

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2025年10月14日提出
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 杉原 規之
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	積木 利浩
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】</b>	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国10) D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国20) D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国30)
<b>【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券の金額】</b>	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国10) 1兆円を上限とします。 D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国20) 1兆円を上限とします。 D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国30) 1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

（以上を総称して、「DIAM DC 8資産バランスファンド」または「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、愛称として「宝船」という名称を用いる場合があります。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### < 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

( 5 ) 【申込手数料】

ありません。

( 6 ) 【申込単位】

1口以上1口単位または1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

( 7 ) 【申込期間】

継続申込期間：2025年10月15日から2026年4月13日まで

ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、香港証券取引所、韓国取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、香港の銀行、韓国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。

上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

( 8 ) 【申込取扱場所】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## (12) 【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた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この信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

### 振替受益権について

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

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

### (参考)

#### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

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

#### <ファンドの特色>

## 1 主としてマザーファンド<sup>※1</sup>への投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券<sup>※2</sup>に投資します。

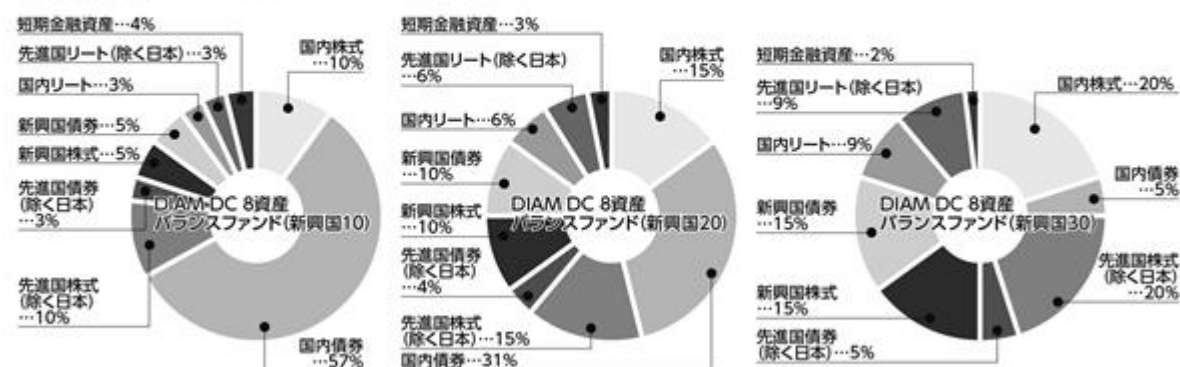
※1 各ファンドが投資するマザーファンドは下記のとおりです。(以下を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。)

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
国内債券パッシブ・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
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
エマージング株式パッシブ・マザーファンド
エマージング債券パッシブ・マザーファンド
J-REITインデックスファンド・マザーファンド
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※2 「不動産投資信託証券」(以下「リート(REIT)」という場合があります。)とは、不動産投資法人または不動産投資信託を総称した一般呼称です。多くの投資者から集めた資金などで、商業施設、マンション、倉庫などの様々な不動産を保有し、そこから生じる賃料収入等が投資者に分配される商品をいいます。

## 2 次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。

#### <基本アロケーション>



※マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下のとおりです。

資産	ベンチマーク
国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
国内債券	NOMURA-BPI総合
先進国株式(除く日本)	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)
先進国債券(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
新興国債券	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)
国内リート	東証REIT指数(配当込み)
先進国リート(除く日本)	S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
短期金融資産	コール・ローン(オーバーナイト物)

※合成ベンチマークとは、各資産ごとのベンチマークの騰落率を基本アロケーションに乗じて指数化したものです。

## 3 実質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。

### ■ 分配方針

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

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

## 商品分類表

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
		不動産投信	
	内外	その他資産 ( )	特殊型
		資産複合	

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

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

## 属性区分表

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル (日本を含む)  日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリーファ ンド	あり ( )	
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	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	その他 (合成ベンチマー ク)
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型					

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。



## 属性区分定義

その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、 債券、不動産投信） 資産配分固定型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。  （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型））に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
その他	日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

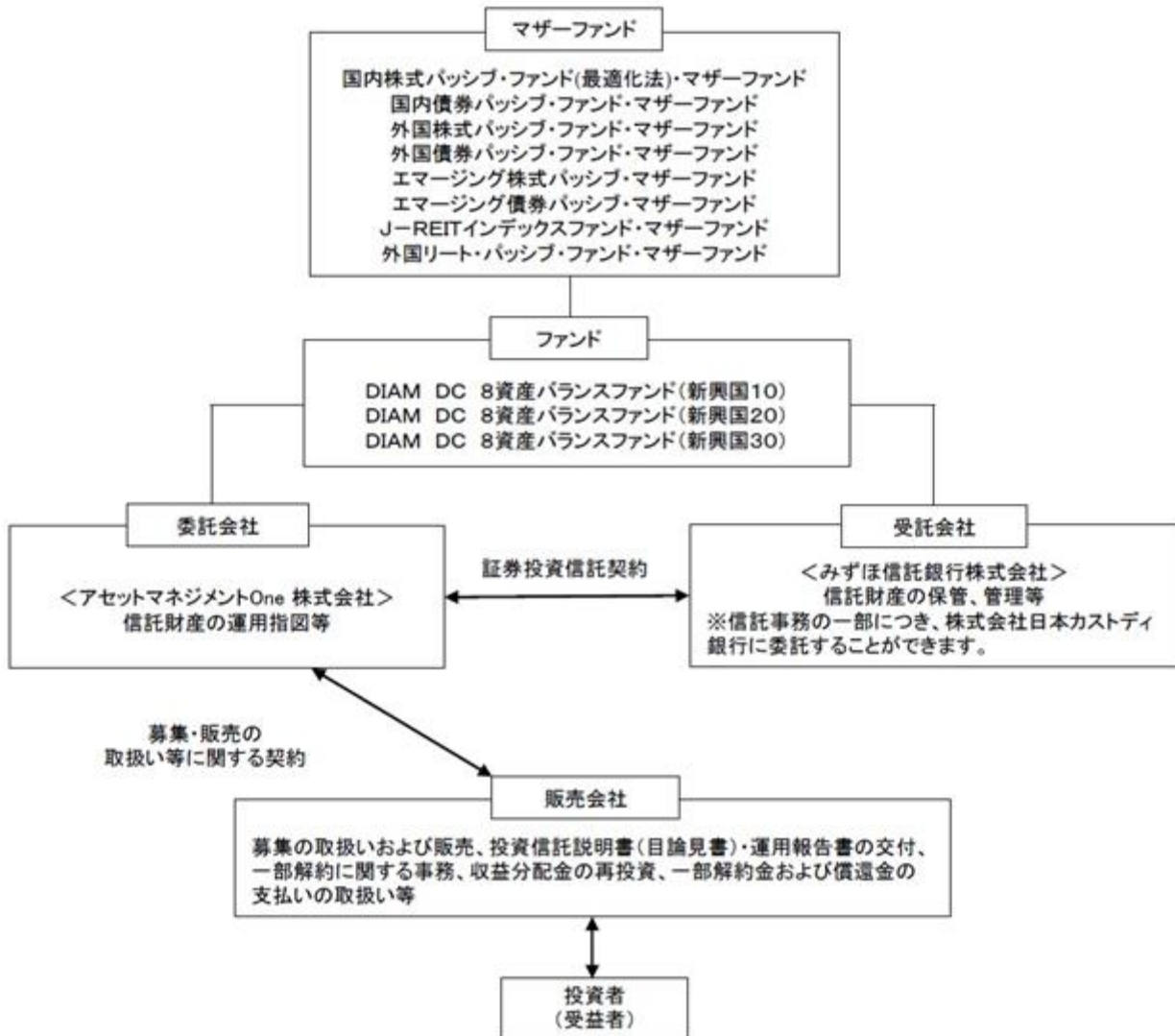
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

## （２）【ファンドの沿革】

2012年9月6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、ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

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

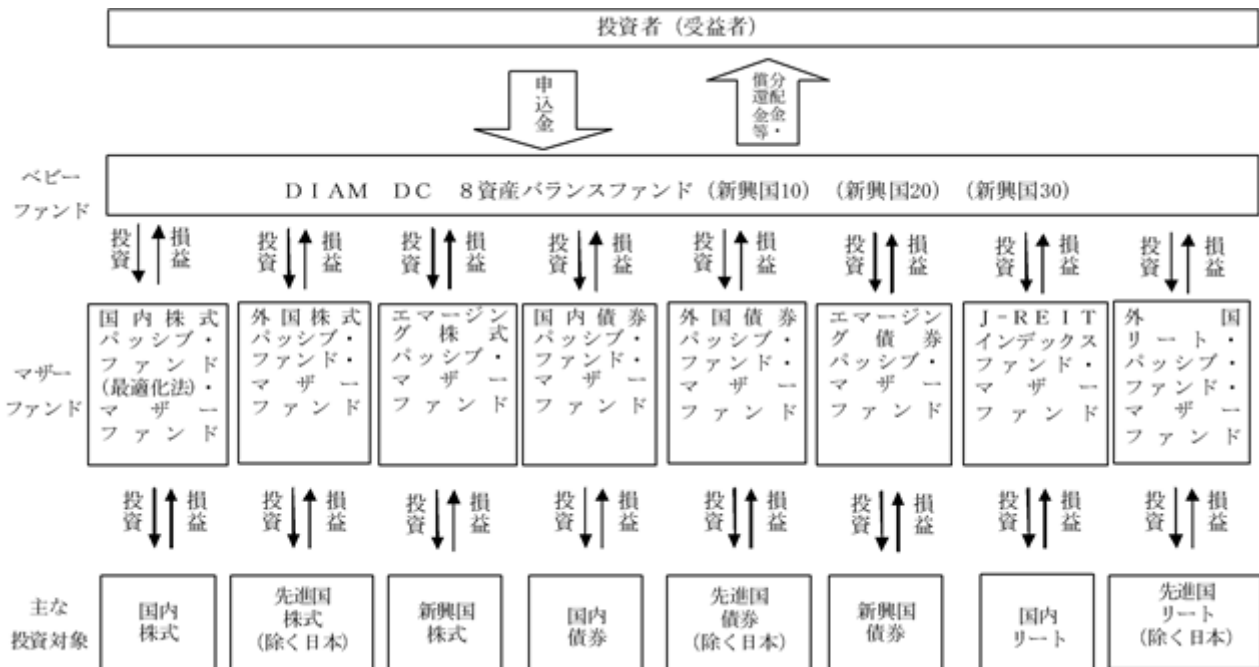
- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

「ファミリーファンド方式」とは

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



## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2025年7月31日現在）

## 委託会社の沿革

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

2016年10月1日

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

(2025年7月31日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## &lt;基本方針&gt;

信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

## &lt;投資対象&gt;

主として、以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

- 1.国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- 2.国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 3.外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 4.外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 5.エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- 6.エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- 7.J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- 8.外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

## &lt;投資態度&gt;

主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。

次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。

<基本アロケーション>

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

国内株式	10%
国内債券	57%
先進国株式（除く日本）	10%
先進国債券（除く日本）	3%
新興国株式	5%
新興国債券	5%
国内不動産投資信託証券	3%
先進国不動産投資信託証券（除く日本）	3%
短期金融資産	4%

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

国内株式	15%
国内債券	31%
先進国株式（除く日本）	15%
先進国債券（除く日本）	4%
新興国株式	10%
新興国債券	10%
国内不動産投資信託証券	6%
先進国不動産投資信託証券（除く日本）	6%
短期金融資産	3%

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

国内株式	20%
国内債券	5%
先進国株式（除く日本）	20%
先進国債券（除く日本）	5%
新興国株式	15%
新興国債券	15%
国内不動産投資信託証券	9%
先進国不動産投資信託証券（除く日本）	9%
短期金融資産	2%

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下のとおりです。

国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
国内債券	NOMURA - BPI総合
先進国株式 (除く日本)	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)
先進国債券 (除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
新興国債券	JPMorgan・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)
国内不動産 投資信託証券	東証REIT指数(配当込み)
先進国不動産 投資信託証券 (除く日本)	S&P 先進国REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
短期金融資産	コール・ローン(オーバーナイト物)

マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。

実質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。

上記にかかわらず、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、および純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

#### 対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成ベンチマークに連動させるため、以下の対応を行います。

各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションとの乖離について乖離許容範囲を定めその範囲内に維持するよう運用を行うことにより、合成ベンチマークに概ね連動させます。なお、乖離距離範囲を超えた場合にはリバランスを実施いたします。

なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針 (2)投資対象 (参考)各ファンドが投資するマザーファンドの概要をご参照ください。

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。）

8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

11. コマーシャル・ペーパー

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

なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。また、「不動産投資信託証券」とは、「投資信託証券」のうち一般社団法人投資信託協会規則に定めるものをいいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

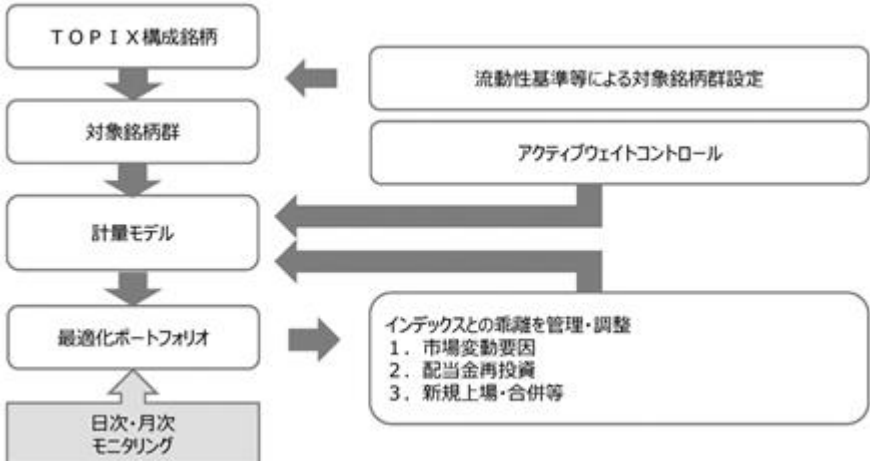
委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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



## (参考)各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <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>

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

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・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、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。</p>

<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&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>
<p>運用プロセス</p>	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定        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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・年限構成変化要因   ・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更   ・クーポン、償還再投資</li> </ul> <div style="text-align: center; margin-top: 20px;"> <pre>       graph TD         A[NOMURA-BPI総合構成銘柄] --&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[日次・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; B         G[金利の期間構造・スプレッド変動リスク] --&gt; C         H[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限構成変化要因 2. 指数構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資] --&gt; D       </pre> </div>

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、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</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	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。

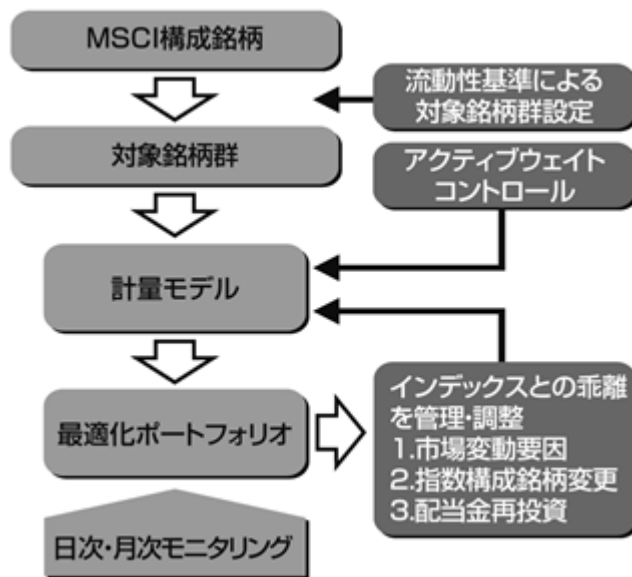
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、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、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</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	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。



<p>投資態度</p>	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <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>
<p>運用プロセス</p>	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定        FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築        金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</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> <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>・年限・通貨構成変化要因</li> <li>・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更</li> <li>・クーポン・償還再投資</li> </ul> <div style="text-align: center; margin-top: 20px;"> <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     C[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     B --&gt; D[計量モデル]     E[金利期間構造為替リスク] --&gt; D     D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]     G["インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限・通貨構成変化要因 2. 指数構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資"] --&gt; F     F --&gt; H[日次・月次モニタリング]       </pre> </div>

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

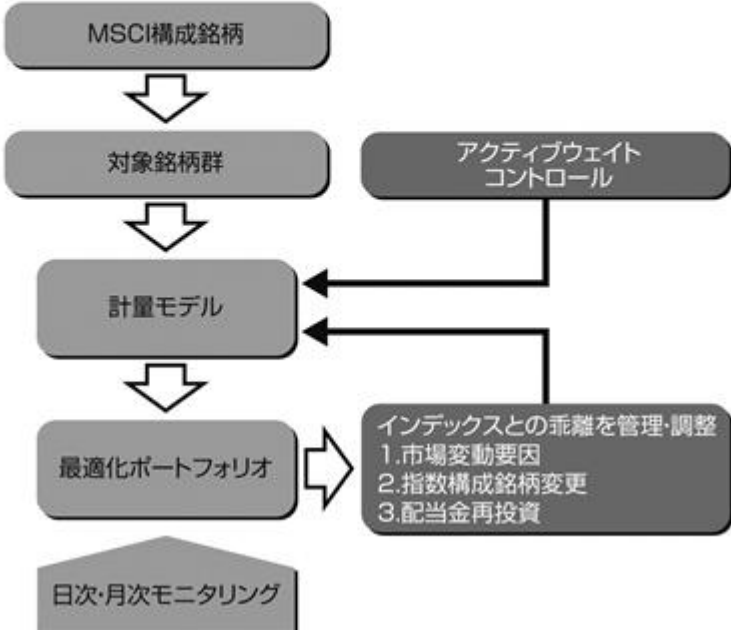
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式<sup>(*)</sup>に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*)DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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>
------	--

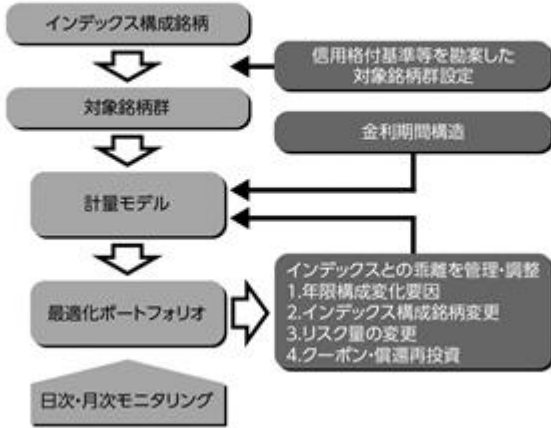
本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関す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、いかなる者または団体も、

	<p>事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。          日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&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]     E[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C     E --&gt; D     D --&gt; F[日次・月次モニタリング]     G["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --&gt; D     </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>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>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>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>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>

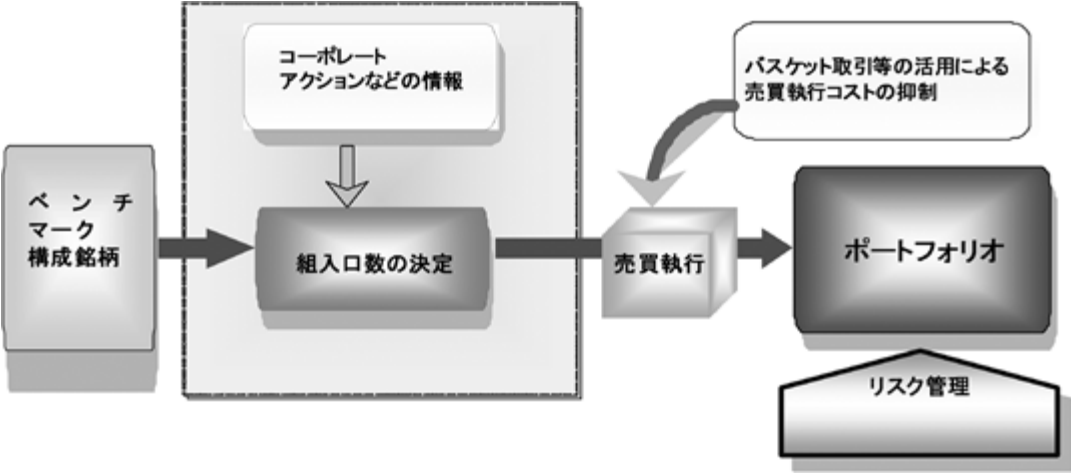
ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>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。</p> <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>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&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[日次・月次モニタリング]          F[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     G[金利期間構造] --&gt; C          C --&gt; H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年利構成変化要因 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]     H --&gt; D   </pre>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>



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ないます。
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	<p>1. 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を主要投資対象とし、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ないます。</p> <p>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。</p> <p>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 R E I T 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。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>東証 R E I T 指数の指数値および東証 R E I T 指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「 J P X 」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 R E I T 指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証 R E I T 指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有しています。</p> <p>J P X は、東証 R E I T 指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証 R E I T 指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証 R E I T 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。</p> <p>J P X は、東証 R E I T 指数の指数値および東証 R E I T 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 R E I T 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。</p> <p>J P X は、東証 R E I T 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、 J P X は、東証 R E I T 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。</p> <p>本件商品は、 J P X 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>J P X 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>J P X は、当社または本件商品の購入者のニーズを東証 R E I T 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。</p> <p>以上の項目に限らず、 J P X 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>



<p>運用プロセス</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 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>2. 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>3. 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> </ol> 
<p>主な投資制限</p>	<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. 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。</li> <li>3. 株式への投資は行いません。</li> <li>4. 外貨建資産への投資は行いません。</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。</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>

<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みます。)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らず、推奨、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、証券全般または具体的に本商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 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

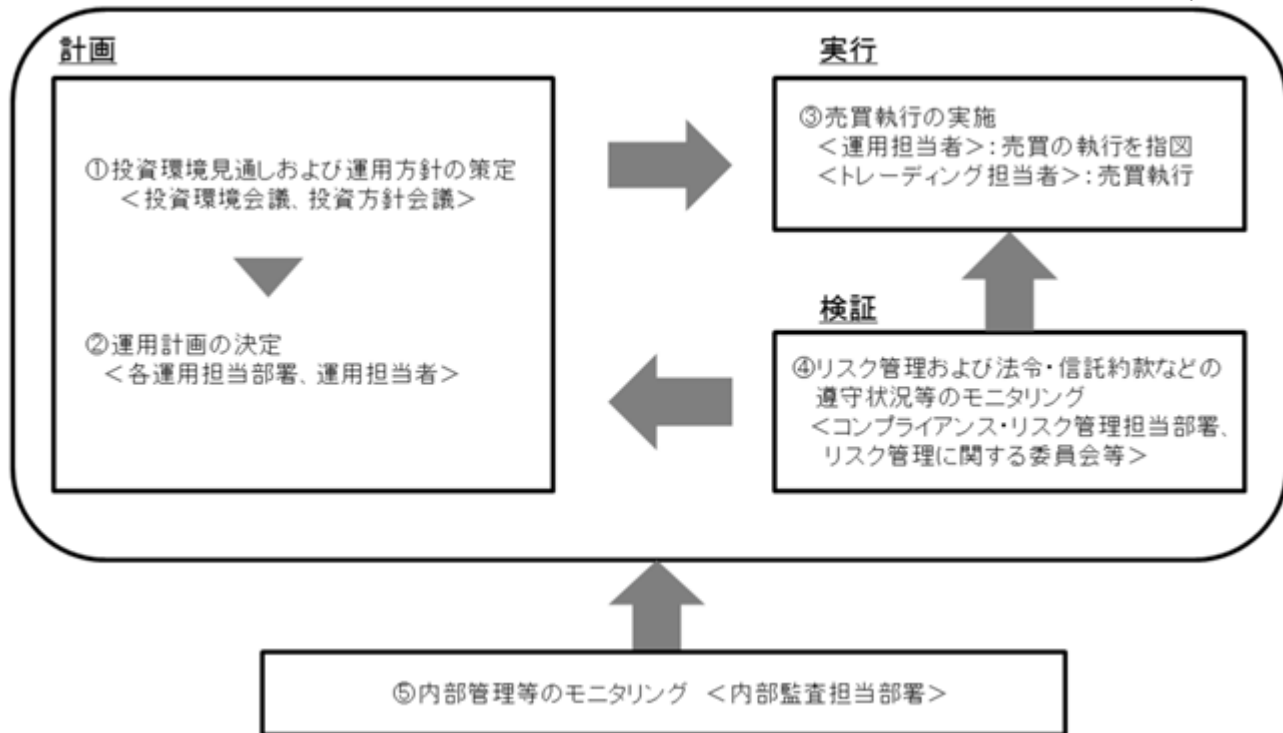
	<p>る保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS &amp; P 先進国 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、アセットマネジメントOne、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られるべき結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&amp;P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、また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&amp;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&amp;P DOW JONES INDICESはそれらを管理していません。S&amp;P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&amp;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。</p>
運用プロセス	<p>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&amp;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。</p> <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定]     B --&gt; C[ポートフォリオ]     C --&gt; D[日々・月次モニタリング]     D --&gt; E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約]     E --&gt; B   </pre>

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るものとします。</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>
--------	---

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原則として月次で開催する「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、運用担当部署の部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60～80人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

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

#### 内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数5～15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2025年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

**(4) 【分配方針】****収益分配方針**

毎決算時に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

**1. 分配対象額の範囲**

経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

**2. 分配対象額についての分配方針**

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

**3. 留保益の運用方針**

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

**収益の分配方式**

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

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

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。



- (2)上記1)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。

#### 収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

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

#### （５）【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）

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

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する実質比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に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（上場予定を含みます。）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します。

信用取引の指図範囲（約款第21条）

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

(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、

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

先物取引等の運用指図（約款第22条）

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

スワップ取引の運用指図（約款第23条）

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

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

#### デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第24条の2)

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

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25条)

- (1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付け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.の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、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第26条)

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

#### 外国為替予約取引の指図(約款第27条)

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

#### 資金の借入れ(約款第33条)

- (1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的とし

て、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- (2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### ・資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、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。

各ファンドが実質的に投資する各資産の配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。この資産配分が各ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、各ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### ・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。各ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

#### ・金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

金利リスクとは、金利の変動を受けて債券・リートの価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、債券・リートの価格は下落します。各ファンドは実質的に債券・リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。

#### ・リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。

各ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

#### ・為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・信用リスク

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

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

#### ・流動性リスク

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

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

#### ・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

各ファンドは、各マザーファンドへの投資を通じて合成ベンチマークに概ね連動する投資成果をめざして運用を行いますが、各マザーファンドが各対象ベンチマーク採用全銘柄を組入れないこと、資金流出から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成ベンチマークが乖離する場合があります。

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

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

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

各ファンドは、受益者のため有利と認められる場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象ベンチマークが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、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。

各ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

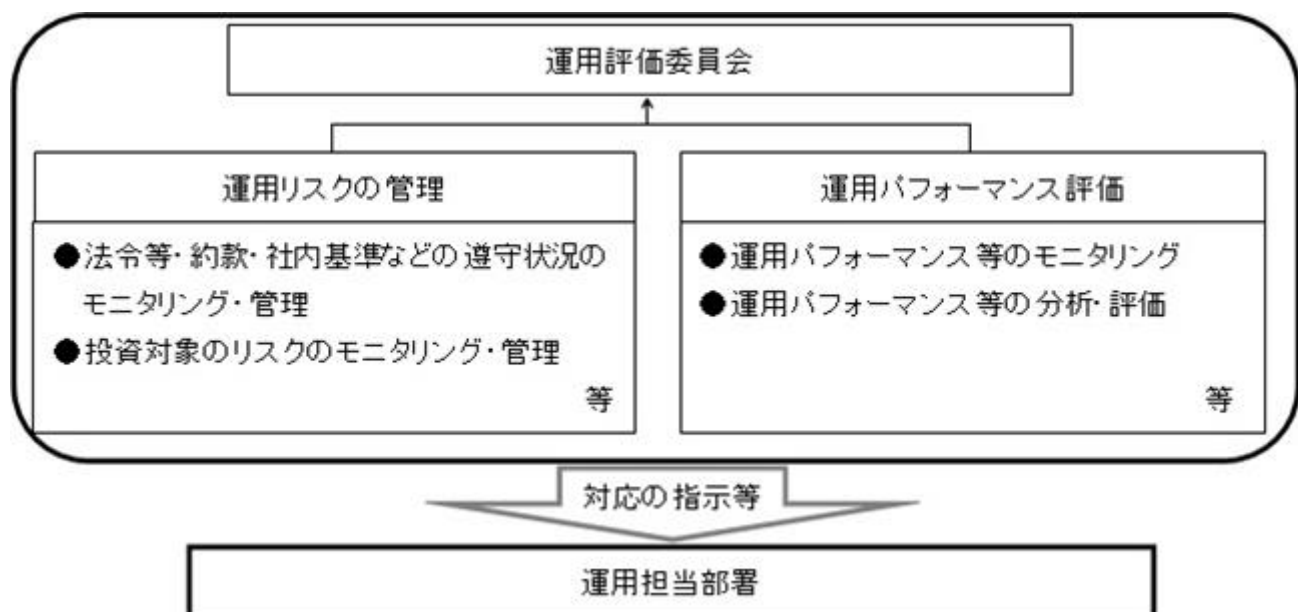
#### 注意事項

- イ．各ファンドは、実質的に株式、債券、不動産投資信託証券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ．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2025年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。



## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

#### DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)



#### DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)



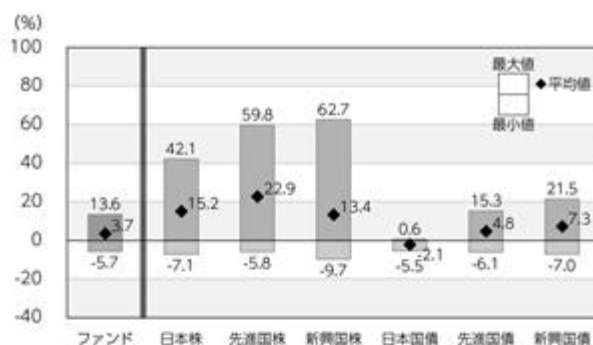
#### DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)



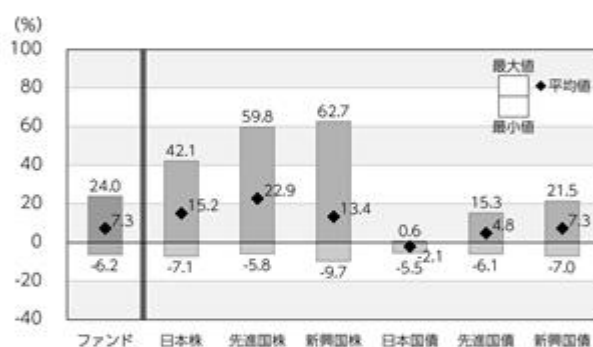
\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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

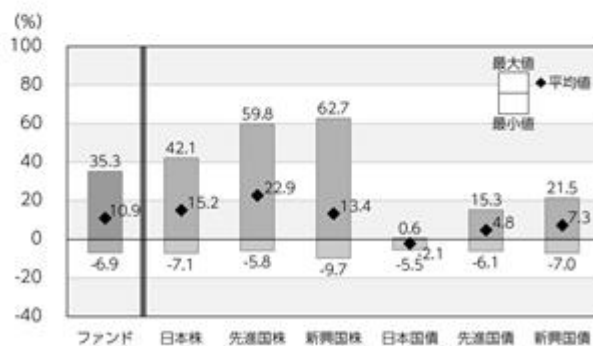
### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2020年8月～2025年7月



2020年8月～2025年7月



2020年8月～2025年7月

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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または高標は、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高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・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・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

各ファンドの信託報酬およびその配分は、日々の純資産総額に対して以下の通りとします。

ファンド名	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
信託報酬 税込（税抜）			
D I A M D C 8 資産バランス ファンド（新興国10）	0.155%	0.125%	0.035%
年率0.3465%（税抜0.315%）			
D I A M D C 8 資産バランス ファンド（新興国20）	0.170%	0.140%	0.035%
年率0.3795%（税抜0.345%）			
D I A M D C 8 資産バランス ファンド（新興国30）	0.185%	0.155%	0.035%
年率0.4125%（税抜0.375%）			
主な役務	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	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	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。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## 1. 信託財産留保額

ありません。

## 2. その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の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ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5)【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定

口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

上記は、2025年7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

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

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

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

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

…(参考情報)ファンドの総経費率…

ファンド名	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	0.37%	0.35%	0.02%
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	0.41%	0.38%	0.03%
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	0.45%	0.41%	0.04%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2024年1月12日~2025年1月14日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	12,231,775,305	96.02
内 日本	12,231,775,305	96.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	507,333,387	3.98
純資産総額	12,739,108,692	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。

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	11,082,100,187	97.01
内 日本	11,082,100,187	97.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	341,238,333	2.99
純資産総額	11,423,338,520	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。

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	15,283,609,726	98.01
内 日本	15,283,609,726	98.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	309,863,702	1.99
純資産総額	15,593,473,428	100.00

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

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

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	663,750,657,670	98.29
内 日本	663,750,657,670	98.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,514,856,764	1.71
純資産総額	675,265,514,434	100.00

## その他資産の投資状況

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	11,412,630,000	1.69
内 日本	11,412,630,000	1.69

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

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

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

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	397,437,842,350	86.39
内 日本	397,437,842,350	86.39
地方債証券	23,968,389,214	5.21
内 日本	23,968,389,214	5.21
特殊債券	20,784,150,044	4.52
内 日本	20,784,150,044	4.52
社債券	16,681,498,000	3.63
内 日本	16,386,955,000	3.56
内 フランス	294,543,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,190,901,627	0.26
純資産総額	460,062,781,235	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

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,964,449,231,963	96.64
内 アメリカ	1,451,133,937,324	71.39
内 イギリス	73,865,587,284	3.63
内 カナダ	68,111,814,275	3.35
内 スイス	53,390,068,062	2.63
内 ドイツ	52,853,426,646	2.60
内 フランス	51,822,789,951	2.55
内 アイルランド	36,505,650,499	1.80
内 オーストラリア	32,902,548,824	1.62
内 オランダ	32,584,869,952	1.60
内 スペイン	16,882,191,860	0.83
内 スウェーデン	15,758,195,527	0.78
内 イタリア	14,193,804,708	0.70
内 デンマーク	10,098,130,361	0.50
内 香港	8,078,820,989	0.40
内 シンガポール	6,759,952,493	0.33
内 フィンランド	5,346,398,995	0.26
内 イスラエル	4,962,889,967	0.24
内 ベルギー	4,297,095,962	0.21
内 ケイマン諸島	3,889,287,448	0.19
内 ジャージー	3,860,349,596	0.19
内 ルクセンブルグ	3,704,781,371	0.18
内 ノルウェー	3,161,946,541	0.16
内 リベリア	2,359,990,130	0.12
内 バミューダ	2,126,115,042	0.10
内 ニュージーランド	1,519,033,839	0.07
内 オランダ領キュラソー	1,313,800,705	0.06
内 オーストリア	1,073,750,357	0.05
内 パナマ	896,258,943	0.04
内 ポルトガル	800,641,331	0.04



	内 マン島	195,102,981	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		2,488,247,025	0.12
	内 オーストラリア	2,039,849,963	0.10
	内 シンガポール	448,397,062	0.02
投資証券		31,255,546,978	1.54
	内 アメリカ	29,622,630,906	1.46
	内 フランス	753,263,111	0.04
	内 イギリス	458,239,938	0.02
	内 香港	421,413,023	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		34,453,177,615	1.69
純資産総額		2,032,646,203,581	100.00

## その他資産の投資状況

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
株価指数先物取引（買建）	35,459,312,250	1.74	
	内 アメリカ	27,567,207,469	1.36
	内 ドイツ	4,713,775,725	0.23
	内 イギリス	1,354,212,318	0.07
	内 カナダ	1,195,198,763	0.06
	内 オーストラリア	628,917,975	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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
国債証券	295,289,719,563	98.45	
	内 アメリカ	136,242,318,328	45.42
	内 中国	33,480,612,067	11.16
	内 フランス	21,701,011,343	7.24
	内 イタリア	20,588,627,167	6.86
	内 ドイツ	17,184,675,287	5.73
	内 イギリス	16,605,239,131	5.54
	内 スペイン	13,283,172,727	4.43
	内 カナダ	5,681,250,132	1.89
	内 ベルギー	4,458,236,953	1.49
	内 オランダ	3,884,242,306	1.30
	内 オーストラリア	3,610,069,386	1.20
	内 オーストリア	3,366,271,565	1.12
	内 メキシコ	2,373,920,747	0.79
	内 ポーランド	1,958,957,053	0.65
	内 ポルトガル	1,837,542,867	0.61
	内 マレーシア	1,524,407,163	0.51
	内 フィンランド	1,507,108,966	0.50
	内 アイルランド	1,268,085,804	0.42

内 シンガポール	1,177,965,153	0.39
内 イスラエル	1,069,579,446	0.36
内 ニュージーランド	836,828,077	0.28
内 デンマーク	665,450,285	0.22
内 スウェーデン	528,243,503	0.18
内 ノルウェー	455,904,107	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,644,365,117	1.55
純資産総額	299,934,084,680	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

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	133,141,274,793	94.40
内 台湾	25,528,621,534	18.10
内 ケイマン諸島	23,703,401,857	16.81
内 インド	22,638,089,439	16.05
内 中国	14,862,393,866	10.54
内 韓国	14,639,030,649	10.38
内 サウジアラビア	4,524,076,379	3.21
内 ブラジル	4,483,782,532	3.18
内 南アフリカ	3,833,089,992	2.72
内 アラブ首長国連邦	2,273,398,771	1.61
内 メキシコ	1,937,351,413	1.37
内 マレーシア	1,643,164,884	1.17
内 インドネシア	1,553,401,275	1.10
内 タイ	1,466,604,701	1.04
内 ポーランド	1,390,146,233	0.99
内 香港	1,113,809,690	0.79
内 クエート	1,026,034,599	0.73
内 カタール	1,016,589,844	0.72
内 ギリシャ	853,959,588	0.61
内 トルコ	709,042,272	0.50
内 フィリピン	592,476,868	0.42
内 チリ	554,008,050	0.39
内 バミューダ	548,145,310	0.39
内 ハンガリー	390,760,004	0.28
内 アメリカ	377,992,472	0.27
内 イギリス	366,467,108	0.26
内 スイス	292,804,531	0.21
内 チェコ	216,109,198	0.15
内 ルクセンブルグ	194,412,285	0.14
内 コロンビア	147,943,784	0.10
内 オランダ	133,601,064	0.09
内 エジプト	69,267,284	0.05
内 ペルー	35,958,113	0.03
内 シンガポール	25,339,204	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		697,506,372	0.49
	内 メキシコ	495,316,872	0.35
	内 ブラジル	202,189,500	0.14
投資証券		125,074,671	0.09
	内 メキシコ	125,074,671	0.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,077,842,724	5.02
純資産総額		141,041,698,560	100.00

## その他資産の投資状況

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	7,108,833,698	5.04
内 アメリカ	7,108,833,698	5.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	95,274,703,670	97.49
内 サウジアラビア	11,218,121,324	11.48
内 メキシコ	10,168,298,049	10.40
内 ポーランド	9,044,189,258	9.25
内 ブラジル	8,067,999,485	8.26
内 コロンビア	7,860,479,023	8.04
内 ハンガリー	7,663,000,190	7.84
内 チリ	6,772,282,525	6.93
内 ルーマニア	6,480,549,536	6.63
内 アラブ首長国連邦	6,303,313,892	6.45
内 ドミニカ共和国	4,481,483,383	4.59
内 南アフリカ	3,734,007,478	3.82
内 ペルー	2,443,945,704	2.50
内 パナマ	2,164,032,167	2.21
内 インドネシア	2,025,543,364	2.07
内 ウルグアイ	1,836,705,233	1.88
内 オマーン	1,417,799,017	1.45
内 カタール	1,350,410,432	1.38
内 フィリピン	1,133,328,281	1.16
内 中国	1,109,215,329	1.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,454,744,078	2.51
純資産総額	97,729,447,748	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	188,648,657,600	97.20

	内 日本	188,648,657,600	97.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,434,149,090	2.80
純資産総額		194,082,806,690	100.00

その他資産の投資状況

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	5,274,022,000	2.72
内 日本	5,274,022,000	2.72

(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

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	11,333,646,349	11.08
内 オーストラリア	7,944,955,151	7.77
内 シンガポール	3,320,498,792	3.25
内 香港	68,192,406	0.07
投資証券	89,857,721,686	87.88
内 アメリカ	78,630,422,841	76.90
内 イギリス	4,275,079,380	4.18
内 フランス	2,115,210,516	2.07
内 カナダ	1,349,118,850	1.32
内 香港	1,075,047,185	1.05
内 ベルギー	1,044,870,540	1.02
内 スペイン	524,246,023	0.51
内 オランダ	172,476,697	0.17
内 韓国	172,275,851	0.17
内 イスラエル	167,187,988	0.16
内 ガーンジー	163,091,788	0.16
内 ニュージーランド	82,142,180	0.08
内 アイルランド	40,727,249	0.04
内 ドイツ	31,924,577	0.03
内 イタリア	13,900,021	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,054,976,017	1.03
純資産総額	102,246,344,052	100.00

その他資産の投資状況

2025年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	1,097,418,940	1.07
内 アメリカ	1,097,418,940	1.07

(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】

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,054,540,960	1.1949 7,234,913,048	1.1639 7,046,880,223	- -	55.32
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	125,232,000	10.0153 1,254,239,943	10.7148 1,341,835,833	- -	10.53
3	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	249,336,093	4.7907 1,194,502,372	5.3267 1,328,138,566	- -	10.43
4	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	337,830,315	1.7924 605,537,843	2.0736 700,524,941	- -	5.50
5	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	256,152,844	2.4527 628,266,082	2.5044 641,509,182	- -	5.04
6	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	157,727,543	2.2282 351,451,386	2.5999 410,075,839	- -	3.22
7	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	156,797,134	2.4256 380,338,639	2.4769 388,370,821	- -	3.05
8	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	174,621,042	2.1267 371,371,120	2.1443 374,439,900	- -	2.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

2025年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.02
合計	96.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

2025年7月31日現在

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

1	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	2,964,442,614	1.1935 3,538,328,038	1.1639 3,450,314,758	- -	30.20
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	164,702,771	10.0236 1,650,923,469	10.7148 1,764,757,250	- -	15.45
3	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	323,880,354	4.7901 1,551,443,669	5.3267 1,725,213,481	- -	15.10
4	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	573,154,669	1.7918 1,027,016,207	2.0736 1,188,493,521	- -	10.40
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	453,732,465	2.4486 1,111,009,719	2.5044 1,136,327,585	- -	9.95
6	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	270,731,514	2.2276 603,083,539	2.5999 703,874,863	- -	6.16
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	315,178,721	2.1227 669,053,120	2.1443 675,837,731	- -	5.92
8	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	176,543,663	2.4247 428,079,400	2.4769 437,280,998	- -	3.83

（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

2025年7月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.01
合計	97.01

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	297,350,082	10.0259 2,981,214,894	10.7148 3,186,046,658	- -	20.43
2	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	583,756,916	4.7915 2,797,118,413	5.3267 3,109,497,964	- -	19.94
3	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	1,161,629,430	1.7914 2,081,040,294	2.0736 2,408,754,786	- -	15.45

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	927,012,743	2.4490 2,270,337,068	2.5044 2,321,610,713	- -	14.89
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	534,032,751	2.2281 1,189,911,978	2.5999 1,388,431,749	- -	8.90
6	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	641,568,250	2.1214 1,361,026,084	2.1443 1,375,714,798	- -	8.82
7	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	301,541,766	2.4271 731,878,285	2.4769 746,888,800	- -	4.79
8	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	641,519,253	1.1938 765,902,338	1.1639 746,664,258	- -	4.79

（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

2025年7月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.01
合計	98.01

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

#### 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	8,453,300	2,809.05 23,745,746,110	2,696.50 22,794,323,450	- -	3.38
2	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	10,045,500	1,906.25 19,149,289,402	2,110.50 21,201,027,750	- -	3.14
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,485,500	3,498.05 19,188,594,594	3,682.00 20,197,611,000	- -	2.99
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	4,085,500	4,055.15 16,567,321,242	4,697.00 19,189,593,500	- -	2.84
5	任天堂 日本	株式 その他製 品	1,004,100	10,891.43 10,936,087,150	12,690.00 12,742,029,000	- -	1.89
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	3,233,700	3,721.84 12,035,319,981	3,855.00 12,465,913,500	- -	1.85

