487,114.350	
VARUN BEVERAGES LTD	91,612	591.550	54,193,078.600	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	8,731	3,890.550	33,968,392.050	
LTIMINDTREE LTD	6,071	5,926.950	35,982,513.450	
ADANI GREEN ENERGY LTD	25,426	1,598.550	40,644,732.300	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	78,639	708.500	55,715,731.500	

	AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,495	580.650	17,706,921.750	
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	16,100	4,400.600	70,849,660.000	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,421	4,484.550	33,279,845.550	
	GODREJ PROPERTIES LTD	9,790	2,685.200	26,288,108.000	
	POLYCAB INDIA LTD	4,354	6,725.800	29,284,133.200	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	33,361	1,260.700	42,058,212.700	
	RAIL VIKAS NIGAM LTD	42,297	447.950	18,946,941.150	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	22,115	699.400	15,467,231.000	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	18,362	832.500	15,286,365.000	
	ZOMATO LTD	537,478	248.730	133,686,902.940	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	24,489	1,170.300	28,659,476.700	
	MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	64,064	1,079.250	69,141,072.000	
	DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	2,645	15,621.100	41,317,809.500	
	APL APOLLO TUBES LTD	12,592	1,520.700	19,148,654.400	
	SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	32,684	704.000	23,009,536.000	
	PB FINTECH LTD	24,230	1,678.700	40,674,901.000	
	MANKIND PHARMA LTD	8,411	2,659.500	22,369,054.500	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	228,797	316.050	72,311,291.850	
	ASTRAL POLYTECHNIK LTD	10,569	1,788.800	18,905,827.200	
	ZYDUS LIFESCIENCES LTD	19,977	970.350	19,384,681.950	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	12,852	3,874.500	49,795,074.000	
	IDFC BANK LTD	288,299	65.630	18,921,063.370	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	18,897	1,910.150	36,096,104.550	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	30,106	710.350	21,385,797.100	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	14,217	4,002.950	56,909,940.150	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	2,247	10,149.600	22,806,151.200	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	35,181	1,569.950	55,232,410.950	
インド・ルピー	小計	15,029,390		10,106,435,208.080 (18,393,712,079)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	2,181,173	940.000	2,050,302,620.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	112,201	27,450.000	3,079,917,450.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	364,000	7,700.000	2,802,800,000.000	

	UNILEVER INDONESIA TBK PT	591,600	1,760.000	1,041,216,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,654,200	4,960.000	8,204,832,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,947,700	2,750.000	10,856,175,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	620,600	4,860.000	3,016,116,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	192,100	7,300.000	1,402,330,000.000	
	BANK MANDIRI	3,023,800	6,325.000	19,125,535,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,522,400	4,520.000	24,961,248,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,203,900	4,980.000	5,995,422,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,953,000	1,540.000	3,007,620,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,463,000	10,075.000	44,964,725,000.000	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	633,400	7,275.000	4,607,985,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,190,100	3,830.000	4,558,083,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	194,100	12,100.000	2,348,610,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,482,800	3,130.000	4,641,164,000.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	74,896,200	63.000	4,718,460,600.000	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL PT	528,400	9,000.000	4,755,600,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	794,082	2,240.000	1,778,743,680.000	
	インドネシア・ルピア 小計	105,548,756		157,916,885,350.000 (1,547,585,476)	
オフショア・ 人民元	EVE ENERGY CO LTD	14,732	51.470	758,256.040	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	78.450	455,010.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	40.310	239,441.400	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	13.200	158,400.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	5,180	36.000	186,480.000	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	16.200	197,640.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	48.870	855,225.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	18,640	28.210	525,834.400	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	14.450	275,995.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	66.080	79,296.000	

SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	23.600	382,320.000	
HUAGONG TECH CO LTD	2,200	39.800	87,560.000	
CHANGCHUN HIGH-TECH INDUSTRY GROUP CO LTD	2,100	113.080	237,468.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	25.080	295,944.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	27.890	225,909.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	30.650	426,035.000	
SHANJIN INTERNATIONAL GOLD CO LTD	23,900	16.780	401,042.000	
GEM CO LTD	29,100	7.390	215,049.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	4.870	282,947.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	21.550	364,195.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	8,260	87.350	721,511.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	8.600	134,099.800	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,812	23.610	137,221.320	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	17.910	239,277.600	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	31.390	160,089.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	49.300	458,490.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	24.100	250,640.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	1,000	36.880	36,880.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	24,000	44.890	1,077,360.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	8,950	30.570	273,601.500	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	8.600	154,800.000	
TIANQI LITHIUM CORP	4,300	37.980	163,314.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	22.360	250,432.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	10.650	264,120.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	13.640	192,324.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	33.630	403,560.000	

HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	17.550	136,890.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	9.980	514,469.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	7,800	48.860	381,108.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,239	71.150	159,304.850	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	11,470	51.710	593,113.700	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	12.230	155,321.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	39,729	16.070	638,445.030	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	37.270	402,516.000	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	500	32.430	16,215.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	13.050	90,045.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	33,100	8.190	271,089.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	60.290	295,421.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	12.680	194,004.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	6,200	36.040	223,448.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	38.640	193,200.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	70,900	3.600	255,240.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	16.560	263,304.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	24.530	240,394.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,600	151.000	1,147,600.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	4,800	62.530	300,144.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	11.570	158,219.750	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	42.470	386,477.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	303.800	1,093,680.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.860	250,252.800	

BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	9.170	131,131.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	31,154	40.300	1,255,506.200	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	19.370	579,163.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	7.490	534,037.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	10.280	204,572.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	17.290	330,239.000	
IFLYTEK CO LTD	7,900	48.200	380,780.000	
GOERTEK INC	25,100	23.010	577,551.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	9.210	196,173.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	26.160	920,832.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	30,200	22.010	664,702.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	54,420	5.240	285,160.800	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.620	215,646.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	14.140	572,500.320	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	10.000	227,000.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,300	25.440	312,912.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	60.610	637,617.200	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	77,918	28.240	2,200,404.320	
JIANGSU YANGHE DISTILLERY CO LTD	7,800	91.850	716,430.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	18,600	156.470	2,910,342.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	58,900	7.710	454,119.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	137,400	4.630	636,162.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	12.010	551,259.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	44.250	535,425.000	
MIDEA GROUP CO LTD	16,200	72.580	1,175,796.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	12.930	546,939.000	
PING AN BANK CO LTD	97,200	11.720	1,139,184.000	

WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	24,480	19.300	472,464.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	113,500	5.850	663,975.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	9.510	524,001.000	
ZTE CORP	16,500	32.780	540,870.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	7.430	211,755.000	
WEICHAI POWER CO LTD	44,200	14.140	624,988.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	38.190	160,398.000	
GF SECURITIES CO LTD	15,300	17.870	273,411.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	11.190	236,109.000	
BYD CO LTD	8,400	297.900	2,502,360.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	8.620	293,942.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	22.010	212,616.600	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	43.420	226,652.400	
LB GROUP CO LTD	11,000	19.720	216,920.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	8.480	362,944.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	14.660	186,182.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,200	447.750	985,050.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	6.700	201,670.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	33.520	429,056.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	8.120	277,704.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	212.400	361,080.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	6.570	102,492.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	36.500	240,900.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	53.410	32,046.000	
NINESTAR CORP	10,400	30.650	318,760.000	
HISENSE HOME APPLIANCES GROUP CO LTD	5,700	31.600	180,120.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	8.880	339,216.000	

HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	19.660	332,254.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	86.300	157,066.000	
SF HOLDING CO LTD	24,400	44.920	1,096,048.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	72.970	182,425.000	
ELOPTOLINK TECHNOLOGY INC LTD	3,900	129.920	506,688.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	80,290	8.140	653,560.600	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	10.840	421,676.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	82,800	7.600	629,280.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	53.500	123,050.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	28,900	30.700	887,230.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	18.960	122,500.560	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	24,800	15.290	379,192.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	13.890	312,525.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	18.740	286,309.720	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	41.070	181,118.700	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,700	37.900	140,230.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	72.360	151,956.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	36.000	328,176.000	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	15.820	150,290.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	4,340	142.210	617,191.400	
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY NETWORK & TECHNOLOGY HOLDINGS CO LTD	27,500	11.760	323,400.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	100	67.340	6,734.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	3,340	107.830	360,152.200	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	134.980	404,940.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	38.180	183,264.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	34.520	107,012.000	

CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	9.060	115,062.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	61.220	146,928.000	
HUANENG LANCANG RIVER HYDROPOWER INC	19,000	9.790	186,010.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	15.780	336,114.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	140	50.980	7,137.200	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	21.730	256,414.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	57,600	25.980	1,496,448.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,800	284.210	1,648,418.000	
SG MICRO CORP	3,395	94.690	321,472.550	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	21,540	257.500	5,546,550.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	95.480	287,967.680	
WUXI APPTPEC CO LTD	13,972	56.120	784,108.640	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	30,200	9.690	292,638.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	25.100	258,530.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,400	5.580	130,572.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	4.070	335,775.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	45.440	331,712.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	102.760	263,065.600	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	25,300	16.430	415,679.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	30.550	226,833.750	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,540	203.270	313,035.800	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	72.170	79,387.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	50.340	126,856.800	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	217.150	651,450.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	70.630	381,402.000	

CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	53,400	6.760	360,984.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	28,700	11.910	341,817.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	5,030	111.660	561,649.800	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.910	332,613.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	3.080	217,756.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	35.060	375,142.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	9.260	229,648.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	57.200	165,880.000	
CGN POWER CO LTD	69,500	4.140	287,730.000	
CITIC PACIFIC SPECIAL STEEL GROUP CO LTD	21,200	12.510	265,212.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	199,300	5.670	1,130,031.000	
GONEO GROUP CO LTD	2,755	76.470	210,674.850	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	89.690	287,008.000	
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO LTD	2,800	137.700	385,560.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	119.610	183,720.960	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	5,520	27.300	150,696.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	117,600	5.290	622,104.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	12.620	265,020.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	67.500	216,000.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	9.220	401,070.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	70.380	98,532.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	37.290	227,469.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	18.150	210,031.800	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	7.370	262,372.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	6,577	73.810	485,448.370	

SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	68.550	198,795.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	94.860	246,636.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,900	38.110	301,069.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	53.890	247,894.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	4,000	130.620	522,480.000	
PIOTECH INC	876	188.780	165,371.280	
RANGE INTELLIGENT COMPUTING TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9,100	33.980	309,218.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	8.940	359,388.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,200	431.000	948,200.000	
ANKER INNOVATIONS TECHNOLOGY CO LTD	3,400	87.600	297,840.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,540	237.000	364,980.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	4,480	102.390	458,707.200	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	282.320	690,837.040	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	23.110	439,090.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	1,176	218.910	257,438.160	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	30.040	258,344.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.510	465,856.000	
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	16,800	41.980	705,264.000	
PETROCHINA CO LTD	117,300	8.250	967,725.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	305,700	6.110	1,867,827.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	413,100	4.760	1,966,356.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	4.860	952,560.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	160,800	6.330	1,017,864.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	48.950	675,510.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,900	40.190	1,362,441.000	

CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	93,700	38.800	3,635,560.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	51,800	59.120	3,062,416.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	99,900	18.700	1,868,130.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	166,700	10.060	1,677,002.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	133,400	3.930	524,262.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	13.430	570,775.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	6,000	1,609.970	9,659,820.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	194,300	7.220	1,402,846.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	59,700	34.880	2,082,336.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,200	38.090	1,531,218.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	6.050	231,715.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	117,200	27.620	3,237,064.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	6.750	557,550.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	3.490	803,747.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	168,300	6.300	1,060,290.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	12.480	692,640.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	7.150	505,505.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	29,600	30.130	891,848.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	138,300	5.690	786,927.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	124,800	5.190	647,712.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	117,500	6.830	802,525.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	27.120	629,184.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	21.340	881,342.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	7.320	431,880.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	27.230	318,591.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	55,700	11.180	622,726.000	
CRRIC CORP LTD	108,900	8.600	936,540.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	32,652	49.500	1,616,274.000	

CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	25.830	449,442.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	19.800	797,940.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	85,600	6.800	582,080.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,600	55.700	367,620.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	25,700	29.150	749,155.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	45,600	18.500	843,600.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.880	494,344.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	8.000	449,600.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	27.460	340,504.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	7.870	207,768.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	38,100	14.200	541,020.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	14,500	81.560	1,182,620.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	12.300	968,010.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GENERATION CO LTD	81,400	3.020	245,828.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	103,500	17.090	1,768,815.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	9.610	529,511.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	15.180	579,876.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	41,712	27.300	1,138,737.600	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.640	168,072.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	75.800	742,840.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	8.550	264,195.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	2.200	489,500.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	73.540	323,576.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	76,300	8.500	648,550.000	
AIR CHINA LTD	44,800	7.720	345,856.000	
TBEA CO LTD	24,180	14.450	349,401.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	8.350	363,225.000	

METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	3.530	198,386.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	5.910	615,822.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	21,200	37.510	795,212.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,600	36.530	423,748.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	29.570	204,033.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	23.170	345,233.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	5.230	179,389.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	5,800	16.580	96,164.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	25,200	9.820	247,464.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	10.270	338,910.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	17.190	407,403.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	19.800	225,720.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	47.230	439,239.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.190	583,887.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	20,450	5.540	113,293.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	72,870	14.850	1,082,119.500	
CMOC GROUP LIMITED	79,800	8.100	646,380.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	31,700	13.200	418,440.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	7.030	237,614.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	42.690	384,210.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	25.470	512,456.400	
JIANGSU PHOENIX PUBLISHING & MEDIA CORP LTD	12,400	10.400	128,960.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	23.460	182,988.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	11.520	319,104.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	2.230	598,309.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	27,300	16.120	440,076.000	

YUTONG BUS CO LTD	6,000	23.260	139,560.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	8.380	359,502.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	4.020	319,590.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	16.220	243,608.180	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	5.760	334,080.000	
CHINA XD ELECTRIC CO LTD	25,700	9.010	231,557.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	16,400	15.610	256,004.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	31.660	324,958.240	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	12.580	204,425.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	21.700	71,610.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	6.300	284,130.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	57.250	583,950.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.810	185,409.000	
YOUNGOR FASHION CO LTD	25,600	7.720	197,632.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	43.800	201,480.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	8.790	147,672.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	800	21.900	17,520.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	14,200	12.560	178,352.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	7.890	176,341.500	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.950	195,030.000	
HISENSE VISUAL TECHNOLOGY CO LTD	9,300	21.800	202,740.000	
WESTERN MINING CO LTD	15,100	18.700	282,370.000	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,500	254.500	636,250.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	6,080	226.100	1,374,688.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	6.870	390,216.000	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-TECH PARK DEVELOPMENT CO LTD	16,400	32.860	538,904.000	

CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	1,250	65.700	82,125.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	22.090	448,427.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	4.410	128,772.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	3,240	22.530	72,997.200	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	17.300	217,980.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	15,900	13.070	207,813.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.740	301,368.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	7.860	373,035.600	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	23.410	297,307.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	18.580	108,321.400	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	10.070	196,365.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	11.080	248,192.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	15,400	22.120	340,648.000	
SHANXI COAL INTERNATIONAL ENERGY GROUP CO LTD	11,100	13.800	153,180.000	
TONGWEI CO LTD	17,000	30.090	511,530.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	12,784	29.560	377,895.040	
JCET GROUP CO LTD	10,900	43.610	475,349.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	30.390	206,652.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	65.250	163,125.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	24.240	254,277.600	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	11.640	235,663.440	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	3,924	57.110	224,099.640	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	18.580	364,168.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	14.740	290,378.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	12.780	200,646.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	2,210	60.120	132,865.200	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	37.380	183,162.000	

NINGBO SANXING MEDICAL ELECTRIC CO LTD	9,004	31.090	279,934.360	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	2,100	44.030	92,463.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	2,156	88.790	191,431.240	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	1,300	217.970	283,361.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	63.970	102,352.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	53.140	377,294.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	26.060	289,266.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	4.840	734,712.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	30.470	353,452.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	52,200	7.930	413,946.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	7,760	51.090	396,458.400	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	12,200	136.990	1,671,278.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	44,968	19.230	864,734.640	
HUAI BEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	15.820	200,914.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	137.410	247,338.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	5.880	431,004.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	700	32.540	22,778.000	
HEILAN HOME CO LTD	44,100	6.100	269,010.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	45,651	24.200	1,104,754.200	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	25,519	48.790	1,245,072.010	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	4,400	47.490	208,956.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	12.820	169,224.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	10,150	52.680	534,702.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	1,000	13.520	13,520.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	20.970	853,479.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	10.080	1,058,400.000	

	ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	42.900	145,860.000	
	SERES GROUP CO LTD	9,000	134.220	1,207,980.000	
	ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	65.580	347,574.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	9.130	759,616.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	33,900	13.990	474,261.000	
	SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	20.100	229,140.000	
	AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	46.190	64,666.000	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	21,200	17.210	364,852.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	16.350	497,040.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	8.340	352,782.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	19.500	358,800.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,616	17.610	98,897.760	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,804	25.830	124,087.320	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	53.830	158,260.200	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	21.400	242,034.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	15,900	11.530	183,327.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	57.800	381,480.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	18.850	301,600.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	31.450	141,525.000	
	オフショア・人民元 小計	12,594,601		199,784,837.360 (4,249,803,082)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	366,689	17.350	6,362,054.150	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	268,621	4.240	1,138,953.040	
	OOREDOO QSC	60,920	11.770	717,028.400	
	QATAR FUEL QSC	46,222	15.260	705,347.720	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,416	16.200	606,139.200	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	83,628	10.750	899,001.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	123,793	13.490	1,669,967.570	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	145,929	21.100	3,079,101.900	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	239,235	4.330	1,035,887.550	
	MASRAF AL RAYAN	479,150	2.399	1,149,480.850	

	BARWA REAL ESTATE CO	190,141	2.889	549,317.340	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	429,105	1.575	675,840.370	
	DUKHAN BANK	131,518	3.743	492,271.870	
カタール・リアル 小計		2,602,367		19,080,390.960 (803,093,656)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	836,149	0.730	610,388.770	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	152,316	0.459	69,913.040	
	GULF BANK KSCP	154,340	0.315	48,617.100	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	647,282	0.859	556,015.230	
	MABANEE CO KPSC	49,098	0.829	40,702.240	
	BOUBYAN BANK KSCP	113,874	0.563	64,111.060	
クウェート・ディナール 小計		1,953,059		1,389,747.440 (694,373,411)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	31,105	17,440.000	542,471,200.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,049	37,700.000	755,847,300.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	39,539	35,380.000	1,398,889,820.000	
コロンビア・ペソ 小計		90,693		2,697,208,320.000 (94,674,709)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	21,587	40.100	865,638.700	
	JARIR MARKETING CO	45,430	13.660	620,573.800	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	5,690	132.800	755,632.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	31,195	52.300	1,631,498.500	
	SAUDI BRITISH BANK	80,349	34.250	2,751,953.250	
	AL RAJHI BANK	158,927	93.800	14,907,352.600	
	ARAB NATIONAL BANK	74,025	19.520	1,444,968.000	
	BANK ALBILAD	48,216	38.000	1,832,208.000	
	BANK AL-JAZIRA	37,396	16.840	629,748.640	
	BANQUE SAUDI FRANSI	47,579	32.400	1,541,559.600	
	RIYAD BANK	120,931	26.400	3,192,578.400	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	56,260	13.920	783,139.200	
	SAUDI TELECOM CO	162,904	42.300	6,890,839.200	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,317	115.800	2,121,108.600	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	73,284	72.000	5,276,448.000	
	SAUDI ELECTRICITY CO	70,794	16.840	1,192,170.960	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	27,847	17.980	500,689.060	
	SAVOLA GROUP	44,492	25.600	1,138,995.200	
ALMARAI CO JSC	19,978	55.200	1,102,785.600		
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,121	263.800	823,319.800		

	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	30,296	26.450	801,329.200	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,164	36.050	366,412.200	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	60,476	7.750	468,689.000	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	38,509	16.900	650,802.100	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	36,059	10.480	377,898.320	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,510	193.000	1,256,430.000	
	ALINMA BANK	100,733	28.300	2,850,743.900	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	105,148	52.100	5,478,210.800	
	AL RAJHI CO FOR CO- OPERATIVE INSURANCE	3,239	169.000	547,391.000	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,975	93.700	747,257.500	
	DALLAH HEALTHCARE CO	2,553	154.600	394,693.800	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	351,627	28.050	9,863,137.350	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	6,966	282.000	1,964,412.000	
	ACWA POWER CO	11,887	421.000	5,004,427.000	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	3,981	117.400	467,369.400	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	1,686	259.400	437,348.400	
	NAHDI MEDICAL CO	3,277	124.000	406,348.000	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,900	243.200	948,480.000	
	ELM CO	1,959	1,080.000	2,115,720.000	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	6,635	58.200	386,157.000	
	ADES HOLDING CO	26,333	19.720	519,286.760	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	2,057	277.800	571,434.600	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	238,281	32.950	7,851,358.950	
	サウジアラビア・リアル 小計	2,208,573		94,478,544.390 (3,858,503,753)	
タイ・パーツ	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	303,000	21.000	6,363,000.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	45,400	148.500	6,741,900.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL- NVDR	1,667,200	1.790	2,984,288.000	
	SHIN CORP PCL	70,700	102.500	7,246,750.000	

	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	24.400	7,320,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	94,100	283.000	26,630,300.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	516,920	9.700	5,014,124.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	250,000	155.000	38,750,000.000	
	PTT PCL	783,400	33.250	26,048,050.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	80,500	46.250	3,723,125.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	65,050	197.000	12,814,850.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	347,800	61.000	21,215,800.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	156,500	62.250	9,742,125.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	911,100	26.500	24,144,150.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	46,800	231.000	10,810,800.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	274,010	26.250	7,192,762.500	
	THAI OIL PCL NVDR	89,000	42.750	3,804,750.000	
	CP ALL PCL NVDR	480,400	64.000	30,745,600.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	110,445	127.500	14,081,737.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	183,408	27.000	4,952,016.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	629,900	7.700	4,850,230.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	253,500	64.750	16,414,125.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	158,333	31.250	4,947,906.250	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	97,800	23.500	2,298,300.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	208,600	14.500	3,024,700.000	
	SCB X PCL NVDR	67,700	115.000	7,785,500.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	896,328	12.000	10,755,936.000	
	CP AXTRA PCL NVDR	157,001	35.000	5,495,035.000	
	タイ・パーツ 小計	9,244,895		325,897,860.250 (1,456,763,435)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,881	823.000	4,840,063.000	
	CEZ	13,485	907.500	12,237,637.500	
	MONETA MONEY BANK AS	23,959	118.400	2,836,745.600	
チェコ・コルナ	小計	43,325		19,914,446.100 (129,368,225)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,279,808	47.240	249,418,129.920	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	7,027	28,744.000	201,984,088.000	

	BANCO DE CHILE	3,896,607	112.990	440,277,624.930	
	EMPRESAS CMPC SA	84,902	1,570.000	133,296,140.000	
	EMPRESAS COPEC SA	29,969	6,065.000	181,761,985.000	
	ENEL AMERICAS SA	1,683,461	89.510	150,686,594.110	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	13,823,587	13.180	182,194,876.660	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	11,501	35,100.000	403,685,100.000	
	FALABELLA SA	63,470	3,450.000	218,971,500.000	
	CENCOSUD SA	116,272	1,936.600	225,172,355.200	
	ENEL CHILE SA	1,930,415	54.480	105,169,009.200	
チリ・ペソ 小計		26,927,019		2,492,617,403.020 (393,207,903)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	260,091	51.200	13,316,659.200	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	16,795	203.800	3,422,821.000	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	108,854	65.250	7,102,723.500	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	107,671	51.100	5,501,988.100	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,691	1,050.000	5,975,550.000	
	KOC HOLDING AS	59,863	171.400	10,260,518.200	
	SASA POLYESTER SANAYI	841,840	3.830	3,224,247.200	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	109,000	40.800	4,447,200.000	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	9,553	192.700	1,840,863.100	
	TURK HAVA YOLLARI	44,686	290.250	12,970,111.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	105,442	91.400	9,637,398.800	
	TURKIYE IS BANKASI	657,193	11.800	7,754,877.400	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	79,870	146.900	11,732,903.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	281,190	25.340	7,125,354.600	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	82,771	83.000	6,869,993.000	
	COCA-COLA ICECEK AS	69,740	45.700	3,187,118.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	36,989	493.500	18,254,071.500	
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	16,769	240.100	4,026,236.900		
トルコ・リラ 小計		2,894,008		136,650,635.000 (609,530,157)	
ハンガリー・ フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	11,886	10,870.000	129,200,820.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	32,609	2,638.000	86,022,542.000	
	OTP BANK NYRT	18,316	19,950.000	365,404,200.000	
ハンガリー・フォロント 小計		62,811		580,627,562.000 (234,009,165)	

フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	496,800	31.000	15,400,800.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	144,448	138.000	19,933,824.000	
	AYALA CORP	21,463	692.000	14,852,396.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	79,760	392.600	31,313,776.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	204,960	24.000	4,919,040.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	34,240	260.000	8,902,400.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	153,485	76.500	11,741,602.500	
	BDO UNIBANK INC	189,682	147.000	27,883,254.000	
	PLDT INC	5,690	1,400.000	7,966,000.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	843,375	28.600	24,120,525.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	75,450	98.500	7,431,825.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,383	916.000	17,754,828.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,420	492.000	12,014,640.000	
	フィリピン・ペソ 小計	2,293,156		204,234,910.500 (536,627,227)	
ブラジル・リアル	BRF SA	49,200	24.100	1,185,720.000	
	VALE SA	275,289	60.630	16,690,772.070	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	83,500	9.380	783,230.000	
	RAIA DROGASIL SA	102,064	25.450	2,597,528.800	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,450	40.160	821,272.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	96,400	35.640	3,435,696.000	
	BANCO DO BRASIL SA	136,600	25.990	3,550,234.000	
	ITAUSA SA	440,107	10.690	4,704,743.830	
	GERDAU SA	111,337	20.460	2,277,955.020	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	302,010	39.080	11,802,550.800	
	VIBRA ENERGIA SA	84,500	22.450	1,897,025.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	363,112	36.180	13,137,392.160	
	CCR SA	79,920	11.690	934,264.800	
	WEG SA	133,344	55.090	7,345,920.960	
	BANCO BRADESCO SA PREF	427,902	13.510	5,780,956.020	
	BANCO BRADESCO SA	126,592	12.040	1,524,167.680	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	48,206	11.750	566,420.500	
	SUZANO SA	62,775	58.400	3,666,060.000	
	CPFL ENERGIA SA	16,900	32.370	547,053.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	391,547	35.080	13,735,468.760	
ENGIE BRASIL SA	15,287	40.270	615,607.490		
LOCALIZA RENT A CAR	77,089	40.900	3,152,940.100		
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	62,004	20.530	1,272,942.120		

	COSAN SA	108,400	11.670	1,265,028.000	
	TOTVS SA	43,300	30.860	1,336,238.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	94,000	31.420	2,953,480.000	
	EMBRAER SA	56,900	53.790	3,060,651.000	
	JBS SA	63,800	34.970	2,231,086.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	142,040	11.290	1,603,631.600	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	35,798	89.370	3,199,267.260	
	HYPERA SA	29,800	20.950	624,310.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	450,048	10.310	4,639,994.880	
	PRIOR SA	66,200	38.970	2,579,814.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	35,328	52.000	1,837,056.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	57,900	34.290	1,985,391.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	404,761	3.190	1,291,187.590	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	54,800	6.950	380,860.000	
	AMBEV SA	373,395	12.330	4,603,960.350	
	NATURA &CO HOLDING SA	68,800	14.530	999,664.000	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACOES S/A	52,100	14.110	735,131.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	108,900	7.010	763,389.000	
	TIM SA	61,300	15.910	975,283.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	64,100	28.680	1,838,388.000	
	RUMO SA	104,500	19.450	2,032,525.000	
	ブラジル・リアル 小計	5,982,305		142,962,256.790 (3,816,105,817)	
ポーランド・ ズロチ	MBANK	1,196	584.000	698,464.000	
	BUDIMEX SA	1,092	506.500	553,098.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,446	146.650	1,678,555.900	
	BANK PEKAO SA	15,205	155.100	2,358,295.500	
	ORLEN SA	47,436	52.600	2,495,133.600	
	LPP SA	91	14,750.000	1,342,250.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,835	473.800	1,343,223.000	
	CD PROJEKT RED SA	5,128	161.000	825,608.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	69,657	59.580	4,150,164.060	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	80,249	6.924	555,644.070	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	47,901	41.150	1,971,126.150	
	ALIOR BANK SA	6,916	95.800	662,552.800	