7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,209,000	10,480.66 12,671,127,363	9,052.00 10,943,868,000	- -	1.62
8	三菱重工業 日本	株式 機械	2,808,800	2,280.04 6,404,200,977	3,630.00 10,195,944,000	- -	1.51
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,092,600	4,121.62 8,624,916,924	4,482.00 9,379,033,200	- -	1.39
10	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	786,800	9,526.25 7,495,260,717	11,810.00 9,292,108,000	- -	1.38
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,109,400	2,542.21 7,904,771,106	2,988.00 9,290,887,200	- -	1.38
12	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	336,600	25,249.11 8,498,851,579	27,330.00 9,199,278,000	- -	1.36
13	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,494,900	5,105.94 7,632,884,229	6,124.00 9,154,767,600	- -	1.36
14	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,130,900	6,735.88 7,617,611,005	7,933.00 8,971,429,700	- -	1.33
15	キーエンス 日本	株式 電気機器	159,000	62,808.39 9,986,535,140	55,200.00 8,776,800,000	- -	1.30
16	三井物産 日本	株式 卸売業	2,418,400	2,866.43 6,932,189,754	3,100.00 7,497,040,000	- -	1.11
17	NTT 日本	株式 情報・通信業	47,440,800	147.48 6,996,662,464	152.70 7,244,210,160	- -	1.07
18	信越化学工業 日本	株式 化学	1,417,000	4,682.67 6,635,349,482	4,395.00 6,227,715,000	- -	0.92
19	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,419,200	4,147.99 5,886,840,218	4,200.00 5,960,640,000	- -	0.88
20	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,767,600	1,437.24 5,414,975,480	1,569.00 5,911,364,400	- -	0.88
21	HOYA 日本	株式 精密機器	306,000	18,670.77 5,713,256,072	19,180.00 5,869,080,000	- -	0.87
22	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	25,582,100	201.65 5,158,785,368	218.60 5,592,247,060	- -	0.83
23	KDDI 日本	株式 情報・通信業	2,241,100	2,444.76 5,478,970,600	2,485.50 5,570,254,050	- -	0.82
24	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,633,800	2,473.57 4,041,328,668	3,342.00 5,460,159,600	- -	0.81
25	第一三共 日本	株式 医薬品	1,464,300	3,800.29 5,564,767,349	3,720.00 5,447,196,000	- -	0.81
26	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	113,600	48,591.83 5,520,033,009	46,380.00 5,268,768,000	- -	0.78
27	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	501,400	8,493.40 4,258,594,087	10,350.00 5,189,490,000	- -	0.77



28	日本電気 日本	株式 電気機器	1,135,900	3,148.29 3,576,146,405	4,399.00 4,996,824,100	- -	0.74
29	富士通 日本	株式 電気機器	1,478,000	3,013.26 4,453,598,527	3,305.00 4,884,790,000	- -	0.72
30	丸紅 日本	株式 卸売業	1,382,600	2,389.51 3,303,738,398	3,113.00 4,304,033,800	- -	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

2025年7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	98.29
合計	98.29

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2025年7月31日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	17.41
銀行業		9.02
情報・通信業		7.89
卸売業		6.80
輸送用機器		6.78
機械		6.10
化学		4.68
小売業		4.62
サービス業		4.35
医薬品		3.80
保険業		3.24
その他製品		3.10
食料品		2.90
陸運業		2.35
建設業		2.26
精密機器		2.00
不動産業		1.80
電気・ガス業		1.24
その他金融業		1.10
非鉄金属		1.05
証券、商品先物取引業		0.91
鉄鋼		0.75
ガラス・土石製品		0.63
ゴム製品		0.62
海運業		0.60
金属製品		0.47
石油・石炭製品		0.45
繊維製品		0.39
空運業		0.34
鉱業		0.27
倉庫・運輸関連業		0.15
パルプ・紙		0.14

水産・農林業	0.07
合計	98.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,100,000,000	98.18 5,007,285,000	98.53 5,025,132,000	0.005 2027/6/20	1.09
2	373回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,800,000,000	94.60 4,540,842,000	93.78 4,501,632,000	0.6 2033/12/20	0.98
3	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	98.40 4,428,225,000	98.70 4,441,905,000	0.1 2027/6/20	0.97
4	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,750,000,000	93.32 4,432,780,000	92.78 4,407,287,500	0.2 2032/9/20	0.96
5	372回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	96.57 4,346,085,000	95.68 4,305,870,000	0.8 2033/9/20	0.94
6	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,370,000,000	98.18 4,290,466,000	98.48 4,303,881,900	0.1 2027/9/20	0.94
7	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,400,000,000	97.45 4,288,098,000	97.80 4,303,420,000	0.1 2028/6/20	0.94
8	377回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,350,000,000	98.03 4,264,735,500	97.37 4,235,638,500	1.2 2034/12/20	0.92
9	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,480,000,000	94.10 4,215,724,000	93.54 4,190,592,000	0.2 2032/3/20	0.91
10	378回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,200,000,000	99.36 4,173,172,000	98.86 4,152,414,000	1.4 2035/3/20	0.90
11	374回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,300,000,000	95.63 4,112,294,000	95.01 4,085,516,000	0.8 2034/3/20	0.89
12	375回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,180,000,000	97.85 4,090,130,000	97.13 4,060,034,000	1.1 2034/6/20	0.88
13	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,330,000,000	93.83 4,063,101,000	93.28 4,039,067,300	0.1 2031/12/20	0.88
14	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,310,000,000	93.88 4,046,522,000	93.65 4,036,659,800	0.1 2031/9/20	0.88

15	471回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.33 4,013,568,000	100.22 4,008,880,000	0.9 2027/4/1	0.87
16	371回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,300,000,000	93.54 4,022,594,000	93.03 4,000,333,000	0.4 2033/6/20	0.87
17	158回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	97.86 3,914,763,000	98.04 3,921,720,000	0.1 2028/3/20	0.85
18	370回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,150,000,000	94.77 3,932,996,500	94.11 3,905,897,000	0.5 2033/3/20	0.85
19	376回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,020,000,000	96.27 3,870,295,000	95.10 3,823,100,400	0.9 2034/9/20	0.83
20	150回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,770,000,000	98.64 3,718,728,000	99.03 3,733,732,600	0.005 2026/12/20	0.81
21	369回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,920,000,000	95.58 3,746,751,000	94.48 3,703,655,200	0.5 2032/12/20	0.81
22	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	94.77 3,696,147,000	94.69 3,693,222,000	0.1 2030/12/20	0.80
23	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,910,000,000	94.51 3,695,419,200	94.37 3,689,867,000	0.1 2031/3/20	0.80
24	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,850,000,000	95.27 3,667,933,500	95.31 3,669,781,500	0.1 2030/6/20	0.80
25	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,660,000,000	98.82 3,616,812,000	99.16 3,629,585,400	0.1 2026/12/20	0.79
26	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	95.03 3,611,140,000	95.02 3,610,836,000	0.1 2030/9/20	0.78
27	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,690,000,000	96.90 3,575,831,400	97.24 3,588,266,700	0.1 2028/12/20	0.78
28	358回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,750,000,000	95.54 3,583,087,000	95.65 3,587,062,500	0.1 2030/3/20	0.78
29	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,570,000,000	99.01 3,534,657,000	99.35 3,546,830,700	0.1 2026/9/20	0.77
30	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,770,000,000	94.29 3,555,078,000	94.03 3,544,968,700	0.1 2031/6/20	0.77

(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

2025年7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	86.39
地方債証券	5.21
特殊債券	4.52
社債券	3.63
合計	99.74

(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

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	4,502,679	20,614.49 92,820,438,449	26,781.14 120,586,900,538	- -	5.93
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,303,079	61,281.84 79,855,083,001	76,672.92 99,910,876,611	- -	4.92
3	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,772,060	36,126.72 100,145,437,104	31,229.97 86,571,376,972	- -	4.26
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,762,676	33,795.29 59,570,153,010	34,388.08 60,615,050,529	- -	2.98
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	404,332	108,581.14 43,902,830,972	103,857.42 41,992,879,111	- -	2.07
6	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	824,560	34,619.24 28,545,645,538	45,208.40 37,277,039,788	- -	1.83
7	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	1,079,338	27,388.83 29,561,810,606	29,359.61 31,688,949,969	- -	1.56

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	910,206	27,736.31 25,245,759,676	29,495.56 26,847,037,141	- -	1.32
9	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	534,426	52,292.48 27,946,462,718	47,661.38 25,471,483,660	- -	1.25
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	516,042	41,097.87 21,208,229,923	44,761.72 23,098,930,453	- -	1.14
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	247,227	72,100.33 17,825,148,485	71,109.63 17,580,222,968	- -	0.86
12	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	148,737	125,430.74 18,656,192,979	113,548.35 16,888,841,112	- -	0.83
13	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	318,295	52,877.25 16,830,565,878	52,422.44 16,685,802,099	- -	0.82
14	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	79,009	158,592.25 12,530,215,112	176,907.63 13,977,295,570	- -	0.69
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	798,298	16,194.20 12,927,801,677	16,716.74 13,344,940,906	- -	0.66
16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	150,450	84,300.55 12,683,018,228	83,525.44 12,566,402,884	- -	0.62
17	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	814,485	15,416.41 12,556,439,652	14,578.97 11,874,352,461	- -	0.58
18	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	310,780	25,895.79 8,047,896,592	37,437.13 11,634,712,504	- -	0.57
19	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	81,902	158,975.56 13,020,416,345	138,560.71 11,348,399,999	- -	0.56
20	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	445,122	23,337.25 10,387,926,226	24,986.97 11,122,250,683	- -	0.55
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	183,679	60,583.74 11,127,961,978	55,585.03 10,209,802,945	- -	0.50
22	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	432,996	24,378.56 10,555,819,282	22,838.74 9,889,084,450	- -	0.49
23	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,334,183	6,959.98 9,285,894,043	7,164.74 9,559,080,177	- -	0.47

24	PALANTIR TECHNOLOGIES INC アメリカ	株式 ソフトウェア	396,086	17,550.78 6,951,621,482	23,694.74 9,385,157,916	- -	0.46
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	326,745	28,812.53 9,414,351,396	28,281.02 9,240,682,173	- -	0.45
26	SAP SE ドイツ	株式 ソフトウェア	192,949	46,938.49 9,056,736,529	43,199.74 8,335,348,562	- -	0.41
27	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	362,618	22,828.83 8,278,147,974	22,940.32 8,318,576,003	- -	0.41
28	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	300,759	16,845.41 5,066,409,638	26,816.99 8,065,453,772	- -	0.40
29	GE AEROSPACE アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	196,748	31,235.76 6,145,573,871	40,865.63 8,040,231,856	- -	0.40
30	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	72,789	123,925.85 9,020,439,032	107,145.62 7,799,022,898	- -	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

2025年7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	96.64
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.12
投資証券	1.54
合計	98.31

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2025年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
半導体・半導体製造装置	外国	10.53
ソフトウェア		9.44
銀行		6.42
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.06
コンピュータ・周辺機器		4.58
医薬品		3.77
資本市場		3.76
大規模小売り		3.45
石油・ガス・消耗燃料		3.44
金融サービス		3.07
保険		2.97

航空宇宙・防衛	2.55
ヘルスケア機器・用品	1.99
ホテル・レストラン・レジャー	1.90
生活必需品流通・小売り	1.73
自動車	1.66
機械	1.64
電力	1.63
娯楽	1.56
バイオテクノロジー	1.49
専門小売り	1.46
化学	1.35
電気設備	1.33
情報技術サービス	1.25
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.19
金属・鉱業	1.16
飲料	1.13
各種電気通信サービス	0.96
食品	0.92
専門サービス	0.87
陸上運輸	0.84
家庭用品	0.80
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.76
繊維・アパレル・贅沢品	0.74
総合公益事業	0.73
通信機器	0.72
タバコ	0.66
コングロマリット	0.66
建設関連製品	0.60
電子装置・機器・部品	0.60
商業サービス・用品	0.60
商社・流通業	0.46
消費者金融	0.45
パーソナルケア用品	0.45
建設・土木	0.38
メディア	0.37
建設資材	0.34
航空貨物・物流サービス	0.32
不動産管理・開発	0.30
家庭用耐久財	0.21
無線通信サービス	0.20
容器・包装	0.20
エネルギー設備・サービス	0.16
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	0.09
旅客航空輸送	0.09
ガス	0.09
自動車用部品	0.08
ヘルスケア・テクノロジー	0.08
水道	0.07
販売	0.06

紙製品・林産品	0.05
海上運輸	0.04
各種消費者サービス	0.01
合計	96.64

（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。

### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証 券	1,613,412,000	99.37 1,603,322,384	99.74 1,609,346,956	4.125 2032/11/15	0.54
2	US T N/B 4.625 02/15/35 アメリカ	国債証 券	1,344,510,000	102.92 1,383,849,394	102.11 1,372,975,804	4.625 2035/2/15	0.46
3	US T N/B 3.75 04/15/28 アメリカ	国債証 券	1,344,510,000	99.94 1,343,824,299	99.63 1,339,625,650	3.75 2028/4/15	0.45
4	US T N/B 4.125 07/31/31 アメリカ	国債証 券	1,269,815,000	100.20 1,272,380,540	100.33 1,274,105,589	4.125 2031/7/31	0.42
5	US T N/B 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証 券	1,195,120,000	99.17 1,185,304,457	100.59 1,202,286,045	4.375 2034/5/15	0.40
6	US T N/B 4.125 11/15/27 アメリカ	国債証 券	1,195,120,000	100.21 1,197,670,087	100.46 1,200,675,443	4.125 2027/11/15	0.40
7	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,398,290,400	82.46 1,153,040,238	85.01 1,188,738,012	1.25 2031/8/15	0.40
8	US T N/B 4.25 06/30/29 アメリカ	国債証 券	1,150,303,000	101.02 1,162,062,186	101.20 1,164,165,047	4.25 2029/6/30	0.39
9	US T N/B 3.875 08/15/34 アメリカ	国債証 券	1,195,120,000	95.67 1,143,408,366	96.70 1,155,741,726	3.875 2034/8/15	0.39
10	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証 券	1,328,077,100	83.39 1,107,540,596	85.02 1,129,150,854	1.375 2031/11/15	0.38
11	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証 券	1,120,425,000	96.39 1,080,072,198	98.04 1,098,519,817	4 2034/2/15	0.37
12	US T N/B 4.25 11/15/34 アメリカ	国債証 券	1,090,547,000	98.50 1,074,238,181	99.33 1,083,305,091	4.25 2034/11/15	0.36
13	US T N/B 3.75 08/15/27 アメリカ	国債証 券	1,075,608,000	99.17 1,066,720,128	99.64 1,071,826,570	3.75 2027/8/15	0.36
14	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証 券	1,045,730,000	100.13 1,047,180,134	101.73 1,063,907,725	4.5 2033/11/15	0.35
15	US T N/B 1.875 02/28/27 アメリカ	国債証 券	1,092,040,900	95.73 1,045,430,377	96.78 1,056,890,832	1.875 2027/2/28	0.35
16	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	1,207,071,200	84.90 1,024,908,580	87.22 1,052,863,131	1.875 2032/2/15	0.35
17	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 中国	国債証 券	1,036,445,000	101.14 1,048,322,037	100.79 1,044,733,761	2.18 2026/8/15	0.35
18	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証 券	1,083,077,500	93.60 1,013,777,455	95.54 1,034,783,244	3.5 2033/2/15	0.35
19	US T N/B 4.0 01/15/27 アメリカ	国債証 券	1,030,791,000	99.84 1,029,184,854	99.95 1,030,287,684	4 2027/1/15	0.34



20	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,096,522,600	89.78 984,534,067	91.49 1,003,253,932	2.75 2032/8/15	0.33
21	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27 中国	国債証券	983,379,016	100.47 988,093,801	100.32 986,601,450	1.62 2027/8/15	0.33
22	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,053,199,500	90.39 952,014,178	92.56 974,867,787	2.875 2032/5/15	0.33
23	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27 中国	国債証券	974,258,300	99.62 970,588,147	99.88 973,151,844	1.42 2027/11/15	0.32
24	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	1,000,913,000	92.51 926,040,009	94.46 945,471,805	3.375 2033/5/15	0.32
25	FRANCE OAT 0.75 02/25/28 フランス	国債証券	969,860,000	95.14 922,792,957	96.51 936,022,566	0.75 2028/2/25	0.31
26	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証券	903,780,040	101.95 921,453,002	101.42 916,644,535	2.69 2026/8/12	0.31
27	CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33 中国	国債証券	846,775,565	107.79 912,821,778	107.06 906,587,557	2.67 2033/11/25	0.30
28	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	862,322,240	105.45 909,389,552	104.96 905,125,156	2.68 2030/5/21	0.30
29	US T N/B 4.25 12/31/26 アメリカ	国債証券	896,340,000	100.31 899,199,324	100.27 898,808,439	4.25 2026/12/31	0.30
30	US T N/B 4.125 01/31/27 アメリカ	国債証券	896,340,000	100.12 897,442,498	100.14 897,617,983	4.125 2027/1/31	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

2025年7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.45
合計	98.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資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

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,460,794	4,320.86 10,632,756,958	5,803.87 14,282,140,776	- -	10.13

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	643,300	8,767.38 5,640,058,661	10,441.98 6,717,325,734	- -	4.76
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小売り	1,717,768	2,076.06 3,566,205,463	2,227.24 3,825,885,035	- -	2.71
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	473,155	5,968.21 2,823,890,676	7,819.01 3,699,608,408	- -	2.62
5	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	564,471	3,267.94 1,844,662,483	3,464.11 1,955,394,151	- -	1.39
6	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	1,712,200	818.15 1,400,850,497	1,041.34 1,782,990,909	- -	1.26
7	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	54,612	19,349.82 1,056,732,827	28,378.94 1,549,831,217	- -	1.10
8	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	9,599,530	128.21 1,230,784,285	155.77 1,495,355,266	- -	1.06
9	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	607,742	2,201.67 1,338,048,374	2,411.27 1,465,430,660	- -	1.04
10	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	524,951	2,407.85 1,264,006,231	2,534.90 1,330,700,389	- -	0.94
11	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・レストラン・レジャー	498,110	2,591.30 1,290,754,740	2,423.14 1,206,994,250	- -	0.86
12	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小売り	69,455	14,086.60 978,385,031	16,869.11 1,171,644,646	- -	0.83
13	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,250,263	683.18 854,158,507	861.78 1,077,461,025	- -	0.76
14	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	152,348	6,723.55 1,024,320,491	6,934.50 1,056,457,206	- -	0.75

15	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	332,596	2,447.94 814,176,509	2,597.48 863,914,784	- -	0.61
16	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 無線通信 サービス	256,234	3,236.66 829,343,613	3,304.74 846,788,286	- -	0.60
17	BYD CO LTD 中国	株式 自動車	366,500	2,326.68 852,729,348	2,299.51 842,773,347	- -	0.60
18	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小 売り	16,417	37,933.29 622,750,870	47,095.26 773,162,932	- -	0.55
19	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,507,235	102.60 667,665,988	115.07 748,794,038	- -	0.53
20	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	195,208	3,889.68 759,298,211	3,771.49 736,225,995	- -	0.52
21	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	664,000	836.80 555,639,531	1,070.82 711,028,464	- -	0.50
22	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	174,500	3,066.54 535,112,115	3,902.90 681,056,748	- -	0.48
23	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,088,200	84.68 600,231,228	87.11 617,464,443	- -	0.44
24	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS ケイマン諸島	株式 銀行	321,506	1,657.70 532,961,769	1,885.30 606,135,840	- -	0.43
25	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	244,485	2,635.14 644,253,521	2,413.63 590,098,286	- -	0.42
26	TRIP.COM GROUP LTD ケイマン諸島	株式 ホテル・ レストラン・ レジャー	62,400	8,589.50 535,985,014	9,392.07 586,065,542	- -	0.42
27	SAUDI ARABIAN OIL CO サウジアラビア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	599,074	1,014.41 607,707,690	967.41 579,555,210	- -	0.41
28	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉄 業	363,989	1,419.59 516,715,903	1,442.99 525,235,451	- -	0.37
29	DELTA ELECTRONICS INC 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	195,045	1,618.85 315,749,726	2,663.24 519,453,596	- -	0.37
30	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	81,598	4,948.30 403,772,176	6,321.98 515,861,740	- -	0.37

(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。

## 投資有価証券の種類別投資比率

2025年7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	94.40
投資信託受益証券	0.49
投資証券	0.09
合計	94.98

（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

2025年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
銀行	外国	17.09
半導体・半導体製造装置		13.22
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.88
コンピュータ・周辺機器		5.62
大規模小売り		4.76
石油・ガス・消耗燃料		3.90
金属・鉱業		3.42
自動車		2.92
保険		2.91
電子装置・機器・部品		2.45
ホテル・レストラン・レジャー		2.06
情報技術サービス		1.57
無線通信サービス		1.49
不動産管理・開発		1.43
化学		1.39
電気設備		1.33
食品		1.22
医薬品		1.19
各種電気通信サービス		1.04
生活必需品流通・小売り		1.03
資本市場		0.99
娯楽		0.98
電力		0.97
バイオテクノロジー		0.96
金融サービス		0.94
コングロマリット		0.93
機械		0.90
飲料		0.85
航空宇宙・防衛		0.83
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.81
専門小売り		0.74
繊維・アパレル・贅沢品		0.65
消費者金融		0.62
運送インフラ		0.62
建設資材		0.58
建設・土木		0.57
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		0.57

自動車用部品	0.54
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.50
パーソナルケア用品	0.49
家庭用耐久財	0.41
旅客航空輸送	0.36
海上運輸	0.30
タバコ	0.30
ガス	0.28
通信機器	0.26
航空貨物・物流サービス	0.25
ソフトウェア	0.22
陸上運輸	0.17
水道	0.14
総合公益事業	0.12
ヘルスケア機器・用品	0.11
各種消費者サービス	0.10
エネルギー設備・サービス	0.09
紙製品・林産品	0.09
商社・流通業	0.09
メディア	0.04
家庭用品	0.03
商業サービス・用品	0.03
建設関連製品	0.02
販売	0.01
合計	94.40

(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。

#### エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	SOUTH AFRICA 7.1 11/19/36 南アフリカ	国債証券	2,539,630,000	94.54 2,401,010,272	99.54 2,528,069,375	7.1 2036/11/19	2.59
2	ROMANIA 6.625 02/17/28 ルーマニア	国債証券	2,240,850,000	102.05 2,286,830,001	103.67 2,323,167,579	6.625 2028/2/17	2.38
3	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	2,240,850,000	92.16 2,065,205,028	94.39 2,115,250,357	3.875 2030/6/12	2.16
4	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	1,942,070,000	98.96 1,921,995,345	99.94 1,941,050,219	4.375 2029/4/16	1.99
5	COLOMBIA 3.125 04/15/31 コロンビア	国債証券	2,091,460,000	79.20 1,656,436,320	84.39 1,765,066,752	3.125 2031/4/15	1.81
6	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30 サウジアラビア	国債証券	1,643,290,000	99.98 1,643,050,976	101.18 1,662,754,047	4.75 2030/1/16	1.70
7	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証券	1,643,290,000	99.31 1,632,038,094	101.14 1,662,100,527	5.25 2029/6/16	1.70

8	UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/07/36 メキシコ	国債証券	1,643,290,000	94.80 1,557,865,810	97.90 1,608,782,241	6 2036/5/7	1.65
9	HUNGARY 6.125 05/22/28 ハンガリー	国債証券	1,493,900,000	102.61 1,533,033,009	103.26 1,542,620,202	6.125 2028/5/22	1.58
10	UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32 アラブ首長国連邦	国債証券	1,493,900,000	97.38 1,454,873,729	98.98 1,478,689,707	4.05 2032/7/7	1.51
11	REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27 ポーランド	国債証券	1,344,510,000	102.79 1,382,034,601	103.16 1,387,033,530	5.5 2027/11/16	1.42
12	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	1,374,388,000	96.35 1,324,322,929	99.50 1,367,653,498	6 2033/2/22	1.40
13	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証券	1,344,510,000	99.10 1,332,530,415	101.65 1,366,791,528	6.35 2035/2/9	1.40
14	ROMANIA 5.875 01/30/29 ルーマニア	国債証券	1,344,510,000	98.87 1,329,363,721	101.64 1,366,620,036	5.875 2029/1/30	1.40
15	REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29 ポーランド	国債証券	1,344,510,000	100.44 1,350,495,745	101.00 1,358,064,435	4.625 2029/3/18	1.39
16	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	1,344,510,000	97.68 1,313,411,483	100.20 1,347,199,020	5.5 2029/2/22	1.38
17	REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32 ポーランド	国債証券	1,269,815,000	104.68 1,329,346,093	105.72 1,342,553,519	5.75 2032/11/16	1.37
18	COLOMBIA 3.25 04/22/32 コロンビア	国債証券	1,643,290,000	75.73 1,244,608,425	81.59 1,340,842,475	3.25 2032/4/22	1.37
19	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 メキシコ	国債証券	1,493,900,000	83.72 1,250,735,387	86.36 1,290,251,552	2.659 2031/5/24	1.32
20	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33 メキシコ	国債証券	1,344,510,000	91.26 1,227,008,789	93.83 1,261,594,068	4.875 2033/5/19	1.29
21	REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54 ポーランド	国債証券	1,344,510,000	92.49 1,243,594,440	93.38 1,255,525,971	5.5 2054/3/18	1.28
22	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,493,900,000	81.16 1,212,595,940	83.93 1,253,973,998	2.125 2031/9/22	1.28
23	DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32 ドミニカ共和国	国債証券	1,344,510,000	90.86 1,221,680,048	92.77 1,247,369,152	4.875 2032/9/23	1.28
24	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証券	1,195,120,000	102.36 1,223,330,807	104.03 1,243,283,336	6.25 2032/9/22	1.27
25	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証券	1,344,510,000	84.09 1,130,635,806	89.69 1,205,938,103	7.3 2052/4/20	1.23
26	REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33 ポーランド	国債証券	1,195,120,000	98.47 1,176,916,081	99.62 1,190,656,501	4.875 2033/10/4	1.22

27	BRAZIL 6.0 10/20/33 ブラジル	国債証券	1,195,120,000	97.11 1,160,583,213	98.87 1,181,701,778	6 2033/10/20	1.21
28	ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31 アラブ首長国連邦	国債証券	1,344,510,000	85.85 1,154,364,167	87.84 1,181,075,451	1.875 2031/9/15	1.21
29	REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33 チリ	国債証券	1,344,510,000	82.86 1,114,092,357	84.11 1,130,934,586	2.55 2033/7/27	1.16
30	BRAZIL 6.25 03/18/31 ブラジル	国債証券	1,045,730,000	101.99 1,066,577,090	102.98 1,076,993,426	6.25 2031/3/18	1.10

(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

2025年7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.49
合計	97.49

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	103,400	134,162.24 13,872,376,559	138,700.00 14,341,580,000	- -	7.39
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	89,518	119,373.21 10,686,051,608	122,900.00 11,001,762,200	- -	5.67
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	90,506	99,399.05 8,996,211,009	110,100.00 9,964,710,600	- -	5.13
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	55,541	142,692.59 7,925,289,494	159,400.00 8,853,235,400	- -	4.56
5	KDX不動産投資法人 日本	投資証券	50,825	154,000.65 7,827,083,358	162,500.00 8,259,062,500	- -	4.26
6	GLP投資法人 日本	投資証券	57,351	128,008.66 7,341,424,927	132,400.00 7,593,272,400	- -	3.91
7	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	89,725	78,172.31 7,014,010,782	81,700.00 7,330,532,500	- -	3.78
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	27,437	240,124.66 6,588,300,409	253,100.00 6,944,304,700	- -	3.58
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	34,729	183,890.35 6,386,328,206	197,800.00 6,869,396,200	- -	3.54
10	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	96,214	63,078.61 6,069,045,940	67,200.00 6,465,580,800	- -	3.33

11	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	38,536	154,151.30 5,940,374,781	165,800.00 6,389,268,800	- -	3.29
12	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	35,890	148,293.45 5,322,252,174	156,100.00 5,602,429,000	- -	2.89
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	64,135	74,966.98 4,808,007,823	82,900.00 5,316,791,500	- -	2.74
14	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	47,137	91,614.88 4,318,450,646	99,300.00 4,680,704,100	- -	2.41
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	52,063	77,060.82 4,012,017,479	78,500.00 4,086,945,500	- -	2.11
16	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	31,913	119,617.80 3,817,363,049	123,700.00 3,947,638,100	- -	2.03
17	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	38,487	101,236.06 3,896,272,388	101,400.00 3,902,581,800	- -	2.01
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	30,092	116,662.75 3,510,615,660	118,400.00 3,562,892,800	- -	1.84
19	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	26,911	119,014.19 3,202,790,911	129,300.00 3,479,592,300	- -	1.79
20	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	22,783	135,865.10 3,095,414,763	143,900.00 3,278,473,700	- -	1.69
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	34,756	92,653.70 3,220,272,252	93,800.00 3,260,112,800	- -	1.68
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	20,496	131,159.35 2,688,242,206	136,600.00 2,799,753,600	- -	1.44
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	21,165	125,663.60 2,659,670,120	128,900.00 2,728,168,500	- -	1.41
24	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	30,633	82,807.08 2,536,629,501	86,100.00 2,637,501,300	- -	1.36
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	25,743	93,930.21 2,418,045,625	102,400.00 2,636,083,200	- -	1.36
26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,837	286,852.07 2,534,911,761	297,000.00 2,624,589,000	- -	1.35
27	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	15,401	152,240.30 2,344,652,866	165,000.00 2,541,165,000	- -	1.31
28	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	7,121	309,058.90 2,200,808,441	351,000.00 2,499,471,000	- -	1.29
29	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	33,596	67,106.39 2,254,506,431	73,500.00 2,469,306,000	- -	1.27



30	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	11,686	187,965.74 2,196,567,735	196,900.00 2,300,973,400	- -	1.19
----	-----------------------	------	--------	-----------------------------	-----------------------------	--------	------

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2025年7月31日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	97.20
合計	97.20

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	285,388	22,613.57 6,453,642,509	24,855.50 7,093,463,774	- -	6.94
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	426,261	15,788.15 6,729,875,550	16,207.32 6,908,548,899	- -	6.76
3	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	44,941	131,170.57 5,894,936,733	119,069.80 5,351,116,133	- -	5.23
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	145,481	26,181.94 3,808,976,149	26,486.84 3,853,332,988	- -	3.77
5	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	415,021	8,542.13 3,545,166,112	8,483.85 3,520,979,272	- -	3.44
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	141,011	23,526.27 3,317,464,223	24,718.06 3,485,519,684	- -	3.41
7	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	933,519	3,327.00 3,105,822,817	3,364.81 3,141,117,240	- -	3.07
8	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	72,569	43,324.69 3,144,029,725	43,121.42 3,129,278,581	- -	3.06
9	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	485,823	4,821.81 2,342,548,098	4,859.65 2,360,932,996	- -	2.31
10	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	97,577	21,828.31 2,129,941,408	22,309.90 2,176,933,366	- -	2.13
11	VENTAS INC アメリカ	投資証券	207,531	9,337.53 1,937,827,631	9,931.44 2,061,083,168	- -	2.02
12	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	135,682	15,129.00 2,052,733,739	14,632.75 1,985,400,853	- -	1.94
13	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	65,392	30,894.66 2,020,263,913	29,326.75 1,917,734,894	- -	1.88
14	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	157,318	10,292.96 1,619,269,000	9,755.16 1,534,663,362	- -	1.50
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	262,390	5,029.97 1,319,815,484	4,687.85 1,230,047,113	- -	1.20

16	MID AMERICA アメリカ	投資証券	53,885	22,190.68 1,195,745,073	22,227.73 1,197,741,667	- -	1.17
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	29,635	42,488.56 1,259,148,519	40,105.23 1,188,518,769	- -	1.16
18	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	311,570	3,122.56 972,896,178	3,271.64 1,019,345,186	- -	1.00
19	LINK REIT 香港	投資証券	1,187,620	791.84 940,410,018	844.48 1,002,930,838	- -	0.98
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	55,264	18,829.30 1,040,582,987	17,418.87 962,636,652	- -	0.94
21	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	100,865	9,470.92 955,284,573	9,511.66 959,393,717	- -	0.94
22	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	2,402,937	346.70 833,105,526	362.74 871,663,954	- -	0.85
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	126,635	6,970.72 882,738,254	6,831.60 865,120,261	- -	0.85
24	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	70,944	10,688.18 758,262,420	11,656.90 826,987,234	- -	0.81
25	UDR INC アメリカ	投資証券	138,939	6,127.84 851,396,447	5,944.22 825,885,107	- -	0.81
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	49,238	17,255.95 849,648,953	16,749.60 824,717,139	- -	0.81
27	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	320,167	2,556.20 818,412,412	2,572.49 823,628,262	- -	0.81
28	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	75,306	10,622.92 799,970,358	10,802.39 813,484,849	- -	0.80
29	SEGRO PLC イギリス	投資証券	623,971	1,365.84 852,245,214	1,275.85 796,097,629	- -	0.78
30	OMEGA HEALTHCARE INVS INC アメリカ	投資証券	133,407	5,521.76 736,641,441	5,800.81 773,869,153	- -	0.76

(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

2025年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	11.08
投資証券	87.88
合計	98.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

該当事項はありません。

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

該当事項はありません。

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

該当事項はありません。

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

該当事項はありません。

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2025年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0709月	買建	387	10,877,807,710	11,412,630,000	1.69

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep25	買建	577	26,830,632,604	27,567,207,469	1.36
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep25	買建	510	4,629,473,888	4,713,775,725	0.23
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep25	買建	75	1,319,932,822	1,354,212,318	0.07
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep25	買建	34	1,175,309,165	1,195,198,763	0.06
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep25	買建	30	618,567,108	628,917,975	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。

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2025年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Sep25	買建	764	6,981,867,884	7,108,833,698	5.04

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

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

#### エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### J - R E I T インデックスファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	T R E I T 先物 0709月	買建	2,857	4,934,210,420	5,274,022,000	2.72

(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

2025年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
----	-----	-------	---------	----	-------------	-------------	-------------

不動産投信指 数先物取引	シカゴ商品 取引所	DJ US REAL ESTATE Sep25	買建	200	1,101,745,274	1,097,418,940	1.07
-----------------	--------------	----------------------------	----	-----	---------------	---------------	------

(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】

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

直近日(2025年7月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (2016年1月12日)	512	512	1.3081	1.3081
第5計算期間末 (2017年1月11日)	792	792	1.3892	1.3892
第6計算期間末 (2018年1月11日)	1,056	1,056	1.4668	1.4668
第7計算期間末 (2019年1月11日)	7,043	7,043	1.4186	1.4186
第8計算期間末 (2020年1月14日)	8,245	8,245	1.5303	1.5303
第9計算期間末 (2021年1月12日)	8,888	8,888	1.5646	1.5646
第10計算期間末 (2022年1月11日)	9,852	9,852	1.6543	1.6543
第11計算期間末 (2023年1月11日)	9,953	9,953	1.5794	1.5794
第12計算期間末 (2024年1月11日)	11,863	11,863	1.7222	1.7222
第13計算期間末 (2025年1月14日)	12,432	12,432	1.7688	1.7688
2024年7月末日	12,270	-	1.7665	-
8月末日	12,300	-	1.7648	-
9月末日	12,403	-	1.7723	-
10月末日	12,591	-	1.7942	-
11月末日	12,491	-	1.7782	-
12月末日	12,592	-	1.7974	-
2025年1月末日	12,555	-	1.7882	-
2月末日	12,425	-	1.7615	-
3月末日	12,322	-	1.7440	-
4月末日	12,165	-	1.7311	-
5月末日	12,341	-	1.7493	-
6月末日	12,555	-	1.7764	-
7月末日	12,739	-	1.7960	-

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

直近日(2025年7月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (2016年1月12日)	658	658	1.4776	1.4776
第5計算期間末 (2017年1月11日)	1,034	1,034	1.6142	1.6142
第6計算期間末 (2018年1月11日)	1,740	1,740	1.7637	1.7637
第7計算期間末 (2019年1月11日)	3,092	3,092	1.6601	1.6601
第8計算期間末 (2020年1月14日)	4,278	4,278	1.8760	1.8760
第9計算期間末 (2021年1月12日)	5,107	5,107	1.9322	1.9322
第10計算期間末 (2022年1月11日)	6,618	6,618	2.1285	2.1285
第11計算期間末 (2023年1月11日)	7,704	7,704	2.0338	2.0338
第12計算期間末 (2024年1月11日)	9,429	9,429	2.3162	2.3162
第13計算期間末 (2025年1月14日)	10,545	10,545	2.4804	2.4804
2024年7月末日	10,320	-	2.4638	-
8月末日	10,253	-	2.4425	-
9月末日	10,369	-	2.4589	-
10月末日	10,627	-	2.5176	-
11月末日	10,559	-	2.4882	-
12月末日	10,728	-	2.5332	-
2025年1月末日	10,727	-	2.5239	-
2月末日	10,611	-	2.4760	-
3月末日	10,562	-	2.4512	-
4月末日	10,359	-	2.4090	-
5月末日	10,748	-	2.4715	-
6月末日	11,092	-	2.5273	-
7月末日	11,423	-	2.5913	-

## DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

直近日（2025年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (2016年1月12日)	1,057	1,057	1.6586	1.6586
第5計算期間末 (2017年1月11日)	1,555	1,555	1.8583	1.8583
第6計算期間末 (2018年1月11日)	2,582	2,582	2.1012	2.1012

第7計算期間末 (2019年1月11日)	4,022	4,022	1.9213	1.9213
第8計算期間末 (2020年1月14日)	5,610	5,610	2.2720	2.2720
第9計算期間末 (2021年1月12日)	6,419	6,419	2.3400	2.3400
第10計算期間末 (2022年1月11日)	8,927	8,927	2.6787	2.6787
第11計算期間末 (2023年1月11日)	9,373	9,373	2.5595	2.5595
第12計算期間末 (2024年1月11日)	12,083	12,083	3.0468	3.0468
第13計算期間末 (2025年1月14日)	14,236	14,236	3.4010	3.4010
2024年7月末日	13,843	-	3.3602	-
8月末日	13,607	-	3.3073	-
9月末日	13,760	-	3.3361	-
10月末日	14,313	-	3.4526	-
11月末日	14,130	-	3.4034	-
12月末日	14,549	-	3.4906	-
2025年1月末日	14,585	-	3.4831	-
2月末日	14,364	-	3.4032	-
3月末日	14,214	-	3.3689	-
4月末日	13,893	-	3.2777	-
5月末日	14,514	-	3.4147	-
6月末日	14,920	-	3.5170	-
7月末日	15,593	-	3.6575	-

## 【分配の推移】

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
2025年1月15日～2025年7月14日	-

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
2025年1月15日～2025年7月14日	-

## DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

	1口当たりの分配金（円）
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
2025年1月15日～2025年7月14日	-

## 【収益率の推移】

## DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

	収益率（％）
第4計算期間	1.8
第5計算期間	6.2
第6計算期間	5.6
第7計算期間	3.3
第8計算期間	7.9
第9計算期間	2.2
第10計算期間	5.7
第11計算期間	4.5
第12計算期間	9.0
第13計算期間	2.7
2025年1月15日～2025年7月14日	0.2

（注）収益率は期間騰落率です。

## DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

	収益率（％）
第4計算期間	4.0
第5計算期間	9.2
第6計算期間	9.3
第7計算期間	5.9
第8計算期間	13.0
第9計算期間	3.0
第10計算期間	10.2
第11計算期間	4.4
第12計算期間	13.9
第13計算期間	7.1



2025年1月15日～2025年7月14日	2.4
-----------------------	-----

(注) 収益率は期間騰落率です。

#### DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

	収益率(%)
第4計算期間	6.4
第5計算期間	12.0
第6計算期間	13.1
第7計算期間	8.6
第8計算期間	18.3
第9計算期間	3.0
第10計算期間	14.5
第11計算期間	4.4
第12計算期間	19.0
第13計算期間	11.6
2025年1月15日～2025年7月14日	4.7

(注) 収益率は期間騰落率です。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

##### DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

	設定口数	解約口数
第4計算期間	260,665,787	117,532,208
第5計算期間	262,202,825	82,821,677
第6計算期間	291,106,374	141,518,655
第7計算期間	4,495,262,603	250,378,156
第8計算期間	771,650,558	348,939,279
第9計算期間	779,738,086	486,612,499
第10計算期間	793,624,600	518,927,965
第11計算期間	772,352,210	426,006,556
第12計算期間	1,074,888,415	488,744,698
第13計算期間	720,012,282	579,353,928
2025年1月15日～ 2025年7月14日	335,317,696	292,534,531

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

##### DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

	設定口数	解約口数
第4計算期間	245,786,975	72,842,093
第5計算期間	279,729,076	84,404,037
第6計算期間	469,630,383	123,925,495
第7計算期間	1,020,882,019	144,579,473
第8計算期間	608,761,946	191,262,701
第9計算期間	637,017,771	274,298,215
第10計算期間	752,122,154	285,922,797
第11計算期間	1,012,283,711	333,793,374
第12計算期間	611,393,392	328,364,651
第13計算期間	544,419,066	364,144,134
2025年1月15日～ 2025年7月14日	320,853,059	193,100,040

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

	設定口数	解約口数
第4計算期間	458,779,190	253,200,673
第5計算期間	385,635,483	185,968,924
第6計算期間	663,783,354	271,611,091
第7計算期間	1,131,364,584	267,113,683
第8計算期間	729,100,474	353,003,717
第9計算期間	872,226,324	598,311,991
第10計算期間	1,138,774,572	549,449,446
第11計算期間	935,702,228	606,213,806
第12計算期間	808,128,696	504,359,574
第13計算期間	786,581,506	566,746,716
2025年1月15日～ 2025年7月14日	397,071,718	336,776,695

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2025年7月31日

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

## 基準価額・純資産の推移 (2015年7月31日～2025年7月31日)



## 分配の推移(税引前)

2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
2024年 1月	0円
2025年 1月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

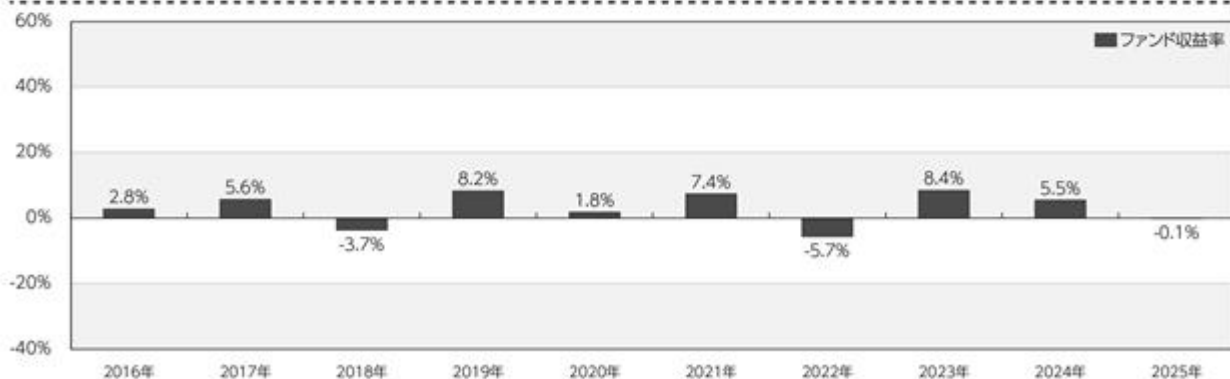
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2012年9月6日)

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	55.32
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.53
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	10.43
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5.50
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5.04
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	3.22
7	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.05
8	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.94

## 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。

※2025年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

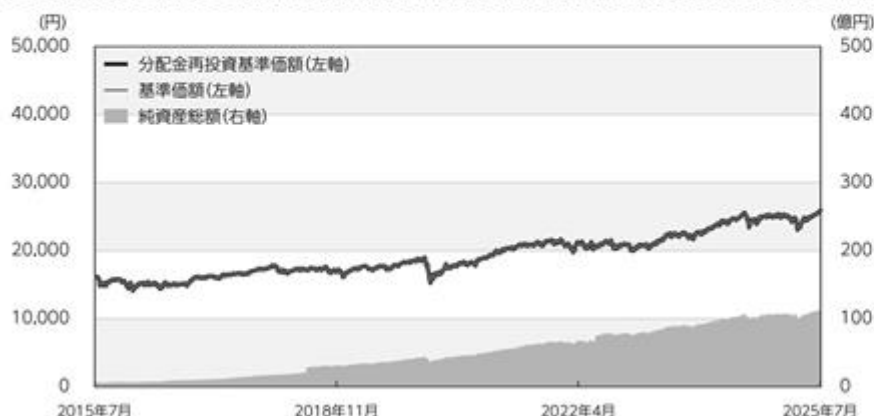
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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:2025年7月31日

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

## 基準価額・純資産の推移 (2015年7月31日～2025年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2012年9月6日)

## 分配の推移(税引前)

2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
2024年 1月	0円
2025年 1月	0円
設定来累計	0円

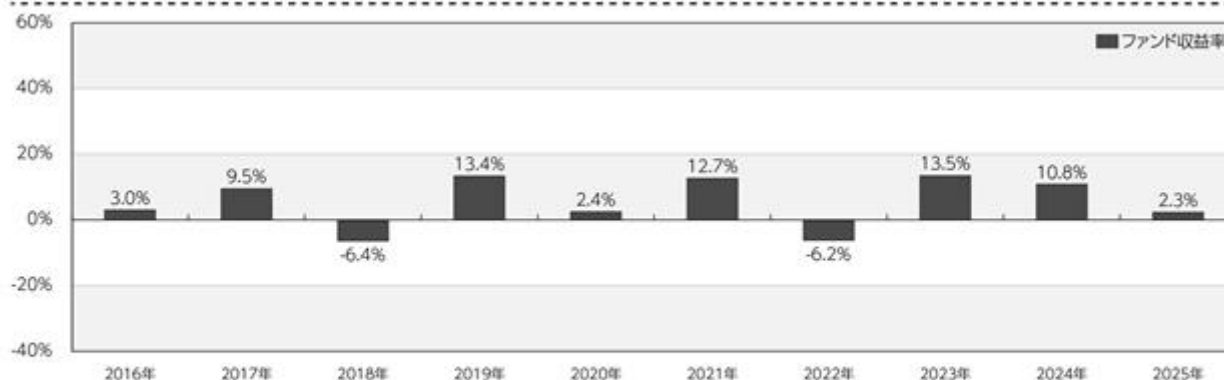
※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	30.20
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.45
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	15.10
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	10.40
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	9.95
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.16
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.92
8	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.83