	DINO POLSKA SA	3,914	394.000	1,542,116.000	
	ALLEGRO.EU SA	47,943	34.650	1,661,224.950	
ポーランド・ズロチ 小計		341,009		21,837,456.030 (827,571,887)	
マレーシア・ リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	201,900	5.250	1,059,975.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	566,200	8.220	4,654,164.000	
	CELCOMDIGI BHD	272,700	3.340	910,818.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	82,820	10.480	867,953.600	
	RHB BANK BHD	103,780	6.450	669,381.000	
	GAMUDA BHD	156,100	8.820	1,376,802.000	
	GENTING BHD	164,900	3.870	638,163.000	
	YTL CORP BHD	263,000	2.050	539,150.000	
	HONG LEONG BANK BHD	49,008	20.540	1,006,624.320	
	IOI CORP BHD	206,713	3.930	812,382.090	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,900	22.000	965,800.000	
	MALAYAN BANKING BHD	426,075	10.500	4,473,787.500	
	MISC BHD	102,180	7.880	805,178.400	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,000	99.980	599,880.000	
	PPB GROUP BHD	50,260	14.240	715,702.400	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,900	18.000	412,200.000	
	PETRONAS GAS BHD	61,000	17.620	1,074,820.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	240,100	2.230	535,423.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,300	6.560	625,168.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	213,750	14.400	3,078,000.000	
	QL RESOURCES BHD	130,575	4.850	633,288.750	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,185,250	4.490	5,321,772.500	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	193,300	3.240	626,292.000	
	SIME DARBY BERHAD	234,400	2.340	548,496.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	264,700	2.250	595,575.000	
	MAXIS BHD	175,800	3.570	627,606.000	
	INARI AMERTRON BHD	221,900	3.130	694,547.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	217,400	4.930	1,071,782.000	
SUNWAY BHD	188,500	4.630	872,755.000		
IHH HEALTHCARE BHD	190,200	7.210	1,371,342.000		
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	284,100	4.660	1,323,906.000		
SD GUTHRIE BHD	161,500	4.990	805,885.000		
MR DIY GROUP M BHD	245,100	2.160	529,416.000		
マレーシア・リンギット 小計		7,021,311		40,844,035.560 (1,422,777,472)	
メキシコ・ペ ソ	ALFA SAB DE CV	303,256	15.530	4,709,565.680	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	105,200	66.530	6,998,956.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,115	359.830	5,798,660.450	

	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	15,860	173.250	2,747,745.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	47,400	120.270	5,700,798.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	206,800	146.330	30,261,044.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	87,025	19.220	1,672,620.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,495	301.590	4,673,137.050	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	121,600	28.780	3,499,648.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	13,950	532.690	7,431,025.500	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	250,652	106.410	26,671,879.320	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	153,200	44.190	6,769,908.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	39,700	172.920	6,864,924.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	419,200	56.040	23,491,968.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	32,725	361.520	11,830,742.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	22,800	167.830	3,826,524.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	22,500	128.330	2,887,425.000	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	104,000	15.670	1,629,680.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,481,678	15.400	22,817,841.200	
	BANCO DEL BAJIO SA	67,400	42.370	2,855,738.000	
メキシコ・ペソ	小計	3,526,556		183,139,829.700 (1,393,712,418)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	81,745	3.810	311,448.450	
	ALPHA BANK A.E.	185,591	1.502	278,757.680	
	NATIONAL BANK OF GREECE	60,562	7.516	455,183.990	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,676	14.960	249,472.960	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	220,148	2.045	450,202.660	
	METLEN ENERGY & METALS SA	8,906	32.580	290,157.480	
	OPAP SA	13,744	15.060	206,984.640	
	JUMBO SA	9,605	24.700	237,243.500	
	PUBLIC POWER CORP	16,875	12.200	205,875.000	
ユーロ	小計	616,982		2,685,326.360 (440,500,936)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	127,100.000	218,612,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,928	162,100.000	474,628,800.000	

SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,524	345,000.000	870,780,000.000	
DB INSURANCE CO LTD	3,655	108,500.000	396,567,500.000	
COWAY CO LTD	4,084	62,100.000	253,616,400.000	
KT&G CORP	8,543	119,500.000	1,020,888,500.000	
KAKAO CORP	25,719	35,000.000	900,165,000.000	
KUM YANG CO LTD	2,599	41,400.000	107,598,600.000	
HANWHA OCEAN CO LTD	7,741	36,200.000	280,224,200.000	
SK TELECOM CO LTD	3,745	56,400.000	211,218,000.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	22,468	8,750.000	196,595,000.000	
NCSOFT CORPORATION	1,142	212,500.000	242,675,000.000	
LG UPLUS CORP	17,131	9,950.000	170,453,450.000	
DOOSAN ENERBILITY	35,773	21,450.000	767,330,850.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	4,225	52,300.000	220,967,500.000	
LG H&H CO LTD	762	347,000.000	264,414,000.000	
LG CHEM LTD	4,078	303,000.000	1,235,634,000.000	
LG CHEM LTD	599	207,000.000	123,993,000.000	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	1,210	162,000.000	196,020,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	34,460	56,800.000	1,957,328,000.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	20,327	17,050.000	346,575,350.000	
S-OIL CORP	3,289	59,300.000	195,037,700.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	9,175	19,090.000	175,150,750.000	
POSCO FUTURE M CO LTD	2,467	212,000.000	523,004,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,312	87,900.000	115,324,800.000	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,314	194,000.000	642,916,000.000	
HYUNDAI MOBIS	4,809	244,500.000	1,175,800,500.000	
SK HYNIX INC	44,109	200,500.000	8,843,854,500.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,695	29,250.000	166,578,750.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,864	154,700.000	288,360,800.000	
HYUNDAI MOTOR CO	10,993	203,500.000	2,237,075,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,856	24,100.000	189,329,600.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,785	14,620.000	318,496,700.000	
KIA CORPORATION	19,374	93,000.000	1,801,782,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	416	1,146,000.000	476,736,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,038	22,200.000	467,043,600.000	
KOREAN AIR CO LTD	14,033	23,950.000	336,090,350.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,209	121,000.000	146,289,000.000	

HLB INC	9,430	61,000.000	575,230,000.000	
LG ELECTRONICS INC	8,378	91,200.000	764,073,600.000	
LG CORP	7,791	75,200.000	585,883,200.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,234	13,500.000	124,659,000.000	
NAVER CORP	10,590	174,600.000	1,849,014,000.000	
L&F CO LTD	2,034	114,300.000	232,486,200.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,443	77,200.000	265,799,600.000	
POSCO HOLDINGS INC	5,851	320,000.000	1,872,320,000.000	
SAMSUNG E&A CO LTD	12,226	18,360.000	224,469,360.000	
COSMOAM&T CO LTD	1,730	85,600.000	148,088,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,502	284,500.000	1,280,819,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	4,673	116,800.000	545,806,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	385,943	57,000.000	21,998,751,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	54,110	11,010.000	595,751,100.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	2,551	403,500.000	1,029,328,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	66,036	47,200.000	3,116,899,200.000	
YUHAN CORP	4,700	132,500.000	622,750,000.000	
GS HOLDINGS CORP	3,803	42,150.000	160,296,450.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,592	10,170.000	239,930,640.000	
CELLTRION INC	12,428	181,500.000	2,255,682,000.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3,614	94,200.000	340,438,800.000	
HANA FINANCIAL GROUP	23,600	61,200.000	1,444,320,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	3,240	115,400.000	373,896,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,314	61,300.000	80,548,200.000	
POSCO DX CO LTD	4,364	26,100.000	113,900,400.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,563	104,900.000	688,458,700.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,280	123,100.000	280,668,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,855	111,100.000	539,390,500.000	
ECOPRO CO LTD	7,950	79,600.000	632,820,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	713	264,500.000	188,588,500.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,135	172,100.000	195,333,500.000	
SK INC	2,945	150,900.000	444,400,500.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	31,100	93,200.000	2,898,520,000.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,645	63,000.000	355,635,000.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,719	105,800.000	816,670,200.000	
HANMI PHARM CO LTD	585	323,000.000	188,955,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,531	37,400.000	206,859,400.000	
HANJIN KAL CORP	2,068	80,000.000	165,440,000.000	