## 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。

※2025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。

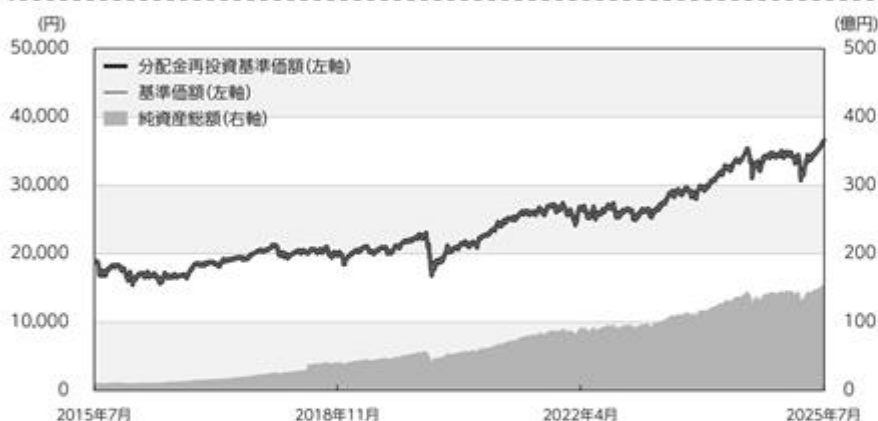
○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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。

データの基準日:2025年7月31日

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

## 基準価額・純資産の推移 (2015年7月31日～2025年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

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

(設定日:2012年9月6日)

## 分配の推移(税引前)

2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
2024年 1月	0円
2025年 1月	0円
設定来累計	0円

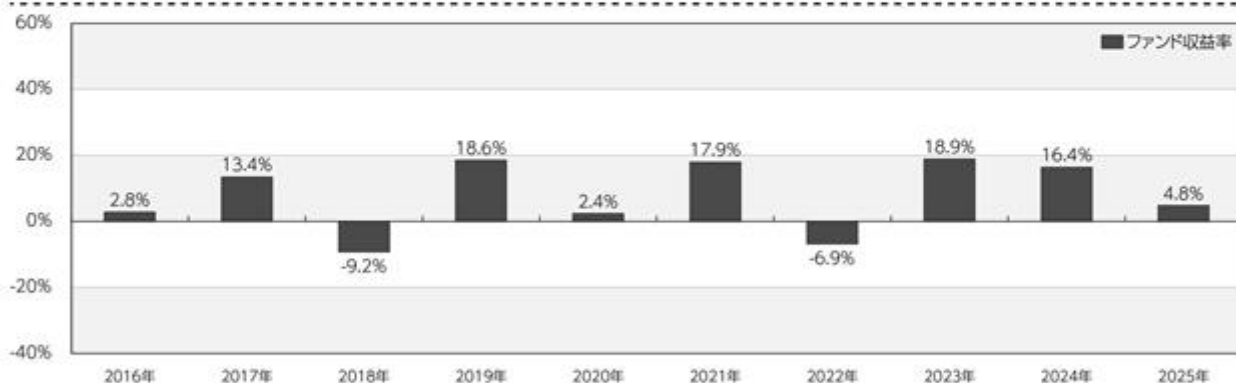
※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

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

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.43
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.94
3	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	15.45
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	14.89
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	8.90
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.82
7	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.79
8	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.79

## 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。

※2025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。

○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:2025年7月31日

## 主要な資産の状況

### ■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	3.38
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	3.14
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.99
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.84
5	任天堂	株式	日本	その他製品	1.89

### ■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	153回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2027/6/20	1.09
2	373回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2033/12/20	0.98
3	347回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/6/20	0.97
4	368回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.2	2032/9/20	0.96
5	372回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2033/9/20	0.94

### ■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	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	5.93
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.92
3	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.26
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.98
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	2.07

### ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	アメリカ	4.125	2032/11/15	0.54
2	US T N/B 4.625 02/15/35	国債証券	アメリカ	4.625	2035/2/15	0.46
3	US T N/B 3.75 04/15/28	国債証券	アメリカ	3.75	2028/4/15	0.45
4	US T N/B 4.125 07/31/31	国債証券	アメリカ	4.125	2031/7/31	0.42
5	US T N/B 4.375 05/15/34	国債証券	アメリカ	4.375	2034/5/15	0.40

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2025年7月31日

### ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	10.13
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	4.76
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.71
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	2.62
5	HDFC BANK LTD	株式	インド	銀行	1.39

### ■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 7.1 11/19/36	国債証券	南アフリカ	7.1	2036/11/19	2.59
2	ROMANIA 6.625 02/17/28	国債証券	ルーマニア	6.625	2028/2/17	2.38
3	BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	ブラジル	3.875	2030/6/12	2.16
4	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	サウジアラビア	4.375	2029/4/16	1.99
5	COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	コロンビア	3.125	2031/4/15	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	7.39
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.67
3	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	5.13
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	KDX不動産投資法人	投資証券	日本	4.26

### ■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	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	6.94
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	6.76
3	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.23
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.77
5	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.44

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ・お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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、香港証券取引所、韓国取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、香港の銀行、韓国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、お申込みの受付は行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた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この信託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。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### < 基準価額の照会方法等 >

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

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）

- ・お申込単位

1口以上1口単位または1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

- ・お申込手数料

ありません。

- ・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、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、この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、解約の請求を受益者がするときには、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、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。

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

1口単位とします。

・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6営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### <主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
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。

ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は2012年9月6日から無期限です。

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

(4) 【計算期間】

a. 計算期間は原則として、毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

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

(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有利であると認めるとき、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の場合、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發します。

c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知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も同様とします。

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

g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変

更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a. の事項(上記a. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b. の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### 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。

#### 二．公告

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

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

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

#### ホ．運用報告書

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### 収益分配金請求権

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

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

##### 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

##### 一部解約請求権

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

##### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)  
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)  
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

(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13期計算期間(2024年1月12日から2025年1月14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】

## 【DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	500,486,415	535,476,391
親投資信託受益証券	11,392,869,757	11,929,789,238
未収入金	-	354,000
流動資産合計	11,893,356,172	12,465,619,629
資産合計	11,893,356,172	12,465,619,629
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,940,170	10,688,911
未払受託者報酬	2,217,445	2,441,722
未払委託者報酬	17,739,954	19,534,017
その他未払費用	225,453	248,269
流動負債合計	30,123,022	32,912,919
負債合計	30,123,022	32,912,919
純資産の部		
元本等		
元本	6,888,287,393	7,028,945,747
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,974,945,757	5,403,760,963
（分配準備積立金）	1,458,374,339	1,637,033,612
元本等合計	11,863,233,150	12,432,706,710
純資産合計	11,863,233,150	12,432,706,710
負債純資産合計	11,893,356,172	12,465,619,629



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	2023年1月12日 至 2024年1月11日	自	2024年1月12日 至 2025年1月14日
<b>営業収益</b>				
受取利息		4,394		643,116
有価証券売買等損益		994,108,523		363,130,481
営業収益合計		994,112,917		363,773,597
<b>営業費用</b>				
支払利息		183,613		7,383
受託者報酬		4,252,712		4,769,366
委託者報酬		34,022,380		38,155,473
その他費用		432,379		484,933
営業費用合計		38,891,084		43,417,155
営業利益又は営業損失（ ）		955,221,833		320,356,442
経常利益又は経常損失（ ）		955,221,833		320,356,442
当期純利益又は当期純損失（ ）		955,221,833		320,356,442
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（ ）		36,754,587		24,966,958
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,651,165,598		4,974,945,757
剰余金増加額又は欠損金減少額		690,440,501		552,867,645
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		690,440,501		552,867,645
剰余金減少額又は欠損金増加額		285,127,588		419,441,923
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		285,127,588		419,441,923
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,974,945,757		5,403,760,963

## (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13期	
	自 2024年1月12日	至 2025年1月14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. 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1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、当計算期間末日を2025年1月14日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期	第13期
	2024年1月11日現在	2025年1月14日現在
1. 期首元本額	6,302,143,676円	6,888,287,393円
期中追加設定元本額	1,074,888,415円	720,012,282円
期中一部解約元本額	488,744,698円	579,353,928円
2. 受益権の総数	6,888,287,393口	7,028,945,747口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 2023年1月12日 至 2024年1月11日	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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(164,590,868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(240,207,226円)、信託約款に規定される収益調整金(3,516,571,418円)及び分配準備積立金(1,053,576,245円)より分配対象収益は4,974,945,757円(1万口当たり7,222.32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(166,111,633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(129,277,851円)、信託約款に規定される収益調整金(3,766,727,351円)及び分配準備積立金(1,341,644,128円)より分配対象収益は5,403,760,963円(1万口当たり7,687.86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12期	第13期
	自 2023年1月12日 至 2024年1月11日	自 2024年1月12日 至 2025年1月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14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	950,113,206	259,059,544
合計	950,113,206	259,059,544

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7222円 (17,222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

2025年1月14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	258,478,733	1,238,113,131	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,927,079,880	7,087,602,120	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	159,030,271	354,255,831	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	124,782,692	1,256,649,056	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	155,013,865	376,094,639	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	175,455,082	373,175,413	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	341,063,213	611,151,171	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	257,980,135	632,747,877	
親投資信託受益証券 合計		7,398,883,871	11,929,789,238	
合計			11,929,789,238	

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

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

## 【DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	305,197,953	347,161,880
親投資信託受益証券	9,149,478,685	10,223,650,914
未収入金	2,253,000	-
流動資産合計	9,456,929,638	10,570,812,794
資産合計	9,456,929,638	10,570,812,794
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,362,770	5,242,699
未払受託者報酬	1,746,083	2,054,427
未払委託者報酬	15,465,610	18,196,793
その他未払費用	177,501	208,876
流動負債合計	27,751,964	25,702,795
負債合計	27,751,964	25,702,795
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,071,030,378	4,251,305,310
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,358,147,296	6,293,804,689
(分配準備積立金)	1,670,324,271	2,158,347,415
元本等合計	9,429,177,674	10,545,109,999
純資産合計	9,429,177,674	10,545,109,999
負債純資産合計	9,456,929,638	10,570,812,794

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	2023年1月12日 2024年1月11日	自	2024年1月12日 2025年1月14日
<b>営業収益</b>				
受取利息		2,608		410,770
有価証券売買等損益		1,148,030,984		711,425,229
営業収益合計		1,148,033,592		711,835,999
<b>営業費用</b>				
支払利息		108,971		4,540
受託者報酬		3,310,806		3,961,645
委託者報酬		29,324,803		35,089,670
その他費用		336,574		402,784
営業費用合計		33,081,154		39,458,639
営業利益又は営業損失（ ）		1,114,952,438		672,377,360
経常利益又は経常損失（ ）		1,114,952,438		672,377,360
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,114,952,438		672,377,360
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（ ）		46,882,441		44,279,714
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,916,149,210		5,358,147,296
剰余金増加額又は欠損金減少額		715,902,071		789,205,299
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		715,902,071		789,205,299
剰余金減少額又は欠損金増加額		341,973,982		481,645,552
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		341,973,982		481,645,552
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,358,147,296		6,293,804,689

## (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13期	
	自 2024年1月12日	至 2025年1月14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. 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1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、当計算期間末日を2025年1月14日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期	第13期
	2024年1月11日現在	2025年1月14日現在
1. 期首元本額	3,788,001,637円	4,071,030,378円
期中追加設定元本額	611,393,392円	544,419,066円
期中一部解約元本額	328,364,651円	364,144,134円
2. 受益権の総数	4,071,030,378口	4,251,305,310口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 2023年1月12日 至 2024年1月11日	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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(185,317,335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(486,397,321円)、信託約款に規定される収益調整金(3,687,823,025円)及び分配準備積立金(998,609,615円)より分配対象収益は5,358,147,296円(1万口当たり13,161.64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(210,940,885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(417,156,761円)、信託約款に規定される収益調整金(4,135,457,274円)及び分配準備積立金(1,530,249,769円)より分配対象収益は6,293,804,689円(1万口当たり14,804.40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12期	第13期
	自 2023年1月12日 至 2024年1月11日	自 2024年1月12日 至 2025年1月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左



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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14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	1,110,427,676	657,697,656
合計	1,110,427,676	657,697,656

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3162円 (23,162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

2025年1月14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	326,821,886	1,565,476,833	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,745,857,566	3,283,496,477	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	274,781,713	612,103,743	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	160,266,969	1,614,000,564	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	167,564,257	406,544,400	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	302,675,299	643,760,093	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	582,696,627	1,044,134,085	
エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	429,785,428	1,054,134,719		
親投資信託受益証券 合計		4,990,449,745	10,223,650,914	
合計			10,223,650,914	

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

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

## 【DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	283,051,305	335,638,955
親投資信託受益証券	11,847,629,458	13,946,097,820
未収入金	16,212,000	-
流動資産合計	12,146,892,763	14,281,736,775
資産合計	12,146,892,763	14,281,736,775
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	39,292,457	15,871,463
未払受託者報酬	2,202,719	2,754,694
未払委託者報酬	21,398,317	26,760,264
その他未払費用	223,965	280,104
流動負債合計	63,117,458	45,666,525
負債合計	63,117,458	45,666,525
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,966,063,126	4,185,897,916
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	8,117,712,179	10,050,172,334
(分配準備積立金)	2,636,965,787	3,579,592,274
元本等合計	12,083,775,305	14,236,070,250
純資産合計	12,083,775,305	14,236,070,250
負債純資産合計	12,146,892,763	14,281,736,775

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	2023年1月12日 至 2024年1月11日	自	2024年1月12日 至 2025年1月14日
<b>営業収益</b>				
受取利息		2,280		386,487
有価証券売買等損益		1,906,127,393		1,474,542,362
営業収益合計		1,906,129,673		1,474,928,849
<b>営業費用</b>				
支払利息		94,908		4,112
受託者報酬		4,111,838		5,270,525
委託者報酬		39,944,464		51,200,221
その他費用		418,066		535,912
営業費用合計		44,569,276		57,010,770
営業利益又は営業損失（ ）		1,861,560,397		1,417,918,079
経常利益又は経常損失（ ）		1,861,560,397		1,417,918,079
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,861,560,397		1,417,918,079
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（ ）		112,974,732		132,809,180
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,711,293,660		8,117,712,179
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,452,294,778		1,817,887,111
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,452,294,778		1,817,887,111
剰余金減少額又は欠損金増加額		794,461,924		1,170,535,855
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		794,461,924		1,170,535,855
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,117,712,179		10,050,172,334

## (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13期	
	自 2024年1月12日	至 2025年1月14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. 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1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、当計算期間末日を2025年1月14日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期	第13期
	2024年1月11日現在	2025年1月14日現在
1. 期首元本額	3,662,294,004円	3,966,063,126円
期中追加設定元本額	808,128,696円	786,581,506円
期中一部解約元本額	504,359,574円	566,746,716円
2. 受益権の総数	3,966,063,126口	4,185,897,916口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 2023年1月12日 至 2024年1月11日	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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(304,055,797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(930,534,184円)、信託約款に規定される収益調整金(5,480,746,392円)及び分配準備積立金(1,402,375,806円)より分配対象収益は8,117,712,179円(1万口当たり20,467.93円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(371,196,590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(913,912,309円)、信託約款に規定される収益調整金(6,470,580,060円)及び分配準備積立金(2,294,483,375円)より分配対象収益は10,050,172,334円(1万口当たり24,009.59円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第12期	第13期
	自 2023年1月12日 至 2024年1月11日	自 2024年1月12日 至 2025年1月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14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	1,856,590,808	1,413,175,403
合計	1,856,590,808	1,413,175,403

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第12期 2024年1月11日現在	第13期 2025年1月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.0468円 (30,468円)	3.4010円 (34,010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

2025年1月14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	595,002,065	2,850,059,891	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	588,267,552	703,450,338	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	575,775,923	1,282,598,446	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	287,998,831	2,900,349,827	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	286,613,340	695,381,285	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	593,804,168	1,262,962,084	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	1,180,426,301	2,115,205,888	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	870,913,712	2,136,090,061	
親投資信託受益証券 合計		4,978,801,892	13,946,097,820	
合計			13,946,097,820	

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

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。



### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)」は、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2025年1月14日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,348,655,689
株式	577,659,289,490
未収入金	188,760,000
未収配当金	784,531,293
前払金	144,290,000
差入委託証拠金	779,847,956
流動資産合計	592,905,374,428
資産合計	592,905,374,428
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	345,008,860
未払解約金	80,803,000
流動負債合計	425,811,860
負債合計	425,811,860
純資産の部	
元本等	
元本	123,691,325,442
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	468,788,237,126
元本等合計	592,479,562,568
純資産合計	592,479,562,568
負債純資産合計	592,905,374,428

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	122,361,611,329円
同期中追加設定元本額	39,004,880,293円
同期中一部解約元本額	37,675,166,180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	2,312,273,409円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	5,525,235,376円
One DC 国内株式インデックスファンド	34,507,749,404円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,626,243,992円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,766,612円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,624,240円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	18,359,951円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,133,733円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,587,440円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	9,314,618円
たわらノーロード TOPIX	3,557,675,155円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,065,261,996円
たわらノーロード バランス(堅実型)	48,957,990円
たわらノーロード バランス(標準型)	410,404,780円
たわらノーロード バランス(積極型)	776,734,830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)	2,542,960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)	202,327,946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)	567,447,576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)	498,234,448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)	690,623,591円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	490,920円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,232,968円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	41,470,883円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	11,146,164円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	22,380,955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)	745,346円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	783,195円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	32,601,562,113円
Oneグローバルバランス	105,392,870円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	907,852,724円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,290,420,828円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,082,521,499円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	248,430,297円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	861,051,606円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,065,743,625円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,142,933円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	967,311,894円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,368,768円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	258,478,733円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	326,821,886円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	595,002,065円
投資のソムリエ	6,160,346,557円
クルーズコントロール	218,517,056円
投資のソムリエ<DC年金>	811,528,044円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	374,200,639円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,404,133,250円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	198,984,398円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	512,911,237円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	101,123,201円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	53,790,209円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,019,246円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	195,970,554円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	654,689,849円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	85,998,373円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	227,002,281円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	80,054,715円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	58,539,436円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	35,778,280円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	755,173,703円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	9,690,593円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,492,691円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	37,533,877円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	62,281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)	344,551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)	331,449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)	4,900,475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)	210,186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)	236,595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)	754,292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)	76,162,151円
日本株40・外債60配分戦略ファンド2021-07(適格機関投資家限定)	349,581,656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)	165,362円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	74,541,566円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定)	348,375,615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)	301,815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)	352,319,455円
AMOne TOPIXインデックスファンド2025-01(適格機関投資家限定)	330,117,815円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	118,366,418円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	3,806,397円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	19,345,874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)	100,754,643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)	439,815円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,170,094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)	28,296,685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)	59,540,484円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,425,839円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,310,426円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,835,897円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	77,308円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	41,359円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	958,571円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	206,326,213円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	344,804,742円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,083,756,620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)	8,584,282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)	12,135,554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)	109,551,741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)	22,928,915円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	50,296円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	93,881,202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)	6,785,216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)	19,986,264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)	42,922,182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)	61,488,189円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	14,436,872円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	5,167,313円

動的パッケージファンド<DC年金>	22,045,680円
コア資産形成ファンド	9,446,067円
MHAMトピックスファンド	734,619,522円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	41,589,938円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	2,385,135,848円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	3,063,614,799円
計	123,691,325,442円
2. 受益権の総数	123,691,325,442口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14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	2025年1月14日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	23,279,155,916	
合計	23,279,155,916	

（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2025年1月14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	2025年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	14,886,690,000	-	14,541,860,000	344,830,000
合計	14,886,690,000	-	14,541,860,000	344,830,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

（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）

	2025年1月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.7900円 (47,900円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2025年1月14日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	8,900	3,935.00	35,021,500	
ニッセイ	211,400	854.90	180,725,860	

マルハニチロ	31,400	2,899.00	91,028,600
雪国まいたけ	18,000	1,088.00	19,584,000
カネコ種苗	6,000	1,380.00	8,280,000
サカタのタネ	23,600	3,385.00	79,886,000
ホクト	18,800	1,819.00	34,197,200
ホクリヨウ	400	1,264.00	505,600
ショーボンドホールディングス	27,700	4,927.00	136,477,900
ミライト・ワン	69,100	2,198.00	151,881,800
タマホーム	13,400	3,435.00	46,029,000
サンヨーホームズ	300	731.00	219,300
日本アクア	1,100	718.00	789,800
ファーストコーポレーション	700	842.00	589,400
ベステラ	500	1,003.00	501,500
robot home	41,000	129.00	5,289,000
キャンディル	400	576.00	230,400
住石ホールディングス	23,300	728.00	16,962,400
日鉄鉱業	8,500	4,420.00	37,570,000
三井松島ホールディングス	10,300	4,455.00	45,886,500
I N P E X	639,000	1,977.50	1,263,622,500
石油資源開発	116,000	1,161.00	134,676,000
K & O エナジーグループ	9,600	3,565.00	34,224,000
リョーサン菱洋ホールディングス	24,300	2,572.00	62,499,600
ダイセキ環境ソリューション	500	1,323.00	661,500
第一カッター興業	6,100	1,351.00	8,241,100
明豊ファシリティワークス	900	905.00	814,500
安藤・間	122,400	1,137.00	139,168,800
東急建設	66,200	711.00	47,068,200
コムシスホールディングス	75,100	3,180.00	238,818,000
ビーアールホールディングス	31,000	335.00	10,385,000
高松コンストラクショングループ	15,700	2,672.00	41,950,400
東建コーポレーション	5,400	11,790.00	63,666,000
ソネック	200	850.00	170,000
ヤマウラ	10,700	1,204.00	12,882,800
オリエンタル白石	78,200	378.00	29,559,600
大成建設	134,300	6,389.00	858,042,700
大林組	488,200	2,007.00	979,817,400
清水建設	404,000	1,261.50	509,646,000
長谷工コーポレーション	135,700	1,985.50	269,432,350
松井建設	14,000	840.00	11,760,000
銭高組	200	4,110.00	822,000
鹿島建設	327,900	2,640.00	865,656,000
不動テトラ	9,300	2,116.00	19,678,800
大末建設	700	1,622.00	1,135,400
鉄建建設	9,700	2,383.00	23,115,100
西松建設	23,600	5,020.00	118,472,000
三井住友建設	119,100	405.00	48,235,500
大豊建設	4,000	3,275.00	13,100,000
佐田建設	1,000	985.00	985,000
ナカノフード建設	1,300	686.00	891,800
奥村組	26,100	3,875.00	101,137,500



東鉄工業	16,300	3,135.00	51,100,500
イチケン	400	2,555.00	1,022,000
富士ピー・エス	600	401.00	240,600
浅沼組	59,300	636.00	37,714,800
戸田建設	182,100	910.30	165,765,630
熊谷組	24,400	3,785.00	92,354,000
北野建設	300	4,095.00	1,228,500
植木組	400	1,593.00	637,200
矢作建設工業	20,000	1,516.00	30,320,000
ピーエス・コンストラクション	10,700	1,165.00	12,465,500
日本ハウスホールディングス	31,500	311.00	9,796,500
大東建託	50,500	16,900.00	853,450,000
新日本建設	20,700	1,545.00	31,981,500
東亜道路工業	25,600	1,265.00	32,384,000
日本道路	14,800	1,735.00	25,678,000
東亜建設工業	44,500	1,170.00	52,065,000
日本国土開発	42,100	505.00	21,260,500
若築建設	4,500	3,480.00	15,660,000
東洋建設	42,600	1,318.00	56,146,800
五洋建設	193,500	646.90	125,175,150
世紀東急工業	21,000	1,485.00	31,185,000
福田組	5,600	4,810.00	26,936,000
日本ドライケミカル	400	4,095.00	1,638,000
住友林業	127,800	5,087.00	650,118,600
日本基礎技術	1,100	575.00	632,500
巴コーポレーション	1,900	945.00	1,795,500
大和ハウス工業	446,200	4,685.00	2,090,447,000
ライト工業	30,100	2,152.00	64,775,200
積水ハウス	448,600	3,590.00	1,610,474,000
日特建設	14,200	993.00	14,100,600
北陸電気工事	10,100	1,085.00	10,958,500
ユアテック	28,500	1,467.00	41,809,500
日本リーテック	11,400	1,284.00	14,637,600
四電工	18,600	1,500.00	27,900,000
中電工	23,100	3,120.00	72,072,000
関電工	81,000	2,337.50	189,337,500
きんでん	102,800	2,970.00	305,316,000
東京エネシス	15,800	1,050.00	16,590,000
トーエネック	24,500	958.00	23,471,000
住友電設	12,000	4,600.00	55,200,000
日本電設工業	27,700	1,888.00	52,297,600
エクシオグループ	152,900	1,663.00	254,272,700
新日本空調	19,200	1,857.00	35,654,400
九電工	32,100	5,259.00	168,813,900
三機工業	30,900	3,020.00	93,318,000
日揮ホールディングス	146,400	1,264.50	185,122,800
中外炉工業	4,800	3,305.00	15,864,000
ヤマト	1,500	1,347.00	2,020,500
太平電業	9,400	4,765.00	44,791,000
高砂熱学工業	35,600	6,083.00	216,554,800

三晃金属工業	200	4,435.00	887,000	
朝日工業社	13,900	2,212.00	30,746,800	
明星工業	25,400	1,400.00	35,560,000	
大気社	18,900	4,675.00	88,357,500	
ダイダン	19,400	3,540.00	68,676,000	
日比谷総合設備	12,000	3,615.00	43,380,000	
ニッポン	49,000	2,134.00	104,566,000	
日清製粉グループ本社	154,400	1,761.50	271,975,600	
日東富士製粉	2,500	6,510.00	16,275,000	
昭和産業	12,500	2,686.00	33,575,000	
鳥越製粉	1,500	720.00	1,080,000	
中部飼料	20,500	1,262.00	25,871,000	
フィード・ワン	21,900	779.00	17,060,100	
東洋精糖	300	1,499.00	449,700	
日本甜菜製糖	7,700	2,257.00	17,378,900	
D M三井製糖ホールディングス	14,700	3,235.00	47,554,500	
塩水港精糖	2,200	314.00	690,800	
ウェルネオシュガー	8,900	2,164.00	19,259,600	
L I F U L L	38,500	184.00	7,084,000	
M I X I	29,000	2,852.00	82,708,000	
ジェイエイシーリクルートメント	56,100	682.00	38,260,200	
日本M & Aセンターホールディングス	227,900	630.40	143,668,160	
メンバーズ	6,100	1,008.00	6,148,800	
中広	300	459.00	137,700	
U Tグループ	20,100	2,113.00	42,471,300	
アイティメディア	8,200	1,533.00	12,570,600	
ケアネット	31,800	523.00	16,631,400	
E・Jホールディングス	9,100	1,628.00	14,814,800	
オープンアップグループ	46,700	1,772.00	82,752,400	
コシダカホールディングス	46,300	1,051.00	48,661,300	
アルトナー	700	1,973.00	1,381,100	
パソナグループ	18,800	2,000.00	37,600,000	
C D S	500	1,817.00	908,500	
リンクアンドモチベーション	38,400	560.00	21,504,000	
エス・エム・エス	59,300	1,587.50	94,138,750	
サニーサイドアップグループ	600	541.00	324,600	
パーソルホールディングス	1,412,900	227.90	321,999,910	
リニカル	1,200	360.00	432,000	
クックパッド	42,900	144.00	6,177,600	
エスクリ	700	185.00	129,500	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,100	763.00	839,300	
森永製菓	62,000	2,640.50	163,711,000	
中村屋	3,600	3,150.00	11,340,000	
江崎グリコ	42,500	4,438.00	188,615,000	
名糖産業	6,600	1,917.00	12,652,200	
井村屋グループ	8,100	2,408.00	19,504,800	
不二家	10,100	2,507.00	25,320,700	
山崎製パン	99,500	2,816.00	280,192,000	
第一屋製パン	300	619.00	185,700	
モロゾフ	4,800	4,745.00	22,776,000	

亀田製菓	9,400	3,855.00	36,237,000
寿スピリッツ	87,700	2,090.50	183,336,850
カルビー	67,900	2,990.00	203,021,000
森永乳業	55,300	2,794.50	154,535,850
六甲バター	10,800	1,201.00	12,970,800
ヤクルト本社	212,200	2,867.00	608,377,400
明治ホールディングス	190,900	3,081.00	588,162,900
雪印メグミルク	40,000	2,579.00	103,160,000
プリマハム	19,900	2,136.00	42,506,400
日本ハム	63,900	4,858.00	310,426,200
林兼産業	600	461.00	276,600
丸大食品	14,900	1,639.00	24,421,100
S Foods	16,400	2,583.00	42,361,200
柿安本店	5,800	2,735.00	15,863,000
伊藤ハム米久ホールディングス	22,800	3,780.00	86,184,000
学情	7,800	2,095.00	16,341,000
スタジオアリス	7,700	2,093.00	16,116,100
クロスキャット	8,700	1,016.00	8,839,200
エプロ	500	749.00	374,500
システナ	216,200	346.00	74,805,200
NJS	3,800	3,165.00	12,027,000
デジタルアーツ	9,500	5,940.00	56,430,000
日鉄ソリューションズ	51,600	3,844.00	198,350,400
総合警備保障	259,000	1,043.00	270,137,000
キューブシステム	7,900	1,018.00	8,042,200
いちご	125,700	341.00	42,863,700
日本駐車場開発	176,700	212.00	37,460,400
コア	6,700	1,823.00	12,214,100
カカクコム	111,600	2,307.00	257,461,200
アイロムグループ	6,300	2,785.00	17,545,500
セントケア・ホールディング	9,800	731.00	7,163,800
サイネックス	300	809.00	242,700
ルネサンス	12,000	1,018.00	12,216,000
ディップ	27,100	2,498.00	67,695,800
SBSホールディングス	13,600	2,273.00	30,912,800
デジタルホールディングス	7,800	1,251.00	9,757,800
新日本科学	16,400	1,704.00	27,945,600
キャリアデザインセンター	300	1,770.00	531,000
エムスリー	306,300	1,455.00	445,666,500
ツカダ・グローバルホールディング	1,300	430.00	559,000
プラス	200	562.00	112,400
ウェルネット	1,500	808.00	1,212,000
ワールドホールディングス	6,100	1,981.00	12,084,100
ディー・エヌ・エー	61,900	2,751.50	170,317,850
博報堂DYホールディングス	175,800	1,152.50	202,609,500
ぐるなび	28,800	252.00	7,257,600
タカミヤ	20,900	404.00	8,443,600
ファンコミュニケーションズ	21,900	400.00	8,760,000
ライク	5,800	1,428.00	8,282,400
AobaBBT	700	321.00	224,700

エスプール	49,100	317.00	15,564,700
WDBホールディングス	7,900	1,597.00	12,616,300
手間いらず	2,500	3,090.00	7,725,000
ティア	1,000	431.00	431,000
アドウェイズ	19,100	299.00	5,710,900
バリューコマース	13,700	1,167.00	15,987,900
インフォマート	146,300	290.00	42,427,000
サッポロホールディングス	49,000	7,048.00	345,352,000
アサヒグループホールディングス	1,114,800	1,588.00	1,770,302,400
キリンホールディングス	618,400	1,940.00	1,199,696,000
宝ホールディングス	100,100	1,348.00	134,934,800
オエノンホールディングス	48,100	368.00	17,700,800
養命酒製造	4,900	2,499.00	12,245,100
飛島ホールディングス	15,200	1,601.00	24,335,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	93,000	2,483.00	230,919,000
ライフドリンク カンパニー	32,500	2,326.00	75,595,000
サントリー食品インターナショナル	104,400	4,799.00	501,015,600
ダイドーグループホールディングス	16,800	3,230.00	54,264,000
伊藤園	49,800	3,379.00	168,274,200
キーコーヒー	16,600	2,027.00	33,648,200
ユニカフェ	600	902.00	541,200
日清オイリオグループ	20,800	4,885.00	101,608,000
不二製油グループ本社	29,800	3,325.00	99,085,000
かどや製油	200	3,620.00	724,000
J・オイルミルズ	17,000	2,012.00	34,204,000
インターメスティック	9,100	2,432.00	22,131,200
サンエー	27,000	2,787.00	75,249,000
カワチ薬品	12,400	2,530.00	31,372,000
エービーシー・マート	69,800	3,156.00	220,288,800
ハードオフコーポレーション	6,300	1,837.00	11,573,100
高千穂交易	6,300	3,820.00	24,066,000
アスクル	37,600	1,620.00	60,912,000
ゲオホールディングス	17,800	1,668.00	29,690,400
アダストリア	22,200	3,240.00	71,928,000
ジーフット	1,400	286.00	400,400
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	555.00	111,000
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,983.00	594,900
リガク・ホールディングス	76,100	962.00	73,208,200
伊藤忠食品	3,500	7,020.00	24,570,000
くら寿司	18,700	2,658.00	49,704,600
キャンドウ	5,700	3,200.00	18,240,000
IKホールディングス	600	360.00	216,000
パルグループホールディングス	36,500	2,923.00	106,689,500
エディオン	69,500	1,768.00	122,876,000
あらた	24,400	3,040.00	74,176,000
サーラコーポレーション	33,500	829.00	27,771,500
ワッツ	700	672.00	470,400
トーメンデバイス	2,300	6,410.00	14,743,000
ハローズ	6,400	3,965.00	25,376,000

J Pホールディングス	39,700	633.00	25,130,100	
フジオフードグループ本社	17,900	1,048.00	18,759,200	
あみやき亭	11,500	1,635.00	18,802,500	
東京エレクトロン デバイス	15,900	3,000.00	47,700,000	
ひらまつ	4,100	164.00	672,400	
円谷フィールズホールディングス	25,800	1,906.00	49,174,800	
双日	177,500	3,115.00	552,912,500	
アルフレッサ ホールディングス	148,800	2,100.00	312,480,000	
大黒天物産	4,900	8,130.00	39,837,000	
ハニーズホールディングス	14,200	1,737.00	24,665,400	
ファーマライズホールディングス	400	536.00	214,400	
キッコーマン	491,900	1,629.00	801,305,100	
味の素	343,900	6,354.00	2,185,140,600	
ブルドックソース	7,800	1,736.00	13,540,800	
キュービー	79,700	3,082.00	245,635,400	
ハウス食品グループ本社	50,000	2,764.00	138,200,000	
カゴメ	63,600	2,922.00	185,839,200	
アリアケジャパン	14,800	5,210.00	77,108,000	
ピエトロ	300	1,755.00	526,500	
エバラ食品工業	3,500	2,850.00	9,975,000	
やまみ	200	3,280.00	656,000	
ニチレイ	57,900	3,952.00	228,820,800	
横浜冷凍	40,200	823.00	33,084,600	
東洋水産	68,800	10,335.00	711,048,000	
イートアンドホールディングス	7,700	2,164.00	16,662,800	
大冷	200	1,902.00	380,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	1,290.00	10,449,000	
日清食品ホールディングス	187,600	3,557.00	667,293,200	
一正蒲鉾	700	745.00	521,500	
フジッコ	15,300	1,640.00	25,092,000	
ロック・フィールド	18,000	1,522.00	27,396,000	
日本たばこ産業	902,200	3,902.00	3,520,384,400	
ケンコーマヨネーズ	9,300	1,860.00	17,298,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,900	2,091.00	20,700,900	
なとり	9,400	2,135.00	20,069,000	
イフジ産業	300	1,517.00	455,100	
ファーマフーズ	19,600	960.00	18,816,000	
北の達人コーポレーション	63,600	154.00	9,794,400	
ユーグレナ	92,300	398.00	36,735,400	
紀文食品	13,000	1,059.00	13,767,000	
ピックルスホールディングス	8,700	1,010.00	8,787,000	
スター・マイカ・ホールディングス	15,300	749.00	11,459,700	
S R Eホールディングス	5,500	3,040.00	16,720,000	
A Dワークスグループ	4,100	203.00	832,300	
片倉工業	14,000	1,947.00	27,258,000	
グンゼ	10,700	5,190.00	55,533,000	
ヒューリック	346,400	1,375.00	476,300,000	
神栄	200	1,625.00	325,000	
ラサ商事	8,800	1,389.00	12,223,200	
アルペン	13,300	2,040.00	27,132,000	

ハブ	600	764.00	458,400
ラクーンホールディングス	11,300	679.00	7,672,700
クオールホールディングス	19,700	1,412.00	27,816,400
アルコニックス	22,900	1,507.00	34,510,300
神戸物産	123,500	3,212.00	396,682,000
ソリトンシステムズ	7,800	1,145.00	8,931,000
ジーンズホールディングス	12,100	6,720.00	81,312,000
ビックカメラ	95,500	1,725.00	164,737,500
DCMホールディングス	82,600	1,400.00	115,640,000
ペッパーフードサービス	47,000	154.00	7,238,000
ハイパー	500	296.00	148,000
Monotaro	226,200	2,503.00	566,178,600
東京一番フーズ	600	485.00	291,000
DDグループ	1,100	1,335.00	1,468,500
あいホールディングス	25,500	2,006.00	51,153,000
ディーブイエックス	400	941.00	376,400
きちりホールディングス	500	825.00	412,500
J・フロントリテイリング	183,200	2,023.50	370,705,200
ドトール・日レスホールディングス	28,200	2,252.00	63,506,400
マツキヨココカラ&カンパニー	281,100	2,179.50	612,657,450
ブロンコビリー	9,400	3,455.00	32,477,000
ZOZO	118,700	4,773.00	566,555,100
トレジャー・ファクトリー	10,900	1,359.00	14,813,100
物語コーポレーション	27,800	3,280.00	91,184,000
三越伊勢丹ホールディングス	238,400	2,445.00	582,888,000
東洋紡	65,300	948.00	61,904,400
ユニチカ	48,900	137.00	6,699,300
富士紡ホールディングス	6,000	5,080.00	30,480,000
日清紡ホールディングス	114,600	868.20	99,495,720
倉敷紡績	10,600	5,500.00	58,300,000
ダイワボウホールディングス	70,600	2,888.00	203,892,800
シキボウ	10,700	999.00	10,689,300
日東紡績	17,000	5,980.00	101,660,000
トヨタ紡織	63,300	1,979.00	125,270,700
マクニカホールディングス	123,600	1,709.50	211,294,200
Hamee	6,500	1,302.00	8,463,000
マーケットエンタープライズ	100	1,450.00	145,000
ラクト・ジャパン	6,800	2,552.00	17,353,600
ウエルシアホールディングス	82,800	2,151.00	178,102,800
クリエイトSDホールディングス	22,700	2,738.00	62,152,600
グリムス	6,700	2,440.00	16,348,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,100	1,221.00	26,984,100
八洲電機	13,000	1,605.00	20,865,000
メディアスホールディングス	9,300	835.00	7,765,500
レスター	13,700	2,477.00	33,934,900
ジオリーブグループ	400	1,125.00	450,000
丸善CHIホールディングス	2,600	317.00	824,200
大光	900	574.00	516,600
OCHIホールディングス	400	1,325.00	530,000

TOKAIホールディングス	86,600	940.00	81,404,000
MERF	600	541.00	324,600
ミサワ	400	713.00	285,200
ティーライフ	200	1,144.00	228,800
Cominix	300	917.00	275,100
エー・ピーホールディングス	500	950.00	475,000
三洋貿易	16,400	1,466.00	24,042,400
チムニー	600	1,198.00	718,800
シュッピン	15,700	1,053.00	16,532,100
ビューティガレージ	5,100	1,322.00	6,742,200
オイシックス・ラ・大地	25,700	1,316.00	33,821,200
ウイン・パートナーズ	11,500	1,283.00	14,754,500
ネクステージ	36,400	1,448.00	52,707,200
ジョイフル本田	44,200	1,829.00	80,841,800
エターナルホスピタリティグループ	5,900	2,765.00	16,313,500
ホットランド	12,200	1,961.00	23,924,200
すかいらーくホールディングス	218,100	2,357.50	514,170,750
SFPホールディングス	9,000	2,000.00	18,000,000
綿半ホールディングス	12,400	1,626.00	20,162,400
日本毛織	38,800	1,296.00	50,284,800
ダイトウボウ	2,700	103.00	278,100
トーア紡コーポレーション	700	391.00	273,700
ダイドーリミテッド	1,500	947.00	1,420,500
ヨシックスホールディングス	5,300	3,020.00	16,006,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	68,000	748.00	50,864,000
野村不動産ホールディングス	93,100	3,877.00	360,948,700
三重交通グループホールディングス	31,900	474.00	15,120,600
ディア・ライフ	25,300	991.00	25,072,300
コーセーアールイー	500	754.00	377,000
地主	13,300	2,135.00	28,395,500
プレサンスコーポレーション	19,700	2,357.00	46,432,900
フィル・カンパニー	2,900	749.00	2,172,100
THEグローバル社	1,100	644.00	708,400
ハウスコム	300	1,346.00	403,800
JPMC	8,600	1,090.00	9,374,000
サンセイランディック	500	969.00	484,500
エストラスト	200	733.00	146,600
フージャースホールディングス	23,000	1,014.00	23,322,000
オープンハウスグループ	54,300	5,138.00	278,993,400
東急不動産ホールディングス	446,500	936.90	418,325,850
飯田グループホールディングス	142,300	2,236.00	318,182,800
イーグランド	200	1,434.00	286,800
ムゲンエステート	1,200	1,767.00	2,120,400
帝国繊維	17,000	2,296.00	39,032,000
日本コークス工業	153,400	90.00	13,806,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,300	307.00	2,855,100
ミタチ産業	500	1,124.00	562,000
BEE NOS	9,900	3,960.00	39,204,000
あさひ	13,400	1,448.00	19,403,200

日本調剤	10,500	1,400.00	14,700,000
コスモス薬品	27,000	7,338.00	198,126,000
シップヘルスケアホールディングス	62,900	2,126.50	133,756,850
トーエル	800	788.00	630,400
ソフトクリエイティブホールディングス	10,800	2,217.00	23,943,600
セブン&アイ・ホールディングス	1,762,200	2,422.00	4,268,048,400
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	119,900	1,173.00	140,642,700
明治電機工業	6,000	1,390.00	8,340,000
ツルハホールディングス	33,500	8,653.00	289,875,500
デリカフーズホールディングス	800	523.00	418,400
スターティアホールディングス	500	2,244.00	1,122,000
サンマルクホールディングス	13,000	2,498.00	32,474,000
フェリシモ	400	810.00	324,000
トリドールホールディングス	44,600	3,600.00	160,560,000
帝人	145,100	1,293.50	187,686,850
東レ	1,103,700	1,018.00	1,123,566,600
クラレ	201,400	2,220.50	447,208,700
旭化成	1,021,800	1,064.00	1,087,195,200
TOKYO BASE	17,100	340.00	5,814,000
稲葉製作所	8,700	1,734.00	15,085,800
宮地エンジニアリンググループ	18,700	1,900.00	35,530,000
トーカロ	44,700	1,757.00	78,537,900
アルファ	600	1,199.00	719,400
SUMCO	296,200	1,123.00	332,632,600
川田テクノロジーズ	10,000	2,547.00	25,470,000
RS Technologies	11,900	3,035.00	36,116,500
ジェイテックコーポレーション	300	1,341.00	402,300
信和	1,200	736.00	883,200
ビーロッド	1,000	1,259.00	1,259,000
ファーストブラザーズ	400	996.00	398,400
And Doホールディングス	9,000	1,178.00	10,602,000
シーアールイー	6,600	1,249.00	8,243,400
ケイアイスター不動産	8,000	4,060.00	32,480,000
アグレ都市デザイン	300	1,640.00	492,000
グッドコムアセット	12,000	856.00	10,272,000
ジェイ・エス・ビー	6,200	2,694.00	16,702,800
ロードスターキャピタル	8,500	2,406.00	20,451,000
イノベーションホールディングス	600	971.00	582,600
グローバル・リンク・マネジメント	300	2,777.00	833,100
フェイスネットワーク	500	1,738.00	869,000
霞ヶ関キャピタル	6,100	14,540.00	88,694,000
SUMINOE	300	2,069.00	620,700
日本フェルト	1,000	487.00	487,000
イチカワ	200	1,641.00	328,200
エコナックホールディングス	1,500	126.00	189,000
日東製網	200	1,628.00	325,600
芦森工業	300	2,668.00	800,400
アツギ	1,100	987.00	1,085,700
ウイルプラスホールディングス	300	1,014.00	304,200



J Mホールディングス	12,000	2,445.00	29,340,000
コメダホールディングス	41,800	2,664.00	111,355,200
サツドラホールディングス	700	819.00	573,300
アレンザホールディングス	11,900	1,102.00	13,113,800
串カツ田中ホールディングス	4,800	1,380.00	6,624,000
バロックジャパンリミテッド	18,600	786.00	14,619,600
クスリのアオキホールディングス	53,200	3,063.00	162,951,600
ダイニック	500	740.00	370,000
共和レザー	1,100	686.00	754,600
ピーバンドットコム	300	367.00	110,100
力の源ホールディングス	11,900	907.00	10,793,300
FOOD & LIFE COMPANIES	85,100	3,074.00	261,597,400
アセンテック	6,100	915.00	5,581,500
セーレン	29,100	2,726.00	79,326,600
ソトー	500	687.00	343,500
東海染工	200	914.00	182,800
小松マテーレ	22,000	788.00	17,336,000
ワコールホールディングス	31,300	5,374.00	168,206,200
ホギメディカル	20,300	4,880.00	99,064,000
クラウドシアホールディングス	400	326.00	130,400
T S Iホールディングス	47,700	1,006.00	47,986,200
マツオカコーポレーション	400	1,956.00	782,400
ワールド	23,400	2,554.00	59,763,600
T I S	159,800	3,508.00	560,578,400
テクミラホールディングス	800	346.00	276,800
グリーホールディングス	50,600	442.00	22,365,200
G M Oベパボ	1,900	1,388.00	2,637,200
コーエーテクモホールディングス	113,600	1,758.00	199,708,800
三菱総合研究所	7,400	4,880.00	36,112,000
ボルテージ	400	224.00	89,600
電算	200	1,435.00	287,000
A G S	600	807.00	484,200
ファインデックス	12,100	877.00	10,611,700
ブレインパッド	12,500	1,116.00	13,950,000
K L a b	37,800	137.00	5,178,600
ポルトゥウィンホールディングス	21,600	433.00	9,352,800
ネクソン	332,200	2,133.50	708,748,700
アイスタイル	50,500	418.00	21,109,000
エムアップホールディングス	18,500	1,558.00	28,823,000
エイチーム	10,100	963.00	9,726,300
セルシス	21,500	1,259.00	27,068,500
エニグモ	16,800	307.00	5,157,600
テクノスジャパン	1,400	775.00	1,085,000
e n i s h	2,300	133.00	305,900
コロプラ	51,300	480.00	24,624,000
オルトプラス	1,500	57.00	85,500
ブロードリーフ	60,700	634.00	38,483,800
クロス・マーケティンググループ	700	780.00	546,000
デジタルハーツホールディングス	10,700	806.00	8,624,200

メディアドゥ	6,800	1,514.00	10,295,200
じげん	37,700	463.00	17,455,100
ブイキューブ	20,600	189.00	3,893,400
エンカレッジ・テクノロジー	400	602.00	240,800
サイバーリンクス	600	753.00	451,800
ディー・エル・イー	1,300	128.00	166,400
フィックスターズ	15,200	1,752.00	26,630,400
CARTA HOLDINGS	8,600	1,346.00	11,575,600
オブティム	15,600	669.00	10,436,400
セレス	6,800	2,833.00	19,264,400
SHIFT	10,000	18,780.00	187,800,000
特種東海製紙	7,300	3,550.00	25,915,000
セック	2,600	4,600.00	11,960,000
テクマトリックス	32,700	2,198.00	71,874,600
プロシップ	6,700	1,590.00	10,653,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	37,400	3,147.00	117,697,800
GMOペイメントゲートウェイ	34,400	7,590.00	261,096,000
ザッパラス	400	353.00	141,200
システムリサーチ	10,300	1,377.00	14,183,100
インターネットイニシアティブ	82,700	2,775.50	229,533,850
さくらインターネット	23,700	4,450.00	105,465,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,700	2,330.00	10,951,000
SRAホールディングス	8,600	4,180.00	35,948,000
システムインテグレータ	600	318.00	190,800
朝日ネット	16,200	649.00	10,513,800
eBASE	21,400	626.00	13,396,400
アバントグループ	19,100	1,863.00	35,583,300
アドソル日進	6,400	1,910.00	12,224,000
ODKソリューションズ	400	567.00	226,800
フリービット	6,600	1,291.00	8,520,600
コムチュア	19,900	2,082.00	41,431,800
アステリア	11,800	594.00	7,009,200
アイル	8,500	2,571.00	21,853,500
王子ホールディングス	572,000	588.30	336,507,600
日本製紙	78,600	858.00	67,438,800
三菱製紙	2,300	552.00	1,269,600
北越コーポレーション	84,800	1,541.00	130,676,800
中越パルプ工業	600	1,469.00	881,400
巴川コーポレーション	500	706.00	353,000
大王製紙	76,200	829.00	63,169,800
阿波製紙	400	444.00	177,600
マークライNZ	9,000	2,108.00	18,972,000
メディカル・データ・ビジョン	18,100	428.00	7,746,800
gumi	24,700	386.00	9,534,200
ショーケース	400	298.00	119,200
モバイルファクトリー	300	942.00	282,600
テラスカイ	5,900	2,533.00	14,944,700

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,959.00	15,280,200	
PCIホールディングス	500	869.00	434,500	
アイビーシー	200	721.00	144,200	
ネオジャパン	3,900	1,707.00	6,657,300	
PR TIMES	3,000	2,089.00	6,267,000	
ラクス	71,300	1,769.00	126,129,700	
ランドコンピュータ	800	668.00	534,400	
ダブルスタンダード	5,400	1,646.00	8,888,400	
オープンドア	10,500	596.00	6,258,000	
マイネット	500	308.00	154,000	
アカツキ	7,400	2,826.00	20,912,400	
ベネフィットジャパン	100	1,070.00	107,000	
Ubicomホールディングス	4,800	1,287.00	6,177,600	
カナミックネットワーク	19,100	473.00	9,034,300	
ノムラシステムコーポレーション	1,500	124.00	186,000	
レンゴー	137,500	850.10	116,888,750	
トーモク	8,700	2,224.00	19,348,800	
ザ・バック	11,100	3,485.00	38,683,500	
チェンジホールディングス	37,300	1,395.00	52,033,500	
シンクロ・フード	1,000	345.00	345,000	
オークネット	7,000	2,361.00	16,527,000	
キャピタル・アセット・プランニング	300	755.00	226,500	
セグエグループ	1,500	641.00	961,500	
エイトレッド	300	1,511.00	453,300	
マクロミル	28,900	1,210.00	34,969,000	
ビーグリー	300	1,905.00	571,500	
オロ	6,400	2,308.00	14,771,200	
ユーザーローカル	6,400	1,805.00	11,552,000	
テモナ	400	187.00	74,800	
ニーズウェル	1,900	403.00	765,700	
PKSHA Technology	12,100	3,480.00	42,108,000	
マネーフォワード	36,900	4,736.00	174,758,400	
サインポスト	700	455.00	318,500	
レゾナック・ホールディングス	135,600	3,950.00	535,620,000	
住友化学	1,214,600	333.60	405,190,560	
住友精化	7,100	4,565.00	32,411,500	
日産化学	77,600	4,715.00	365,884,000	
ラサ工業	5,400	2,472.00	13,348,800	
クレハ	31,300	2,773.00	86,794,900	
多木化学	5,900	3,220.00	18,998,000	
テイカ	10,900	1,497.00	16,317,300	
石原産業	25,100	1,498.00	37,599,800	
片倉コープアグリ	400	954.00	381,600	
日本曹達	32,100	2,833.00	90,939,300	
東ソー	201,600	2,068.00	416,908,800	
トクヤマ	48,900	2,548.50	124,621,650	
セントラル硝子	19,000	3,150.00	59,850,000	
東亜合成	72,700	1,445.00	105,051,500	
大阪ソーダ	52,700	1,792.00	94,438,400	

関東電化工業	32,600	965.00	31,459,000
SUN ASTERISK	10,700	670.00	7,169,000
デンカ	54,800	2,159.00	118,313,200
イビデン	87,300	4,538.00	396,167,400
信越化学工業	1,354,300	5,058.00	6,850,049,400
日本カーバイド工業	7,900	1,721.00	13,595,900
プラスアルファ・コンサルティング	19,100	1,765.00	33,711,500
電算システムホールディングス	6,700	2,384.00	15,972,800
堺化学工業	10,500	2,516.00	26,418,000
第一稀元素化学工業	16,500	679.00	11,203,500
エア・ウォーター	142,600	1,841.00	262,526,600
日本酸素ホールディングス	146,500	4,202.00	615,593,000
日本化学工業	5,600	2,270.00	12,712,000
東邦アセチレン	1,800	366.00	658,800
日本パーカライジング	67,300	1,245.00	83,788,500
高压ガス工業	22,100	807.00	17,834,700
チタン工業	200	790.00	158,000
四国化成ホールディングス	17,000	1,934.00	32,878,000
戸田工業	3,400	1,072.00	3,644,800
ステラ ケミファ	8,100	4,445.00	36,004,500
保土谷化学工業	4,800	3,625.00	17,400,000
日本触媒	96,700	1,879.00	181,699,300
大日精化工業	10,400	2,878.00	29,931,200
カネカ	37,100	3,650.00	135,415,000
協和キリン	177,800	2,330.00	414,274,000
APPIER GROUP	46,000	1,441.00	66,286,000
三菱瓦斯化学	122,400	2,716.00	332,438,400
三井化学	135,900	3,282.00	446,023,800
東京応化工業	72,100	3,662.00	264,030,200
大阪有機化学工業	12,600	2,767.00	34,864,200
三菱ケミカルグループ	1,103,900	783.80	865,236,820
KHネオケム	27,200	1,952.00	53,094,400
ピジョン	17,800	7,785.00	138,573,000
ダイセル	171,800	1,325.00	227,635,000
住友ベークライト	47,600	3,775.00	179,690,000
積水化学工業	300,800	2,505.50	753,654,400
日本ゼオン	116,500	1,404.50	163,624,250
アイカ工業	38,200	3,204.00	122,392,800
UBE	77,800	2,304.50	179,290,100
積水樹脂	20,600	2,019.00	41,591,400
旭有機材	10,000	4,270.00	42,700,000
ニチバン	9,400	1,983.00	18,640,200
リケンテクノス	28,200	1,005.00	28,341,000
大倉工業	7,000	2,995.00	20,965,000
積水化成品工業	21,300	343.00	7,305,900
群栄化学工業	3,500	2,730.00	9,555,000
タイガースポリマー	800	704.00	563,200
ミライアル	500	1,295.00	647,500
ダイキアクシス	700	667.00	466,900
ダイキョーニシカワ	33,300	621.00	20,679,300

竹本容器	600	832.00	499,200
森六ホールディングス	8,400	1,923.00	16,153,200
恵和	9,800	969.00	9,496,200
日本化薬	102,400	1,258.50	128,870,400
カーリット	14,900	1,188.00	17,701,200
ソルクシーズ	1,300	318.00	413,400
CLホールディングス	3,600	676.00	2,433,600
プレステージ・インターナショナル	72,600	653.00	47,407,800
プロトコーポレーション	16,500	1,229.00	20,278,500
ハイマックス	4,600	1,381.00	6,352,600
アミューズ	9,400	1,459.00	13,714,600
野村総合研究所	327,800	4,474.00	1,466,577,200
ドリームインキュベータ	3,700	3,350.00	12,395,000
クイック	10,700	2,181.00	23,336,700
TAC	700	205.00	143,500
CEホールディングス	800	544.00	435,200
日本システム技術	14,100	1,986.00	28,002,600
電通グループ	164,800	3,654.00	602,179,200
インテージホールディングス	17,100	1,500.00	25,650,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,400	894.00	6,615,600
東邦システムサイエンス	7,000	1,291.00	9,037,000
ぴあ	5,300	3,000.00	15,900,000
イオンファンタジー	6,700	2,551.00	17,091,700
ソースネクスト	76,800	190.00	14,592,000
シーティーエス	21,400	826.00	17,676,400
NEXYZ . Group	500	821.00	410,500
メディカルシステムネットワーク	15,600	400.00	6,240,000
日本精化	10,000	2,229.00	22,290,000
扶桑化学工業	14,100	3,340.00	47,094,000
トリケミカル研究所	16,500	3,170.00	52,305,000
シンプレクス・ホールディングス	29,500	2,347.00	69,236,500
HEROZ	6,000	937.00	5,622,000
ラクスル	36,500	1,150.00	41,975,000
メルカリ	73,900	1,667.50	123,228,250
IPS	4,500	2,394.00	10,773,000
FIG	2,000	276.00	552,000
システムサポートホールディングス	5,900	1,729.00	10,201,100
ADEKA	52,600	2,804.00	147,490,400
日油	177,700	2,097.50	372,725,750
ミヨシ油脂	600	1,555.00	933,000
新日本理化	2,500	196.00	490,000
ハリマ化成グループ	11,600	847.00	9,825,200
イーソル	10,200	618.00	6,303,600
東海ソフト	200	1,407.00	281,400
ウイングアーク1st	15,800	3,350.00	52,930,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,200	851.00	4,425,200
サーバーワークス	2,600	2,448.00	6,364,800
東名	300	2,207.00	662,100
ヴィッツ	200	997.00	199,400

トピラシステムズ	500	860.00	430,000	
Sansan	49,800	2,450.00	122,010,000	
Link-Uグループ	300	392.00	117,600	
ギフトィ	13,400	1,262.00	16,910,800	
花王	367,600	5,907.00	2,171,413,200	
第一工業製薬	5,500	3,440.00	18,920,000	
石原ケミカル	6,600	2,166.00	14,295,600	
日華化学	600	1,111.00	666,600	
ニイタカ	300	1,993.00	597,900	
三洋化成工業	9,300	3,905.00	36,316,500	
メドレー	16,600	3,710.00	61,586,000	
ベース	7,400	2,832.00	20,956,800	
JMDC	18,400	3,762.00	69,220,800	
武田薬品工業	1,345,500	4,121.00	5,544,805,500	
アステラス製薬	1,326,500	1,516.50	2,011,637,250	
住友ファーマ	134,600	552.00	74,299,200	
塩野義製薬	501,400	2,248.00	1,127,147,200	
わかもと製薬	2,000	218.00	436,000	
日本新薬	39,700	3,877.00	153,916,900	
中外製薬	473,300	6,800.00	3,218,440,000	
科研製薬	25,900	4,257.00	110,256,300	
エーザイ	197,300	4,283.00	845,035,900	
理研ビタミン	13,000	2,326.00	30,238,000	
ロート製薬	159,800	2,704.50	432,179,100	
小野薬品工業	309,400	1,635.00	505,869,000	
久光製薬	33,600	4,611.00	154,929,600	
有機合成薬品工業	1,200	266.00	319,200	
持田製薬	19,000	3,315.00	62,985,000	
参天製薬	273,900	1,565.50	428,790,450	
扶桑薬品工業	5,900	2,438.00	14,384,200	
日本ケミファ	200	1,504.00	300,800	
ツムラ	52,000	4,576.00	237,952,000	
テルモ	1,008,600	2,991.00	3,016,722,600	
H.U.グループホールディングス	45,300	2,570.00	116,421,000	
キッセイ薬品工業	25,100	4,095.00	102,784,500	
生化学工業	28,800	777.00	22,377,600	
栄研化学	23,900	2,156.00	51,528,400	
鳥居薬品	8,100	4,675.00	37,867,500	
JCRファーマ	51,200	582.00	29,798,400	
東和薬品	20,300	3,280.00	66,584,000	
富士製薬工業	11,100	1,530.00	16,983,000	
ゼリア新薬工業	23,900	2,225.00	53,177,500	
ネクセラファーマ	70,900	970.00	68,773,000	
第一三共	1,427,100	4,157.00	5,932,454,700	
杏林製薬	32,900	1,449.00	47,672,100	
大幸薬品	34,200	309.00	10,567,800	
ダイト	11,200	2,072.00	23,206,400	
大塚ホールディングス	377,400	8,051.00	3,038,447,400	
ペプチドリーム	73,300	2,291.00	167,930,300	
大日本塗料	16,700	1,138.00	19,004,600	

日本ペイントホールディングス	668,200	983.50	657,174,700	
関西ペイント	126,500	2,121.50	268,369,750	
神東塗料	1,500	130.00	195,000	
中国塗料	34,100	2,172.00	74,065,200	
日本特殊塗料	1,200	1,248.00	1,497,600	
藤倉化成	19,000	490.00	9,310,000	
太陽ホールディングス	26,300	4,195.00	110,328,500	
D I C	53,500	3,512.00	187,892,000	
サカタインクス	33,500	1,661.00	55,643,500	
a r t i e n c e	27,000	2,951.00	79,677,000	
アルプス技研	13,600	2,435.00	33,116,000	
サニックス	22,300	230.00	5,129,000	
日本空調サービス	16,600	1,016.00	16,865,600	
オリエンタルランド	922,700	3,294.00	3,039,373,800	
フォーカスシステムズ	10,100	1,067.00	10,776,700	
ダスキン	33,800	3,628.00	122,626,400	
パーク24	115,800	2,003.50	232,005,300	
明光ネットワークジャパン	18,800	747.00	14,043,600	
ファルコホールディングス	6,300	2,342.00	14,754,600	
クレスコ	24,700	1,130.00	27,911,000	
フジ・メディア・ホールディングス	145,300	1,641.50	238,509,950	
秀英予備校	300	262.00	78,600	
田谷	300	310.00	93,000	
ラウンドワン	146,200	1,261.00	184,358,200	
リゾートトラスト	61,200	2,990.00	182,988,000	
オービック	280,800	4,457.00	1,251,525,600	
ジャストシステム	21,900	3,395.00	74,350,500	
T D C ソフト	25,500	1,471.00	37,510,500	
L I N E ヤフー	2,418,700	425.10	1,028,189,370	
ビー・エム・エル	19,000	2,749.00	52,231,000	
トレンドマイクロ	79,400	8,404.00	667,277,600	
I D ホールディングス	10,200	1,635.00	16,677,000	
リソー教育	96,700	295.00	28,526,500	
日本オラクル	28,900	14,040.00	405,756,000	
早稲田アカデミー	8,600	1,839.00	15,815,400	
アルファシステムズ	4,800	3,250.00	15,600,000	
フューチャー	37,500	1,750.00	65,625,000	
C A C H o l d i n g s	9,300	1,692.00	15,735,600	
トーセ	500	661.00	330,500	
ユー・エス・エス	318,900	1,309.50	417,599,550	
オービックビジネスコンサルタント	25,500	6,773.00	172,711,500	
アイティフォー	17,700	1,402.00	24,815,400	
東京個別指導学院	18,400	340.00	6,256,000	
東計電算	4,100	4,040.00	16,564,000	
サイバーエージェント	342,500	1,039.00	355,857,500	
楽天グループ	1,091,800	901.70	984,476,060	
エクスネット	300	1,519.00	455,700	
クリーク・アンド・リバー社	7,800	1,616.00	12,604,800	
S B I グローバルアセットマネジメント	30,400	645.00	19,608,000	

テー・オー・ダブリュー	30,600	310.00	9,486,000
大塚商会	171,300	3,409.00	583,961,700
サイボウズ	20,700	2,606.00	53,944,200
山田コンサルティンググループ	7,800	1,831.00	14,281,800
セントラルスポーツ	5,900	2,382.00	14,053,800
パラカ	4,800	1,839.00	8,827,200
電通総研	14,700	5,490.00	80,703,000
A C C E S S	15,800	842.00	13,303,600
デジタルガレージ	24,100	3,775.00	90,977,500
イーエムシステムズ	25,200	759.00	19,126,800
ウェザーニューズ	9,700	3,500.00	33,950,000
C I J	37,600	450.00	16,920,000
ビジネスエンジニアリング	3,500	3,500.00	12,250,000
日本エンタープライズ	1,400	116.00	162,400
WOWOW	11,300	983.00	11,107,900
スカラ	14,000	365.00	5,110,000
インテリジェント ウェイブ	900	1,100.00	990,000
フルキャストホールディングス	12,600	1,434.00	18,068,400
エン・ジャパン	25,200	1,988.00	50,097,600
セルソース	10,000	790.00	7,900,000
あすか製薬ホールディングス	13,900	1,968.00	27,355,200
サワイグループホールディングス	89,100	2,136.50	190,362,150
富士フイルムホールディングス	911,800	3,272.00	2,983,409,600
コニカミノルタ	340,000	644.90	219,266,000
資生堂	315,700	2,518.50	795,090,450
ライオン	192,500	1,633.50	314,448,750
高砂香料工業	10,100	5,300.00	53,530,000
マンダム	30,100	1,242.00	37,384,200
ミルボン	24,200	3,205.00	77,561,000
コーセー	30,800	6,617.00	203,803,600
コタ	15,300	1,594.00	24,388,200
シーボン	200	1,085.00	217,000
ポーラ・オルビスホールディングス	77,500	1,398.00	108,345,000
ノエビアホールディングス	13,600	4,680.00	63,648,000
アジュバンホールディングス	400	819.00	327,600
新日本製薬	8,700	1,926.00	16,756,200
I - n e	5,100	1,850.00	9,435,000
アクシージア	10,000	441.00	4,410,000
エステー	12,200	1,498.00	18,275,600
コニシ	47,700	1,231.00	58,718,700
長谷川香料	28,900	2,914.00	84,214,600
小林製薬	39,700	5,710.00	226,687,000
荒川化学工業	14,100	1,053.00	14,847,300
メック	12,400	3,560.00	44,144,000
日本高純度化学	3,700	3,125.00	11,562,500
タカラバイオ	47,600	992.00	47,219,200
J C U	16,700	3,540.00	59,118,000
新田ゼラチン	1,100	723.00	795,300
O A T アグリオ	6,300	1,906.00	12,007,800
デクセリアルズ	132,500	2,272.50	301,106,250



アース製薬	13,900	5,050.00	70,195,000
北興化学工業	13,600	1,253.00	17,040,800
大成ラミック	4,500	2,480.00	11,160,000
クミアイ化学工業	60,100	741.00	44,534,100
日本農薬	23,200	681.00	15,799,200
富士興産	500	1,415.00	707,500
ニチレキグループ	16,100	2,401.00	38,656,100
ユシロ化学工業	7,700	2,080.00	16,016,000
ビービー・カストロール	800	856.00	684,800
富士石油	39,700	318.00	12,624,600
MORESCO	600	1,400.00	840,000
出光興産	706,800	1,040.00	735,072,000
ENEOSホールディングス	2,565,000	805.00	2,064,825,000
コスモエネルギーホールディングス	49,900	7,158.00	357,184,200
ANYCOLOR	20,400	2,800.00	57,120,000
テスホールディングス	32,200	266.00	8,565,200
インフロンニア・ホールディングス	154,900	1,160.00	179,684,000
横浜ゴム	76,500	3,267.00	249,925,500
TOYO TIRE	86,800	2,364.00	205,195,200
ブリヂストン	442,600	5,273.00	2,333,829,800
住友ゴム工業	148,400	1,733.00	257,177,200
藤倉コンポジット	14,500	1,575.00	22,837,500
オカモト	8,000	5,210.00	41,680,000
アキレス	8,200	1,396.00	11,447,200
フコク	8,900	1,704.00	15,165,600
ニッタ	14,800	3,510.00	51,948,000
クリエートメディック	500	912.00	456,000
住友理工	29,300	1,531.00	44,858,300
三ツ星ベルト	20,900	3,835.00	80,151,500
バンドー化学	22,600	1,820.00	41,132,000
AGC	147,100	4,418.00	649,887,800
日本板硝子	77,400	325.00	25,155,000
石塚硝子	300	2,323.00	696,900
有沢製作所	22,800	1,447.00	32,991,600
日本山村硝子	700	1,546.00	1,082,200
日本電気硝子	56,200	3,375.00	189,675,000
オハラ	7,200	1,116.00	8,035,200
住友大阪セメント	27,000	3,223.00	87,021,000
太平洋セメント	93,300	3,378.00	315,167,400
リソルホールディングス	200	5,270.00	1,054,000
日本ヒューム	13,400	1,304.00	17,473,600
日本コンクリート工業	29,200	360.00	10,512,000
三谷セキサン	6,400	4,960.00	31,744,000
アジアパイルホールディングス	21,500	801.00	17,221,500
東海カーボン	139,400	876.00	122,114,400
日本カーボン	8,700	4,140.00	36,018,000
東洋炭素	10,600	4,005.00	42,453,000
ノリタケ	16,700	3,675.00	61,372,500
TOTO	109,700	3,640.00	399,308,000
日本碍子	176,000	1,915.50	337,128,000

日本特殊陶業	123,600	4,804.00	593,774,400
ダントーホールディングス	500	294.00	147,000
MARUWA	6,300	47,560.00	299,628,000
品川リフラクトリーズ	18,600	1,694.00	31,508,400
黒崎播磨	10,200	2,395.00	24,429,000
ヨータイ	7,700	1,603.00	12,343,100
東京窯業	2,100	410.00	861,000
ニッカトー	800	496.00	396,800
フジインコーポレーテッド	40,700	2,243.00	91,290,100
クニミネ工業	500	1,022.00	511,000
エーアンドエーマテリアル	400	1,220.00	488,000
ニチアス	38,400	5,149.00	197,721,600
日本製鉄	787,700	3,010.00	2,370,977,000
神戸製鋼所	312,900	1,549.50	484,838,550
中山製鋼所	32,300	737.00	23,805,100
合同製鐵	8,800	3,925.00	34,540,000
JFEホールディングス	468,700	1,726.00	808,976,200
東京製鐵	43,400	1,490.00	64,666,000
共英製鋼	15,300	1,921.00	29,391,300
大和工業	29,300	7,273.00	213,098,900
東京鐵鋼	6,900	6,320.00	43,608,000
大阪製鐵	7,200	2,702.00	19,454,400
淀川製鋼所	14,400	5,330.00	76,752,000
中部鋼鈹	10,200	2,339.00	23,857,800
丸一鋼管	47,500	3,376.00	160,360,000
モリ工業	3,600	4,405.00	15,858,000
大同特殊鋼	98,100	1,174.00	115,169,400
日本高周波鋼業	700	362.00	253,400
日本冶金工業	10,500	3,865.00	40,582,500
山陽特殊製鋼	15,500	1,875.00	29,062,500
愛知製鋼	9,000	5,050.00	45,450,000
日本金属	500	619.00	309,500
ミガロホールディングス	500	2,682.00	1,341,000
大平洋金属	14,400	1,524.00	21,945,600
新日本電工	93,200	272.00	25,350,400
栗本鐵工所	7,200	4,235.00	30,492,000
虹技	300	1,184.00	355,200
日本鑄鐵管	200	1,009.00	201,800
日本製鋼所	46,100	5,941.00	273,880,100
三菱製鋼	11,500	1,507.00	17,330,500
日亜鋼業	2,200	305.00	671,000
日本精線	12,400	1,320.00	16,368,000
エンビプロ・ホールディングス	15,400	381.00	5,867,400
大紀アルミニウム工業所	22,400	1,035.00	23,184,000
日本輕金属ホールディングス	45,500	1,503.00	68,386,500
三井金属鋳業	39,000	4,498.00	175,422,000
東邦亜鉛	12,300	523.00	6,432,900
三菱マテリアル	111,200	2,362.00	262,654,400
住友金属鋳山	196,700	3,577.00	703,595,900
DOWAホールディングス	42,100	4,467.00	188,060,700

古河機械金属	20,500	1,536.00	31,488,000
エス・サイエンス	10,400	21.00	218,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,900	1,739.00	46,779,100
東邦チタニウム	32,300	1,025.00	33,107,500
U A C J	22,000	4,965.00	109,230,000
C Kサンエツ	2,900	3,710.00	10,759,000
古河電気工業	50,600	6,900.00	349,140,000
住友電気工業	537,100	2,678.00	1,438,353,800
フジクラ	166,800	6,106.00	1,018,480,800
S W C C	20,800	7,190.00	149,552,000
カナレ電気	300	1,406.00	421,800
平河ヒューテック	9,900	1,459.00	14,444,100
いよぎんホールディングス	194,400	1,529.50	297,334,800
しずおかフィナンシャルグループ	327,200	1,310.00	428,632,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	125,100	1,569.00	196,281,900
楽天銀行	68,900	4,572.00	315,010,800
京都フィナンシャルグループ	186,800	2,204.50	411,800,600
リョービ	16,500	2,193.00	36,184,500
アーレスティ	1,900	603.00	1,145,700
A R Eホールディングス	62,900	1,676.00	105,420,400
東洋製罐グループホールディングス	99,300	2,291.50	227,545,950
ホッカフホールディングス	8,400	1,643.00	13,801,200
コロナ	8,800	934.00	8,219,200
横河ブリッジホールディングス	26,700	2,730.00	72,891,000
駒井ハルテック	300	1,578.00	473,400
高田機工	400	1,025.00	410,000
三和ホールディングス	153,600	4,389.00	674,150,400
文化シャッター	40,800	1,825.00	74,460,000
三協立山	19,500	602.00	11,739,000
アルインコ	11,800	1,019.00	12,024,200
東洋シャッター	400	803.00	321,200
L I X I L	226,800	1,701.00	385,786,800
日本フィルコン	1,100	507.00	557,700
ノーリツ	22,100	1,616.00	35,713,600
長府製作所	17,300	1,933.00	33,440,900
リンナイ	82,700	3,197.00	264,391,900
ユニプレス	27,000	1,078.00	29,106,000
ダイニチ工業	700	635.00	444,500
日東精工	22,700	578.00	13,120,600
三洋工業	200	2,900.00	580,000
岡部	27,700	729.00	20,193,300
ジーテクト	17,300	1,681.00	29,081,300
東プレ	27,300	1,870.00	51,051,000
高周波熱錬	23,100	969.00	22,383,900
東京製綱	9,200	1,261.00	11,601,200
サンコール	17,200	244.00	4,196,800
モリテックスチール	1,800	173.00	311,400
パイオラックス	20,800	2,335.00	48,568,000
エイチワン	16,000	1,020.00	16,320,000
日本発条	137,600	1,901.00	261,577,600

中央発條	10,000	1,311.00	13,110,000
アドバネクス	200	952.00	190,400
三浦工業	70,600	3,856.00	272,233,600
タクマ	51,500	1,613.00	83,069,500
テクノプロ・ホールディングス	90,100	2,826.50	254,667,650
アトラグループ	500	128.00	64,000
アイ・アールジャパンホールディングス	8,000	695.00	5,560,000
Keeper 技研	9,600	4,385.00	42,096,000
楽待	500	702.00	351,000
三機サービス	300	1,000.00	300,000
Gunosy	12,400	659.00	8,171,600
デザインワン・ジャパン	400	109.00	43,600
イー・ガーディアン	7,400	1,840.00	13,616,000
リブセンス	900	136.00	122,400
ジャパンマテリアル	47,500	1,726.00	81,985,000
ベクトル	21,000	1,010.00	21,210,000
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	13,000	1,242.00	16,146,000
キャリアリンク	5,700	2,404.00	13,702,800
I B J	11,800	625.00	7,375,000
アサンテ	7,600	1,650.00	12,540,000
バリューHR	14,000	1,628.00	22,792,000
M&Aキャピタルパートナーズ	12,500	2,465.00	30,812,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,000.00	6,200,000
E R Iホールディングス	500	2,210.00	1,105,000
アビスト	300	3,100.00	930,000
シグマクシス・ホールディングス	45,400	871.00	39,543,400
ウィルグループ	13,100	993.00	13,008,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,800	143.00	257,400
メドピア	12,500	442.00	5,525,000
レアジョブ	400	359.00	143,600
リクルートホールディングス	1,209,300	10,630.00	12,854,859,000
エラン	20,400	736.00	15,014,400
ツガミ	32,600	1,490.00	48,574,000
オークマ	26,600	3,220.00	85,652,000
芝浦機械	20,000	3,490.00	69,800,000
アマダ	211,500	1,476.00	312,174,000
アイダエンジニアリング	34,000	774.00	26,316,000
F U J I	66,200	2,261.50	149,711,300
牧野フライス製作所	16,800	11,600.00	194,880,000
オーエスジー	67,100	1,672.00	112,191,200
ダイジェット工業	200	723.00	144,600
旭ダイヤモンド工業	37,900	806.00	30,547,400
D M G 森精機	96,000	2,336.00	224,256,000
ソディック	40,200	716.00	28,783,200
ディスコ	73,300	44,350.00	3,250,855,000
日東工器	5,900	2,398.00	14,148,200
日進工具	12,600	741.00	9,336,600

パンチ工業	1,800	397.00	714,600
富士ダイス	11,200	796.00	8,915,200
土木管理総合試験所	600	301.00	180,600
日本郵政	1,735,900	1,518.50	2,635,964,150
ベルシステム24ホールディングス	16,600	1,232.00	20,451,200
鎌倉新書	13,300	521.00	6,929,300
S MN	400	355.00	142,000
一蔵	300	375.00	112,500
グローバルキッズCOMPANY	300	683.00	204,900
エアトリ	11,300	1,112.00	12,565,600
アトラエ	10,800	722.00	7,797,600
ストライク	7,600	3,510.00	26,676,000
ソラスト	42,800	464.00	19,859,200
セラク	4,800	1,303.00	6,254,400
インソース	33,600	1,100.00	36,960,000
豊田自動織機	128,600	12,255.00	1,575,993,000
豊和工業	900	1,188.00	1,069,200
石川製作所	400	1,347.00	538,800
リケンNPR	19,100	2,421.00	46,241,100
東洋機械金属	1,400	653.00	914,200
津田駒工業	300	396.00	118,800
エンシュウ	400	528.00	211,200
島精機製作所	24,200	960.00	23,232,000
オプトラン	24,900	1,713.00	42,653,700
イワキ	10,100	2,281.00	23,038,100
フリー	14,300	1,061.00	15,172,300
ヤマシンフィルタ	32,300	606.00	19,573,800
日阪製作所	18,500	1,030.00	19,055,000
やまびこ	24,800	2,432.00	60,313,600
野村マイクロ・サイエンス	25,200	2,775.00	69,930,000
平田機工	7,300	5,290.00	38,617,000
PEGASUS	16,800	440.00	7,392,000
マルマエ	6,600	1,620.00	10,692,000
タツモ	10,800	2,039.00	22,021,200
ナブテスコ	95,500	2,646.00	252,693,000
三井海洋開発	19,200	3,365.00	64,608,000
レオン自動機	16,000	1,436.00	22,976,000
S MC	45,500	58,460.00	2,659,930,000
ホソカワミクロン	10,600	3,955.00	41,923,000
ユニオンツール	6,700	4,755.00	31,858,500
瑞光	9,700	1,285.00	12,464,500
オイレス工業	20,600	2,375.00	48,925,000
日精エー・エス・ビー機械	5,300	4,950.00	26,235,000
サトーホールディングス	19,000	2,112.00	40,128,000
技研製作所	14,300	1,489.00	21,292,700
日本エアテック	7,100	1,061.00	7,533,100
カワタ	500	784.00	392,000
日精樹脂工業	10,000	941.00	9,410,000
オカダアイヨン	500	1,847.00	923,500
ワイエイシイホールディングス	15,500	937.00	14,523,500

小松製作所	750,600	4,161.00	3,123,246,600
住友重機械工業	90,200	3,082.00	277,996,400
日立建機	60,600	3,417.00	207,070,200
日工	22,700	701.00	15,912,700
巴工業	6,000	3,660.00	21,960,000
井関農機	14,300	902.00	12,898,600
TOWA	46,700	1,750.00	81,725,000
丸山製作所	300	2,054.00	616,200
北川鉄工所	6,000	1,154.00	6,924,000
シンニッタン	2,100	209.00	438,900
ローツェ	79,500	1,581.00	125,689,500
タカキタ	500	369.00	184,500
クボタ	796,100	1,780.50	1,417,456,050
荏原実業	7,300	3,700.00	27,010,000
東洋エンジニアリング	21,900	698.00	15,286,200
三菱化工機	5,400	3,480.00	18,792,000
月島ホールディングス	20,500	1,425.00	29,212,500
帝国電機製作所	10,400	2,666.00	27,726,400
東京機械製作所	400	356.00	142,400
新東工業	33,800	906.00	30,622,800
澁谷工業	14,300	3,595.00	51,408,500
アイチコーポレーション	25,200	1,376.00	34,675,200
小森コーポレーション	37,400	1,136.00	42,486,400
鶴見製作所	11,500	3,120.00	35,880,000
日本ギア工業	700	521.00	364,700
酒井重工業	6,000	2,237.00	13,422,000
荏原製作所	312,600	2,645.00	826,827,000
西島製作所	13,200	2,229.00	29,422,800
北越工業	15,300	1,850.00	28,305,000
ダイキン工業	198,200	18,215.00	3,610,213,000
オルガノ	23,600	8,890.00	209,804,000
トーヨーカネツ	5,700	4,005.00	22,828,500
栗田工業	85,200	5,545.00	472,434,000
椿本チエイン	69,000	1,819.00	125,511,000
大同工業	700	771.00	539,700
日機装	39,100	922.00	36,050,200
木村化工機	11,600	825.00	9,570,000
レイズネクスト	21,500	1,495.00	32,142,500
アネスト岩田	25,900	1,320.00	34,188,000
ダイフク	256,900	3,133.00	804,867,700
サムコ	3,600	2,915.00	10,494,000
加藤製作所	900	1,310.00	1,179,000
油研工業	300	2,669.00	800,700
タダノ	87,500	1,092.50	95,593,750
フジテック	49,000	5,700.00	279,300,000
CKD	42,200	2,406.00	101,533,200
平和	50,700	2,331.00	118,181,700
理想科学工業	24,300	1,414.00	34,360,200
SANKYO	176,000	2,050.00	360,800,000
日本金銭機械	18,400	1,090.00	20,056,000

マースグループホールディングス	10,200	3,210.00	32,742,000
フクシマガリレイ	22,300	2,437.00	54,345,100
オーイズミ	600	334.00	200,400
ダイコク電機	6,700	2,909.00	19,490,300
竹内製作所	27,500	4,875.00	134,062,500
アマノ	43,200	3,958.00	170,985,600
JUKI	23,800	338.00	8,044,400
サンデン	3,100	140.00	434,000
ジャノメ	13,300	945.00	12,568,500
ブラザー工業	203,500	2,583.00	525,640,500
マックス	18,800	3,440.00	64,672,000
モリタホールディングス	23,800	2,066.00	49,170,800
グローリー	40,000	2,526.00	101,040,000
新晃工業	43,600	1,222.00	53,279,200
大和冷機工業	23,400	1,476.00	34,538,400
セガサミーホールディングス	136,000	2,835.50	385,628,000
TPR	19,300	2,320.00	44,776,000
ツバキ・ナカシマ	37,500	447.00	16,762,500
ホシザキ	98,100	6,087.00	597,134,700
大豊工業	13,300	625.00	8,312,500
日本精工	281,900	657.60	185,377,440
NTN	360,300	242.00	87,192,600
ジェイテクト	135,500	1,116.00	151,218,000
不二越	11,200	2,959.00	33,140,800
ミネベアミツミ	264,700	2,433.00	644,015,100
日本トムソン	41,400	501.00	20,741,400
THK	87,800	3,504.00	307,651,200
ユーシン精機	14,200	647.00	9,187,400
前澤給装工業	10,800	1,283.00	13,856,400
イーグル工業	16,800	1,998.00	33,566,400
前澤工業	1,000	1,164.00	1,164,000
PILLAR	14,200	4,195.00	59,569,000
キッツ	51,000	1,115.00	56,865,000
日立製作所	3,921,200	3,739.00	14,661,366,800
三菱電機	1,548,900	2,559.50	3,964,409,550
富士電機	92,600	7,811.00	723,298,600
東洋電機製造	600	1,222.00	733,200
安川電機	165,600	4,087.00	676,807,200
シンフォニアテクノロジー	15,200	5,840.00	88,768,000
明電舎	25,700	4,005.00	102,928,500
オリジン	300	1,135.00	340,500
山洋電気	6,600	8,460.00	55,836,000
デンヨー	11,500	2,699.00	31,038,500
PHCホールディングス	28,500	949.00	27,046,500
KOKUSAI ELECTRIC	106,600	2,254.50	240,329,700
ソシオネクスト	151,800	2,606.00	395,590,800
ベイカレント	113,800	4,984.00	567,179,200
Orchestra Holdings	3,400	717.00	2,437,800
アイモバイル	19,600	477.00	9,349,200

ディスラプターズ	800	149.00	119,200	
MS - Japan	8,500	1,077.00	9,154,500	
船場	300	1,324.00	397,200	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	60,300	2,825.00	170,347,500	
フルテック	200	1,115.00	223,000	
グリーンズ	600	2,003.00	1,201,800	
ツナググループ・ホールディングス	500	578.00	289,000	
GAMEWITH	700	201.00	140,700	
MS&Consulting	200	415.00	83,000	
エル・ティー・エス	2,100	2,527.00	5,306,700	
ミダックホールディングス	9,400	1,600.00	15,040,000	
キュービーネットホールディングス	8,900	970.00	8,633,000	
オープングループ	24,500	197.00	4,826,500	
三櫻工業	20,800	719.00	14,955,200	
マキタ	189,400	4,449.00	842,640,600	
東芝テック	22,900	3,380.00	77,402,000	
芝浦メカトロニクス	11,000	7,940.00	87,340,000	
マブチモーター	66,800	2,141.50	143,052,200	
ニデック	672,300	2,858.00	1,921,433,400	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,700	287.00	2,783,900	
トレックス・セミコンダクター	7,200	1,127.00	8,114,400	
東光高岳	8,200	1,929.00	15,817,800	
ダブル・スコープ	46,800	268.00	12,542,400	
宮越ホールディングス	6,800	1,372.00	9,329,600	
ダイヘン	14,400	7,480.00	107,712,000	
ヤーマン	29,500	690.00	20,355,000	
JVCケンウッド	120,100	1,709.50	205,310,950	
ミマキエンジニアリング	12,600	1,480.00	18,648,000	
大崎電気工業	32,800	769.00	25,223,200	
オムロン	139,400	4,755.00	662,847,000	
日東工業	20,400	2,819.00	57,507,600	
I D E C	22,600	2,421.00	54,714,600	
正興電機製作所	500	1,100.00	550,000	
不二電機工業	300	1,139.00	341,700	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	67,900	2,507.50	170,259,250	
サクサ	400	2,830.00	1,132,000	
テクノメディカ	2,900	1,752.00	5,080,800	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	6,200	483.00	2,994,600	
日本電気	215,300	12,800.00	2,755,840,000	
富士通	1,401,300	2,665.00	3,734,464,500	
沖電気工業	73,800	955.00	70,479,000	
電気興業	6,200	1,597.00	9,901,400	
サンケン電気	15,600	6,000.00	93,600,000	
ナカヨ	300	1,120.00	336,000	
アイホン	9,300	2,639.00	24,542,700	
ルネサスエレクトロニクス	1,160,100	1,983.00	2,300,478,300	
セイコーエプソン	195,300	2,702.50	527,798,250	
ワコム	107,100	685.00	73,363,500	



アルバック	33,400	6,100.00	203,740,000	
アクセル	7,600	1,284.00	9,758,400	
E I Z O	19,800	2,122.00	42,015,600	
ジャパンディスプレイ	655,900	19.00	12,462,100	
日本信号	34,600	894.00	30,932,400	
京三製作所	35,400	499.00	17,664,600	
能美防災	20,500	3,065.00	62,832,500	
ホーチキ	9,700	2,366.00	22,950,200	
星和電機	700	517.00	361,900	
エレコム	36,300	1,426.00	51,763,800	
パナソニック ホールディングス	1,799,100	1,547.50	2,784,107,250	
シャープ	220,000	923.60	203,192,000	
アンリツ	107,300	1,272.50	136,539,250	
富士通ゼネラル	43,100	2,766.00	119,214,600	
ソニーグループ	5,279,800	3,155.00	16,657,769,000	
T D K	1,315,100	1,850.50	2,433,592,550	
帝国通信工業	6,700	2,266.00	15,182,200	
タムラ製作所	60,600	531.00	32,178,600	
アルプスアルパイン	123,700	1,549.00	191,611,300	
池上通信機	500	663.00	331,500	
日本電波工業	14,300	819.00	11,711,700	
鈴木	8,100	1,768.00	14,320,800	
メイコー	14,900	8,780.00	130,822,000	
日本トリム	3,400	3,575.00	12,155,000	
フォスター電機	15,500	1,611.00	24,970,500	
S M K	3,600	2,790.00	10,044,000	
ヨコオ	13,600	1,688.00	22,956,800	
ティアック	2,500	76.00	190,000	
ホシデン	37,900	2,052.00	77,770,800	
ヒロセ電機	22,300	18,190.00	405,637,000	
日本航空電子工業	39,700	2,815.00	111,755,500	
T O A	15,500	946.00	14,663,000	
マクセル	29,100	1,911.00	55,610,100	
古野電気	17,900	2,481.00	44,409,900	
スミダコーポレーション	20,400	869.00	17,727,600	
アイコム	5,900	2,686.00	15,847,400	
リオン	6,300	2,479.00	15,617,700	
横河電機	166,700	3,364.00	560,778,800	
新電元工業	5,900	2,423.00	14,295,700	
アズビル	410,900	1,165.50	478,903,950	
東亜ディーケーケー	800	745.00	596,000	
日本光電工業	134,900	2,017.00	272,093,300	
チノー	6,300	2,111.00	13,299,300	
共和電業	1,800	402.00	723,600	
日本電子材料	9,300	2,149.00	19,985,700	
堀場製作所	28,500	9,085.00	258,922,500	
アドバンテスト	475,200	9,424.00	4,478,284,800	
小野測器	700	528.00	369,600	
エスベック	13,500	2,549.00	34,411,500	
キーエンス	150,800	62,120.00	9,367,696,000	

日置電機	7,900	6,940.00	54,826,000
シスメックス	390,300	2,943.50	1,148,848,050
日本マイクロニクス	24,800	3,910.00	96,968,000
メガチップス	11,500	5,850.00	67,275,000
OBARA GROUP	9,400	3,840.00	36,096,000
IMAGICA GROUP	15,200	533.00	8,101,600
澤藤電機	200	903.00	180,600
デンソー	1,477,000	2,142.00	3,163,734,000
原田工業	800	507.00	405,600
コーセル	16,100	1,035.00	16,663,500
イリソ電子工業	15,300	2,638.00	40,361,400
オブテックスグループ	27,600	1,626.00	44,877,600
千代田インテグレ	5,300	2,941.00	15,587,300
レーザーテック	69,100	14,925.00	1,031,317,500
スタンレー電気	94,400	2,577.50	243,316,000
ウシオ電機	66,700	2,044.00	136,334,800
岡谷電機産業	1,200	222.00	266,400
ヘリオス テクノ ホールディング	1,800	949.00	1,708,200
エノモト	500	1,423.00	711,500
日本セラミック	13,900	2,383.00	33,123,700
遠藤照明	800	1,420.00	1,136,000
古河電池	11,000	1,383.00	15,213,000
山一電機	12,300	2,351.00	28,917,300
図研	13,900	4,105.00	57,059,500
日本電子	34,800	5,655.00	196,794,000
カシオ計算機	120,500	1,249.00	150,504,500
ファナック	729,500	4,143.00	3,022,318,500
日本シイエムケイ	44,100	404.00	17,816,400
エンプラス	4,500	4,650.00	20,925,000
大真空	18,400	535.00	9,844,000
ローム	273,100	1,421.00	388,075,100
浜松ホトニクス	242,200	1,835.00	444,437,000
三井ハイテック	66,800	811.00	54,174,800
新光電気工業	53,200	5,865.00	312,018,000
京セラ	936,900	1,584.00	1,484,049,600
協栄産業	200	2,311.00	462,200
太陽誘電	66,100	2,250.00	148,725,000
村田製作所	1,327,900	2,497.50	3,316,430,250
双葉電子工業	28,600	476.00	13,613,600
日東電工	478,400	2,625.00	1,255,800,000
北陸電気工業	600	1,595.00	957,000
東海理化電機製作所	42,600	2,188.00	93,208,800
ニチコン	39,700	1,035.00	41,089,500
日本ケミコン	18,600	901.00	16,758,600
KOA	25,100	948.00	23,794,800
三井E&S	81,400	1,579.00	128,530,600
カナデビア	124,800	972.00	121,305,600
三菱重工業	2,663,000	2,100.00	5,592,300,000
川崎重工業	113,500	6,978.00	792,003,000
IHI	122,000	8,275.00	1,009,550,000