	HYUNDAI ELECTRIC & ENERGY SYSTEM CO LTD	1,895	363,500.000	688,832,500.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	3,598	73,700.000	265,172,600.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,013	100,800.000	202,910,400.000	
	NETMARBLE CORP	2,112	53,400.000	112,780,800.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	51,067	16,180.000	826,264,060.000	
	ECOPRO BM CO LTD	3,906	160,600.000	627,303,600.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,438	112,000.000	273,056,000.000	
	ENCHEM CO LTD	1,059	159,600.000	169,016,400.000	
	KRAFTON INC	2,300	325,000.000	747,500,000.000	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	1,376	114,100.000	157,001,600.000	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,930	209,500.000	404,335,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	7,635	95,100.000	726,088,500.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,340	50,800.000	118,872,000.000	
	HYBE CO LTD	1,832	198,600.000	363,835,200.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,851	398,500.000	1,534,623,500.000	
	KAKAObANK CORP	13,292	22,100.000	293,753,200.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,513	135,700.000	476,714,100.000	
	ALTEOGEN INC	3,259	437,000.000	1,424,183,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	7,111	123,100.000	875,364,100.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,415	1,004,000.000	1,420,660,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,542	39,850.000	180,998,700.000	
	韓国・ウォン 小計	1,248,921		88,887,300,910.000 (9,750,936,910)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	88,000	13.760	1,210,880.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	7.990	814,980.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	8,700	126.500	1,100,550.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	100,000	22.350	2,235,000.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,500	25.600	1,088,000.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	320,000	4.190	1,340,800.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	476,000	4.320	2,056,320.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	258,700	10.220	2,643,914.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	51,000	23.800	1,213,800.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	691,600	5.350	3,700,060.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	320,120	15.360	4,917,043.200	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	261,388	26.750	6,992,129.000	

CITIC LTD	463,000	9.360	4,333,680.000	
LENOVO GROUP LTD	656,000	9.830	6,448,480.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,696,000	5.720	9,701,120.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	116,390	13.540	1,575,920.600	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,967,200	4.360	8,576,992.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	74,000	11.540	853,960.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	221,000	8.600	1,900,600.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,100	55.050	3,528,705.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	324,000	7.750	2,511,000.000	
HISENSE KELON ELECTRICAL HOLDINGS CO LTD	28,000	26.200	733,600.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	108,000	12.680	1,369,440.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	310,000	5.700	1,767,000.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	199,000	6.830	1,359,170.000	
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	482,000	14.740	7,104,680.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	77,000	29.550	2,275,350.000	
BYD CO LTD	84,500	278.800	23,558,600.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	7.510	1,201,600.000	
MMG LTD	324,000	2.840	920,160.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,000	110.300	1,103,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	561,788	12.520	7,033,585.760	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	4.500	985,500.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	153,200	18.620	2,852,584.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	190,000	13.340	2,534,600.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	608,000	17.400	10,579,200.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	455,000	16.420	7,471,100.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	194,400	5.030	977,832.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	152,440	12.020	1,832,328.800	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	7.050	803,700.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	11.660	2,098,800.000	

TSINGTAO BREWERY CO LTD	50,000	54.500	2,725,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	206,000	5.040	1,038,240.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	129,333	31.400	4,061,056.200	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	94,000	5.460	513,240.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	823,250	3.450	2,840,212.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	263,000	18.460	4,854,980.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	528,900	420.800	222,561,120.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	544,000	49.900	27,145,600.000	
LI NING CO LTD	193,500	17.380	3,363,030.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	268,000	2.290	613,720.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	348,000	3.290	1,144,920.000	
ZTE CORP	63,288	21.000	1,329,048.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	272,000	33.500	9,112,000.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	221,250	12.220	2,703,675.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	686,205	6.050	4,151,540.250	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	170,250	11.400	1,940,850.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	56,500	32.700	1,847,550.000	
BAIDU INC	184,800	88.950	16,437,960.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,748,530	6.200	48,040,886.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	66,700	60.500	4,035,350.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	408,000	3.650	1,489,200.000	
BANK OF CHINA LTD	6,371,200	3.770	24,019,424.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	320,470	39.050	12,514,353.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,617,235	4.870	27,355,934.450	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	126,500	12.360	1,563,540.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	183,600	4.180	767,448.000	
CHINA COAL ENERGY CO	171,000	9.540	1,631,340.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	21.400	1,177,000.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	37,600	30.000	1,128,000.000	
CMOC GROUP LIMITED	315,000	6.880	2,167,200.000	
CHINA CITIC BANK-H	678,800	5.060	3,434,728.000	

SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	58,700	56.150	3,296,005.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	102,200	89.450	9,141,790.000	
FOSUN INTERNATIONAL	242,028	4.640	1,123,009.920	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	316,000	4.630	1,463,080.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,200	30.250	2,305,050.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,821,000	1.600	2,913,600.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	21.600	1,177,200.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	351,000	4.110	1,442,610.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	63,500	30.450	1,933,575.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	423,000	5.050	2,136,150.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	208,200	26.950	5,610,990.000	
CRRC CORP LTD - H	342,000	5.170	1,768,140.000	
SINOPHARM GROUP CO	104,000	20.250	2,106,000.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	214,527	3.070	658,597.890	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	230,500	14.500	3,342,250.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	228,000	6.950	1,584,600.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	70,400	12.580	885,632.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	168,800	7.500	1,266,000.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	155,000	13.720	2,126,600.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	85,200	28.350	2,415,420.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	531,656	3.060	1,626,867.360	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.770	628,790.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,224,000	4.020	8,940,480.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	68,000	15.600	1,060,800.000	
FAR EAST HORIZON LTD	169,000	5.620	949,780.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	129,000	25.250	3,257,250.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	239,600	7.340	1,758,664.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	672,000	4.220	2,835,840.000	

CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	265,000	8.000	2,120,000.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	670,000	4.580	3,068,600.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	84,000	10.880	913,920.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	64,000	14.560	931,840.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,674,000	1.040	3,820,960.000	
XIAOMI CORP	1,238,800	28.300	35,058,040.000	
BEIGENE LTD	54,600	123.200	6,726,720.000	
WUXI APPTec CO LTD	24,112	56.850	1,370,767.200	
MEITUAN	402,710	191.800	77,239,778.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	104,800	19.680	2,062,464.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	136,000	17.400	2,366,400.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,000	3.540	1,366,440.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	98,500	38.850	3,826,725.000	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	40,300	32.050	1,291,615.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	133,000	2.730	363,090.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	88,000	17.360	1,527,680.000	
CHINA FEIHE LTD	341,000	5.950	2,028,950.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,228,368	94.000	115,466,592.000	
JD.COM INC	198,735	155.300	30,863,545.500	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	140,000	10.740	1,503,600.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	186,200	53.700	9,998,940.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	197,800	27.950	5,528,510.000	
BILIBILI INC	19,180	183.300	3,515,694.000	
AKESO INC	50,000	67.950	3,397,500.000	
NETEASE INC	156,600	119.400	18,698,040.000	
NONGFU SPRING CO LTD	163,600	33.700	5,513,320.000	
LI AUTO INC	100,500	96.050	9,653,025.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	88,050	28.850	2,540,242.500	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	63,200	33.850	2,139,320.000	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	33,900	174.100	5,901,990.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	163,161	8.000	1,305,288.000	

	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	117,900	46.450	5,476,455.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	42,600	72.650	3,094,890.000	
	JD LOGISTICS INC	148,100	16.020	2,372,562.000	
	GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	24,000	55.950	1,342,800.000	
	TRIP.COM GROUP LTD	44,500	527.000	23,451,500.000	
	XPENG INC	101,300	57.350	5,809,555.000	
	NIO INC	107,600	41.600	4,476,160.000	
	MIDEA GROUP CO LTD	29,000	72.000	2,088,000.000	
	MINISO GROUP HOLDING LTD	28,600	38.500	1,101,100.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	51,000	22.900	1,167,900.000	
	CGN POWER CO LTD	826,000	2.800	2,312,800.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	48,400	55.050	2,664,420.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	80,600	15.220	1,226,732.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	172,500	5.690	981,525.000	
	CHINA LITERATURE LTD	37,600	28.500	1,071,600.000	
	BOC AVIATION LTD	18,300	61.650	1,128,195.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	98,000	12.580	1,232,840.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	122,800	15.860	1,947,608.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	287,000	17.120	4,913,440.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	520,000	1.890	982,800.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	15.340	920,400.000	
	香港・ドル 小計	64,557,864		1,086,641,559.630 (21,406,838,725)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	40,633	584.000	23,729,672.000	
	ACER INC	237,661	40.400	9,601,504.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	57,108	621.000	35,464,068.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	39,932	500.000	19,966,000.000	
	ASIA CEMENT CORP	164,778	47.550	7,835,193.900	
	TAIWAN BUSINESS BANK	555,714	15.350	8,530,209.900	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	83,996	94.300	7,920,822.800	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	41,646	305.500	12,722,853.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,335	184.500	10,578,307.500	

UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	109,525	174.000	19,057,350.000	
QUANTA COMPUTER INC	218,168	328.000	71,559,104.000	
EVA AIRWAYS CORP	228,765	38.400	8,784,576.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50,554	215.500	10,894,387.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	459,676	17.750	8,159,249.000	
CHINA AIRLINES	231,823	23.150	5,366,702.450	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	160,684	46.200	7,423,600.800	
CHINA STEEL CORP	964,670	23.250	22,428,577.500	
ADVANTECH CO LTD	38,979	333.500	12,999,496.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	353,445	37.550	13,271,859.750	
DELTA ELECTRONICS INC	158,235	400.000	63,294,000.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	110,788	40.700	4,509,071.600	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	300,565	123.000	36,969,495.000	
AUO CORP	526,500	16.400	8,634,600.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	147,784	113.000	16,699,592.000	
EVERGREEN MARINE CORP	83,482	218.000	18,199,076.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	225,768	36.450	8,229,243.600	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	40,131	142.500	5,718,667.500	
ECLAT TEXTILE CO LTD	14,780	580.000	8,572,400.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	46,961	488.500	22,940,448.500	
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	11,648	620.000	7,221,760.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	312,857	47.700	14,923,278.900	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	281,026	38.300	10,763,295.800	
MEDIATEK INC	122,945	1,280.000	157,369,600.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	661,749	92.900	61,476,482.100	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	735,202	25.550	18,784,411.100	
HOTAI MOTOR CO LTD	23,556	647.000	15,240,732.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	150,343	88.600	13,320,389.800	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	842,744	33.200	27,979,100.800	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	775,894	69.500	53,924,633.000	
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,234,386	17.250	21,293,158.500	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,159,893	27.450	31,839,062.850	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,008,195	218.000	219,786,510.000	

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	936,448	39.100	36,615,116.800	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,159	2,305.000	18,806,495.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	971,766	17.150	16,665,786.900	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,131,263	11.450	12,952,961.350	
INVENTEC CO LTD	220,927	52.400	11,576,574.800	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	165,221	105.000	17,348,205.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	857,603	22.750	19,510,468.250	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,285,933	36.900	47,450,927.700	
ASIA VITAL COMPONENTS CO LTD	26,609	687.000	18,280,383.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	885,796	26.800	23,739,332.800	
NAN YA PLASTICS CORP	407,756	42.850	17,472,344.600	
WISTRON CORP	222,307	123.500	27,454,914.500	
POU CHEN CORP	168,225	39.200	6,594,420.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	389,625	87.300	34,014,262.500	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	43,796	273.000	11,956,308.000	
E INK HOLDINGS INC	68,620	294.000	20,174,280.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121,517	47.500	5,772,057.500	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	106,935	71.500	7,645,852.500	
TCC GROUP HOLDINGS	548,163	31.900	17,486,399.700	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,989,940	1,090.000	2,169,034,600.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	899,843	46.650	41,977,675.950	
WAN HAI LINES LTD	51,482	93.700	4,823,863.400	
WALSIN LIHWA CORP	221,605	30.150	6,681,390.750	
WINBOND ELECTRONICS CORP	247,693	19.500	4,830,013.500	
YAGEO CORP	32,457	548.000	17,786,436.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	144,188	71.500	10,309,442.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	145,465	28.800	4,189,392.000	
GLOBAL UNICHIP CORP	6,904	1,280.000	8,837,120.000	
INNOLUX CORPORATION	608,428	16.100	9,795,690.800	
WPG HOLDINGS CO LTD	133,481	76.600	10,224,644.600	
E MEMORY TECHNOLOGY INC	4,925	3,505.000	17,262,125.000	
PEGATRON CORP	158,874	99.800	15,855,625.200	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	6,436	2,420.000	15,575,120.000	

	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,248	931.000	10,471,888.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	122,739	149.000	18,288,111.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	56,562	117.500	6,646,035.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	866,244	25.300	21,915,973.200	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	322,570	38.900	12,547,973.000	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	5,243	1,995.000	10,459,785.000	
	WIWYNN CORP	7,791	2,060.000	16,049,460.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	267,472	155.500	41,591,896.000	
	SILERGY CORP	26,396	483.500	12,762,466.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	19,205	624.000	11,983,920.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	22,335	426.500	9,525,877.500	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,658	447.000	6,552,126.000	
	台湾・ドル 小計	28,031,377		4,051,478,284.350 (19,310,966,095)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	27,835	282.870	7,873,686.450	
	CLICKS GROUP LTD	19,196	388.330	7,454,382.680	
	DISCOVERY LTD	42,619	183.360	7,814,619.840	
	GOLD FIELDS LTD	71,833	277.290	19,918,572.570	
	REMGRO LTD	41,148	150.970	6,212,113.560	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	43,521	177.430	7,721,931.030	
	EXXARO RESOURCES LTD	21,000	167.500	3,517,500.000	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,963	3,295.370	22,945,661.310	
	MTN GROUP LTD	135,077	84.270	11,382,938.790	
	FIRSTRAND LTD	409,321	78.820	32,262,681.220	
	NASPERS LTD	14,368	4,083.230	58,667,848.640	
	NEDBANK GROUP LTD	37,719	293.300	11,062,982.700	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,842	671.770	3,924,480.340	
	SASOL LTD	48,138	99.700	4,799,358.600	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,769	314.520	12,508,145.880	
	STANDARD BANK GROUP LTD	106,544	241.550	25,735,703.200	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	78,996	64.800	5,118,940.800	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,167	176.710	5,330,810.570	
	ABSA GROUP LTD	70,074	168.760	11,825,688.240	
	SANLAM LTD	143,578	88.790	12,748,290.620	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	69,363	113.000	7,838,019.000	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,386	341.820	1,841,042.520	