名村造船所	43,000	1,793.00	77,099,000
サノヤホールディングス	2,500	149.00	372,500
スプリックス	500	952.00	476,000
マネジメントソリューションズ	7,600	1,605.00	12,198,000
プロレド・パートナーズ	3,800	392.00	1,489,600
and factory	500	217.00	108,500
テノ・ホールディングス	200	442.00	88,400
フロンティア・マネジメント	4,700	745.00	3,501,500
ピアラ	300	244.00	73,200
コプロ・ホールディングス	600	1,671.00	1,002,600
ギークス	300	381.00	114,300
アンビスホールディングス	33,300	626.00	20,845,800
カーブスホールディングス	42,400	739.00	31,333,600
フォーラムエンジニアリング	18,000	1,016.00	18,288,000
FAST FITNESS JAPAN	5,400	1,279.00	6,906,600
Macbee Planet	4,400	2,965.00	13,046,000
日本車輛製造	5,800	2,065.00	11,977,000
三菱ロジスネクスト	24,000	1,918.00	46,032,000
近畿車輛	300	1,421.00	426,300
一家ホールディングス	500	660.00	330,000
フルサト・マルカホールディングス	12,900	2,292.00	29,566,800
ヤマエグループホールディングス	17,200	1,860.00	31,992,000
ジャパクラフトホールディングス	1,200	132.00	158,400
FPG	52,900	2,683.00	141,930,700
島根銀行	500	493.00	246,500
じもとホールディングス	1,500	304.00	456,000
全国保証	39,000	5,356.00	208,884,000
めぶきフィナンシャルグループ	745,500	630.20	469,814,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	24,100	1,139.00	27,449,900
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,000	4,480.00	85,120,000
九州フィナンシャルグループ	261,300	750.40	196,079,520
かんぽ生命保険	172,800	2,883.00	498,182,400
ゆうちょ銀行	1,223,800	1,489.00	1,822,238,200
あんしん保証	700	150.00	105,000
富山第一銀行	47,200	1,014.00	47,860,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	789,900	851.60	672,678,840
ジェイリース	11,000	1,233.00	13,563,000
西日本フィナンシャルホールディングス	91,400	1,929.00	176,310,600
イントラスト	600	800.00	480,000
日本モーゲージサービス	1,000	431.00	431,000
CASA	700	842.00	589,400
SBIアルヒ	15,200	803.00	12,205,600
プレミアグループ	25,100	2,492.00	62,549,200
日産自動車	1,884,400	439.90	828,947,560
いすゞ自動車	465,700	2,072.00	964,930,400
トヨタ自動車	8,014,800	2,907.50	23,303,031,000

日野自動車	226,800	506.30	114,828,840
三菱自動車工業	576,400	481.40	277,478,960
エフテック	1,200	542.00	650,400
レシップホールディングス	900	480.00	432,000
GMB	300	1,003.00	300,900
ファルテック	200	420.00	84,000
武蔵精密工業	36,900	3,825.00	141,142,500
日産車体	23,000	961.00	22,103,000
新明和工業	43,300	1,305.00	56,506,500
極東開発工業	20,300	2,406.00	48,841,800
トビー工業	12,200	1,974.00	24,082,800
ティラド	3,300	3,525.00	11,632,500
曙ブレーキ工業	92,000	108.00	9,936,000
タチエス	27,700	1,715.00	47,505,500
NOK	58,600	2,289.50	134,164,700
フタバ産業	45,400	691.00	31,371,400
カヤバ	25,800	2,856.00	73,684,800
市光工業	27,200	384.00	10,444,800
大同メタル工業	29,400	493.00	14,494,200
プレス工業	59,000	540.00	31,860,000
ミクニ	2,100	319.00	669,900
太平洋工業	34,500	1,299.00	44,815,500
河西工業	2,900	108.00	313,200
アイシン	319,300	1,687.50	538,818,750
マツダ	463,100	1,034.50	479,076,950
今仙電機製作所	1,000	557.00	557,000
本田技研工業	3,572,300	1,479.00	5,283,431,700
スズキ	1,218,500	1,760.50	2,145,169,250
SUBARU	454,600	2,662.50	1,210,372,500
安永	800	471.00	376,800
ヤマハ発動機	636,500	1,284.50	817,584,250
小糸製作所	156,200	1,976.50	308,729,300
TBK	2,000	272.00	544,000
エクセディ	24,600	4,425.00	108,855,000
ミツバ	28,400	894.00	25,389,600
豊田合成	43,100	2,635.00	113,568,500
愛三工業	28,600	1,672.00	47,819,200
盟和産業	200	1,229.00	245,800
日本プラスト	1,300	350.00	455,000
ヨロズ	15,600	1,105.00	17,238,000
エフ・シー・シー	26,400	3,135.00	82,764,000
新家工業	300	5,050.00	1,515,000
シマノ	65,600	20,900.00	1,371,040,000
テイ・エス テック	61,300	1,742.00	106,784,600
三十三フィナンシャルグループ	13,400	2,235.00	29,949,000
第四北越フィナンシャルグループ	46,700	2,806.00	131,040,200
ひろぎんホールディングス	209,000	1,120.50	234,184,500
マーキュリアホールディングス	700	747.00	522,900
おきなわフィナンシャルグループ	11,600	2,460.00	28,536,000
ダイレクトマーケティングミックス	18,700	256.00	4,787,200

ポピンズ	2,800	1,161.00	3,250,800
LITALICO	14,200	818.00	11,615,600
コンフィデンス・インターワークス	300	1,552.00	465,600
十六フィナンシャルグループ	20,700	4,130.00	85,491,000
北國フィナンシャルホールディングス	14,500	5,050.00	73,225,000
ネットプロテクションズホールディングス	49,500	481.00	23,809,500
プロクレアホールディングス	16,900	1,688.00	28,527,200
FPパートナー	6,500	2,142.00	13,923,000
あいちフィナンシャルグループ	27,600	2,460.00	67,896,000
ジャムコ	9,100	1,408.00	12,812,800
小野建	17,500	1,476.00	25,830,000
はるやまホールディングス	800	608.00	486,400
南陽	700	1,131.00	791,700
ノジマ	52,100	2,190.00	114,099,000
佐島電機	11,100	1,723.00	19,125,300
カップ・クリエイト	25,100	1,436.00	36,043,600
エコートレーディング	400	842.00	336,800
伯東	9,100	4,285.00	38,993,500
コンドーテック	12,200	1,323.00	16,140,600
中山福	1,000	362.00	362,000
ライトオン	1,300	225.00	292,500
ナガイレベーン	20,100	2,036.00	40,923,600
三菱食品	14,700	4,660.00	68,502,000
良品計画	189,900	3,700.00	702,630,000
パリミキホールディングス	2,500	294.00	735,000
松田産業	12,100	3,010.00	36,421,000
第一興商	61,800	1,761.00	108,829,800
メディカルホールディングス	173,000	2,313.50	400,235,500
アドヴァングループ	13,700	974.00	13,343,800
SPK	6,500	2,045.00	13,292,500
萩原電気ホールディングス	6,900	3,355.00	23,149,500
アルビス	5,300	2,581.00	13,679,300
アズワン	49,500	2,350.00	116,325,000
スズデン	6,800	1,876.00	12,756,800
尾家産業	400	2,030.00	812,000
シモジマ	10,600	1,283.00	13,599,800
ドウシシャ	14,700	2,066.00	30,370,200
小津産業	400	1,700.00	680,000
コナカ	2,200	228.00	501,600
高速	9,500	2,343.00	22,258,500
ハウスオブローゼ	200	1,464.00	292,800
G-7ホールディングス	17,400	1,370.00	23,838,000
たけびし	6,800	1,910.00	12,988,000
イオン北海道	39,400	859.00	33,844,600
コジマ	30,800	1,000.00	30,800,000
ヒマラヤ	600	856.00	513,600
コーナン商事	17,500	3,465.00	60,637,500
エコス	6,000	2,003.00	12,018,000
ワタミ	19,200	921.00	17,683,200

マルシェ	700	199.00	139,300	
リックス	3,600	2,821.00	10,155,600	
システムソフト	52,300	53.00	2,771,900	
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	322,300	4,121.00	1,328,198,300	
丸文	14,300	1,071.00	15,315,300	
西松屋チェーン	35,300	2,194.00	77,448,200	
ゼンショーホールディングス	90,600	8,412.00	762,127,200	
ハビネット	12,200	4,610.00	56,242,000	
幸楽苑	11,800	1,009.00	11,906,200	
ハークスレイ	600	678.00	406,800	
橋本総業ホールディングス	6,300	1,206.00	7,597,800	
日本ライフライン	42,800	1,382.00	59,149,600	
サイゼリヤ	23,700	4,775.00	113,167,500	
タカショー	13,000	464.00	6,032,000	
V Tホールディングス	62,000	499.00	30,938,000	
アルゴグラフィックス	14,000	4,545.00	63,630,000	
魚力	5,600	2,394.00	13,406,400	
I D O M	54,100	1,159.00	62,701,900	
日本エム・ディ・エム	11,900	595.00	7,080,500	
ポブラ	500	208.00	104,000	
フジ・コーポレーション	7,300	1,930.00	14,089,000	
ユナイテッドアローズ	17,000	2,690.00	45,730,000	
進和	9,700	2,741.00	26,587,700	
エスケイジャパン	400	788.00	315,200	
ダイトロン	6,900	2,640.00	18,216,000	
ハイデイ日高	25,800	2,550.00	65,790,000	
シークス	22,900	1,146.00	26,243,400	
京都きもの友禅ホールディングス	900	81.00	72,900	
コロワイド	90,100	1,627.00	146,592,700	
田中商事	500	693.00	346,500	
オーハシテクニカ	7,600	1,907.00	14,493,200	
壱番屋	62,900	956.00	60,132,400	
白銅	4,700	2,344.00	11,016,800	
トップカルチャー	600	133.00	79,800	
P L A N T	400	1,708.00	683,200	
スギホールディングス	85,700	2,496.50	213,950,050	
ダイコー通産	200	1,359.00	271,800	
薬王堂ホールディングス	7,800	1,893.00	14,765,400	
島津製作所	217,000	4,285.00	929,845,000	
J M S	13,900	424.00	5,893,600	
クボテック	400	205.00	82,000	
長野計器	9,800	2,202.00	21,579,600	
ブイ・テクノロジ	7,300	2,340.00	17,082,000	
スター精密	25,600	1,871.00	47,897,600	
東京計器	10,500	2,933.00	30,796,500	
愛知時計電機	7,200	1,905.00	13,716,000	
インターアクション	9,100	1,071.00	9,746,100	
オーバル	1,500	364.00	546,000	
東京精密	31,000	7,106.00	220,286,000	

マニー	60,300	1,508.00	90,932,400
ニコン	237,700	1,664.00	395,532,800
トプコン	85,600	2,723.50	233,131,600
オリンパス	863,200	2,344.00	2,023,340,800
理研計器	21,400	3,290.00	70,406,000
S C R E E Nホールディングス	62,900	10,080.00	634,032,000
キヤノン電子	14,300	2,369.00	33,876,700
タムロン	20,700	4,160.00	86,112,000
H O Y A	294,500	20,260.00	5,966,570,000
シード	1,300	509.00	661,700
ノーリツ鋼機	14,300	4,815.00	68,854,500
A & Dホロンホールディングス	18,800	1,834.00	34,479,200
朝日インテック	183,900	2,508.00	461,221,200
キヤノン	752,100	4,945.00	3,719,134,500
リコー	397,100	1,669.00	662,759,900
シチズン時計	138,600	904.00	125,294,400
リズム	300	4,050.00	1,215,000
大研医器	1,300	511.00	664,300
メニコン	56,300	1,332.00	74,991,600
シンシア	100	475.00	47,500
K Y O R I T S U	2,400	163.00	391,200
中本パックス	500	1,765.00	882,500
パラマウントベッドホールディングス	32,500	2,602.00	84,565,000
トランザクション	9,900	1,988.00	19,681,200
粧美堂	400	528.00	211,200
ニホンフラッシュ	12,900	800.00	10,320,000
前田工織	26,800	1,843.00	49,392,400
永大産業	2,000	212.00	424,000
アートネイチャー	15,600	800.00	12,480,000
フルヤ金属	14,300	3,315.00	47,404,500
バンダイナムコホールディングス	409,300	3,498.00	1,431,731,400
アイフィスジャパン	500	533.00	266,500
S H O E I	42,500	2,131.00	90,567,500
フランスベッドホールディングス	21,800	1,252.00	27,293,600
マーベラス	27,900	570.00	15,903,000
パイロットコーポレーション	23,100	4,444.00	102,656,400
萩原工業	10,000	1,485.00	14,850,000
エイベックス	28,400	1,407.00	39,958,800
フジシールインターナショナル	33,900	2,387.00	80,919,300
タカラトミー	63,200	4,355.00	275,236,000
広済堂ホールディングス	56,900	482.00	27,425,800
エステールホールディングス	400	615.00	246,000
レック	19,300	1,178.00	22,735,400
タカノ	600	710.00	426,000
三光合成	19,000	660.00	12,540,000
プロネクサス	15,700	1,281.00	20,111,700
ホクシン	900	101.00	90,900
ウッドワン	600	850.00	510,000
きもと	2,700	284.00	766,800
T O P P A Nホールディングス	197,500	4,224.00	834,240,000

大日本印刷	312,600	2,211.50	691,314,900
共同印刷	4,400	3,980.00	17,512,000
N I S S H A	25,800	1,597.00	41,202,600
光村印刷	100	1,392.00	139,200
Z A C R O S	11,900	3,970.00	47,243,000
ヴィア・ホールディングス	3,500	132.00	462,000
T A K A R A & C O M P A N Y	8,900	2,799.00	24,911,100
前澤化成工業	10,600	1,660.00	17,596,000
未来工業	5,500	3,605.00	19,827,500
アシックス	556,700	3,224.00	1,794,800,800
ツツミ	3,500	2,385.00	8,347,500
ウェーブロックホールディングス	600	705.00	423,000
J S P	12,400	2,054.00	25,469,600
ニチハ	18,900	2,818.00	53,260,200
ローランド	11,000	3,685.00	40,535,000
エフピコ	33,300	2,700.00	89,910,000
小松ウオール工業	11,000	1,512.00	16,632,000
ヤマハ	275,700	1,066.50	294,034,050
河合楽器製作所	4,700	2,930.00	13,771,000
クリナップ	14,700	637.00	9,363,900
ビジョン	96,000	1,400.50	134,448,000
天馬	12,500	2,774.00	34,675,000
キングジム	13,500	846.00	11,421,000
象印マホービン	44,900	1,612.00	72,378,800
リンテック	28,600	2,976.00	85,113,600
信越ポリマー	32,700	1,600.00	52,320,000
東リ	4,500	452.00	2,034,000
イトーキ	30,200	1,546.00	46,689,200
任天堂	952,000	9,332.00	8,884,064,000
三菱鉛筆	20,800	2,208.00	45,926,400
松風	15,200	2,137.00	32,482,400
タカラスタANDARD	34,600	1,635.00	56,571,000
コクヨ	75,400	2,612.50	196,982,500
ナカバヤシ	16,300	507.00	8,264,100
ニフコ	56,600	3,698.00	209,306,800
立川ブラインド工業	7,000	1,432.00	10,024,000
グローブライド	14,800	1,874.00	27,735,200
オカムラ	45,300	1,947.00	88,199,100
バルカー	11,500	3,310.00	38,065,000
M U T O H ホールディングス	200	2,843.00	568,600
伊藤忠商事	1,072,300	7,354.00	7,885,694,200
丸紅	1,310,800	2,245.50	2,943,401,400
スクロール	23,800	1,036.00	24,656,800
高島	1,200	1,258.00	1,509,600
ヨンドシーホールディングス	15,100	1,863.00	28,131,300
三陽商会	7,800	3,020.00	23,556,000
長瀬産業	71,200	2,923.50	208,153,200
ナイガイ	500	235.00	117,500
蝶理	8,600	3,535.00	30,401,000
豊田通商	479,300	2,655.00	1,272,541,500



オンワードホールディングス	98,000	596.00	58,408,000
三共生興	20,700	601.00	12,440,700
兼松	66,700	2,498.50	166,649,950
美津濃	14,900	8,650.00	128,885,000
ツカモトコーポレーション	200	1,102.00	220,400
ルックホールディングス	4,800	2,181.00	10,468,800
三井物産	2,343,600	3,042.00	7,129,231,200
日本紙パルプ商事	76,300	639.00	48,755,700
東京エレクトロン	319,100	26,020.00	8,302,982,000
カメイ	16,900	1,704.00	28,797,600
東都水産	100	5,810.00	581,000
OUGホールディングス	300	2,670.00	801,000
スターゼン	10,900	2,787.00	30,378,300
セイコーグループ	23,400	4,710.00	110,214,000
山善	53,600	1,327.00	71,127,200
椿本興業	8,800	1,946.00	17,124,800
住友商事	956,000	3,245.00	3,102,220,000
BIPROGY	51,100	4,439.00	226,832,900
内田洋行	6,500	6,570.00	42,705,000
三菱商事	2,948,000	2,508.00	7,393,584,000
第一実業	15,100	2,680.00	40,468,000
キヤノンマーケティングジャパン	31,400	4,830.00	151,662,000
西華産業	7,600	4,345.00	33,022,000
佐藤商事	11,100	1,404.00	15,584,400
東京産業	16,200	706.00	11,437,200
ユアサ商事	13,800	4,200.00	57,960,000
神鋼商事	3,400	5,960.00	20,264,000
トルク	1,200	224.00	268,800
阪和興業	26,200	4,735.00	124,057,000
正栄食品工業	10,500	3,860.00	40,530,000
カナデン	12,000	1,449.00	17,388,000
RYODEN	13,000	2,356.00	30,628,000
ニプロ	125,700	1,460.50	183,584,850
岩谷産業	158,500	1,777.00	281,654,500
ナイス	500	1,560.00	780,000
ニチモウ	500	1,951.00	975,500
極東貿易	9,500	1,513.00	14,373,500
アステナホールディングス	30,100	452.00	13,605,200
三愛オブリ	37,100	1,808.00	67,076,800
稲畑産業	43,100	3,165.00	136,411,500
G S Iクレオス	8,600	2,112.00	18,163,200
明和産業	23,600	638.00	15,056,800
クワザワホールディングス	600	664.00	398,400
キムラタン	10,800	28.00	302,400
ゴールドウイン	26,700	8,350.00	222,945,000
ユニ・チャーム	944,800	1,220.50	1,153,128,400
キング	600	723.00	433,800
ワキタ	23,600	1,745.00	41,182,000
ヤマトインターナショナル	1,300	332.00	431,600
東邦ホールディングス	43,000	4,155.00	178,665,000

サンゲツ	40,100	2,857.00	114,565,700
ミツウロコグループホールディングス	20,300	1,649.00	33,474,700
シナネンホールディングス	4,500	6,120.00	27,540,000
伊藤忠エネクス	39,600	1,576.00	62,409,600
サンリオ	129,500	5,332.00	690,494,000
サンワテクノス	7,200	2,279.00	16,408,800
新光商事	21,500	1,029.00	22,123,500
トーヨー	6,800	2,793.00	18,992,400
三信電気	6,500	1,910.00	12,415,000
東陽テクニカ	14,700	1,414.00	20,785,800
モスフードサービス	23,500	3,500.00	82,250,000
加賀電子	32,500	2,686.00	87,295,000
都築電気	9,100	2,870.00	26,117,000
ソーダニッカ	15,600	1,088.00	16,972,800
立花エレテック	9,500	2,522.00	23,959,000
木曾路	24,100	2,064.00	49,742,400
SRSホールディングス	26,300	1,132.00	29,771,600
千趣会	32,300	248.00	8,010,400
リテールパートナーズ	23,700	1,219.00	28,890,300
上新電機	15,800	2,256.00	35,644,800
日本瓦斯	76,300	2,132.00	162,671,600
ロイヤルホールディングス	28,000	2,262.00	63,336,000
東天紅	100	880.00	88,000
チヨダ	15,300	1,235.00	18,895,500
ライフコーポレーション	16,700	3,400.00	56,780,000
リンガーハット	20,500	2,225.00	45,612,500
MrMaxHD	20,000	673.00	13,460,000
テンアライド	2,700	276.00	745,200
AOKIホールディングス	34,100	1,263.00	43,068,300
オークワ	25,500	817.00	20,833,500
コメリ	21,500	3,110.00	66,865,000
青山商事	34,000	2,126.00	72,284,000
しまむら	37,300	8,520.00	317,796,000
はせがわ	900	310.00	279,000
高島屋	221,600	1,226.00	271,681,600
松屋	27,000	980.00	26,460,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	77,600	2,202.00	170,875,200
近鉄百貨店	9,100	2,168.00	19,728,800
丸井グループ	106,000	2,477.50	262,615,000
クレディセゾン	94,000	3,549.00	333,606,000
アクシアル リテイリング	43,500	871.00	37,888,500
井筒屋	700	415.00	290,500
イオン	590,000	3,590.00	2,118,100,000
イズミ	24,200	3,063.00	74,124,600
フォーバル	6,300	1,290.00	8,127,000
平和堂	26,600	2,268.00	60,328,800
フジ	29,300	2,009.00	58,863,700
ヤオコー	18,900	9,014.00	170,364,600
ゼビオホールディングス	21,800	1,118.00	24,372,400
ケーズホールディングス	107,200	1,402.50	150,348,000

PAL TAC	24,800	4,200.00	104,160,000
三谷産業	27,800	316.00	8,784,800
Olympicグループ	700	459.00	321,300
日産東京販売ホールディングス	2,600	498.00	1,294,800
あおぞら銀行	102,400	2,330.50	238,643,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,524,400	1,859.50	17,710,621,800
りそなホールディングス	1,833,900	1,107.00	2,030,127,300
三井住友トラストグループ	528,600	3,600.00	1,902,960,000
三井住友フィナンシャルグループ	3,097,700	3,712.00	11,498,662,400
千葉銀行	459,800	1,198.50	551,070,300
群馬銀行	257,900	1,016.00	262,026,400
武蔵野銀行	22,700	2,956.00	67,101,200
千葉興業銀行	35,100	1,535.00	53,878,500
筑波銀行	65,200	234.00	15,256,800
七十七銀行	47,600	4,321.00	205,679,600
秋田銀行	9,900	2,151.00	21,294,900
山形銀行	16,500	973.00	16,054,500
岩手銀行	9,400	2,741.00	25,765,400
東邦銀行	127,900	286.00	36,579,400
東北銀行	800	1,138.00	910,400
ふくおかフィナンシャルグループ	129,200	3,920.00	506,464,000
スルガ銀行	100,000	1,086.00	108,600,000
八十二銀行	347,500	967.70	336,275,750
山梨中央銀行	16,600	1,922.00	31,905,200
大垣共立銀行	28,200	1,855.00	52,311,000
福井銀行	13,400	1,789.00	23,972,600
清水銀行	5,900	1,412.00	8,330,800
富山銀行	200	1,558.00	311,600
滋賀銀行	22,600	3,850.00	87,010,000
南都銀行	22,500	3,130.00	70,425,000
百五銀行	139,800	619.00	86,536,200
紀陽銀行	53,000	2,125.00	112,625,000
ほくほくフィナンシャルグループ	83,500	1,895.00	158,232,500
山陰合同銀行	93,000	1,217.00	113,181,000
鳥取銀行	600	1,243.00	745,800
百十四銀行	14,500	3,205.00	46,472,500
四国銀行	22,000	1,133.00	24,926,000
阿波銀行	20,700	2,633.00	54,503,100
大分銀行	9,000	3,025.00	27,225,000
宮崎銀行	9,700	3,015.00	29,245,500
佐賀銀行	8,700	2,148.00	18,687,600
琉球銀行	34,000	1,029.00	34,986,000
セブン銀行	531,900	305.00	162,229,500
みずほフィナンシャルグループ	2,004,200	3,843.00	7,702,140,600
高知銀行	500	777.00	388,500
山口フィナンシャルグループ	145,600	1,590.00	231,504,000
芙蓉総合リース	13,800	11,225.00	154,905,000
みずほリース	111,500	1,008.00	112,392,000
東京センチュリー	110,900	1,460.00	161,914,000
SBIホールディングス	238,900	3,878.00	926,454,200

日本証券金融	54,400	2,022.00	109,996,800
アイフル	245,900	312.00	76,720,800
日本アジア投資	1,100	207.00	227,700
名古屋銀行	9,300	6,460.00	60,078,000
北洋銀行	202,500	433.00	87,682,500
大光銀行	500	1,413.00	706,500
愛媛銀行	21,900	1,092.00	23,914,800
トマト銀行	600	1,212.00	727,200
京葉銀行	66,700	755.00	50,358,500
栃木銀行	67,900	268.00	18,197,200
北日本銀行	5,300	2,769.00	14,675,700
東和銀行	27,200	619.00	16,836,800
福島銀行	1,600	220.00	352,000
大東銀行	700	726.00	508,200
リコーリース	14,200	5,040.00	71,568,000
イオンフィナンシャルサービス	85,300	1,217.00	103,810,100
アコム	353,300	365.60	129,166,480
ジャックス	17,700	3,720.00	65,844,000
オリエントコーポレーション	48,600	804.00	39,074,400
オリックス	890,400	3,203.00	2,851,951,200
三菱HCキャピタル	744,400	1,006.00	748,866,400
ジャフコグループ	44,100	2,101.50	92,676,150
九州リースサービス	600	1,020.00	612,000
トモニホールディングス	141,900	428.00	60,733,200
大和証券グループ本社	1,061,900	1,007.00	1,069,333,300
野村ホールディングス	2,497,100	892.00	2,227,413,200
岡三証券グループ	117,400	596.00	69,970,400
丸三証券	49,500	964.00	47,718,000
東洋証券	44,200	543.00	24,000,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	176,300	478.00	84,271,400
光世証券	400	415.00	166,000
水戸証券	40,800	538.00	21,950,400
いちよし証券	30,100	878.00	26,427,800
松井証券	102,300	801.00	81,942,300
SOMPOホールディングス	726,100	4,080.00	2,962,488,000
日本取引所グループ	883,300	1,685.50	1,488,802,150
マネックスグループ	145,400	882.00	128,242,800
極東証券	18,500	1,419.00	26,251,500
岩井コスモホールディングス	16,900	2,178.00	36,808,200
アイザワ証券グループ	21,500	1,647.00	35,410,500
フィデアホールディングス	15,400	1,411.00	21,729,400
池田泉州ホールディングス	205,900	386.00	79,477,400
アニコムホールディングス	50,400	645.00	32,508,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1,088,400	3,218.00	3,502,471,200
スパークス・グループ	16,500	1,440.00	23,760,000
小林洋行	600	287.00	172,200
第一生命ホールディングス	698,500	4,077.00	2,847,784,500
東京海上ホールディングス	1,449,700	5,248.00	7,608,025,600

アドバンテッジリスクマネジメント	800	545.00	436,000	
イー・ギャランティ	24,200	1,693.00	40,970,600	
アサックス	600	712.00	427,200	
NECキャピタルソリューション	7,300	3,760.00	27,448,000	
T&Dホールディングス	398,700	2,773.00	1,105,595,100	
アドバンスクリエイト	11,500	512.00	5,888,000	
三井不動産	2,039,000	1,231.00	2,510,009,000	
三菱地所	846,200	2,111.00	1,786,328,200	
平和不動産	24,100	4,465.00	107,606,500	
東京建物	129,600	2,487.00	322,315,200	
京阪神ビルディング	24,900	1,540.00	38,346,000	
住友不動産	241,800	4,749.00	1,148,308,200	
太平洋興発	700	727.00	508,900	
テオーシー	26,400	701.00	18,506,400	
レオパレス21	129,900	542.00	70,405,800	
スターツコーポレーション	24,300	3,570.00	86,751,000	
フジ住宅	18,700	740.00	13,838,000	
空港施設	20,800	573.00	11,918,400	
明和地所	11,900	992.00	11,804,800	
ゴールドクレスト	10,100	2,863.00	28,916,300	
リログループ	86,300	1,845.50	159,266,650	
エスリード	7,000	4,435.00	31,045,000	
日神グループホールディングス	23,800	514.00	12,233,200	
日本エスコン	39,000	967.00	37,713,000	
MIRARTHホールディングス	86,900	513.00	44,579,700	
AVANTIA	900	793.00	713,700	
イオンモール	89,900	1,919.00	172,518,100	
毎日コムネット	600	715.00	429,000	
ファースト住建	600	996.00	597,600	
ランド	931,700	8.00	7,453,600	
カチタス	40,000	2,148.00	85,920,000	
東祥	13,100	606.00	7,938,600	
トーセイ	24,700	2,360.00	58,292,000	
穴吹興産	400	2,001.00	800,400	
サンフロンティア不動産	24,700	1,858.00	45,892,600	
FJネクストホールディングス	15,700	1,158.00	18,180,600	
インテリックス	400	864.00	345,600	
ランドビジネス	700	191.00	133,700	
サンネクスタグループ	500	1,018.00	509,000	
グランディハウス	14,000	570.00	7,980,000	
東武鉄道	158,900	2,522.50	400,825,250	
相鉄ホールディングス	49,800	2,464.50	122,732,100	
東急	422,900	1,682.50	711,529,250	
京浜急行電鉄	186,500	1,251.00	233,311,500	
小田急電鉄	249,300	1,398.00	348,521,400	
京王電鉄	79,700	3,649.00	290,825,300	
京成電鉄	262,300	1,418.50	372,072,550	
富士急行	18,600	2,105.00	39,153,000	
東日本旅客鉄道	831,400	2,674.50	2,223,579,300	
西日本旅客鉄道	371,800	2,676.50	995,122,700	

東海旅客鉄道	580,800	2,791.50	1,621,303,200	
東京地下鉄	251,900	1,666.50	419,791,350	
西武ホールディングス	164,100	3,201.00	525,284,100	
鴻池運輸	25,700	2,941.00	75,583,700	
西日本鉄道	43,500	2,158.00	93,873,000	
ハマキョウレックス	51,500	1,292.00	66,538,000	
サカイ引越センター	19,100	2,361.00	45,095,100	
近鉄グループホールディングス	161,200	3,189.00	514,066,800	
阪急阪神ホールディングス	199,700	3,895.00	777,831,500	
南海電気鉄道	67,100	2,392.00	160,503,200	
京阪ホールディングス	83,000	3,151.00	261,533,000	
神戸電鉄	4,000	2,293.00	9,172,000	
名古屋鉄道	166,500	1,667.50	277,638,750	
山陽電気鉄道	11,300	1,983.00	22,407,900	
ヤマトホールディングス	183,000	1,751.00	320,433,000	
山九	36,300	5,344.00	193,987,200	
日新	10,200	4,350.00	44,370,000	
丸運	900	421.00	378,900	
丸全昭和運輸	9,300	5,620.00	52,266,000	
センコーグループホールディングス	88,500	1,436.00	127,086,000	
トナミホールディングス	3,300	5,820.00	19,206,000	
ニッコンホールディングス	85,600	2,011.50	172,184,400	
日本石油輸送	200	2,828.00	565,600	
福山通運	16,100	3,580.00	57,638,000	
セイノーホールディングス	74,100	2,307.00	170,948,700	
神奈川中央交通	4,400	3,660.00	16,104,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	46,800	1,052.00	49,233,600	
日本郵船	311,900	4,915.00	1,532,988,500	
商船三井	286,200	5,263.00	1,506,270,600	
川崎汽船	342,500	2,049.50	701,953,750	
NSユナイテッド海運	9,500	3,920.00	37,240,000	
明海グループ	1,900	642.00	1,219,800	
飯野海運	55,400	1,131.00	62,657,400	
共栄タンカー	300	1,045.00	313,500	
九州旅客鉄道	115,400	3,688.00	425,595,200	
SGホールディングス	252,700	1,474.50	372,606,150	
NIPPON EXPRESSホールディングス	161,400	2,438.50	393,573,900	
ID&Eホールディングス	9,100	6,470.00	58,877,000	
日本航空	345,100	2,430.00	838,593,000	
ANAホールディングス	409,500	2,787.00	1,141,276,500	
ビーウィズ	3,100	1,446.00	4,482,600	
サンウェルズ	6,000	607.00	3,642,000	
TREホールディングス	35,600	1,456.00	51,833,600	
人・夢・技術グループ	6,400	1,443.00	9,235,200	
シルバーライフ	4,500	689.00	3,100,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,345.00	234,500	
Genky Drug Stores	14,100	2,985.00	42,088,500	
コア商事ホールディングス	11,600	599.00	6,948,400	
KPPグループホールディングス	33,100	626.00	20,720,600	

ナルミヤ・インターナショナル	300	1,322.00	396,600	
ブックオフグループホールディングス	11,500	1,390.00	15,985,000	
ギフトホールディングス	7,800	3,140.00	24,492,000	
三菱倉庫	153,200	1,094.00	167,600,800	
三井倉庫ホールディングス	15,500	7,190.00	111,445,000	
住友倉庫	44,600	2,645.00	117,967,000	
澁澤倉庫	6,900	3,005.00	20,734,500	
ヤマタネ	6,400	3,505.00	22,432,000	
東陽倉庫	400	1,409.00	563,600	
乾汽船	19,100	1,697.00	32,412,700	
日本トランスシティ	30,400	975.00	29,640,000	
ケイヒン	300	2,025.00	607,500	
中央倉庫	8,900	1,425.00	12,682,500	
川西倉庫	300	1,083.00	324,900	
安田倉庫	10,200	1,732.00	17,666,400	
ファイズホールディングス	300	949.00	284,700	
N I S S Oホールディングス	13,500	762.00	10,287,000	
大栄環境	33,700	2,815.00	94,865,500	
G E N O V A	5,300	1,325.00	7,022,500	
日本管財ホールディングス	16,200	2,572.00	41,666,400	
東洋埠頭	500	1,254.00	627,000	
上組	69,500	3,372.00	234,354,000	
サンリツ	400	791.00	316,400	
キムラユニティー	800	1,462.00	1,169,600	
キューソー流通システム	10,000	2,025.00	20,250,000	
東海運	900	334.00	300,600	
エーアイテイー	9,400	1,677.00	15,763,800	
内外トランスライン	6,100	2,535.00	15,463,500	
ショーエイコーポレーション	500	573.00	286,500	
日本コンセプト	5,500	1,801.00	9,905,500	
T B Sホールディングス	74,600	3,623.00	270,275,800	
日本テレビホールディングス	133,900	2,533.00	339,168,700	
朝日放送グループホールディングス	14,200	612.00	8,690,400	
テレビ朝日ホールディングス	36,600	2,112.00	77,299,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	117,500	894.00	105,045,000	
テレビ東京ホールディングス	9,300	3,025.00	28,132,500	
日本BS放送	600	905.00	543,000	
ビジョン	22,800	1,159.00	26,425,200	
スマートバリュー	500	325.00	162,500	
U - N E X T H O L D I N G S	50,700	1,629.00	82,590,300	
ワイヤレスゲート	800	238.00	190,400	
日本通信	121,500	121.00	14,701,500	
クロップス	200	1,024.00	204,800	
日本電信電話	44,979,400	154.20	6,935,823,480	
K D D I	1,112,100	4,807.00	5,345,864,700	
ソフトバンク	24,194,300	192.50	4,657,402,750	
光通信	17,400	33,680.00	586,032,000	
エムティーアイ	10,300	1,033.00	10,639,900	
G M Oインターネットグループ	49,300	2,605.50	128,451,150	
ファイバーゲート	8,000	871.00	6,968,000	

アйдママーケティングコミュニケーション	500	234.00	117,000	
KADOKAWA	79,900	3,131.00	250,166,900	
学研ホールディングス	27,600	998.00	27,544,800	
ゼンリン	25,800	822.00	21,207,600	
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	145.00	232,000	
東京電力ホールディングス	1,268,500	422.40	535,814,400	
中部電力	555,700	1,578.50	877,172,450	
関西電力	735,400	1,659.50	1,220,396,300	
中国電力	261,900	834.70	218,607,930	
北陸電力	154,100	792.00	122,047,200	
東北電力	396,900	1,089.00	432,224,100	
四国電力	140,500	1,168.50	164,174,250	
九州電力	347,500	1,315.00	456,962,500	
北海道電力	157,800	761.00	120,085,800	
沖縄電力	38,700	898.00	34,752,600	
電源開発	113,400	2,430.00	275,562,000	
エフオン	11,100	353.00	3,918,300	
イーレックス	29,300	719.00	21,066,700	
レノバ	41,200	679.00	27,974,800	
東京瓦斯	285,100	4,170.00	1,188,867,000	
大阪瓦斯	296,200	3,212.00	951,394,400	
東邦瓦斯	59,400	3,972.00	235,936,800	
北海道瓦斯	44,900	548.00	24,605,200	
広島ガス	32,100	366.00	11,748,600	
西部ガスホールディングス	15,700	1,671.00	26,234,700	
静岡ガス	34,300	1,001.00	34,334,300	
メタウォーター	20,500	1,777.00	36,428,500	
M&A総研ホールディングス	16,700	1,931.00	32,247,700	
アイネット	9,200	1,524.00	14,020,800	
松竹	8,700	11,410.00	99,267,000	
東宝	94,600	6,051.00	572,424,600	
エイチ・アイ・エス	49,600	1,339.00	66,414,400	
東映	24,900	5,320.00	132,468,000	
ラックランド	6,500	1,743.00	11,329,500	
NTTデータグループ	395,400	2,967.00	1,173,151,800	
共立メンテナンス	48,800	2,800.00	136,640,000	
イチネンホールディングス	15,100	1,783.00	26,923,300	
建設技術研究所	15,900	2,510.00	39,909,000	
スペース	11,200	1,070.00	11,984,000	
アインホールディングス	22,100	4,265.00	94,256,500	
燦ホールディングス	13,100	1,053.00	13,794,300	
ピー・シー・エー	9,900	1,969.00	19,493,100	
スバル興業	6,000	3,145.00	18,870,000	
東京テアトル	600	1,073.00	643,800	
タナベコンサルティンググループ	6,700	1,153.00	7,725,100	
ビジネスブレイン太田昭和	6,500	2,092.00	13,598,000	
ナガワ	4,100	6,300.00	25,830,000	
東京都競馬	11,300	4,350.00	49,155,000	



カナモト	24,000	3,130.00	75,120,000	
D T S	27,300	4,060.00	110,838,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	76,000	6,160.00	468,160,000	
シーイーシー	19,100	1,818.00	34,723,800	
カブコン	300,600	3,292.00	989,575,200	
ニシオホールディングス	13,000	4,230.00	54,990,000	
アイ・エス・ビー	7,100	1,306.00	9,272,600	
アゴラ ホスピタリティグループ	11,000	49.00	539,000	
日本空港ビルデング	52,500	4,678.00	245,595,000	
トランス・コスモス	19,700	3,150.00	62,055,000	
乃村工藝社	67,600	907.00	61,313,200	
S C S K	123,600	3,149.00	389,216,400	
藤田観光	6,900	7,510.00	51,819,000	
K N T - C Tホールディングス	9,200	1,127.00	10,368,400	
トーカイ	13,800	2,090.00	28,842,000	
白洋舎	300	2,210.00	663,000	
セコム	315,700	5,143.00	1,623,645,100	
N S W	6,700	2,852.00	19,108,400	
セントラル警備保障	8,400	2,748.00	23,083,200	
アイネス	11,800	1,795.00	21,181,000	
丹青社	32,900	882.00	29,017,800	
メイテックグループホールディングス	57,200	2,894.50	165,565,400	
T K C	26,900	3,625.00	97,512,500	
富士ソフト	41,900	9,725.00	407,477,500	
応用地質	14,400	2,385.00	34,344,000	
船井総研ホールディングス	31,100	2,313.00	71,934,300	
N S D	58,200	3,233.00	188,160,600	
進学会ホールディングス	600	196.00	117,600	
丸紅建材リース	200	3,005.00	601,000	
オオバ	1,100	1,003.00	1,103,300	
コナミグループ	56,700	14,105.00	799,753,500	
いであ	400	2,265.00	906,000	
学究社	6,200	2,043.00	12,666,600	
イオンディライト	16,600	4,235.00	70,301,000	
ナック	15,800	584.00	9,227,200	
福井コンピュータホールディングス	10,500	2,827.00	29,683,500	
ダイセキ	37,300	3,660.00	136,518,000	
ステップ	5,700	2,100.00	11,970,000	
泉州電業	10,900	4,800.00	52,320,000	
GENKI GLOBAL DINI NG CONCEPTS	9,000	3,315.00	29,835,000	
トラスコ中山	33,500	2,101.00	70,383,500	
ヤマダホールディングス	490,400	440.00	215,776,000	
オートバックスセブン	55,600	1,442.00	80,175,200	
モリト	12,600	1,470.00	18,522,000	
アーケランズ	47,500	1,685.00	80,037,500	
ニトリホールディングス	58,100	18,105.00	1,051,900,500	
グルメ杵屋	13,100	1,021.00	13,375,100	

愛眼	1,300	142.00	184,600
ケーユーホールディングス	9,300	1,081.00	10,053,300
吉野家ホールディングス	62,300	2,872.00	178,925,600
加藤産業	19,700	4,215.00	83,035,500
北恵	400	768.00	307,200
イノテック	10,800	1,345.00	14,526,000
イエローハット	28,000	2,574.00	72,072,000
松屋フーズホールディングス	7,500	6,050.00	45,375,000
JBC Cホールディングス	10,000	4,255.00	42,550,000
J Kホールディングス	12,200	981.00	11,968,200
サガミホールディングス	25,600	1,701.00	43,545,600
日伝	9,100	2,781.00	25,307,100
ミロク情報サービス	13,800	1,846.00	25,474,800
北沢産業	1,100	351.00	386,100
杉本商事	14,200	1,274.00	18,090,800
因幡電機産業	44,400	3,673.00	163,081,200
王将フードサービス	31,600	2,931.00	92,619,600
ミニストップ	13,400	1,614.00	21,627,600
アークス	26,800	2,636.00	70,644,800
パローホールディングス	30,500	2,093.00	63,836,500
東テク	16,000	2,505.00	40,080,000
ミスミグループ本社	240,900	2,310.00	556,479,000
アルテック	900	211.00	189,900
ベルク	7,900	6,270.00	49,533,000
大 庄	9,600	1,082.00	10,387,200
タキヒヨー	500	1,520.00	760,000
ファーストリテイリング	89,700	47,720.00	4,280,484,000
ソフトバンクグループ	745,900	9,007.00	6,718,321,300
蔵王産業	300	2,470.00	741,000
スズケン	52,500	4,597.00	241,342,500
サンドラッグ	53,700	4,052.00	217,592,400
サクスパー ホールディングス	15,200	923.00	14,029,600
ジェコス	9,500	985.00	9,357,500
ヤマザワ	400	1,203.00	481,200
やまや	400	2,842.00	1,136,800
ベルーナ	38,500	765.00	29,452,500
合計	285,376,900		577,659,289,490

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 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)

2025年1月14日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,933,033,597
国債証券	423,105,966,600
地方債証券	25,700,438,044
特殊債証券	24,399,593,093
社債証券	20,911,710,000
未収利息	842,339,678
前払費用	50,475,295
流動資産合計	496,943,556,307
資産合計	496,943,556,307
負債の部	
流動負債	
未払解約金	55,900,000
流動負債合計	55,900,000
負債合計	55,900,000
純資産の部	
元本等	
元本	415,533,630,878
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	81,354,025,429
元本等合計	496,887,656,307
純資産合計	496,887,656,307
負債純資産合計	496,943,556,307

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	428,394,158,975円
同期中追加設定元本額	491,031,007,299円
同期中一部解約元本額	503,891,535,396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	31,548,161,277円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	44,590,897円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	88,729,570円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	50,019,514円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	558,672,868円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	251,217,576円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	25,376,126円
たわらノーロード 国内債券	20,617,582,863円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	8,088,780,650円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,795,697,954円
たわらノーロード バランス(標準型)	3,988,088,099円
たわらノーロード バランス(積極型)	616,930,445円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	185,453,433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)	2,542,874,851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)	3,089,553,163円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	809,633,289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)	57,770,508円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	22,953,317円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	191,964,776円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	9,457,821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>	12,541,282,231円
Oneグローバルバランス	285,793,018円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	12,659,863,913円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	19,024,084,401円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	9,077,882,549円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,666,877,408円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	3,045,688,330円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	616,772,861円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	90,751,810円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,493,217,908円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,772,050円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	5,927,079,880円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	2,745,857,566円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	588,267,552円
投資のソムリエ	55,632,023,602円
クルーズコントロール	870,831,258円
投資のソムリエ<DC年金>	7,334,801,046円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	8,564,451,694円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	3,150,721,333円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	11,587,896,406円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	29,913,043,789円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	414,869,353円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	219,166,985円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	117,690,942円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,772,687,109円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,986,482,894円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	10,833,825,530円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,959,208,196円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	624,150,657円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	238,822,045円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	146,381,057円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,786,860,710円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	39,343,648円
O n eグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	175,323,718円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	253,439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)	1,202,686,427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)	1,206,879,441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)	788,417,229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)	726,831,094円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,190,663,035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)	3,068,261,224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)	2,072,419,777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)	833,467,028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)	2,106,530,510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)	1,326,184,500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)	8,979,117,824円
O n eコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	42,158,175円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,069,134,801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)	201,232,629円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	262,099,951円
O n e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)	82,625,295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)	85,373,971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)	82,365,873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)	2,004,839,123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)	28,650,797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)	16,647,602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)	139,922,224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)	98,043,963円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	23,340,534円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	57,574,044円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	29,231,512円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	423,811円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	252,868円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,927,475円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,271,463,385円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,132,654,416円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,467,003,206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)	53,089,605円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	125,121,718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)	1,356,950,568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)	94,535,883円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	619,809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)	1,032,079,993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)	27,967,025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)	164,995,144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)	235,870,106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)	422,492,442円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	194,719,990円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	49,704,185円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,250,989円
動的パッケージファンド<DC年金>	324,325,773円
コア資産形成ファンド	137,138,051円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	15,602,791,716円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	35,782,473,626円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	26,445,590,242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]	157,521,952円
計	415,533,630,878円
2. 受益権の総数	415,533,630,878口