OUTSURANCE GROUP LTD	70,350	60.800	4,277,280.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	51,779	104.500	5,410,905.500	
NEPI ROCKCASTLE NV	45,937	138.770	6,374,677.490	
OLD MUTUAL LTD	391,487	12.650	4,952,310.550	
REINET INVESTMENTS SCA	11,620	485.930	5,646,506.600	
PEPKOR HOLDINGS LTD	189,792	22.500	4,270,320.000	
SIBANYE STILLWATER LTD	224,039	20.280	4,543,510.920	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	30,906	122.340	3,781,040.040	
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	34,335	479.350	16,458,482.250	
BID CORP LTD	26,051	436.910	11,381,942.410	
南アフリカ・ランド 小計	2,544,753		355,602,374.320 (3,090,184,633)	
合計	302,118,063		98,664,995,084 (98,664,995,084)	

## (2) 株式以外の有価証券

2024年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	91,500.000	2,973,750.000		
		ENERGISA SA	19,900.000	820,875.000		
		KLABIN SA	65,450.000	1,354,815.000		
		ブラジル・レアル	小計	176,850.000	5,149,440.000 (137,454,517)	
	メキシコ・ペソ		CEMEX SAB DE CV	1,205,475.000	14,381,316.750	
			COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,900.000	6,650,532.000	
			FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	146,750.000	28,648,535.000	
		メキシコ・ペソ	小計	1,392,125.000	49,680,383.750 (378,072,687)	
	投資信託受益証券 合計			1,568,975	515,527,204 (515,527,204)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	229,200.000	5,267,016.000		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA DE CV	80,700.000	5,366,550.000		
		メキシコ・ペソ	小計	309,900.000	10,633,566.000 (80,922,500)	
投資証券 合計			309,900	80,922,500 (80,922,500)		
合計				596,449,704 (596,449,704)		

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 43銘柄	2.91	-	-	3.03
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 12銘柄	1.15	-	-	1.20
インド・ルピー	株式 151銘柄	17.76	-	-	18.53
インドネシア・ルピア	株式 20銘柄	1.49	-	-	1.56
オフショア・人民元	株式 394銘柄	4.10	-	-	4.28
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.78	-	-	0.81
クウェート・ディナール	株式 6銘柄	0.67	-	-	0.70
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.09	-	-	0.10
サウジアラビア・リアル	株式 43銘柄	3.73	-	-	3.89
タイ・バーツ	株式 28銘柄	1.41	-	-	1.47
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.12	-	-	0.13
チリ・ペソ	株式 11銘柄	0.38	-	-	0.40
トルコ・リラ	株式 18銘柄	0.59	-	-	0.61
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.23	-	-	0.24
フィリピン・ペソ	株式 13銘柄	0.52	-	-	0.54
ブラジル・レアル	株式 44銘柄 投資信託受益証 券 3銘柄	3.68 -	- 0.13	- -	3.98
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.80	-	-	0.83
マレーシア・リンギット	株式 33銘柄	1.37	-	-	1.43
メキシコ・ペソ	株式 20銘柄 投資信託受益証 券 3銘柄 投資証券 2銘柄	1.35 - -	- 0.37 -	- - 0.08	1.87
ユーロ	株式 10銘柄	0.43	-	-	0.44
韓国・ウォン	株式 97銘柄	9.41	-	-	9.82
香港・ドル	株式 154銘柄	20.67	-	-	21.57
台湾・ドル	株式 87銘柄	18.64	-	-	19.45
南アフリカ・ランド	株式 32銘柄	2.98	-	-	3.11

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2024年11月29日現在

資産総額	44,534,746,629円
負債総額	127,683,627円
純資産総額( - )	44,407,063,002円
発行済数量	45,506,046,970口
1口当たり純資産額( / )	0.9758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

## 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

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産総額	378,421,880,298円
負債総額	90,518,454,210円
純資産総額( - )	287,903,426,088円
発行済数量	247,763,561,507口
1口当たり純資産額( / )	1.1620円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産総額	162,878,543,025円
負債総額	775,571,408円
純資産総額( - )	162,102,971,617円
発行済数量	72,169,197,207口
1口当たり純資産額( / )	2.2462円

## 外国リート・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	113,746,948,464円
負債総額	296,994,886円
純資産総額( - )	113,449,953,578円
発行済数量	50,013,741,811口
1口当たり純資産額( / )	2.2684円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産総額	135,023,808,559円
負債総額	7,469,312,290円
純資産総額( - )	127,554,496,269円
発行済数量	52,483,853,561口
1口当たり純資産額( / )	2.4304円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産総額	100,623,636,538円
負債総額	289,335,554円
純資産総額( - )	100,334,300,984円
発行済数量	56,517,890,247口
1口当たり純資産額( / )	1.7753円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2)受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5)受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6)受益権の再分割

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

### (7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額(2024年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. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

##### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年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	1,127	1,093
建物	1 1,001	1 918
器具備品	1 118	1 130
リース資産	1 7	1 5
建設仮勘定	-	39
無形固定資産		
ソフトウェア	5,021	4,495
ソフトウェア仮勘定	3,367	2,951
ソフトウェア仮勘定	1,651	1,543
電話加入権	2	0
投資その他の資産		
投資有価証券	9,768	8,935
投資有価証券	182	184
関係会社株式	5,810	4,447
長期差入保証金	775	768
繰延税金資産	2,895	3,406
その他	104	128
固定資産計	15,918	14,524
資産合計	102,265	110,368

(単位:百万円)

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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

## (3)【株主資本等変動計算書】

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

## 重要な会計方針

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

## 6. 収益及び費用の計上基準

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

## (1) 委託者報酬

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

## (2) 運用受託報酬

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

## (3) 投資助言報酬

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

## (4) 成功報酬

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

**注記事項**

(貸借対照表関係)

## 1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

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

(損益計算書関係)

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

(百万円)

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

## 2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

(百万円)

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

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

(株主資本等変動計算書関係)

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。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) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。 )または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。 )と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は2024年12月25日付でPayPayアセットマネジメント株式会社が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「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社長野銀行	13,017	日本において銀行業務を営んでおります。
三菱UFJ eスマート証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	54,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
あかつき証券株式会社	3,067	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	( 1 ) 19,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2024年3月末日現在

( 1 ) 2023年12月31日現在

## (3) 投資顧問会社

名称	Asset Management One USA Inc.
資本金の額	400万米ドル(2024年12月末日現在)
事業の内容	米国において投資顧問業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、委託会社との投資顧問契約に基づき、信託財産の運用の助言を行います。

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2024年2月13日	有価証券報告書
2024年2月13日	有価証券届出書
2024年8月13日	半期報告書
2024年8月13日	有価証券届出書

## 独立監査人の監査報告書

2024年5月23日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

## 監査意見

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

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

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

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 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの2023年11月14日から2024年11月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、リスクコントロール世界資産分散ファンドの2024年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

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。