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14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	2025年1月14日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券	13,668,273,700	
地方債証券	679,820,913	
特殊債券	863,818,978	
社債券	413,571,800	
合計	15,625,485,391	

（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2025年1月14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)

2025年1月14日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1958円 (11,958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

2025年1月14日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	459回 利付国庫債券(2年)	3,200,000,000	3,187,488,000	
	460回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,491,825,000	
	463回 利付国庫債券(2年)	2,700,000,000	2,690,712,000	
	464回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	2,988,390,000	
	466回 利付国庫債券(2年)	2,300,000,000	2,293,468,000	
	147回 利付国庫債券(5年)	3,350,000,000	3,330,034,000	
	148回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	1,983,560,000	
	149回 利付国庫債券(5年)	3,180,000,000	3,146,705,400	
	150回 利付国庫債券(5年)	4,570,000,000	4,513,834,700	
	151回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,577,344,000	
	152回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,768,305,200	
	153回 利付国庫債券(5年)	5,210,000,000	5,126,587,900	
	154回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,430,115,000	
	155回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,482,345,000	
	156回 利付国庫債券(5年)	2,300,000,000	2,266,328,000	
	157回 利付国庫債券(5年)	900,000,000	885,195,000	
	158回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,451,100,000	
159回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	978,280,000		



160回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,570,592,000	
161回 利付国庫債券(5年)	1,300,000,000	1,280,448,000	
162回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,573,088,000	
163回 利付国庫債券(5年)	3,650,000,000	3,601,674,000	
164回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,465,995,000	
165回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	981,140,000	
166回 利付国庫債券(5年)	500,000,000	492,475,000	
167回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,573,184,000	
168回 利付国庫債券(5年)	1,800,000,000	1,784,358,000	
169回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	987,280,000	
170回 利付国庫債券(5年)	1,900,000,000	1,880,924,000	
171回 利付国庫債券(5年)	2,400,000,000	2,355,408,000	
172回 利付国庫債券(5年)	2,300,000,000	2,267,087,000	
173回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,087,372,000	
174回 利付国庫債券(5年)	2,400,000,000	2,383,248,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	115,684,800	
2回 利付国庫債券(40年)	330,000,000	333,686,100	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	542,192,400	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	716,428,800	
5回 利付国庫債券(40年)	710,000,000	672,689,500	
6回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	863,173,800	
7回 利付国庫債券(40年)	1,030,000,000	897,037,300	
8回 利付国庫債券(40年)	990,000,000	791,118,900	
9回 利付国庫債券(40年)	1,780,000,000	1,018,053,200	
10回 利付国庫債券(40年)	1,730,000,000	1,162,802,200	
11回 利付国庫債券(40年)	1,380,000,000	882,537,600	
12回 利付国庫債券(40年)	1,420,000,000	792,857,000	
13回 利付国庫債券(40年)	2,120,000,000	1,155,548,400	
14回 利付国庫債券(40年)	1,920,000,000	1,106,860,800	
15回 利付国庫債券(40年)	2,170,000,000	1,373,458,100	

16回 利付国庫債券(40年)	2,040,000,000	1,407,824,400	
17回 利付国庫債券(40年)	1,100,000,000	984,973,000	
1回 CT利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,632,765,000	
2回 CT利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,474,590,000	
342回 利付国庫債券(10年)	3,520,000,000	3,502,928,000	
343回 利付国庫債券(10年)	3,090,000,000	3,068,771,700	
344回 利付国庫債券(10年)	3,570,000,000	3,538,227,000	
345回 利付国庫債券(10年)	5,060,000,000	5,006,971,200	
346回 利付国庫債券(10年)	4,540,000,000	4,484,975,200	
347回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,438,170,000	
348回 利付国庫債券(10年)	5,570,000,000	5,483,497,900	
349回 利付国庫債券(10年)	6,050,000,000	5,944,064,500	
350回 利付国庫債券(10年)	6,800,000,000	6,666,992,000	
351回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,326,152,000	
352回 利付国庫債券(10年)	3,370,000,000	3,288,614,500	
353回 利付国庫債券(10年)	3,690,000,000	3,592,288,800	
354回 利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,388,487,800	
355回 利付国庫債券(10年)	3,730,000,000	3,612,169,300	
356回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,284,468,000	
357回 利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,046,196,000	
358回 利付国庫債券(10年)	3,350,000,000	3,220,656,500	
359回 利付国庫債券(10年)	3,850,000,000	3,692,496,500	
360回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	3,922,757,000	
361回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	3,912,056,000	
362回 利付国庫債券(10年)	3,910,000,000	3,720,443,200	

363回 利付国庫債券(10年)	4,170,000,000	3,955,286,700	
364回 利付国庫債券(10年)	4,110,000,000	3,885,676,200	
365回 利付国庫債券(10年)	3,830,000,000	3,608,970,700	
366回 利付国庫債券(10年)	4,040,000,000	3,821,032,000	
367回 利付国庫債券(10年)	3,970,000,000	3,741,328,000	
368回 利付国庫債券(10年)	4,350,000,000	4,085,781,000	
369回 利付国庫債券(10年)	4,820,000,000	4,620,885,800	
370回 利付国庫債券(10年)	4,150,000,000	3,966,196,500	
371回 利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	4,724,550,000	
372回 利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,483,528,000	
373回 利付国庫債券(10年)	2,450,000,000	2,339,921,500	
374回 利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	3,778,866,000	
375回 利付国庫債券(10年)	4,280,000,000	4,247,343,600	
376回 利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,468,670,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	119,814,200	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	107,653,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	222,836,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	219,064,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	262,275,000	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	248,814,000	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	161,040,000	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	376,679,200	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	290,347,200	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	268,101,600	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	299,141,100	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	439,500,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	307,546,400	

20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	369,035,700	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	340,314,900	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	324,431,700	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	391,394,500	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	361,465,500	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	685,918,400	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	691,944,800	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	858,480,700	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	947,307,200	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	956,146,400	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	770,889,600	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,047,784,300	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,223,058,200	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,272,084,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,089,987,400	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,404,099,300	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,368,146,400	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	838,516,500	
39回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,209,165,100	
40回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,010,914,100	
41回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,021,235,800	
42回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	960,410,000	
43回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	679,718,500	
44回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,079,070,900	
45回 利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,149,475,000	

46回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,413,057,800	
47回 利付国庫債券(30年)	1,340,000,000	1,248,679,000	
48回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,316,884,800	
49回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,160,939,000	
50回 利付国庫債券(30年)	1,550,000,000	1,220,656,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,060,808,000	
52回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,019,228,000	
53回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	978,621,600	
54回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,082,060,000	
55回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	831,081,600	
56回 利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	873,411,000	
57回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,014,510,700	
58回 利付国庫債券(30年)	1,660,000,000	1,261,633,200	
59回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	900,872,400	
60回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	795,520,500	
61回 利付国庫債券(30年)	960,000,000	702,854,400	
62回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	774,872,000	
63回 利付国庫債券(30年)	950,000,000	636,338,500	
64回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	732,336,000	
65回 利付国庫債券(30年)	900,000,000	595,557,000	
66回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	716,402,500	
67回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	753,408,000	
68回 利付国庫債券(30年)	1,240,000,000	851,557,600	
69回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	955,345,600	
70回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	908,206,000	

71回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	924,030,800	
72回 利付国庫債券(30年)	1,390,000,000	961,101,600	
73回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	887,713,500	
74回 利付国庫債券(30年)	1,570,000,000	1,169,979,700	
75回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,220,240,800	
76回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,083,350,400	
77回 利付国庫債券(30年)	1,380,000,000	1,185,489,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,060,098,000	
79回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,119,994,500	
80回 利付国庫債券(30年)	1,380,000,000	1,235,141,400	
81回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,276,575,000	
82回 利付国庫債券(30年)	1,310,000,000	1,168,100,800	
83回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,363,460,000	
84回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,237,756,000	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	600,956,300	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	122,509,200	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	122,368,800	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	604,360,600	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,229,300	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	482,299,900	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	113,061,300	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,192,259,600	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	380,670,800	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	690,763,300	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	571,549,000	

96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	124,128,000	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	686,485,800	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	166,000,000	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	780,240,000	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	868,395,800	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	242,070,400	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	527,920,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	168,398,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	115,038,000	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	670,931,200	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	525,955,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	630,306,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	719,594,100	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	365,627,500	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	463,201,200	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	487,328,600	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	780,796,200	
113回 利付国庫債券(20年)	2,470,000,000	2,611,284,000	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	565,748,500	
117回 利付国庫債券(20年)	1,870,000,000	1,986,856,300	
118回 利付国庫債券(20年)	955,000,000	1,011,975,300	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	493,034,700	
120回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	519,185,000	
121回 利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,098,562,400	
122回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	914,030,700	

123回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,550,543,000	
125回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	969,579,000	
126回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	969,404,800	
127回 利付国庫債券(20年)	840,000,000	889,921,200	
128回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	212,150,000	
130回 利付国庫債券(20年)	1,110,000,000	1,171,094,400	
131回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,153,625,000	
132回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	556,197,900	
133回 利付国庫債券(20年)	2,030,000,000	2,143,558,200	
134回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	950,742,000	
135回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	136,457,100	
136回 利付国庫債券(20年)	560,000,000	583,861,600	
137回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	503,750,400	
138回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,097,396,800	
139回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	708,940,800	
140回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	997,063,000	
141回 利付国庫債券(20年)	1,560,000,000	1,637,204,400	
142回 利付国庫債券(20年)	730,000,000	771,763,300	
143回 利付国庫債券(20年)	2,130,000,000	2,219,034,000	
144回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,085,574,000	
145回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,360,475,000	
146回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,349,267,200	
147回 利付国庫債券(20年)	1,290,000,000	1,341,342,000	
148回 利付国庫債券(20年)	1,730,000,000	1,781,727,000	
149回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	2,354,142,900	



150回 利付国庫債券(20年)	2,330,000,000	2,369,377,000	
151回 利付国庫債券(20年)	2,360,000,000	2,351,645,600	
152回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,226,873,600	
153回 利付国庫債券(20年)	2,560,000,000	2,563,507,200	
154回 利付国庫債券(20年)	2,420,000,000	2,393,936,600	
155回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,202,936,000	
156回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,055,693,600	
157回 利付国庫債券(20年)	2,380,000,000	2,085,284,600	
158回 利付国庫債券(20年)	2,390,000,000	2,158,887,000	
159回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,038,064,000	
160回 利付国庫債券(20年)	2,120,000,000	1,944,379,200	
161回 利付国庫債券(20年)	1,760,000,000	1,587,414,400	
162回 利付国庫債券(20年)	1,930,000,000	1,732,020,600	
163回 利付国庫債券(20年)	1,730,000,000	1,545,495,500	
164回 利付国庫債券(20年)	2,570,000,000	2,254,995,100	
165回 利付国庫債券(20年)	2,070,000,000	1,807,337,700	
166回 利付国庫債券(20年)	2,160,000,000	1,928,815,200	
167回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,684,566,000	
168回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,777,986,000	
169回 利付国庫債券(20年)	2,220,000,000	1,840,713,000	
170回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,400,647,000	
171回 利付国庫債券(20年)	1,840,000,000	1,507,254,400	
172回 利付国庫債券(20年)	1,980,000,000	1,637,875,800	
173回 利付国庫債券(20年)	1,960,000,000	1,612,119,600	
174回 利付国庫債券(20年)	1,930,000,000	1,578,354,000	

	175回 利付国庫債券(20年)	2,020,000,000	1,670,095,600	
	176回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,726,620,000	
	177回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,687,665,000	
	178回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,545,460,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	1,810,000,000	1,463,855,600	
	180回 利付国庫債券(20年)	2,140,000,000	1,816,346,400	
	181回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,633,069,000	
	182回 利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,550,360,000	
	183回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,669,590,000	
	184回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,389,515,200	
	185回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	1,926,892,000	
	186回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,055,988,000	
	187回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,531,343,000	
	188回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,369,612,000	
	189回 利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,385,244,000	
	190回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,747,926,000	
	<b>国債証券 合計</b>	<b>451,705,000,000</b>	<b>423,105,966,600</b>	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	98,865,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	107,672,400	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	191,752,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	383,164,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	285,885,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	216,422,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	100,708,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	204,960,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	308,001,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	105,338,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	105,897,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	198,602,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	98,947,000	

30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	391,268,000	
30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	389,232,000	
令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	94,877,000	
36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	238,005,000	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	194,190,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	190,288,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	282,546,000	
3回 神奈川県公募公債 30 年	100,000,000	111,867,000	
11回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	105,076,000	
16回 神奈川県公募公債 2 0年	300,000,000	318,990,000	
19回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	105,014,000	
413回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	98,728,000	
419回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	98,712,000	
464回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	189,104,000	
467回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	189,604,000	
469回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	188,742,000	
472回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	187,734,000	
474回 大阪府公募公債 1 0年	300,000,000	281,274,000	
10回 大阪府公募公債 20 年	200,000,000	208,680,000	
13回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	97,936,000	
14回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	89,676,000	
190回 大阪府公募公債 5 年	300,000,000	295,665,000	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	107,201,344	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	382,960,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	190,494,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	191,630,000	

令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	94,873,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	107,450,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	202,896,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	304,665,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	100,411,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	99,787,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	191,884,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	95,319,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	189,602,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	101,540,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	101,667,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	198,442,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	315,771,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	318,690,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	102,344,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	204,646,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	136,456,500	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	193,448,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	194,157,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	97,777,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	190,466,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	75,532,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	81,514,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	191,830,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	157,330,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	197,691,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	106,124,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	103,352,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	307,056,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	98,189,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	98,918,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	194,680,000	

令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	192,244,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	95,214,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	101,515,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	131,754,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	104,470,000	
21年度2回 福岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,270,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	311,178,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,372,000	
令和3年5回 千葉県公募公債	200,000,000	187,814,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	99,717,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	97,784,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	88,360,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	190,016,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	102,147,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,134,800	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,196,000	
160回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,010,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	494,200,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	493,745,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	394,168,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,300,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,268,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	491,180,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,371,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	289,632,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	480,785,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	95,666,000	

227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	471,420,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	469,325,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	97,325,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	190,208,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	196,636,000	
令和2年2回 大阪市公募公債	300,000,000	286,824,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	210,198,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	190,956,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	102,067,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	98,261,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	102,957,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	213,108,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	208,544,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	293,355,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	135,958,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	383,332,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	110,674,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	104,546,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	102,170,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	102,758,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	266,319,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	195,078,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	211,000,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	102,396,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	104,394,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	318,519,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	102,149,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	106,080,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	176,236,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	81,468,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	178,248,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	294,573,000	

	30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	88,479,000	
	令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	295,428,000	
	17回 さいたま市公募公債	200,000,000	191,788,000	
	令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	190,208,000	
	30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	193,728,000	
地方債証券 合計		26,539,330,000	25,700,438,044	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	201,712,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	199,974,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	296,097,000	
	125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	401,100,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	68,192,000	
	156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	376,080,000	
	33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,068,000	
	1回 高速道路機構債	300,000,000	338,451,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	162,339,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	223,022,000	
	36回 高速道路機構債	300,000,000	327,852,000	
	50回 高速道路機構債	300,000,000	249,714,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,395,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,891,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	98,462,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	90,345,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	84,392,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	83,031,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	173,718,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	87,045,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,621,000	
	116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,875,000	
	121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	523,600,000	
	153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,106,000	
	188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,938,000	
	239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	294,921,000	

250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,298,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	175,868,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	486,020,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	85,763,000	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	297,948,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	175,564,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	98,783,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	789,360,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	179,354,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	88,353,000	
398回 政保道路債	300,000,000	195,915,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	111,224,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	133,152,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	134,650,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	563,170,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	208,774,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	316,878,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	317,274,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	106,307,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,909,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,640,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	103,690,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	207,696,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,120,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,447,000	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	102,130,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	502,600,000	



4 2 回 地方公共団体金融機構 債券 2 0 年	300,000,000	288,501,000	
4 4 回 地方公共団体金融機構 債券 2 0 年	200,000,000	197,062,000	
2 8 8 回 政保地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	282,423,000	
8 3 回 地方公共団体金融機構 債券 1 0 年	400,000,000	396,964,000	
9 1 回 政保地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	98,811,000	
5 9 回 地方公共団体金融機構 債券 2 0 年	100,000,000	89,468,000	
9 6 回 地方公共団体金融機構 債券	500,000,000	492,975,000	
9 8 回 政保地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	98,576,000	
1 0 3 回 政保地方公共団体金 融機構債券	100,000,000	98,254,000	
1 1 3 回 政保地方公共団体金 融機構債券	100,000,000	97,741,000	
7 7 回 地方公共団体金融機構 債券 2 0 年	300,000,000	238,053,000	
1 0 回 地方公共団体金融機構 債券 3 0 年	300,000,000	195,960,000	
1 5 回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	209,500,000	
4 0 回 政保日本政策金融公庫 債券	103,000,000	102,341,830	
9 3 回 都市再生債券	100,000,000	100,519,000	
1 0 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	198,642,000	
1 6 5 回 都市再生機構債券	200,000,000	136,146,000	
1 1 回 独立行政法人福祉医療 機構	100,000,000	102,226,000	
3 9 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	210,486,000	
7 5 回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	370,842,500	
8 0 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,347,000	
1 1 5 回 住宅金融支援機構債 券	100,000,000	104,489,000	
1 2 4 回 住宅金融支援機構債 券	100,000,000	101,667,000	
1 4 8 回 住宅金融支援機構債 券	250,000,000	245,122,500	
1 5 9 回 住宅金融支援機構債 券	100,000,000	96,900,000	
1 8 7 回 住宅金融支援機構債 券	100,000,000	99,242,000	
2 2 2 回 住宅金融支援機構債 券	300,000,000	294,660,000	
2 3 0 回 住宅金融支援機構債 券	300,000,000	294,477,000	
2 3 3 回 住宅金融支援機構債 券	100,000,000	86,688,000	

3 2 1回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	493,625,000	
3 2 5回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	493,625,000	
2 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,176,000	13,437,148	
2 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,525,000	85,685,791	
3 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,712,000	127,468,135	
3 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,866,000	18,187,230	
4 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,270,000	15,581,355	
5 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,838,000	18,101,824	
5 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,927,000	19,192,545	
6 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,976,000	23,155,902	
6 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,040,000	56,894,548	
7 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,629,000	25,638,739	
8 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,285,000	30,844,194	
8 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,591,000	31,134,194	
8 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,045,000	34,385,803	
9 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,686,000	35,733,631	
9 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,977,000	39,958,326	
9 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,081,000	45,098,419	
9 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,245,000	47,385,016	
1 1 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,143,000	172,197,760	
1 1 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,815,000	58,939,534	
1 1 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,349,000	58,617,463	
1 1 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,870,000	59,015,241	
1 2 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,801,000	182,121,596	
1 2 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,342,000	181,605,902	

130回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	136,120,000	124,410,957	
131回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	203,142,000	185,052,204	
132回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	201,090,000	183,299,567	
137回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	350,035,000	319,679,963	
139回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	69,626,000	63,517,014	
142回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	72,043,000	64,887,689	
154回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	234,798,000	209,622,958	
156回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	311,844,000	279,178,341	
160回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	240,198,000	214,936,376	
168回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	245,880,000	220,404,373	
170回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	748,350,000	669,421,525	
い第851号 利付商工債	300,000,000	297,501,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	296,496,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	197,500,000	
377回 利附信金中金債(5 年)	300,000,000	297,426,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	103,843,000	
72回 東日本高速道路社債	200,000,000	196,602,000	
77回 東日本高速道路社債	300,000,000	293,433,000	
87回 中日本高速道路債券	400,000,000	397,112,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	98,735,000	
90回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	188,992,000	
特殊債券 合計	25,511,315,000	24,399,593,093	
社債券			
25回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2 017)	300,000,000	293,907,000	
11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債(2 016)	100,000,000	99,059,000	
37回 成田国際空港社債	100,000,000	80,418,000	
57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,081,000	
67回 東日本高速道路社債	200,000,000	191,720,000	
79回 東日本高速道路社債	300,000,000	296,991,000	
83回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,994,000	
90回 中日本高速道路債券	200,000,000	197,812,000	
91回 中日本高速道路債券	500,000,000	493,800,000	
33回 西日本高速道路債券	300,000,000	296,922,000	
34回 西日本高速道路債券	200,000,000	198,006,000	

61回	西日本高速道路債券	500,000,000	494,915,000	
62回	西日本高速道路債券	500,000,000	493,790,000	
24回	大和ハウス工業社債	200,000,000	197,946,000	
3回	ダイドーグループHD社債	300,000,000	286,029,000	
9回	野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	89,830,000	
30回	東レ社債	300,000,000	295,716,000	
42回	王子ホールディングス社債	200,000,000	198,236,000	
23回	三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	175,754,000	
40回	三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	98,946,000	
17回	ダイセル社債	300,000,000	285,432,000	
16回	武田薬品工業社債	500,000,000	466,280,000	
4回	ENEOSホールディングス社債	300,000,000	284,841,000	
14回	ブリヂストン社債	300,000,000	290,508,000	
35回	三菱マテリアル社債	300,000,000	296,643,000	
17回	パナソニック社債	100,000,000	99,172,000	
19回	パナソニック社債	100,000,000	95,306,000	
23回	パナソニック社債	200,000,000	188,772,000	
58回	川崎重工業社債	300,000,000	279,342,000	
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	97,403,000	
26回	トヨタ自動車社債	200,000,000	198,348,000	
26回	豊田通商社債	100,000,000	86,747,000	
73回	三井物産社債	400,000,000	385,232,000	
88回	三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	102,977,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	101,939,000	
20回	三井住友信託銀行社債	300,000,000	296,346,000	
28回	芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,351,000	
17回	NTTファイナンス社債	300,000,000	293,892,000	
18回	NTTファイナンス社債	400,000,000	381,676,000	
69回	ホンダファイナンス社債	300,000,000	296,718,000	
81回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,111,000	
96回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,121,000	
80回	日立キャピタル社債	200,000,000	191,144,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	284,052,000	
23回	三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	96,617,000	
27回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	197,560,000	

31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	190,028,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	294,573,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	296,031,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	99,360,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	197,430,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	100,459,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	84,301,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	104,791,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,069,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	210,490,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	85,803,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	77,015,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,743,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,484,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	57,007,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,363,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	159,568,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	130,600,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,798,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	190,686,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	67,574,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	58,048,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	94,176,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	159,106,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,657,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	122,658,000	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	55,992,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	286,263,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	190,430,000	
12回 ソフトバンク社債	400,000,000	387,324,000	
30回 光通信社債	200,000,000	185,688,000	
527回 中部電力社債	100,000,000	87,043,000	
532回 中部電力社債	200,000,000	191,946,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	296,565,000	
530回 関西電力社債	400,000,000	387,104,000	
531回 関西電力社債	200,000,000	163,544,000	
541回 関西電力社債	300,000,000	280,590,000	
396回 中国電力社債	200,000,000	188,260,000	
425回 中国電力社債	100,000,000	95,242,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	100,263,000	
311回 北陸電力社債	100,000,000	99,639,000	
488回 東北電力社債	100,000,000	98,906,000	
521回 東北電力社債	400,000,000	383,152,000	
525回 東北電力社債	200,000,000	195,782,000	
536回 東北電力社債	300,000,000	278,991,000	

3 2 0 回	四国電力社債	300,000,000	281,628,000	
4 6 3 回	九州電力社債	100,000,000	85,269,000	
4 6 6 回	九州電力社債	100,000,000	84,158,000	
4 9 1 回	九州電力社債	300,000,000	281,880,000	
4 9 2 回	九州電力社債	100,000,000	77,853,000	
4 9 3 回	九州電力社債	200,000,000	197,984,000	
5 0 7 回	九州電力社債	200,000,000	188,584,000	
3 4 0 回	北海道電力社債	300,000,000	296,598,000	
3 5 0 回	北海道電力社債	200,000,000	169,714,000	
5 4 回	電源開発社債	100,000,000	98,312,000	
7 5 回	電源開発社債	200,000,000	186,672,000	
4 1 回	東京瓦斯社債	200,000,000	175,396,000	
5 2 回	東京瓦斯社債	100,000,000	81,960,000	
5 5 回	東京瓦斯社債	100,000,000	78,737,000	
5 7 回	東京瓦斯社債	300,000,000	163,935,000	
7 回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	195,702,000	
8 回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	174,384,000	
社債券 合計		22,220,000,000	20,911,710,000	
合計			494,117,707,737	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2025年1月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	33,297,571,012
コール・ローン	169,898,290
株式	1,733,861,897,391
投資信託受益証券	2,418,318,924
投資証券	29,065,806,461
派生商品評価勘定	24,743,018
未収配当金	1,243,988,671
差入委託証拠金	15,762,090,064
流動資産合計	1,815,844,313,831
資産合計	1,815,844,313,831
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,578,959,001
未払金	791,268
未払解約金	1,762,000
流動負債合計	1,581,512,269
負債合計	1,581,512,269
純資産の部	
元本等	
元本	180,152,640,719
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,634,110,160,843
元本等合計	1,814,262,801,562
純資産合計	1,814,262,801,562
負債純資産合計	1,815,844,313,831

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	160,807,419,421円
同期中追加設定元本額	50,090,412,260円
同期中一部解約元本額	30,745,190,962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	3,934,560,727円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,127,962円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	5,835,985円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	14,566,427円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	14,132,112円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	16,524,006円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	7,389,438円
たわらノーロード 先進国株式	73,108,150,903円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,863,854,641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)	70,491,026円
たわらノーロード バランス(標準型)	760,120,116円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,148,212,437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)	39,029,759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)	274,306,225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)	329,071,867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)	545,660,929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)	479,597円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	18,346,109円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,324,774円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	16,450,272円
たわらノーロード 全世界株式	7,881,680,093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)	218,685円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	167,064円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	58,850,429,049円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3,835,234,942円
O n eグローバルバランス	50,102,106円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	115,675,642円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	645,403,749円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	948,458,718円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	59,794,856円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	177,548,697円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	205,308,116円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	15,593,152円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	600,069,666円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	108,947,078円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	124,782,692円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	160,266,969円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	287,998,831円
投資のソムリエ	6,192,507,983円
クルーズコントロール	54,566,254円
投資のソムリエ<DC年金>	815,684,436円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	180,152,985円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	322,557,557円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	545,469,047円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,407,970,404円
ワールドアセットバランス(基本コース)	114,219,508円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	244,969,924円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	74,191,064円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	39,192,435円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,539,940円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	196,992,966円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	158,320,334円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	392,659,786円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	109,375,258円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	80,082,384円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	42,708,091円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	26,176,150円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	182,939,470円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	7,037,257円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	27,597,626円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	44,557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)	325,990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)	358,155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)	8,026,059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)	171,490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)	66,906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)	883,669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)	13,478,420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)	222,085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)	15,098,364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)	242,500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)	214,682,019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)	13,312,336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)	967,304,468円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,019,617,257円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	118,855,054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)	1,548,102円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	3,995,195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)	566,001円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,185,277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)	13,645,440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)	28,711,769円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,169,804円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,735,811円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	683,452円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	24,903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)	19,931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)	693,484円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	66,535,624円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	145,719,366円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	523,126,501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)	20,726,217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)	17,579,268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)	105,998,968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)	3,680,308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)	109,084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)	30,176,422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)	3,272,083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)	9,667,333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)	13,797,161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)	29,651,192円
動的パッケージファンド<DC年金>	13,414,331円
コア資産形成ファンド	5,738,267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>	2,609,787,924円
MHAM外国株式インデックスファンド	127,389,520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>	914,733,516円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,450,859,742円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,151,137,358円
計	180,152,640,719円
2. 受益権の総数	180,152,640,719口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14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	2025年1月14日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	203,732,771,201	
投資信託受益証券	264,076,870	
投資証券	654,891,407	
合計	204,651,739,478	

(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2025年1月14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	2025年1月14日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	2,169,372,926	-	2,169,414,593	41,667	
イギリス・ポンド	1,747,637,820	-	1,747,673,320	35,500	
オーストラリア・ドル	69,238,440	-	69,242,760	4,320	
カナダ・ドル	35,849,088	-	35,846,180	2,908	
	72,763,112	-	72,768,623	5,511	

ユーロ	243,884,466	-	243,883,710	756
合計	2,169,372,926	-	2,169,414,593	41,667

## (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	2025年1月14日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	52,301,365,596	-	50,747,107,946	1,554,257,650
合計	52,301,365,596	-	50,747,107,946	1,554,257,650

## (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)

2025年1月14日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	10.0707円 (100,707円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2025年1月14日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,612,828	218.460	352,338,404.880	
	ABBOTT LABORATORIES	298,205	113.190	33,753,823.950	

AES CORP	109,122	11.690	1,275,636.180	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	157,384	217.400	34,215,281.600	
ADVANCED MICRO DEVICES	277,053	117.320	32,503,857.960	
ADOBE INC	75,061	408.500	30,662,418.500	
CHUBB LTD	65,994	261.760	17,274,589.440	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	37,905	301.740	11,437,454.700	
ALLSTATE CORP	43,830	182.540	8,000,728.200	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	109,936	219.100	24,086,977.600	
AMGEN INC	91,894	270.190	24,828,839.860	
HESS CORP	47,477	144.830	6,876,093.910	
AMERICAN EXPRESS CO	97,472	297.020	28,951,133.440	
AMERICAN ELECTRIC POWER	92,281	94.540	8,724,245.740	
AFLAC INC	89,636	102.490	9,186,793.640	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	70.840	7,661,346.000	
ANALOG DEVICES	85,829	212.950	18,277,285.550	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	114,610	79.300	9,088,573.000	
VALERO ENERGY CORP	56,511	133.350	7,535,741.850	
ANSYS INC	14,299	337.190	4,821,479.810	
APPLE INC	2,595,440	234.400	608,371,136.000	
APPLIED MATERIALS INC	141,091	170.860	24,106,808.260	
ALBEMARLE CORP	18,991	91.510	1,737,866.410	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	52.120	4,247,988.480	
AMEREN CORP	44,814	88.810	3,979,931.340	
AUTODESK INC	36,571	284.820	10,416,152.220	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	69,110	290.200	20,055,722.000	
AUTOZONE INC	2,840	3,239.620	9,200,520.800	
AVERY DENNISON CORP	13,185	187.960	2,478,252.600	
BALL CORP	51,188	53.250	2,725,761.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	226,276	443.910	100,446,179.160	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	123,730	76.110	9,417,090.300	
BAXTER INTERNATIONAL INC	80,219	30.500	2,446,679.500	
BECTON DICKINSON & CO	49,469	236.190	11,684,083.110	
AMETEK INC	39,830	176.500	7,029,995.000	
VERIZON COMM INC	721,194	38.120	27,491,915.280	
WR BERKLEY CORP	55,630	57.300	3,187,599.000	
BEST BUY CO INC	35,626	84.310	3,003,628.060	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	351.700	1,062,485.700	
YUM! BRANDS INC	48,345	123.730	5,981,726.850	
FIRSTENERGY CORP	96,001	39.160	3,759,399.160	
BOEING CO	124,217	170.570	21,187,693.690	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	252,376	94.610	23,877,293.360	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	21,827	103.570	2,260,622.390	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	29,288	178.760	5,235,522.880	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,710	1,267.220	4,701,386.200	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	348,040	55.360	19,267,494.400	
ONEOK INC	100,328	103.980	10,432,105.440	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,940	131.310	1,699,151.400	
UNITED RENTALS INC	11,385	689.150	7,845,972.750	
SEMPRA	107,707	76.940	8,286,976.580	
FEDEX CORP	39,466	274.590	10,836,968.940	
VERISIGN INC	14,698	209.560	3,080,112.880	
AMPHENOL CORP	205,492	68.340	14,043,323.280	
BROWN-FORMAN CORP	37,107	34.470	1,279,078.290	
QUANTA SERVICES INC	25,373	314.230	7,972,957.790	
CSX CORP	330,543	31.890	10,541,016.270	
COTERRA ENERGY INC	134,560	28.610	3,849,761.600	
THE CAMPBELL'S COMPANY	38,172	38.620	1,474,202.640	
CONSTELLATION BRANDS INC	28,149	185.910	5,233,180.590	
CARDINAL HEALTH INC	42,364	120.860	5,120,113.040	
CARLISLE COS INC	8,519	373.160	3,178,950.040	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	182,752	23.890	4,365,945.280	
CATERPILLAR INC	82,724	362.500	29,987,450.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	16,645	182.690	3,040,875.050	
JPMORGAN CHASE & CO	486,436	244.210	118,792,535.560	
CHURCH & DWIGHT CO INC	43,274	102.860	4,451,163.640	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	25,734	135.920	3,497,765.280	
CINTAS CORP	61,973	190.600	11,812,053.800	
CISCO SYSTEMS INC	679,008	58.760	39,898,510.080	
CLOROX COMPANY	21,216	157.470	3,340,883.520	
COCA-COLA CO/THE	700,581	61.650	43,190,818.650	
COPART INC	149,289	55.630	8,304,947.070	
COLGATE-PALMOLIVE CO	132,059	87.100	11,502,338.900	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	40,263	272.290	10,963,212.270	
MOLINA HEALTHCARE INC	9,939	294.450	2,926,538.550	
NRG ENERGY, INC.	34,874	97.200	3,389,752.800	
COMCAST CORP-CL A	661,568	36.450	24,114,153.600	
CONAGRA BRANDS INC	73,639	26.270	1,934,496.530	
CONSOLIDATED EDISON INC	60,171	88.470	5,323,328.370	
CMS ENERGY CORP	49,050	64.990	3,187,759.500	
COOPER COS INC	31,884	91.280	2,910,371.520	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	53.810	1,637,761.160	

CORNING INC	136,980	46.580	6,380,528.400	
HEICO CORP-CL A	14,337	178.790	2,563,312.230	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	10,995	265.330	2,917,303.350	
CUMMINS INC	23,003	361.070	8,305,693.210	
DR HORTON INC	49,181	138.400	6,806,650.400	
DANAHER CORP	110,876	239.880	26,596,934.880	
MOODY'S CORP	27,822	457.880	12,739,137.360	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	82,266	76.680	6,308,156.880	
TARGET CORP	79,921	138.770	11,090,637.170	
DEERE & CO	44,349	429.910	19,066,078.590	
MORGAN STANLEY	206,445	123.990	25,597,115.550	
REPUBLIC SERVICES INC	37,796	207.220	7,832,087.120	
COSTAR GROUP INC	71,135	69.290	4,928,944.150	
DECKERS OUTDOOR CORP	25,044	204.590	5,123,751.960	
THE WALT DISNEY CO	308,867	108.080	33,382,345.360	
DOLLAR TREE INC	35,355	71.150	2,515,508.250	
DOVER CORP	24,373	186.750	4,551,657.750	
OMNICOM GROUP	30,586	83.160	2,543,531.760	
DTE ENERGY CO	33,700	118.220	3,984,014.000	
DUKE ENERGY CORP	130,605	106.140	13,862,414.700	
DARDEN RESTAURANTS INC	20,935	182.770	3,826,289.950	
EBAY INC	84,227	65.720	5,535,398.440	
BANK OF AMERICA CORP	1,196,739	45.060	53,925,059.340	
CITIGROUP INC	323,405	72.770	23,534,181.850	
EASTMAN CHEMICAL CO	21,268	89.120	1,895,404.160	
EATON CORP PLC	67,762	340.880	23,098,710.560	
CADENCE DESIGN SYS INC	46,905	292.500	13,719,712.500	
ECOLAB INC	43,435	233.460	10,140,335.100	
REVVITY INC	21,035	122.700	2,580,994.500	
ELECTRONIC ARTS INC	41,850	141.960	5,941,026.000	
SALESFORCE INC	163,470	319.070	52,158,372.900	
ERIE INDEMNITY CO	4,050	388.580	1,573,749.000	
EMERSON ELECTRIC CO	96,074	118.470	11,381,886.780	
ATMOS ENERGY CORP	24,532	138.260	3,391,794.320	
ENTERGY CORP	78,020	77.070	6,013,001.400	
EOG RESOURCES INC	97,854	134.490	13,160,384.460	
EQUIFAX INC	21,778	247.560	5,391,361.680	
EQT CORP	90,040	50.080	4,509,203.200	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	37,953	75.000	2,846,475.000	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	110.580	2,478,650.700	
EXXON MOBIL CORP	759,238	109.290	82,977,121.020	
NEXTERA ENERGY INC	348,097	66.960	23,308,575.120	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,019	454.860	2,737,802.340	
FAIR ISAAC CORP	4,212	1,911.980	8,053,259.760	
ASSURANT INC	8,766	199.870	1,752,060.420	
FASTENAL CO	95,215	72.890	6,940,221.350	
FIFTH THIRD BANCORP	120,431	41.730	5,025,585.630	



M&T BANK CORP	28,540	191.150	5,455,421.000	
FISERV INC	98,665	201.530	19,883,957.450	
FORD MOTOR CO	675,985	9.710	6,563,814.350	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	18.990	901,588.230	
FREEMPORT-MCMORAN INC	244,611	39.410	9,640,119.510	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,770	2,085.610	3,691,529.700	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	41,590	285.810	11,886,837.900	
GENERAL DYNAMICS CORP	39,325	263.670	10,368,822.750	
GENERAL MILLS INC	94,669	59.330	5,616,711.770	
GENUINE PARTS CO	23,115	116.510	2,693,128.650	
GILEAD SCIENCES INC	212,357	89.940	19,099,388.580	
GARTNER INC	12,872	493.130	6,347,569.360	
MCKESSON CORP	22,195	585.080	12,985,850.600	
NVIDIA CORP	4,187,529	133.230	557,904,488.670	
GRACO INC	27,006	81.860	2,210,711.160	
GE AEROSPACE	185,365	171.570	31,803,073.050	
VW GRAINGER INC	7,565	1,075.980	8,139,788.700	
HALLIBURTON CO	155,027	27.800	4,309,750.600	
MONSTER BEVERAGE CORP	124,258	49.990	6,211,657.420	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	53,515	562.950	30,126,269.250	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	31,942	213.920	6,833,032.640	
HENRY SCHEIN INC	20,863	70.700	1,475,014.100	
HEICO CORP	6,878	226.300	1,556,491.400	
HERSHEY FOODS CORP	24,324	157.280	3,825,678.720	
HP INC	164,781	32.620	5,375,156.220	
F5 INC	10,684	255.160	2,726,129.440	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	82.700	1,498,937.500	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	362.880	2,763,331.200	
JUNIPER NETWORKS INC	60,059	38.490	2,311,670.910	
HOLOGIC INC	38,399	70.290	2,699,065.710	
HOME DEPOT INC	170,018	389.180	66,167,605.240	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29,668	66.990	1,987,459.320	
HORMEL FOODS CORP	49,054	30.260	1,484,374.040	
CENTERPOINT ENERGY INC	115,509	31.610	3,651,239.490	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,672	618.510	3,508,188.720	
HUBBELL INC	8,750	420.510	3,679,462.500	
HUMANA INC	20,751	287.360	5,963,007.360	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,365	179.230	2,753,868.950	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	240,636	16.220	3,903,115.920	
BIOGEN INC	25,797	150.180	3,874,193.460	
IDEX CORP	12,292	210.030	2,581,688.760	
ILLINOIS TOOL WORKS	50,275	249.700	12,553,667.500	
INTUIT INC	47,878	613.220	29,359,747.160	
IDEXX LABORATORIES INC	14,376	422.620	6,075,585.120	

TRANE TECHNOLOGIES PLC	38,409	376.980	14,479,424.820	
INTEL CORP	724,665	19.200	13,913,568.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	45,847	83.300	3,819,055.100	
INTERNATIONAL PAPER CO	53,419	53.890	2,878,749.910	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	63,859	26.820	1,712,698.380	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	173.250	2,054,225.250	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	153.510	3,006,646.860	
INCYTE CORP	28,067	72.370	2,031,208.790	
EMCOR GROUP INC	7,710	467.780	3,606,583.800	
JOHNSON & JOHNSON	411,627	144.470	59,467,752.690	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	51,256	107.480	5,508,994.880	
KLA CORPORATION	22,406	690.990	15,482,321.940	
DEVON ENERGY CORP	106,971	36.770	3,933,323.670	
KELLANOVA	47,714	81.510	3,889,168.140	
KEYCORP	166,503	17.020	2,833,881.060	
KIMBERLY-CLARK CORP	55,965	125.430	7,019,689.950	
KROGER CO	118,023	59.490	7,021,188.270	
LAM RESEARCH CORP	224,098	74.450	16,684,096.100	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8,555	460.790	3,942,058.450	
PACKAGING CORP OF AMERICA	15,558	230.320	3,583,318.560	
AKAMAI TECHNOLOGIES	27,653	89.610	2,477,985.330	
LENNAR CORP	40,713	131.580	5,357,016.540	
ELI LILLY & CO	137,932	797.480	109,998,011.360	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	126,093	125.010	15,762,885.930	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	47,654	141.950	6,764,485.300	
LOCKHEED MARTIN CORP	37,005	483.160	17,879,335.800	
LOEWS CORP	30,289	82.080	2,486,121.120	
LOWE'S COS INC	96,208	248.660	23,923,081.280	
DOMINION ENERGY INC	142,221	53.460	7,603,134.660	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	32.330	1,306,164.330	
MCCORMICK & CO INC	40,279	71.240	2,869,475.960	
MCDONALD'S CORPORATION	122,952	283.630	34,872,875.760	
S&P GLOBAL INC	54,887	482.590	26,487,917.330	
EVEREST GROUP LTD	8,130	351.690	2,859,239.700	
MARKEL GROUP INC	2,404	1,669.970	4,014,607.880	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	103,592	71.090	7,364,355.280	
MARSH & MCLENNAN COS	84,799	211.500	17,934,988.500	
MASCO CORP	34,561	73.560	2,542,307.160	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	10,701	513.200	5,491,753.200	

METLIFE INC	103,317	81.910	8,462,695.470	
MEDTRONIC PLC	221,134	81.790	18,086,549.860	
CVS HEALTH CORP	214,005	51.520	11,025,537.600	
MERCK & CO. INC.	433,955	100.980	43,820,775.900	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	75,686	55.870	4,228,576.820	
MICROSOFT CORP	1,205,374	417.190	502,869,979.060	
MICRON TECH INC	188,151	95.060	17,885,634.060	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	92,397	55.910	5,165,916.270	
3M CO	94,148	134.600	12,672,320.800	
ENTEGRIS INC	23,675	98.260	2,326,305.500	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	190.140	1,459,134.360	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	27,968	456.770	12,774,943.360	
ILLUMINA INC	27,148	144.220	3,915,284.560	
XCEL ENERGY INC	96,398	63.620	6,132,840.760	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	17,037	143.030	2,436,802.110	
NETAPP INC	36,842	114.920	4,233,882.640	
NEWMONT CORP	192,440	39.170	7,537,874.800	
NVR INC	548	7,962.000	4,363,176.000	
NIKE INC-CL B	201,444	72.080	14,520,083.520	
NORDSON CORP	8,735	203.830	1,780,455.050	
NORFOLK SOUTHERN CORP	38,420	237.360	9,119,371.200	
EVERSOURCE ENERGY	65,787	55.860	3,674,861.820	
NISOURCE INC	69,366	36.340	2,520,760.440	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	100.320	3,297,317.760	
NORTHROP GRUMMAN CORP	24,160	472.380	11,412,700.800	
WELLS FARGO & CO	582,778	70.530	41,103,332.340	
NUCOR CORP	40,395	122.880	4,963,737.600	
CHENIERE ENERGY INC	38,886	229.440	8,922,003.840	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	65,838	180.330	11,872,566.540	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	105,039	52.680	5,533,454.520	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	33,427	180.670	6,039,256.090	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,986	1,210.140	12,084,458.040	
ORACLE CORP	283,923	153.920	43,701,428.160	
PACCAR INC	90,022	108.160	9,736,779.520	
PTC INC	20,087	182.420	3,664,270.540	
EXELON CORP	172,366	37.560	6,474,066.960	
PARKER HANNIFIN CORP	21,835	637.990	13,930,511.650	
PAYCHEX INC	55,583	140.530	7,811,078.990	
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,452	213.680	2,447,063.360	
PPL CORPORATION	132,503	31.680	4,197,695.040	
PEPSICO INC	235,231	144.500	33,990,879.500	
PENTAIR PLC	30,201	98.640	2,979,026.640	
PFIZER INC	962,220	26.800	25,787,496.000	

ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	33.740	1,360,363.060	
CONOCOPHILLIPS	220,734	104.230	23,007,104.820	
PG&E CORP	347,639	16.220	5,638,704.580	
ALTRIA GROUP INC	290,614	50.850	14,777,721.900	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	67,693	192.430	13,026,163.990	
BROWN & BROWN INC	40,458	102.550	4,148,967.900	
GARMIN LTD	25,779	208.440	5,373,374.760	
PPG INDUSTRIES INC	37,839	114.800	4,343,917.200	
COSTCO WHOLESALE CORP	75,700	924.700	69,999,790.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	37,719	110.630	4,172,852.970	
QUEST DIAGNOSTICS	19,786	154.020	3,047,439.720	
PROCTER & GAMBLE CO	401,654	158.840	63,798,721.360	
PROGRESSIVE CORP	99,272	235.780	23,406,352.160	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	85,682	84.110	7,206,713.020	
PULTE GROUP INC	33,950	108.990	3,700,210.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	43,206	106.820	4,615,264.920	
QUALCOMM INC	189,162	157.130	29,723,025.060	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	32,000	154.210	4,934,720.000	
EXACT SCIENCES CORP	29,779	58.510	1,742,369.290	
RELIANCE INC	10,527	274.800	2,892,819.600	
REGENERON PHARMACEUTICALS	18,431	716.900	13,213,183.900	
RESMED INC	24,715	230.260	5,690,875.900	
US BANCORP	265,109	48.390	12,828,624.510	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	65,415	90.830	5,941,644.450	
ROSS STORES INC	57,180	151.160	8,643,328.800	
ROLLINS INC	45,708	46.480	2,124,507.840	
ROPER TECHNOLOGIES INC	18,125	508.000	9,207,500.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	19,881	275.530	5,477,811.930	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	41,808	227.230	9,500,031.840	
RPM INTERNATIONAL INC	22,264	122.120	2,718,879.680	
ACCENTURE PLC-CL A	105,955	349.140	36,993,128.700	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	226,602	56.170	12,728,234.340	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	17,682	311.260	5,503,699.320	
AXON ENTERPRISE INC	12,002	568.680	6,825,297.360	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	39,040	233.330	9,109,203.200	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	93,547	78.630	7,355,600.610	
BOOKING HOLDINGS INC	5,745	4,763.900	27,368,605.500	
SCHLUMBERGER LTD	244,939	39.850	9,760,819.150	
SCHWAB (CHARLES) CORP	273,818	72.660	19,895,615.880	
POOL CORP	6,305	334.430	2,108,581.150	

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	35,309	105.490	3,724,746.410	
SEI INVESTMENTS CO	20,388	79.020	1,611,059.760	
ELEVANCE HEALTH INC	39,750	396.490	15,760,477.500	
CENCORA INC	29,520	236.090	6,969,376.800	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	42,607	77.800	3,314,824.600	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	40,720	336.120	13,686,806.400	
CENTENE CORP	88,199	63.700	5,618,276.300	
SMITH (A.O.) CORP	19,563	68.630	1,342,608.690	
SNAP-ON INC	9,624	339.200	3,264,460.800	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	61,857	116.290	7,193,350.530	
EDISON INTERNATIONAL	63,206	57.270	3,619,807.620	
SOUTHERN CO	184,910	81.870	15,138,581.700	
TRUIST FINANCIAL CORP	229,384	43.120	9,891,038.080	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	32.660	643,402.000	
AT&T INC	1,213,193	21.560	26,156,441.080	
CHEVRON CORP	295,246	155.350	45,866,466.100	
STANLEY BLACK & DECKER INC	26,546	80.890	2,147,305.940	
STATE STREET CORP	49,873	94.450	4,710,504.850	
STARBUCKS CORP	192,907	93.510	18,038,733.570	
STEEL DYNAMICS INC	25,751	123.270	3,174,325.770	
STRYKER CORP	58,012	360.980	20,941,171.760	
NETFLIX INC	73,315	840.290	61,605,861.350	
GEN DIGITAL INC	92,583	26.850	2,485,853.550	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	54.230	1,485,902.000	
SYNOPSIS INC	26,297	487.430	12,817,946.710	
SYSCO CORP	83,870	73.710	6,182,057.700	
INTUITIVE SURGICAL INC	60,797	539.750	32,815,180.750	
TELEFLEX INC	9,358	178.540	1,670,777.320	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	183,707	20.440	3,754,971.080	
TERADYNE INC	29,014	133.220	3,865,245.080	
TEXAS INSTRUMENTS INC	156,604	191.090	29,925,458.360	
TEXTRON INC	29,841	76.970	2,296,861.770	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	65,649	555.520	36,469,332.480	
TORO CO	18,011	80.170	1,443,941.870	
DAVITA INC	9,106	157.060	1,430,188.360	
TRACTOR SUPPLY CO	90,530	54.570	4,940,222.100	
BIO-TECHNE CORP	25,934	76.420	1,981,876.280	
TRIMBLE INC	43,160	70.270	3,032,853.200	
TYLER TECHNOLOGIES INC	7,396	562.010	4,156,625.960	
TYSON FOODS INC	47,194	55.630	2,625,402.220	
UNION PACIFIC CORP	104,586	226.760	23,715,921.360	
RTX CORP	229,200	117.740	26,986,008.000	

UNITEDHEALTH GROUP INC	157,571	541.140	85,267,970.940	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,903	185.740	1,839,383.220	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	43,742	413.370	18,081,630.540	
VULCAN MATERIALS CO	23,048	256.030	5,900,979.440	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	139,773	11.900	1,663,298.700	
WALMART INC	755,711	91.530	69,170,227.830	
WASTE MANAGEMENT INC	68,368	207.530	14,188,411.040	
WATERS CORP	9,995	399.870	3,996,700.650	
WATSCO INC	5,565	476.570	2,652,112.050	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	12,974	339.600	4,405,970.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	19,624	102.170	2,004,984.080	
WESTERN DIGITAL CORP	59,863	62.020	3,712,703.260	
WABTEC CORP	28,400	191.840	5,448,256.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,319	90.340	2,287,318.460	
WYNN RESORTS LTD	15,379	81.330	1,250,774.070	
NASDAQ INC	71,851	76.180	5,473,609.180	
CME GROUP INC	61,720	229.450	14,161,654.000	
WILLIAMS COS INC	209,189	56.030	11,720,859.670	
WILLIAMS-SONOMA INC	22,865	195.260	4,464,619.900	
DICK'S SPORTING GOODS INC	9,703	224.440	2,177,741.320	
LKQ CORP	43,882	36.490	1,601,254.180	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	56.980	2,309,057.520	
WEC ENERGY GROUP INC	56,102	93.890	5,267,416.780	
MICROSTRATEGY INC-CL A	31,299	328.400	10,278,591.600	
CARMAX INC	27,022	78.500	2,121,227.000	
TJX COMPANIES INC	190,716	119.890	22,864,941.240	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	9,012	381.690	3,439,790.280	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	4.280	667,889.720	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	40.250	947,002.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	21,812	258.270	5,633,385.240	
CBRE GROUP INC	52,609	123.560	6,500,368.040	
REGIONS FINANCIAL CORP	152,588	23.620	3,604,128.560	
DOMINO'S PIZZA INC	5,925	410.140	2,430,079.500	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8,645	587.350	5,077,640.750	
CRH PLC	117,073	91.550	10,718,033.150	
WESTLAKE CORP	6,030	113.410	683,862.300	
T-MOBILE US INC	89,605	213.460	19,127,083.300	
LAS VEGAS SANDS CORP	59,474	46.870	2,787,546.380	
MOSAIC CO/THE	48,502	26.820	1,300,823.640	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	216.890	1,328,668.140	

CELANESE CORP	19,797	67.380	1,333,921.860	
DEXCOM INC	68,840	79.840	5,496,185.600	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	146.470	2,864,074.380	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	181.300	3,984,611.400	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	95.500	2,957,539.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,417	517.590	8,497,275.030	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	97,187	143.890	13,984,237.430	
LIVE NATION	27,355	130.610	3,572,836.550	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	234,186	56.260	13,175,304.360	
TRANSDIGM GROUP INC	9,498	1,278.460	12,142,813.080	
MASTERCARD INC	140,760	504.910	71,071,131.600	
OWENS CORNING	15,643	169.500	2,651,488.500	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,679	152.640	3,156,442.560	
AERCAP HOLDINGS NV	33,912	94.700	3,211,466.400	
FIRST SOLAR INC	16,384	183.610	3,008,266.240	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	20,698	224.810	4,653,117.380	
SUPER MICRO COMPUTER INC	90,744	31.080	2,820,323.520	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	108.470	2,288,066.180	
DELTA AIR LINES INC	30,555	65.100	1,989,130.500	
INSULET CORP	12,022	267.990	3,221,775.780	
DISCOVER FINANCIAL	43,392	175.680	7,623,106.560	
LULULEMON ATHLETICA INC	19,016	398.860	7,584,721.760	
MERCADOLIBRE INC	7,746	1,740.000	13,478,040.000	
ULTA BEAUTY INC	7,914	403.940	3,196,781.160	
MSCI INC	13,320	580.520	7,732,526.400	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	266,084	117.550	31,278,174.200	
VISA INC	285,183	306.920	87,528,366.360	
KEURIG DR PEPPER INC	197,495	30.780	6,078,896.100	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	34,911	121.010	4,224,580.110	
MARATHON PETROLEUM CORP	56,329	146.750	8,266,280.750	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	70.830	1,517,886.900	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	339,285	28.520	9,676,408.200	
XYLEM INC	42,710	115.640	4,938,984.400	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	46,489	75.150	3,493,648.350	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	195.140	1,264,702.340	
EPAM SYSTEMS INC	9,031	225.820	2,039,380.420	
HCA HEALTHCARE INC	32,407	308.180	9,987,189.260	
VERISK ANALYTICS INC	24,505	275.470	6,750,392.350	
CORPAY INC	11,338	352.230	3,993,583.740	

NXP SEMICONDUCTOR NV	43,768	206.830	9,052,535.440	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	21,225	135.120	2,867,922.000	
TARGA RESOURCES CORP	36,212	197.470	7,150,783.640	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,578	192.720	3,387,632.160	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	40,549	75.530	3,062,665.970	
DOLLAR GENERAL CORP	35,900	71.590	2,570,081.000	
FORTINET INC	111,202	93.830	10,434,083.660	
HYATT HOTELS CORP	6,647	152.390	1,012,936.330	
TESLA INC	491,013	403.310	198,030,453.030	
ENPHASE ENERGY INC	21,539	66.870	1,440,312.930	
GENERAL MOTORS CO	188,091	49.930	9,391,383.630	
ALLY FINANCIAL INC	47,540	34.960	1,661,998.400	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	12,907	327.120	4,222,137.840	
PHILLIPS 66	70,901	115.980	8,223,097.980	
META PLATFORMS INC	373,062	608.330	226,944,806.460	
IQVIA HOLDINGS INC	30,188	204.640	6,177,672.320	
DIAMONDBACK ENERGY INC	32,925	177.610	5,847,809.250	
SERVICENOW INC	35,236	1,015.740	35,790,614.640	
PALO ALTO NETWORKS INC	109,898	167.820	18,443,082.360	
WORKDAY INC	36,785	246.000	9,049,110.000	
ABBVIE INC	302,055	176.740	53,385,200.700	
ZOETIS INC	77,646	166.320	12,914,082.720	
NEWS CORP/NEW-CL A	74,964	27.440	2,057,012.160	
CDW CORP	22,475	180.920	4,066,177.000	
HOWMET AEROSPACE INC	66,688	114.750	7,652,448.000	
TWILIO INC	25,710	107.960	2,775,651.600	
SNAP INC	174,273	12.150	2,117,416.950	
TRADE DESK INC A	76,348	117.890	9,000,665.720	
OKTA INC	25,106	83.490	2,096,099.940	
BAKER HUGHES CO	166,560	44.830	7,466,884.800	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	27,172	60.850	1,653,416.200	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	11.670	1,890,096.540	
BROADCOM INC	757,794	225.290	170,723,410.260	
ARES MANAGEMENT CORP	32,721	175.490	5,742,208.290	
MONGODB INC	12,304	240.190	2,955,297.760	
BURLINGTON STORES INC	10,565	284.900	3,009,968.500	
VEEVA SYSTEMS INC	26,583	212.840	5,657,925.720	
EVERGY INC	45,274	60.670	2,746,773.580	
ALLEGION PLC	13,423	128.260	1,721,633.980	
DAYFORCE INC	29,460	70.420	2,074,573.200	
STERIS PLC	17,428	207.370	3,614,044.360	
DOCUSIGN INC	35,627	90.020	3,207,142.540	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	25,991	458.540	11,917,913.140	
WIX.COM LTD	8,997	224.580	2,020,546.260	
KKR & CO INC	105,595	141.250	14,915,293.750	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	9,649	75.130	724,929.370	



ZOOM COMMUNICATIONS INC	44,913	78.820	3,540,042.660	
MODERNA INC	52,618	35.150	1,849,522.700	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	43,239	241.470	10,440,921.330	
CIGNA GROUP	48,437	282.450	13,681,030.650	
DELL TECHNOLOGIES INC	55,660	110.170	6,132,062.200	
DOW INC	126,892	39.670	5,033,805.640	
OVINTIV INC	48,592	44.600	2,167,203.200	
AMCOR PLC	265,013	9.520	2,522,923.760	
PINTEREST INC	105,039	30.410	3,194,235.990	
FOX CORP-A	36,501	48.190	1,758,983.190	
FOX CORP-B	27,507	45.940	1,263,671.580	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	39,834	341.460	13,601,717.640	
AVANTOR INC	107,376	22.020	2,364,419.520	
DYNATRACE INC	52,494	50.510	2,651,471.940	
CLOUDFLARE INC	52,012	110.710	5,758,248.520	
TRADEWEB MARKETS INC	20,579	129.980	2,674,858.420	
CARRIER GLOBAL CORP	135,070	67.110	9,064,547.700	
OTIS WORLDWIDE CORP	66,367	91.160	6,050,015.720	
UBER TECHNOLOGIES INC	323,711	65.700	21,267,812.700	
CORTEVA INC	116,431	59.930	6,977,709.830	
MATCH GROUP INC	44,764	31.170	1,395,293.880	
BLACKSTONE INC	123,530	165.770	20,477,568.100	
CARLYLE GROUP INC	42,691	50.540	2,157,603.140	
DATADOG INC	47,899	138.000	6,610,062.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	36,279	88.930	3,226,291.470	
VERTIV HOLDINGS CO	62,079	124.010	7,698,416.790	
INGERSOLL RAND INC	69,666	88.180	6,143,147.880	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	77,607	85.360	6,624,533.520	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	200.780	1,795,173.980	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	118,889	13.490	1,603,812.610	
DRAFTKINGS INC	75,786	39.830	3,018,556.380	
AON PLC	33,576	354.680	11,908,735.680	
WARNER BROS DISCOVERY INC	398,011	9.840	3,916,428.240	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	3,255	1,300.570	4,233,355.350	
BENTLEY SYSTEMS INC	27,315	45.360	1,239,008.400	
COINBASE GLOBAL INC	33,141	251.200	8,325,019.200	
AIRBNB INC	73,863	128.850	9,517,247.550	
CONSTELLATION ENERGY CORP	52,525	279.240	14,667,081.000	
MONDAY.COM LTD	6,356	213.000	1,353,828.000	
SOLVENTUM CORP	21,683	68.510	1,485,502.330	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	39,050	29.610	1,156,270.500	
APPROVIN CORP	35,297	315.680	11,142,556.960	
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	29.990	1,864,568.270	
ROBLOX CORP	78,921	61.370	4,843,381.770	

VIATRIS INC	218,432	11.800	2,577,497.600	
EXPAND ENERGY CORP	36,772	102.210	3,758,466.120	
BLACKROCK INC	25,071	955.010	23,943,055.710	
HF SINCLAIR CORP	25,560	36.850	941,886.000	
SNOWFLAKE INC	52,402	162.430	8,511,656.860	
DOORDASH INC	51,630	168.370	8,692,943.100	
ARISTA NETWORKS INC	180,816	112.640	20,367,114.240	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	69,129	154.800	10,701,169.200	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	53.090	843,759.370	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	347,172	64.980	22,559,236.560	
FNF GROUP	46,461	54.360	2,525,619.960	
JACOBS SOLUTIONS INC	21,170	134.280	2,842,707.600	
MARVELL TECHNOLOGY INC	147,444	115.150	16,978,176.600	
APA CORP	67,758	24.380	1,651,940.040	
LINDE PLC	80,865	421.430	34,078,936.950	
ROBINHOOD MARKETS INC	87,606	39.590	3,468,321.540	
U-HAUL HOLDING CO	16,864	62.460	1,053,325.440	
ASPEN TECHNOLOGY INC	5,007	249.060	1,247,043.420	
TOAST INC	68,531	35.110	2,406,123.410	
GE VERNOVA INC	46,675	366.810	17,120,856.750	
GRAB HOLDINGS LTD	369,622	4.500	1,663,299.000	
SYNCHRONY FINANCIAL	70,641	64.810	4,578,243.210	
VERALTO CORP	40,316	101.140	4,077,560.240	
SAMSARA INC	33,531	43.530	1,459,604.430	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	37,461	92.100	3,450,158.100	
BUNGE GLOBAL SA	21,715	81.990	1,780,412.850	
KENVUE INC	331,175	20.970	6,944,739.750	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	44.160	3,224,254.080	
CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	337.830	2,296,906.170	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	30,674	161.110	4,941,888.140	
HUBSPOT INC	8,416	699.140	5,883,962.240	
QORVO INC	14,144	71.910	1,017,095.040	
TE CONNECTIVITY PLC	52,304	141.160	7,383,232.640	
SMURFIT WESTROCK PLC	90,859	52.160	4,739,205.440	
FERGUSON ENTERPRISES INC	34,901	170.410	5,947,479.410	
LABCORP HOLDINGS INC	15,164	234.100	3,549,892.400	
APTIV PLC	43,097	60.610	2,612,109.170	
GODADDY INC	24,464	193.490	4,733,539.360	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	30,382	256.600	7,796,021.200	
TRANSUNION	31,262	88.290	2,760,121.980	
ALBERTSONS COS INC	54,086	20.660	1,117,416.760	
BLOCK INC	95,972	82.010	7,870,663.720	
DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	74.430	5,078,731.050	

	NUTANIX INC	44,547	62.610	2,789,087.670	
	CARVANA CO	19,502	194.510	3,793,334.020	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	35,323	73.750	2,605,071.250	
	KRAFT HEINZ CO	152,849	28.780	4,398,994.220	
	FORTIVE CORP	61,764	76.090	4,699,622.760	
	WASTE CONNECTIONS INC	43,910	176.690	7,758,457.900	
	ALPHABET INC-CL A	999,847	191.010	190,980,775.470	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	224,243	21.980	4,928,861.140	
	PAYPAL HOLDINGS INC	164,087	83.990	13,781,667.130	
	SEA LTD ADR	63,450	106.870	6,780,901.500	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	57,347	49.020	2,811,149.940	
	ZILLOW GROUP INC-C	27,351	70.830	1,937,271.330	
	ALPHABET INC-CL C	858,409	192.290	165,063,466.610	
	PURE STORAGE INC	50,378	62.590	3,153,159.020	
	ZSCALER INC	16,171	186.490	3,015,729.790	
	ATLASSIAN CORP PLC	27,526	236.240	6,502,742.240	
	ROKU INC	19,331	76.660	1,481,914.460	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	16,164	337.840	5,460,845.760	
	VISTRA CORP	59,614	162.130	9,665,217.820	
アメリカ・ドル	小計	62,985,300		8,621,332,263.900 (1,358,463,324,818)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	16.910	1,036,498.450	
	ASHTED GROUP	76,183	48.660	3,707,064.780	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	23.630	1,076,299.240	
	BARCLAYS PLC	2,537,586	2.607	6,615,486.700	
	BARRATT REDROW PLC	285,009	3.977	1,133,480.790	
	BT GROUP PLC	1,171,195	1.388	1,625,618.660	
	BUNZL PLC	53,979	33.100	1,786,704.900	
	AVIVA PLC	429,205	4.688	2,012,113.040	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	31.910	656,484.430	
	DIAGEO PLC	378,748	23.915	9,057,758.420	
	SCHRODERS PLC	110,366	3.078	339,706.540	
	DCC PLC	17,471	50.850	888,400.350	
	NATIONAL GRID PLC	841,197	9.158	7,703,682.120	
	KINGFISHER PLC	336,026	2.282	766,811.330	
	BAE SYSTEMS PLC	513,661	11.815	6,068,904.710	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	340,141	29.330	9,976,335.530	
	HALMA PLC	62,208	26.470	1,646,645.760	
	NEXT PLC	21,907	93.500	2,048,304.500	
	IMPERIAL BRANDS PLC	140,692	25.790	3,628,446.680	
	ANGLO AMERICAN PLC	219,763	24.525	5,389,687.570	
	COMPASS GROUP PLC	290,317	26.760	7,768,882.920	
	HSBC HOLDINGS PLC	3,114,559	7.983	24,863,524.490	

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	949,467	2.213	2,101,170.470	
CENTRICA PLC	793,776	1.358	1,077,947.800	
UNILEVER PLC	425,778	45.310	19,292,001.180	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,134	9.502	1,094,003.260	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	19.630	1,080,494.090	
PEARSON PLC	116,743	12.700	1,482,636.100	
PERSIMMON PLC	56,989	10.560	601,803.840	
PRUDENTIAL PLC	474,188	5.952	2,822,366.970	
RIO TINTO PLC	193,036	48.850	9,429,808.600	
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.669	2,396,962.100	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	114,964	48.920	5,624,038.880	
RELX PLC	316,084	37.650	11,900,562.600	
RENTOKIL INITIAL PLC	418,475	3.826	1,601,085.350	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,452,324	5.674	8,240,486.370	
NATWEST GROUP PLC	1,227,583	3.817	4,685,684.310	
SSE PLC	183,547	15.460	2,837,636.620	
BP PLC	2,765,335	4.312	11,924,124.520	
SAGE GROUP PLC(THE)	186,583	12.725	2,374,268.670	
SMITHS GROUP PLC	77,205	17.320	1,337,190.600	
SPIRAX GROUP PLC	17,230	64.550	1,112,196.500	
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	10.150	3,679,659.200	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,385,556	0.531	5,514,730.230	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.083	617,161.620	
TESCO PLC	1,122,991	3.602	4,045,013.580	
3I GROUP PLC	161,058	35.550	5,725,611.900	
SMITH & NEPHEW PLC	156,657	9.838	1,541,191.560	
GSK PLC	708,892	13.310	9,435,352.520	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	80,360	115.700	9,297,652.000	
WPP PLC	176,061	7.218	1,270,808.290	
ASTRAZENECA PLC	265,644	108.220	28,747,993.680	
WHITBREAD PLC	31,475	28.650	901,758.750	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	343,796	3.326	1,143,465.490	
INTERTEK GROUP PLC	29,397	48.000	1,411,056.000	
INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	100.250	2,694,118.500	
SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.528	671,960.090	
ADMIRAL GROUP PLC	40,084	25.240	1,011,720.160	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	15,910	35.400	563,214.000	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	34,042	20.080	683,563.360	
EXPERIAN PLC	153,056	34.320	5,252,881.920	
MONDI PLC	67,554	11.610	784,301.940	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,623	11.020	723,165.460	

	INFORMA PLC	223,961	7.868	1,762,125.140	
	GLENCORE PLC	1,805,454	3.639	6,570,047.100	
	ENTAIN PLC	96,924	6.242	604,999.600	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	27.340	848,496.900	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	4.810	653,332.680	
	M&G PLC	454,395	1.910	867,894.450	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	14.850	416,913.750	
	WISE PLC	96,207	10.430	1,003,439.010	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	0.963	367,934.370	
	HALEON PLC	1,339,534	3.682	4,932,164.180	
	SHELL PLC	1,062,829	26.630	28,303,136.270	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	7.642	1,094,242.690	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	5.572	1,204,242.920	
イギリス・ポンド 小計		45,668,869		327,158,660.050 (62,942,054,607)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	228,416	46.190	10,550,535.040	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	44.700	10,687,010.100	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,599	1,061.600	5,943,898.400	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	244,057	25.790	6,294,230.030	
	ICL GROUP LTD	103,067	19.760	2,036,603.920	
	NICE LTD	10,202	596.600	6,086,513.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	165.000	4,858,260.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	304.500	1,422,624.000	
イスラエル・シュケル 小計		864,540		47,879,674.690 (2,077,973,094)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	33.580	950,515.480	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	588,905	31.870	18,768,402.350	
	FORTESCUE LTD	272,505	17.980	4,899,639.900	
	TELSTRA GROUP LTD	843,086	4.050	3,414,498.300	
	ASX LTD	31,215	64.030	1,998,696.450	
	BHP GROUP LTD	859,598	39.590	34,031,484.820	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	34.100	3,124,378.400	
	CSL LIMITED	83,144	280.000	23,280,320.000	
	REA GROUP LTD	9,317	235.900	2,197,880.300	
	TRANSURBAN GROUP	520,681	13.580	7,070,847.980	
	COCHLEAR LTD	10,446	302.240	3,157,199.040	
	ORIGIN ENERGY LTD	326,442	11.190	3,652,885.980	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	286,428	152.760	43,754,741.280	
	RIO TINTO LIMITED	61,394	118.790	7,292,993.260	
	APA GROUP	222,829	6.850	1,526,378.650	
	ARISTOCRAT LEISU	96,033	70.740	6,793,374.420	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	444,982	8.400	3,737,848.800	
PRO MEDICUS LTD	11,011	254.010	2,796,904.110		

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	69,336	49.390	3,424,505.040	
ORICA LTD	91,188	16.910	1,541,989.080	
BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	19.080	1,461,279.960	
MACQUARIE GROUP LTD	62,407	225.580	14,077,771.060	
SUNCORP GROUP LTD	231,189	19.170	4,431,893.130	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	526,873	37.220	19,610,213.060	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	9.310	1,048,855.290	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	255,447	19.090	4,876,483.230	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	191,685	16.780	3,216,474.300	
REECE LTD	31,558	22.120	698,062.960	
SANTOS LTD	582,512	7.120	4,147,485.440	
SONIC HEALTHCARE	88,200	27.630	2,436,966.000	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	32.870	1,295,735.400	
WESFARMERS LTD	195,200	70.960	13,851,392.000	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	319,683	25.770	8,238,230.910	
WOOLWORTHS GROUP LTD	203,840	30.100	6,135,584.000	
SEEK LTD	58,513	21.420	1,253,348.460	
MINERAL RESOURCES LTD	28,865	35.080	1,012,584.200	
BRAMBLES LTD	220,767	19.280	4,256,387.760	
CAR GROUP LTD	58,310	37.500	2,186,625.000	
SGH LTD	28,600	45.470	1,300,442.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	10.540	1,421,951.400	
XERO LTD	23,149	165.420	3,829,307.580	
LOTTERY CORP LTD	366,780	4.860	1,782,550.800	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	4.120	962,596.800	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	511,608	28.900	14,785,471.200	
MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.770	1,556,071.270	
SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.370	2,300,827.060	
COLES GROUP LTD	230,734	18.810	4,340,106.540	
WISETECH GLOBAL LTD	33,648	121.020	4,072,080.960	
オーストラリア・ドル 小計	10,890,743		308,002,261.410 (30,008,660,329)	
カナダ・ドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	83,530	118.610	9,907,493.300	
BARRICK GOLD CORP	302,207	22.260	6,727,127.820	
BANK OF MONTREAL	125,699	139.460	17,529,982.540	
BANK OF NOVA SCOTIA	207,973	72.800	15,140,434.400	
NATIONAL BANK OF CANADA	56,424	131.850	7,439,504.400	
BCE INC	14,197	33.380	473,895.860	
BROOKFIELD CORP	237,262	79.050	18,755,561.100	
SAPUTO INC	34,582	23.310	806,106.420	

DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	17,471	159.640	2,789,070.440	
CGI INC	34,495	155.350	5,358,798.250	
CCL INDUSTRIES INC	27,743	71.830	1,992,779.690	
CAE INC	55,407	33.870	1,876,635.090	
CAMECO CORP	73,563	70.240	5,167,065.120	
ROGERS COMM-CL B	62,818	42.260	2,654,688.680	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	161,399	89.050	14,372,580.950	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	363,414	45.450	16,517,166.300	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	160.930	1,434,047.230	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	33.880	553,260.400	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	92,199	144.320	13,306,159.680	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,175	69.050	1,462,133.750	
OPEN TEXT CORP	40,459	39.130	1,583,160.670	
EMPIRE CO LTD	20,608	43.520	896,860.160	
KINROSS GOLD CORP	192,737	14.500	2,794,686.500	
RB GLOBAL INC	31,137	128.640	4,005,463.680	
FORTIS INC	82,632	58.620	4,843,887.840	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	117,480	19.520	2,293,209.600	
TELUS CORP	31,890	19.870	633,654.300	
GREAT WEST LIFECO INC	43,551	46.000	2,003,346.000	
IMPERIAL OIL LTD	32,165	95.830	3,082,371.950	
ENBRIDGE INC	371,797	62.470	23,226,158.590	
IGM FINANCIAL INC	12,478	43.480	542,543.440	
MANULIFE FINANCIAL CORP	302,871	42.530	12,881,103.630	
LOBLAW CO LTD	24,803	181.360	4,498,272.080	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	125,335	75.250	9,431,458.750	
MAGNA INTERNATIONAL INC	55,589	58.180	3,234,168.020	
SUN LIFE FINANCIAL INC	96,171	82.410	7,925,452.110	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,425	1,935.500	6,629,087.500	
METRO INC	35,059	90.210	3,162,672.390	
EMERA INC	44,643	51.850	2,314,739.550	
ONEX CORP	10,157	108.500	1,102,034.500	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	29.660	1,642,363.180	
POWER CORP OF CANADA	89,864	42.280	3,799,449.920	
QUEBECOR INC-B	30,598	31.750	971,486.500	
ROYAL BANK OF CANADA	241,440	170.810	41,240,366.400	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	158,520	106.190	16,833,238.800	
STANTEC INC	18,358	110.260	2,024,153.080	
SUNCOR ENERGY INC	221,204	56.730	12,548,902.920	
LUNDIN MINING CORP	119,660	12.130	1,451,475.800	
TECK RESOURCES LTD-CL B	82,129	60.760	4,990,158.040	
THOMSON REUTERS CORP	27,621	223.170	6,164,178.570	

TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	114.880	1,504,583.360		
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	299,353	78.180	23,403,417.540		
TC ENERGY CORP	177,069	66.150	11,713,114.350		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	122.550	992,900.100		
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	218.430	2,149,132.770		
INTACT FINANCIAL CORP	31,315	252.160	7,896,390.400		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	82,315	80.250	6,605,778.750		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,467	4,298.370	14,902,448.790		
FRANCO-NEVADA CORP NPR	34,326	178.970	6,143,324.220		
TOURMALINE OIL CORP	59,089	67.610	3,995,007.290		
KEYERA CORP	39,997	43.690	1,747,468.930		
PARKLAND CORP	24,129	34.250	826,418.250		
ALTAGAS LTD	47,249	33.790	1,596,543.710		
PEMBINA PIPELINE CORP	94,699	52.290	4,951,810.710		
DOLLARAMA INC	49,948	135.800	6,782,938.400		
MEG ENERGY CORP	47,181	23.700	1,118,189.700		
CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	21.980	4,984,338.660		
ARC RESOURCES LTD	96,301	27.100	2,609,757.100		
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	73,200	28.180	2,062,776.000		
TMX GROUP LTD	46,884	42.970	2,014,605.480		
IVANHOE MINES LTD	136,822	16.670	2,280,822.740		
NUTRIEN LTD	90,212	73.720	6,650,428.640		
TFI INTERNATIONAL INC	14,528	191.910	2,788,068.480		
WSP GLOBAL INC	22,489	238.230	5,357,554.470		
IA FINANCIAL CORP INC	16,448	128.900	2,120,147.200		
GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	63.590	2,268,064.530		
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	60,033	74.750	4,487,466.750		
AIR CANADA	41,858	21.240	889,063.920		
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28,942	38.130	1,103,558.460		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	51,117	87.710	4,483,472.070		
SHOPIFY INC	205,818	146.470	30,146,162.460		
FIRSTSERVICE CORP	7,857	252.270	1,982,085.390		
HYDRO ONE LTD	56,437	42.870	2,419,454.190		
カナダ・ドル 小計	6,949,108		507,991,889.700 (55,680,991,030)		
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	289,800	4.610	1,335,978.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	162,200	5.510	893,722.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	340,281	44.070	14,996,183.670	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	12.120	1,695,588.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.730	555,670.890	



	KEPPEL LTD	249,600	6.760	1,687,296.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	570,598	16.970	9,683,048.060	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	3.120	4,183,389.600	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.320	1,542,080.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	218,866	36.800	8,054,268.800	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.010	778,085.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	508,500	2.950	1,500,075.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.450	992,960.500	
	シンガポール・ドル 小計	5,489,558		47,898,345.520 (5,510,704,652)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	77.900	1,848,878.600	
	NESTLE SA-REGISTERED	449,530	74.240	33,373,107.200	
	CIE FINANC RICHEMONT	92,164	138.450	12,760,105.800	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	119,501	264.900	31,655,814.900	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,599	245.600	1,866,314.400	
	SIKA INHABER	25,179	217.400	5,473,914.600	
	SGS SA-REG	27,911	92.520	2,582,325.720	
	NOVARTIS AG-REG SHS	336,907	90.790	30,587,786.530	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,117	164.500	1,335,246.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	717	1,097.000	786,549.000	
	CLARIANT AG-REG	45,795	10.060	460,697.700	
	SWISSCOM AG-REG	4,457	507.500	2,261,927.500	
	ABB LTD	270,739	48.630	13,166,037.570	
	ADECCO GROUP AG-REG	26,454	20.740	548,655.960	
	GEBERIT AG	6,081	494.400	3,006,446.400	
	LONZA GROUP AG-REG	12,043	544.400	6,556,209.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	161	9,800.000	1,577,800.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	97,000.000	1,940,000.000	
	GIVAUDAN-REG	1,589	3,885.000	6,173,265.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	24,695	525.200	12,969,814.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	6,123	282.600	1,730,359.800	
	HOLCIM LTD	86,530	84.320	7,296,209.600	
	TEMENOS GROUP	10,930	67.400	736,682.000	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	55.800	260,753.400	
	SONOVA HOLDING AG	8,100	299.600	2,426,760.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,251	201.300	1,660,926.300	
	STRAUMANN HOLDING AG	19,254	116.650	2,245,979.100	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	156.000	670,800.000	
	HELVETIA HOLDING AG	7,946	153.900	1,222,889.400	
	SCHINDLER NAMEN	3,789	243.000	920,727.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	701.000	3,156,603.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	87.750	430,238.250	

	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	614.500	765,052.500	
	SWISS PRIME SITE AG	13,356	100.700	1,344,949.200	
	AVOLTA AG	12,933	35.240	455,758.920	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,730	1,281.000	4,778,130.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	38,960	58.260	2,269,809.600	
	SWISS RE LTD	52,324	131.100	6,859,676.400	
	BKW AG	3,194	153.800	491,237.200	
	SIG GROUP AG	50,969	18.870	961,785.030	
	ALCON INC	86,889	76.040	6,607,039.560	
	SANDOZ GROUP AG	65,523	38.650	2,532,463.950	
	GALDERMA GROUP AG	14,716	106.980	1,574,317.680	
	UBS GROUP AG	559,306	29.300	16,387,665.800	
	VAT GROUP AG	5,180	333.200	1,725,976.000	
スイス・フラン	小計	2,561,020		240,443,686.270 (41,325,056,359)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	456,651	174.850	79,845,427.350	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	266,320	155.950	41,532,604.000	
	ERICSSON LM-B SHS	465,668	89.660	41,751,792.880	
	GETINGE AB-B SHS	38,925	187.050	7,280,921.250	
	LUNDBERGS B	14,872	501.500	7,458,308.000	
	SKF AB-B SHS	66,600	209.700	13,966,020.000	
	SANDVIK AB	186,658	202.200	37,742,247.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	250,203	156.750	39,219,320.250	
	SKANSKA AB-B SHS	62,329	225.100	14,030,257.900	
	SWEDBANK AB	132,581	228.300	30,268,242.300	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,795	143.400	13,306,803.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	260,610	118.750	30,947,437.500	
	TRELLEBORG AB-B SHS	37,154	389.000	14,452,906.000	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	276.800	6,698,006.400	
	VOLVO AB-B SHS	282,769	276.500	78,185,628.500	
	HOLMEN AB-B SHS	19,972	419.600	8,380,251.200	
	TELE2 AB-B SHS	100,027	106.700	10,672,880.900	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	360.600	5,514,295.200	
	INDUSTRIVARDEN C	31,300	360.500	11,283,650.000	
	SAAB AB-B	47,156	229.500	10,822,302.000	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	134.650	10,244,845.250	
	INVESTOR AB-B SHS	288,459	297.500	85,816,552.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	143.750	15,046,168.750	
	ASSA ABLOY AB-B	172,830	316.900	54,769,827.000	
	TELIA CO AB	344,810	30.470	10,506,360.700	
	BOLIDEN AB	53,939	328.000	17,691,992.000	
	ALFA LAVAL AB	44,407	461.800	20,507,152.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	117,966	69.420	8,189,199.720	
	INDUTRADE AB	39,178	273.800	10,726,936.400	

	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	39.770	8,464,328.640	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	320.800	11,671,024.800	
	HEXAGON AB-B SHS	363,839	106.400	38,712,469.600	
	SAGAX AB	44,607	210.800	9,403,155.600	
	EPIROC AB-A	125,482	191.950	24,086,269.900	
	EPIROC AB-B	61,487	170.100	10,458,938.700	
	ESSITY AB-B	99,980	290.400	29,034,192.000	
	EQT AB	68,460	306.400	20,976,144.000	
	ADDTECH AB	47,848	288.200	13,789,793.600	
	BEIJER REF AB	50,493	152.400	7,695,133.200	
	LIFCO AB	39,631	316.600	12,547,174.600	
	EVOLUTION AB	33,386	844.600	28,197,815.600	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	270.300	7,470,551.400	
スウェーデン・クローナ 小計		5,306,487		959,365,328.790 (13,431,114,603)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	15,167	671.200	10,180,090.400	
	A P MOLLER A/S	663	10,625.000	7,044,375.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	10,420.000	5,658,060.000	
	DANSKE BANK A/S	113,672	212.100	24,109,831.200	
	GENMAB A/S	11,219	1,563.000	17,535,297.000	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	59,656	400.900	23,916,090.400	
	ROCKWOOL AS	1,677	2,432.000	4,078,464.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	550,407	613.100	337,454,531.700	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	169,829	95.540	16,225,462.660	
	COLOPLAST-B	21,291	797.000	16,968,927.000	
	DSV A/S	34,993	1,509.500	52,821,933.500	
	DEMANT A/S	17,700	283.200	5,012,640.000	
	TRYG A/S	58,222	152.100	8,855,566.200	
	ZEALAND PHARMA A/S	11,566	699.000	8,084,634.000	
	PANDORA A/S	12,473	1,269.500	15,834,473.500	
ORSTED A/S	31,744	292.300	9,278,771.200		
デンマーク・クローネ 小計		1,110,822		563,059,147.760 (12,184,599,958)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	229,726	8.450	1,941,184.700	
	FISHER & PAYKEL	95,209	37.550	3,575,097.950	
	INFRATIL LTD	167,377	11.690	1,956,637.130	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	175,979	5.850	1,029,477.150	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.950	1,423,882.600	
ニュージーランド・ドル 小計		907,599		9,926,279.530 (875,894,906)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	193.550	14,151,988.900	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	65.320	14,447,608.240	
	TELENOR ASA	119,422	127.900	15,274,073.800	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	14,874	1,219.000	18,131,406.000	
	ORKLA ASA	116,068	99.000	11,490,732.000	

	EQUINOR ASA	141,333	298.100	42,131,367.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	317.200	9,330,120.800	
	AKER BP ASA	55,995	256.100	14,340,319.500	
	SALMAR ASA	12,897	537.500	6,932,137.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	206.200	5,303,670.200	
	DNB BANK ASA	143,909	232.100	33,401,278.900	
ノルウェー・クローネ 小計		953,933		184,934,703.140 (2,552,098,903)	
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	25,025	91.200	2,282,280.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	24,704	64.750	1,599,584.000	
	AIR LIQUIDE	99,553	156.480	15,578,053.440	
	AIRBUS SE	101,352	155.440	15,754,154.880	
	AXA SA	294,074	33.480	9,845,597.520	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	124,161	26.380	3,275,367.180	
	ADIDAS AG	28,260	238.800	6,748,488.000	
	GENERALI	167,223	28.260	4,725,721.980	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	206.200	643,344.000	
	DANONE	112,535	63.980	7,199,989.300	
	SAFRAN SA	62,357	218.900	13,649,947.300	
	INTESA SANPAOLO	2,497,503	3.961	9,892,609.380	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	53,290	76.220	4,061,763.800	
	ACCOR SA	31,427	46.820	1,471,412.140	
	BOUYGUES	29,123	28.870	840,781.010	
	BPER BANCA SPA	205,147	6.316	1,295,708.450	
	BNP PARIBAS	169,516	59.640	10,109,934.240	
	THALES SA	15,023	144.100	2,164,814.300	
	CAPGEMINI SA	27,456	156.050	4,284,508.800	
	LOTUS BAKERIES NV	77	10,520.000	810,040.000	
	UNICREDIT SPA	248,386	40.315	10,013,681.590	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	141.000	1,748,823.000	
	D' IETEREN TRDG	4,146	154.300	639,727.800	
	COMMERZBANK AG	179,069	16.720	2,994,033.680	
	EIFFAGE	12,706	82.320	1,045,957.920	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	68,521	34.540	2,366,715.340	
	PUBLICIS GROUPE	40,360	98.340	3,969,002.400	
	IBERDROLA SA	1,034,264	13.135	13,585,057.640	
	ENI SPA	382,505	13.872	5,306,109.360	
	JERONIMO MARTINS	45,606	18.370	837,782.220	
	KESKO OYJ-B	56,685	17.470	990,286.950	
	KBC GROUPE	40,769	72.100	2,939,444.900	
HANNOVER RUECK SE	9,638	247.600	2,386,368.800		
WARTSILA OYJ	77,148	17.770	1,370,919.960		
L'OREAL	41,234	328.400	13,541,245.600		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	46,768	646.400	30,230,835.200		
GEA GROUP AG	25,513	48.280	1,231,767.640		

BOLLORE	114,808	5.800	665,886.400	
MEDIOBANCA SPA	86,792	14.465	1,255,446.280	
MICHELIN(CGDE) -B	109,281	30.900	3,376,782.900	
CONTINENTAL AG	17,635	64.060	1,129,698.100	
DEUTSCHE POST AG-REG	176,018	33.530	5,901,883.540	
OMV AG	23,354	39.140	914,075.560	
VERBUND AG	10,663	70.650	753,340.950	
PERNOD-RICARD	33,037	104.750	3,460,625.750	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	35.880	836,398.680	
RENAULT SA	27,902	45.820	1,278,469.640	
REPSOL SA	195,049	11.900	2,321,083.100	
MERCK KGAA	22,842	140.650	3,212,727.300	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	76,705	83.700	6,420,208.500	
RWE AG	114,655	28.580	3,276,839.900	
SEB SA	2,596	82.750	214,819.000	
SOCIETE GENERALE-A	116,635	27.235	3,176,554.220	
VINCI S.A.	88,100	98.760	8,700,756.000	
SODEXO	12,910	72.500	935,975.000	
SOFINA	2,281	217.600	496,345.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	93,897	248.000	23,286,456.000	
SAP SE	178,153	243.900	43,451,516.700	
TELEFONICA S.A	755,720	3.906	2,951,842.320	
TOTALENERGIES SE	363,897	55.920	20,349,120.240	
E.ON SE	374,168	10.500	3,928,764.000	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	73.150	1,308,360.900	
SIEMENS AG-REG	128,644	193.180	24,851,447.920	
UPM-KYMMENE OYJ	106,964	27.170	2,906,211.880	
ING GROEP NV-CVA	562,986	15.538	8,747,676.460	
PUMA AG	17,210	41.520	714,559.200	
BAYER AG	173,835	20.035	3,482,784.220	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	9.730	933,885.400	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	29,704	83.060	2,467,214.240	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	129,331	55.450	7,171,403.950	
BASF SE	156,165	41.830	6,532,381.950	
BEIERSDORF AG	15,743	126.100	1,985,192.300	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	52,919	12.000	635,028.000	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	123.150	2,658,315.900	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	43.430	1,460,637.760	
ASM INTERNATIONAL NV	7,821	586.000	4,583,106.000	
ORANGE	344,524	9.826	3,385,292.820	
SAMPO OYJ-A SHS	82,999	38.760	3,217,041.240	
RANDSTAD NV	15,584	38.780	604,347.520	
ALLIANZ SE	67,192	293.900	19,747,728.800	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	3.039	1,536,035.190	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	162,715	32.300	5,255,694.500	
HERMES INTL	5,491	2,353.000	12,920,323.000	
ENDESA S.A.	50,946	20.650	1,052,034.900	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	5.560	604,077.320	
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	60.160	3,403,491.840	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	22,488	483.600	10,875,196.800	
ARCELOR MITTAL (NL)	88,596	21.750	1,926,963.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	111,221	33.970	3,778,177.370	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	47.280	1,647,046.080	
RHEINMETALL STAMM	7,339	644.800	4,732,187.200	
HEINEKEN NV	47,066	64.600	3,040,463.600	
AKZO NOBEL	34,237	55.360	1,895,360.320	
ASML HOLDING NV	68,508	711.500	48,743,442.000	
AEGON LTD	232,433	5.900	1,371,354.700	
VOLKSWAGEN AG PFD	33,164	90.900	3,014,607.600	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	998,628	10.245	10,230,943.860	
KERING	12,764	227.400	2,902,533.600	
ACCIONA S.A.	5,005	106.000	530,530.000	
FORTUM OYJ	73,699	13.845	1,020,362.650	
AGEAS	24,086	46.500	1,119,999.000	
UCB SA	22,227	191.250	4,250,913.750	
NEMETSCHEK SE	10,222	94.600	967,001.200	
CARREFOUR SA	90,642	13.875	1,257,657.750	
NOKIA OYJ	934,221	4.346	4,060,124.460	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	141,413	25.060	3,543,809.780	
WOLTERS KLUWER-CVA	41,015	163.750	6,716,206.250	
SANOFI	193,631	94.970	18,389,136.070	
STMICROELECTRONICS NV	110,999	23.420	2,599,596.580	
ELISA OYJ	20,242	41.200	833,970.400	
BANCO SANTANDER SA	2,590,110	4.588	11,883,424.680	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	16.020	1,050,735.780	
QIAGEN N.V.	34,544	44.740	1,545,498.560	
DEUTSCHE BANK AG-REG	338,007	17.028	5,755,583.190	
BMW VORZUG	7,821	71.550	559,592.550	
ENEL SPA	1,407,627	6.885	9,691,511.890	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	599,449	29.850	17,893,552.650	
SARTORIUS AG	4,533	243.300	1,102,878.900	
LEONARDO SPA	64,915	27.400	1,778,671.000	
CTS EVENTIM AG	11,578	86.550	1,002,075.900	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	219,873	32.460	7,137,077.580	
RATIONAL AG	860	798.500	686,710.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	7,150	46.620	333,333.000	
BECHTLE AG	14,521	30.660	445,213.860	
KONINKLIJKE KPN NV	708,323	3.548	2,513,130.000	

EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	49.010	1,129,092.380	
TELEPERFORMANCE	9,581	82.200	787,558.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	32,080	225.900	7,246,872.000	
EURAZEO	5,673	75.150	426,325.950	
BANCO SABADELL	905,307	2.061	1,865,837.720	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	65.350	844,191.300	
HEINEKEN HOLDING NV-A	25,357	55.250	1,400,974.250	
INDITEX	185,535	48.910	9,074,516.850	
ESSILORLUXOTTICA	50,566	233.400	11,802,104.400	
SNAM SPA	317,518	4.344	1,379,298.190	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	13.420	2,240,079.820	
TENARIS SA	76,002	19.070	1,449,358.140	
TELECOM ITALIA SPA	1,970,516	0.255	502,481.580	
TERNA SPA	207,655	7.622	1,582,746.410	
BIOMERIEUX	9,417	110.000	1,035,870.000	
GRIFOLS SA	53,226	8.780	467,324.280	
NESTE OYJ	66,248	12.700	841,349.600	
RECORDATI SPA	18,197	52.600	957,162.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	156,478	5.572	871,895.410	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	324.100	2,817,077.200	
KONE OYJ	54,590	45.520	2,484,936.800	
ELIA GROUP	4,078	62.450	254,671.100	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,801	203.800	978,443.800	
ENGIE	302,123	15.795	4,772,032.780	
ALSTOM	70,027	19.635	1,374,980.140	
IPSEN SA	5,964	119.300	711,505.200	
ARKEMA SA	10,489	71.850	753,634.650	
LEGRAND SA	45,141	95.580	4,314,576.780	
AMPLIFON SPA	20,249	25.830	523,031.670	
ADP	6,104	106.500	650,076.000	
ORION OYJ	22,095	44.590	985,216.050	
METSO CORPORATION	102,831	8.742	898,948.600	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	16.350	1,301,214.750	
SYMRISE AG	22,612	99.600	2,252,155.200	
REXEL SA	33,916	24.400	827,550.400	
PRYSMIAN SPA	45,653	63.860	2,915,400.580	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	101.450	246,422.050	
CAIXABANK	670,111	5.702	3,820,972.920	
BUREAU VERITAS SA	54,064	29.660	1,603,538.240	
GETLINK	65,097	14.990	975,804.030	
EDP RENOVAVEIS SA	92,750	9.080	842,170.000	
AMADEUS IT GROUP SA	75,491	67.900	5,125,838.900	
BRENNTAG SE	21,559	55.220	1,190,487.980	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	16.570	709,792.520	
EDENRED	42,160	30.970	1,305,695.200	
TALANX AG	10,349	81.250	840,856.250	

LEG IMMOBILIEN SE	11,915	74.700	890,050.500	
VONOVIA SE	120,979	27.130	3,282,160.270	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	8.990	1,475,762.440	
KNORR-BREMSE AG	10,342	68.250	705,841.500	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	50.740	2,281,371.880	
FERRARI NV	20,905	406.900	8,506,244.500	
ASR NEDERLAND NV	27,365	45.420	1,242,918.300	
AIB GROUP PLC	293,677	5.535	1,625,502.190	
NORDEA BANK ABP	541,540	10.980	5,946,109.200	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	35.860	620,126.980	
MONCLER SPA	43,309	53.420	2,313,566.780	
NEXI SPA	83,576	5.046	421,724.490	
PROSUS NV	232,662	33.255	7,737,174.810	
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	59.720	1,097,116.120	
JDE PEET'S BV	14,385	16.950	243,825.750	
EXOR NV	16,552	88.250	1,460,714.000	
SIEMENS ENERGY AG	111,218	49.230	5,475,262.140	
INPOST SA	36,721	16.100	591,208.100	
EURONEXT NV	14,077	106.200	1,494,977.400	
IMCD NV	9,332	134.200	1,252,354.400	
NN GROUP NV	43,478	41.430	1,801,293.540	
FINECOBANK SPA	96,393	17.010	1,639,644.930	
ARGENX SE	10,592	646.800	6,850,905.600	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	141,064	24.060	3,393,999.840	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	83,468	37.620	3,140,066.160	
DSM-FIRMENICH AG	32,472	94.920	3,082,242.240	
SYENSQO SA	11,217	69.010	774,085.170	
ZALANDO SE	42,234	28.220	1,191,843.480	
COVESTRO AG	34,369	59.000	2,027,771.000	
STELLANTIS NV	363,425	12.040	4,375,637.000	
FERROVIAL SE	84,753	39.540	3,351,133.620	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	39,582	20.600	815,389.200	
IBERDROLA SA-RTS	1,034,264	0.224	231,675.130	
AENA SME SA	11,603	195.500	2,268,386.500	
CELLNEX TELECOM SAU	84,967	28.720	2,440,252.240	
BANCO BPM SPA	202,727	7.992	1,620,194.180	
ABN AMRO BANK NV	75,982	15.615	1,186,458.930	
SCOUT24 SE	15,599	87.200	1,360,232.800	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	151,636	45.460	6,893,372.560	
POSTE ITALIANE SPA	89,785	13.850	1,243,522.250	
AMUNDI SA	11,288	61.000	688,568.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	44,691	9.610	429,480.510	
ADYEN NV	3,621	1,390.800	5,036,086.800	
DELIVERY HERO SE	34,547	28.600	988,044.200	
ユーロ 小計	32,586,280		875,594,688.270	



			(141,347,250,527)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	281,796	63.450	17,879,956.200
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	54.050	5,043,621.700
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	209,391	275.400	57,666,281.400
	MTR CORP	338,941	24.150	8,185,425.150
	HANG SENG BANK LTD	122,096	91.550	11,177,888.800
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	21.900	6,525,586.800
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	51.300	10,917,666.000
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	21.000	4,242,000.000
	HONG KONG & CHINA GAS	1,947,406	5.900	11,489,695.400
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	32.050	10,797,773.200
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	24.450	16,638,102.750
	SINO LAND CO	659,200	7.590	5,003,328.000
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	248,565	70.100	17,424,406.500
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	68.200	3,615,964.000
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	240,156	97.700	23,463,241.200
	AIA GROUP LTD	1,903,316	52.150	99,257,929.400
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	9.610	7,660,476.960
	SANDS CHINA LTD	335,800	18.760	6,299,608.000
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	19.880	2,783,200.000
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	18.520	4,743,620.200
WH GROUP LTD	1,550,000	5.800	8,990,000.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	427,945	39.800	17,032,211.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	379,695	31.200	11,846,484.000	
香港・ドル 小計	11,714,103		368,684,466.660 (7,462,173,605)	
合計	187,988,362		1,733,861,897,391 (1,733,861,897,391)	

## (2) 株式以外の有価証券

2025年1月14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	GOODMAN GROUP	295,264.000	10,815,520.320	
		GPT GROUP	349,447.000	1,527,083.390	

		MIRVAC GROUP	700,332.000	1,281,607.560	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,905,598.080	
		STOCKLAND	369,843.000	1,753,055.820	
		VICINITY CENTRES	919,737.000	1,931,447.700	
	オーストラリア・ドル 小計		3,460,077.000	20,214,312.870 (1,969,480,503)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,201,431.000	2,330,776.140	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,570,470.460	
	シンガポール・ドル 小計		1,812,509.000	3,901,246.600 (448,838,421)	
投資信託受益証券 合計			5,272,586	2,418,318,924 (2,418,318,924)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,674.000	2,702,919.580	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,806,752.850	
		AMERICAN TOWER CORP	79,561.000	14,077,523.340	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	105,024.000	1,903,034.880	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,527.000	5,076,656.060	
		BXP INC	24,473.000	1,696,468.360	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,881,582.660	
		CROWN CASTLE INC	72,473.000	6,213,110.290	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	54,719.000	9,407,290.480	
		EQUINIX INC	16,266.000	14,633,706.900	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,125.000	2,219,831.250	
		EQUITY RESIDENTIAL	60,317.000	4,174,539.570	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,587.000	3,278,541.650	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	36,738.000	5,415,181.200	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	41,252.000	1,914,917.840	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	117,820.000	2,356,400.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	1,894,721.400	
		INVITATION HOMES INC	96,467.000	2,984,688.980	
		IRON MOUNTAIN INC	48,519.000	4,960,582.560	
		KIMCO REALTY	111,968.000	2,471,133.760	
		MID AMERICA	20,193.000	3,032,786.670	
		PROLOGIS INC	157,805.000	16,627,912.850	
		PUBLIC STORAGE	27,252.000	7,909,620.480	
		REALTY INCOME CORP	153,660.000	8,062,540.200	
		REGENCY CENTERS CORP	27,176.000	1,922,973.760	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	18,280.000	3,563,868.800	
SIMON PROPERTY GROUP INC	55,804.000	9,642,931.200			
SUN COMMUNITIES INC	21,879.000	2,673,832.590			
UDR INC	50,449.000	2,067,400.020			

	VENTAS INC	68,228.000	3,957,224.000	
	VICI PROPERTIES INC	184,246.000	5,293,387.580	
	WELLTOWER INC	105,624.000	13,279,049.280	
	WEYERHAEUSER CO	131,923.000	3,780,913.180	
	WP CAREY INC	42,337.000	2,265,029.500	
アメリカ・ドル 小計		2,205,627.000	175,149,053.720 (27,598,236,395)	
イギリス・ボンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	647,375.570	
	SEGRO PLC	207,676.000	1,393,090.600	
イギリス・ボンド 小計		329,021.000	2,040,466.170 (392,565,286)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	24,471.000	1,012,120.560	
カナダ・ドル 小計		24,471.000	1,012,120.560 (110,938,535)	
ユーロ	COVIVIO	15,284.000	707,343.520	
	GECINA SA	8,697.000	756,204.150	
	KLEPIERRE	36,407.000	1,003,376.920	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,477.000	1,317,779.640	
	WAREHOUSES DE PAUW	31,043.000	572,743.350	
ユーロ 小計		109,908.000	4,357,447.580 (703,422,763)	
香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	12,877,642.400	
香港・ドル 小計		410,116.000	12,877,642.400 (260,643,482)	
投資証券 合計		3,079,143	29,065,806,461 (29,065,806,461)	
合計			31,484,125,385 (31,484,125,385)	

(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 569銘柄	74.88	-	-	-	78.52
	投資証券 34銘柄	-	-	-	1.52	
イギリス・ボンド	株式 76銘柄	3.47	-	-	-	3.59
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.02	
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	0.11	-	-	-	0.12
オーストラリア・ドル	株式 48銘柄	1.65	-	-	-	1.81
	投資信託受益証 券 6銘柄	-	-	0.11	-	

カナダ・ドル	株式	83銘柄	3.07	-	-	-	3.16
	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	13銘柄	0.30	-	-	-	0.34
	投資信託受益証券	2銘柄	-	-	0.02	-	
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.28	-	-	-	2.34
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	0.74	-	-	-	0.76
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.67	-	-	-	0.69
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	215銘柄	7.79	-	-	-	8.05
	投資証券	5銘柄	-	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	23銘柄	0.41	-	-	-	0.44
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.01	

(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)

2025年1月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,113,701,390
コール・ローン	1,005,851,927
国債証券	267,368,681,692
派生商品評価勘定	593,364
未収利息	2,247,247,496
前払費用	251,255,244
流動資産合計	271,987,331,113
資産合計	271,987,331,113
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	54,958
未払金	1,696,416,563
未払解約金	42,534,000
流動負債合計	1,739,005,521
負債合計	1,739,005,521
純資産の部	
元本等	
元本	111,389,638,247
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	158,858,687,345
元本等合計	270,248,325,592
純資産合計	270,248,325,592
負債純資産合計	271,987,331,113

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	107,965,110,236円
同期中追加設定元本額	45,972,952,212円
同期中一部解約元本額	42,548,424,201円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,695,567,237円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	1,342,501円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	9,714,778円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	29,296,524円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	16,817,237円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	27,505,526円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	14,862,622円
たわらノーロード 先進国債券	23,195,977,801円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	4,121,133,337円
たわらノーロード バランス（堅実型）	73,894,023円
たわらノーロード バランス（標準型）	471,082,185円
たわらノーロード バランス（積極型）	120,134,083円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	16,527,962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）	934,789,051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）	1,792,002,496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）	948,022,283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）	725,146,380円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,645,935円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	11,939,698円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	166,475,929円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	28,992,081円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	26,771,865円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	66,500円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	745,740円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	474,700円

DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,989,093,473円
One DC 先進国債券インデックスファンド	2,858,865,187円
Oneグローバルバランス	146,885,959円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	761,720,874円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,642,102,545円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,251,181,357円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	374,868,751円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	841,799,155円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	857,097,502円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,768,040円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	952,077,302円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,134,851円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	155,013,865円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	167,564,257円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	286,613,340円
クルーズコントロール	710,873,761円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	225,130,824円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,124,855,429円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	987,272,498円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	183,724,538円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	752,891,100円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	5,000,114円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	44,942,994円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	833,893,256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)	400,801,899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)	402,153,862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)	146,110,453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)	240,775,029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)	32,658,239円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	1,016,814,239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)	196,290,298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)	277,781,331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)	199,962,909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)	650,186,464円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,708,231,377円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,361,069,715円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,507,768,734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)	35,070,972円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	38,873,138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)	667,934,987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)	273,021,078円

D I A Mグローバル・バランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定)	191,393,258円
D I A M国際分散バランスファンド3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	11,378,598円
D I A M国際分散バランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定)	18,708,113円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	5,698,267円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定)	51,788円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A ( 適格機関投資家限定)	124,668円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定)	1,926,169円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	970,940,688円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限定)	1,127,422,170円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定)	2,178,814,917円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A ( 適格機関投資家限定)	43,149,023円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 ( 適格機関投資家限定)	85,408,223円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	884,804,959円
D I A M世界アセットバランスファンドV A ( 適格機関投資家向け)	169,003,651円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A ( 適格機関投資家限定)	151,379円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A ( 適格機関投資家限定)	125,740,722円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A ( 適格機関投資家限定)	114,988,644円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A ( 適格機関投資家限定)	164,764,607円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	28,993,277円
動的パッケージファンド< D C 年金 >	52,172,301円
コア資産形成ファンド	22,352,187円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジなし)< ラップ専用 >	857,408,834円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジあり)< ラップ専用 >	13,670,584,850円
M H A M動的パッケージファンド[ 適格機関投資家限定 ]	5,895,370,274円
M H A M外国債券パッシブファンド[ 適格機関投資家限定 ]	5,986,482,510円
計	111,389,638,247円
2. 受益権の総数	111,389,638,247口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14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	2025年1月14日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	2,217,430,930	
合計	2,217,430,930	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2024年2月22日から2025年1月14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	2025年1月14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	166,285,000	-	165,715,488	569,512
オフショア・人民元	166,285,000	-	165,715,488	569,512
買建	1,499,999,000	-	1,499,967,894	31,106
アメリカ・ドル	738,586,000	-	738,601,004	15,004
イギリス・ポンド	101,397,000	-	101,403,327	6,327
オフショア・人民元	171,431,000	-	171,377,452	53,548
カナダ・ドル	33,294,000	-	33,296,521	2,521

ユーロ	455,291,000	-	455,289,590	1,410
合計	1,666,284,000	-	1,665,683,382	538,406

## (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)

	2025年1月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4262円 (24,262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

2025年1月14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 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,412,926.540	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,416,572.840	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,954,515.980	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,970,000.000	2,718,478.120	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,718,202.350	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,680,000.000	2,436,601.560	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,763,323.450	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,281,418.750	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,948,124.990	
		US T N/B 0.625 05/15/30	4,050,000.000	3,289,992.180	
		US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,818,105.450	
		US T N/B 0.625 08/15/30	5,740,000.000	4,613,973.390	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,498,117.160	
		US T N/B 0.625 12/31/27	4,020,000.000	3,594,052.720	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,180,000.000	3,738,650.750	
		US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,479,692.950	
		US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,731,054.660	

US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,361,695.310	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,671,562.500	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,510,000.000	4,290,666.000	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,510,000.000	4,251,996.280	
US T N/B 0.875 11/15/30	4,680,000.000	3,789,063.280	
US T N/B 1.0 07/31/28	5,270,000.000	4,664,876.360	
US T N/B 1.125 02/15/31	4,890,000.000	3,989,074.800	
US T N/B 1.125 02/28/27	3,300,000.000	3,083,437.500	
US T N/B 1.125 02/29/28	5,500,000.000	4,964,716.790	
US T N/B 1.125 05/15/40	1,800,000.000	1,056,691.400	
US T N/B 1.125 08/15/40	2,460,000.000	1,429,826.940	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,230,000.000	3,749,828.920	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,239,980.670	
US T N/B 1.25 03/31/28	4,610,000.000	4,166,197.450	
US T N/B 1.25 04/30/28	5,700,000.000	5,135,343.750	
US T N/B 1.25 05/15/50	2,380,000.000	1,095,078.910	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,718,237.500	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,500,000.000	3,135,781.250	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,360,000.000	6,739,596.910	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,422,959.740	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,437,093.750	
US T N/B 1.25 12/31/26	4,290,000.000	4,039,135.550	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,770,000.000	2,260,532.790	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,800,000.000	2,669,789.040	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,191,532.050	
US T N/B 1.375 11/15/31	5,890,000.000	4,751,803.480	
US T N/B 1.375 11/15/40	2,000,000.000	1,206,914.060	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,072,078.130	
US T N/B 1.5 01/31/27	2,940,000.000	2,774,797.250	
US T N/B 1.5 02/15/30	2,830,000.000	2,433,910.530	
US T N/B 1.5 11/30/28	3,500,000.000	3,122,041.020	
US T N/B 1.625 02/15/26	5,290,000.000	5,139,565.620	
US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,989,050.000	
US T N/B 1.625 05/15/31	7,340,000.000	6,119,581.630	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,460,000.000	3,044,664.840	
US T N/B 1.625 09/30/26	5,050,000.000	4,823,539.050	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,296,560.540	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,280,000.000	2,678,156.220	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,720,984.760	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	4,034,355.480	
US T N/B 1.75 08/15/41	4,810,000.000	3,040,633.990	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,250,000.000	1,977,275.370	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	2,006,890.210	
US T N/B 1.875 02/15/32	8,580,000.000	7,124,416.380	
US T N/B 1.875 02/15/41	3,100,000.000	2,027,290.990	
US T N/B 1.875 02/15/51	4,780,000.000	2,587,455.050	
US T N/B 1.875 02/28/27	5,210,000.000	4,945,226.160	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,700,000.000	4,225,685.530	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,780,437.500	

US T N/B 1.875 07/31/26	3,200,000.000	3,083,124.990	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,370,000.000	2,882,389.420	
US T N/B 2.0 02/15/50	1,800,000.000	1,017,949.210	
US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,232,833.750	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,500,000.000	4,312,265.620	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,150,000.000	2,722,221.660	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,850,000.000	2,765,724.600	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,619,497.640	
US T N/B 2.25 02/15/52	5,000,000.000	2,951,367.190	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,219,046.870	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,062,231.240	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	4,014,915.600	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,570,000.000	988,793.350	
US T N/B 2.25 08/15/49	4,140,000.000	2,499,444.120	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,078,526.160	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,509,091.000	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,663,281.230	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	2,009,063.280	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,830,000.000	3,656,901.940	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,770,000.000	3,446,972.860	
US T N/B 2.375 05/15/51	4,760,000.000	2,915,128.130	
US T N/B 2.375 11/15/49	4,490,000.000	2,780,818.340	
US T N/B 2.5 02/15/45	1,200,000.000	812,343.740	
US T N/B 2.5 02/15/46	2,870,000.000	1,914,716.010	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,234,622.650	
US T N/B 2.5 03/31/27	3,000,000.000	2,881,113.240	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,730,000.000	1,149,841.800	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,330,000.000	4,946,177.520	
US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,712,161.510	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,823,980.260	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,312,645.330	
US T N/B 2.75 04/30/27	2,500,000.000	2,410,156.250	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,060,621.100	
US T N/B 2.75 07/31/27	4,120,000.000	3,953,429.670	
US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	6,857,703.110	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	908,590.620	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,531,644.120	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,056,000.000	770,385.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,540,986.300	
US T N/B 2.875 04/30/29	4,000,000.000	3,734,687.510	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,560,000.000	4,330,574.990	
US T N/B 2.875 05/15/32	7,050,000.000	6,247,649.440	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,890,000.000	2,135,890.620	
US T N/B 2.875 05/15/52	7,010,000.000	4,774,467.180	
US T N/B 2.875 08/15/28	3,530,000.000	3,337,159.940	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,470,000.000	1,058,342.580	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,580,000.000	1,121,367.950	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,960,000.000	1,419,047.650	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	1,899,045.870	

US T N/B 3.0 02/15/49	2,010,000.000	1,428,434.760	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	825,904.670	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	951,878.890	
US T N/B 3.0 05/15/47	2,620,000.000	1,891,977.740	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,510,000.000	1,790,041.790	
US T N/B 3.0 08/15/52	4,740,000.000	3,312,445.270	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,000,000.000	741,210.940	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,063,721.870	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,540,000.000	1,188,085.940	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,071,206.250	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,590,000.000	1,205,915.620	
US T N/B 3.125 08/31/27	4,540,000.000	4,391,297.240	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,919,816.220	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,180,000.000	3,971,081.620	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	800,978.900	
US T N/B 3.25 05/15/42	3,060,000.000	2,429,831.240	
US T N/B 3.25 06/30/27	2,700,000.000	2,626,962.890	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,500,000.000	3,311,123.050	
US T N/B 3.375 05/15/33	6,700,000.000	6,066,509.750	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,730,000.000	1,369,403.120	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,353,850.770	
US T N/B 3.375 09/15/27	4,000,000.000	3,891,875.000	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,450,000.000	2,632,713.840	
US T N/B 3.5 01/31/28	3,680,000.000	3,577,362.510	
US T N/B 3.5 01/31/30	3,700,000.000	3,514,855.470	
US T N/B 3.5 02/15/33	6,250,000.000	5,729,980.480	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,000,000.000	858,085.940	
US T N/B 3.5 04/30/28	4,500,000.000	4,361,308.600	
US T N/B 3.5 04/30/30	3,000,000.000	2,842,089.840	
US T N/B 3.5 09/30/26	4,000,000.000	3,942,656.240	
US T N/B 3.5 09/30/29	3,500,000.000	3,337,373.060	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,342,712.500	
US T N/B 3.625 02/15/53	4,800,000.000	3,802,500.000	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,409,218.750	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,500,000.000	2,384,667.970	
US T N/B 3.625 05/15/26	3,900,000.000	3,863,437.500	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,510,000.000	2,780,166.780	
US T N/B 3.625 05/31/28	2,500,000.000	2,430,419.920	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,216,999.200	
US T N/B 3.625 08/31/29	1,500,000.000	1,439,531.250	
US T N/B 3.625 09/30/31	2,500,000.000	2,346,337.900	
US T N/B 3.75 04/15/26	6,000,000.000	5,956,406.280	
US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,354,121.080	
US T N/B 3.75 06/30/30	3,200,000.000	3,064,312.510	
US T N/B 3.75 08/15/27	3,500,000.000	3,440,527.330	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,720,000.000	3,192,951.540	
US T N/B 3.75 08/31/31	1,000,000.000	946,210.940	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,228,396.090	
US T N/B 3.75 12/31/28	1,500,000.000	1,455,322.260	

US T N/B 3.75 12/31/30	2,600,000.000	2,477,058.580	
US T N/B 3.875 02/15/43	3,500,000.000	3,017,109.370	
US T N/B 3.875 05/15/43	1,300,000.000	1,117,847.640	
US T N/B 3.875 08/15/33	7,000,000.000	6,563,046.840	
US T N/B 3.875 08/15/34	8,000,000.000	7,444,375.030	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,100,000.000	967,119.140	
US T N/B 3.875 09/30/29	2,950,000.000	2,859,022.460	
US T N/B 3.875 10/15/27	2,500,000.000	2,462,060.550	
US T N/B 3.875 11/30/27	3,300,000.000	3,247,212.900	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,800,000.000	2,710,476.550	
US T N/B 3.875 12/31/27	3,600,000.000	3,540,937.500	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,709,054.680	
US T N/B 4.0 01/15/27	4,000,000.000	3,969,843.760	
US T N/B 4.0 01/31/29	1,500,000.000	1,468,095.700	
US T N/B 4.0 01/31/31	2,000,000.000	1,929,648.440	
US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	3,986,093.760	
US T N/B 4.0 02/15/34	7,500,000.000	7,072,558.560	
US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	2,915,742.180	
US T N/B 4.0 02/29/28	4,700,000.000	4,632,712.870	
US T N/B 4.0 06/30/28	3,500,000.000	3,441,621.080	
US T N/B 4.0 07/31/29	1,400,000.000	1,365,929.680	
US T N/B 4.0 07/31/30	3,500,000.000	3,391,103.520	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,800,000.000	2,727,375.000	
US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	2,741,151.560	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,760,000.000	4,040,050.000	
US T N/B 4.0 12/15/27	2,000,000.000	1,974,375.000	
US T N/B 4.125 02/15/27	4,000,000.000	3,977,656.240	
US T N/B 4.125 03/31/29	2,500,000.000	2,455,664.050	
US T N/B 4.125 03/31/31	1,200,000.000	1,164,304.690	
US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,684,945.330	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,466,552.720	
US T N/B 4.125 07/31/31	2,000,000.000	1,936,328.120	
US T N/B 4.125 08/15/44	2,000,000.000	1,768,437.500	
US T N/B 4.125 08/15/53	2,600,000.000	2,257,328.110	
US T N/B 4.125 08/31/30	2,500,000.000	2,435,302.710	
US T N/B 4.125 09/30/27	4,000,000.000	3,966,796.880	
US T N/B 4.125 10/31/27	3,340,000.000	3,311,035.910	
US T N/B 4.125 10/31/29	4,000,000.000	3,917,500.000	
US T N/B 4.125 10/31/31	1,500,000.000	1,449,726.570	
US T N/B 4.125 11/15/27	4,000,000.000	3,963,125.000	
US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,308,765.620	
US T N/B 4.125 11/30/29	4,000,000.000	3,917,187.520	
US T N/B 4.125 11/30/31	3,000,000.000	2,898,046.860	
US T N/B 4.25 02/15/54	3,000,000.000	2,663,320.320	
US T N/B 4.25 02/28/29	4,930,000.000	4,868,856.460	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,000,000.000	1,954,687.500	
US T N/B 4.25 03/15/27	3,850,000.000	3,836,765.620	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	882,943.340	
US T N/B 4.25 06/30/29	2,000,000.000	1,971,992.180	

US T N/B 4.25 06/30/31	2,800,000.000	2,731,859.360	
US T N/B 4.25 08/15/54	3,000,000.000	2,665,312.500	
US T N/B 4.25 11/15/34	3,800,000.000	3,641,171.850	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	1,837,109.350	
US T N/B 4.375 02/15/38	500,000.000	476,699.220	
US T N/B 4.375 05/15/34	8,500,000.000	8,241,015.620	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,000,000.000	934,726.560	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,430,000.000	1,329,117.950	
US T N/B 4.375 07/15/27	3,500,000.000	3,494,531.250	
US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	4,000,703.120	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	1,839,062.500	
US T N/B 4.375 08/31/28	3,500,000.000	3,479,082.040	
US T N/B 4.375 11/30/28	4,000,000.000	3,972,500.000	
US T N/B 4.375 11/30/30	3,000,000.000	2,956,113.270	
US T N/B 4.375 12/15/26	1,800,000.000	1,799,296.880	
US T N/B 4.5 02/15/36	500,000.000	490,937.500	
US T N/B 4.5 02/15/44	1,300,000.000	1,212,148.440	
US T N/B 4.5 04/15/27	4,300,000.000	4,306,718.750	
US T N/B 4.5 05/15/27	3,500,000.000	3,505,058.580	
US T N/B 4.5 05/15/38	500,000.000	482,578.120	
US T N/B 4.5 05/31/29	2,700,000.000	2,690,244.140	
US T N/B 4.5 07/15/26	4,100,000.000	4,108,328.120	
US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	933,794.520	
US T N/B 4.5 11/15/33	7,000,000.000	6,865,332.040	
US T N/B 4.5 11/15/54	4,500,000.000	4,175,156.250	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,390,000.000	1,337,793.550	
US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,641,910.930	
US T N/B 4.625 04/30/29	1,000,000.000	1,001,230.470	
US T N/B 4.625 04/30/31	3,000,000.000	2,990,390.640	
US T N/B 4.625 05/15/44	1,000,000.000	947,343.750	
US T N/B 4.625 05/15/54	4,600,000.000	4,349,875.000	
US T N/B 4.625 05/31/31	2,000,000.000	1,992,656.240	
US T N/B 4.625 06/15/27	4,500,000.000	4,519,511.730	
US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,514,082.040	
US T N/B 4.625 09/30/28	2,300,000.000	2,304,986.330	
US T N/B 4.625 09/30/30	3,000,000.000	2,996,308.590	
US T N/B 4.625 10/15/26	3,400,000.000	3,413,679.690	
US T N/B 4.625 11/15/26	3,900,000.000	3,916,300.780	
US T N/B 4.625 11/15/44	2,000,000.000	1,894,375.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,230,000.000	2,168,587.890	
US T N/B 4.75 11/15/43	2,020,000.000	1,948,432.020	
US T N/B 4.75 11/15/53	3,100,000.000	2,988,351.560	
US T N/B 4.875 04/30/26	2,000,000.000	2,012,812.500	
US T N/B 4.875 10/31/28	3,000,000.000	3,031,992.180	
US T N/B 4.875 10/31/30	4,500,000.000	4,549,570.290	
US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	813,218.750	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,382,537.100	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,860,000.000	1,929,750.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,446,406.250	

	US T N/B 6.125 11/15/27	3,200,000.000	3,343,624.990	
	US T N/B 6.25 05/15/30	5,259,000.000	5,658,971.610	
アメリカ・ドル	小計	907,105,000.000 (142,932,534,850)	811,349,161.960 (127,844,287,451)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,182,333.910	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,440,000.000	1,093,469.910	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,430,000.000	2,268,017.100	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	990,000.000	785,416.500	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,880,000.000	1,608,071.550	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	880,000.000	238,656.000	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,950,000.000	1,270,596.600	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,640,000.000	591,548.000	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,250,000.000	557,250.000	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,800,000.000	2,042,023.120	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,030,000.000	874,766.900	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,870,000.000	2,247,238.700	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,670,000.000	1,010,739.940	
	UK TREASURY 1.125 10/22/73	1,240,000.000	401,016.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,900,000.000	1,758,851.790	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,730,000.000	736,115.000	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,850,000.000	1,040,440.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,230,000.000	1,178,102.810	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,200,000.000	604,651.350	
	UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,410,000.000	623,502.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	931,663.730	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	573,827.270	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	330,672.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	1,230,000.000	640,052.440		
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,310,000.000	596,482.300		
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,190,000.000	826,812.000		



UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	674,237.500	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,660,000.000	1,245,166.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,600,000.000	2,336,828.180	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,050,000.000	810,807.790	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	880,000.000	614,616.590	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,550,000.000	1,353,314.940	
UK TREASURY 3.75 03/07/27	1,700,000.000	1,670,998.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,370,000.000	1,045,734.700	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	800,000.000	606,377.160	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,300,000.000	1,024,010.000	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	1,400,000.000	1,344,885.500	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	820,000.000	640,873.690	
UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,440,000.000	2,418,991.600	
UK TREASURY 4.125 07/22/29	2,300,000.000	2,256,645.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,400,000.000	2,251,210.570	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,870,000.000	1,823,249.020	
UK TREASURY 4.25 07/31/34	1,100,000.000	1,048,245.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,160,000.000	1,049,150.400	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,210,000.000	1,205,680.300	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,090,000.000	974,787.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,092,096.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,147,000.000	966,410.800	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,512,000.000	1,251,863.440	
UK TREASURY 4.375 01/31/40	1,100,000.000	1,004,410.000	
UK TREASURY 4.375 03/07/28	400,000.000	397,474.970	
UK TREASURY 4.375 07/31/54	1,180,000.000	998,162.000	
UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,700,000.000	1,696,490.400	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,250,000.000	1,216,672.210	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,745,000.000	1,583,413.000	

	UK TREASURY 4.625 01/31/34	1,350,000.000	1,327,495.500	
	UK TREASURY 4.75 10/22/43	1,050,000.000	975,240.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,995,000.000	2,015,249.250	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,430,000.000	1,375,636.430	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,180,000.000	1,245,650.360	
イギリス・ボンド 小計		87,859,000.000 (16,903,193,010)	69,554,390.220 (13,381,569,134)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,430,000.000	1,372,732.790	
	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	1,700,000.000	1,661,785.700	
	ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	1,300,000.000	1,241,147.700	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	3,110,000.000	2,631,355.450	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	2,350,000.000	1,894,593.500	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,490,000.000	1,759,605.810	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,130,000.000	767,613.520	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,660,000.000	1,579,822.000	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	3,810,000.000	3,540,457.740	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,540,682.860	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,410,000.000	1,524,943.200	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,259,596.320	
イスラエル・シュケル 小計		23,420,000.000 (1,016,425,658)	20,774,336.590 (901,604,131)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,515,000.000	1,429,478.250	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,070,000.000	1,656,372.600	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,120,000.000	928,188.800	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,300,000.000	1,841,012.000	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,310,000.000	1,942,733.100	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,420,000.000	730,377.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,450,000.000	1,187,245.500	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,080,000.000	1,018,990.800	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,660,000.000	1,523,913.200	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	728,160.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,250,000.000	1,053,825.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,130,000.000	1,090,879.400	

	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,600,000.000	1,524,192.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,600,000.000	1,500,672.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	792,015.800	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,820,000.000	1,612,447.200	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,400,000.000	2,318,184.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	550,000.000	460,256.500	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,820,000.000	1,657,310.200	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,080,000.000	981,244.800	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,340,000.000	1,253,918.400	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,250,000.000	1,253,112.500	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,060,000.000	2,055,941.800	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,740,000.000	1,767,022.200	
	AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	800,000.000	757,112.000	
	オーストラリア・ドル 小計	37,415,000.000 (3,645,343,450)	33,064,605.050 (3,221,484,470)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	34,440,000.000	34,701,802.540	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 06/15/26	4,000,000.000	4,024,348.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.74 10/15/29	21,000,000.000	21,260,796.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.85 05/15/27	19,000,000.000	19,256,598.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.87 09/15/31	22,000,000.000	22,409,640.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29	27,000,000.000	27,556,302.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27	35,000,000.000	35,551,866.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	29,040,000.000	29,769,049.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34	25,000,000.000	25,993,242.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31	21,410,000.000	22,139,854.050	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	50,000,000.000	50,700,500.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34	21,590,000.000	22,777,948.720	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	23,000,000.000	23,983,367.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	49,500,000.000	50,186,807.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	21,000,000.000	22,203,180.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	29,000,000.000	30,045,400.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26	35,000,000.000	35,698,995.500	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	30,000,000.000	31,013,868.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,615,371.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,743,692.010	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	31,410,000.000	32,278,860.270	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	22,000,000.000	23,492,136.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	23,000,000.000	24,284,796.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	23,000,000.000	23,936,284.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	19,300,000.000	20,645,522.660	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	23,000,000.000	24,333,740.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	24,000,000.000	24,932,887.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	18,000,000.000	19,032,444.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	18,000,000.000	18,939,087.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	19,500,000.000	21,023,999.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	24,880,000.000	26,921,657.770	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	33,600,000.000	35,649,939.360	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	46,600,000.000	47,671,464.480	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	16,000,000.000	17,230,980.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	15,500,000.000	16,704,647.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	22,000,000.000	23,214,578.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,720,096.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	22,000,000.000	23,371,143.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,592,790.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,657,850.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	19,300,000.000	20,946,245.610	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	28,000,000.000	29,058,850.800	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	11,200,000.000	12,266,663.360	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	11,100,000.000	12,046,444.830	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	20,100,000.000	21,206,993.430	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	14,900,000.000	18,333,904.660	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	32,000,000.000	33,717,052.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	21,000,000.000	22,902,117.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	12,000,000.000	12,264,589.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	11,500,000.000	14,293,798.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,641,600.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	15,800,000.000	19,940,268.340	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	18,995,957.640	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30	9,000,000.000	9,925,677.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,571,288.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	11,000,000.000	11,912,851.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	8,820,000.000	11,292,795.480	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	16,100,000.000	20,571,721.870	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	10,450,000.000	13,787,957.810	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,314,533.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	10,600,000.000	14,361,849.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	14,000,000.000	19,289,001.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	16,300,000.000	22,215,032.020	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	10,300,000.000	14,369,736.000	
	オフショア・人民元 小計	1,328,290,000.000 (28,487,835,630)	1,419,494,470.110 (30,443,897,900)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,810,000.000	1,752,283.160	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,212,205.990	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,150,000.000	1,096,777.620	
	CANADA 1.0 09/01/26	2,670,000.000	2,582,468.050	

CANADA 1.25 03/01/27	2,110,000.000	2,030,246.600	
CANADA 1.25 06/01/30	1,940,000.000	1,746,169.930	
CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,664,031.080	
CANADA 1.5 06/01/31	2,370,000.000	2,118,843.150	
CANADA 1.5 12/01/31	1,840,000.000	1,628,331.240	
CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,469,046.470	
CANADA 2.0 06/01/28	930,000.000	896,282.310	
CANADA 2.0 06/01/32	2,390,000.000	2,172,045.790	
CANADA 2.0 12/01/51	2,910,000.000	2,121,259.050	
CANADA 2.25 06/01/29	600,000.000	578,218.260	
CANADA 2.25 12/01/29	900,000.000	860,400.720	
CANADA 2.5 12/01/32	1,820,000.000	1,704,047.750	
CANADA 2.75 06/01/33	1,330,000.000	1,263,166.760	
CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,040,097.310	
CANADA 2.75 12/01/48	500,000.000	434,384.550	
CANADA 2.75 12/01/55	1,450,000.000	1,226,933.620	
CANADA 2.75 12/01/64	380,000.000	321,795.130	
CANADA 3.0 04/01/26	1,350,000.000	1,347,495.770	
CANADA 3.0 06/01/34	1,700,000.000	1,634,198.440	
CANADA 3.25 09/01/28	1,400,000.000	1,403,362.390	
CANADA 3.25 12/01/33	1,620,000.000	1,593,201.170	
CANADA 3.25 12/01/34	570,000.000	558,180.340	
CANADA 3.5 03/01/28	1,030,000.000	1,040,802.880	
CANADA 3.5 03/01/34	1,450,000.000	1,452,710.020	
CANADA 3.5 09/01/29	1,300,000.000	1,314,486.920	
CANADA 3.5 12/01/45	900,000.000	891,590.350	
CANADA 4.0 03/01/29	1,700,000.000	1,751,792.030	
CANADA 4.0 05/01/26	500,000.000	505,267.800	
CANADA 4.0 06/01/41	590,000.000	623,392.120	
CANADA 4.0 08/01/26	500,000.000	506,363.580	
CANADA 5.0 06/01/37	330,000.000	378,126.780	
CANADA 5.75 06/01/29	640,000.000	707,782.710	
CANADA 5.75 06/01/33	1,010,000.000	1,175,523.060	
カナダ・ドル 小計	51,220,000.000 (5,614,224,200)	47,803,310.900 (5,239,720,908)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	494,873.400
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	840,000.000	772,590.000
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	630,000.000	510,678.000
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	570,000.000	457,282.500
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	590,000.000	583,480.500
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	770,000.000	711,942.000
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	240,000.000	220,701.600
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	240,000.000	237,732.000
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	550,000.000	534,737.500
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	634,065.300
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	638,715.000
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	620,000.000	617,293.700
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	199,760.000

	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	617,582.000	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	320,000.000	321,472.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	127,687.500	
	SINGAPORE 3.25 06/01/54	160,000.000	169,226.400	
	SINGAPORE 3.375 05/01/34	310,000.000	317,460.150	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	809,320.000	
シンガポール・ドル 小計		9,415,000.000 (1,083,195,750)	8,976,599.550 (1,032,757,778)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,820,000.000	4,210,438.700	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,490,000.000	4,294,842.150	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,960,000.000	3,697,273.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,010,000.000	6,881,156.200	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,200,000.000	3,030,336.000	
	SWEDEN 2.25 05/11/35	1,000,000.000	978,826.700	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,030,000.000	4,002,758.900	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,900,000.000	4,294,972.500	
スウェーデン・クローナ 小計		32,410,000.000 (453,740,000)	31,390,604.950 (439,468,469)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,386,366.640	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,560,000.000	2,531,774.660	
	DENMARK 0.5 11/15/27	2,850,000.000	2,734,024.170	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,140,000.000	4,759,623.880	
	DENMARK 2.25 11/15/26	1,210,000.000	1,215,587.170	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,940,000.000	1,933,753.200	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,330,000.000	9,101,532.720	
デンマーク・クローネ 小計		28,110,000.000 (608,300,400)	26,662,662.440 (576,980,015)	
ニュージーラン ド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	1,050,000.000	935,592.210	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	380,000.000	364,695.590	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	741,576.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	252,237.800	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	1,410,000.000	1,199,199.490	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	790,000.000	635,169.610	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	810,000.000	518,953.520	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	723,698.330	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	910,000.000	845,929.700	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	126,397.510	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/36	100,000.000	95,010.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	814,397.030	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	200,000.000	204,216.180	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	450,000.000	442,125.740	
ニュージーランド・ドル 小計		9,060,000.000	7,899,198.710	

		(799,454,400)	(697,025,294)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,950,000.000	2,483,339.500	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,610,000.000	4,017,995.320	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,510,000.000	3,413,606.620	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,700,000.000	4,494,709.860	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,650,213.890	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,420,000.000	2,278,914.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,530,000.000	2,232,503.620	
	NORWAY 3.0 08/15/33	3,500,000.000	3,247,956.250	
	NORWAY 3.5 10/06/42	2,160,000.000	2,029,644.000	
	NORWAY 3.625 04/13/34	1,570,000.000	1,524,195.250	
ノルウェー・クローネ 小計		30,870,000.000 (426,006,000)	28,373,078.310 (391,548,481)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,280,000.000	2,093,410.500	
	POLAND 04/25/26	600,000.000	563,370.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	6,720,000.000	5,265,187.200	
	POLAND 1.75 04/25/32	4,350,000.000	3,300,960.500	
	POLAND 2.5 07/25/26	1,420,000.000	1,364,772.640	
	POLAND 2.5 07/25/27	5,060,000.000	4,729,555.420	
	POLAND 2.75 04/25/28	2,960,000.000	2,726,411.600	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,762,860.000	
	POLAND 3.75 05/25/27	2,620,000.000	2,534,096.750	
	POLAND 4.75 07/25/29	1,800,000.000	1,734,039.000	
	POLAND 5.0 01/25/30	1,900,000.000	1,855,124.430	
	POLAND 5.0 10/25/34	1,750,000.000	1,615,488.700	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,190,000.000	3,200,554.740	
	POLAND 6.0 10/25/33	1,690,000.000	1,686,990.720	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,400,000.000	3,609,525.000	
ポーランド・ズロチ 小計		41,740,000.000 (1,577,521,560)	38,042,347.200 (1,437,772,470)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,872,389.630	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,250,000.000	1,250,798.250	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,379,746.870	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,010,753.400	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,400,000.000	1,358,795.720	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,270,000.000	2,269,177.840	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,660,582.660	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,100,000.000	1,111,844.690	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,009,021.900	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	2,030,000.000	2,051,725.060	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,675,091.710	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,220,000.000	1,229,884.310	
	MALAYSIA 4.054 04/18/39	650,000.000	656,046.560	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,676,530.400	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	686,444.270	
MALAYSIA 4.254 05/31/35	2,400,000.000	2,480,860.560		



	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,063,686.430	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,720,000.000	1,797,662.470	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,245,186.000	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,590,000.000	1,645,788.010	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	530,006.950	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,160,000.000	1,253,488.330	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	326,132.430	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,900,000.000	2,049,082.740	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,000,000.000	1,094,385.600	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,224,402.290	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,774,815.040	
マレーシア・リングギット 小計		38,420,000.000 (1,344,853,680)	39,384,330.120 (1,378,609,092)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	25,000,000.000	23,716,000.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	28,080,000.000	25,801,159.440	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	11,500,000.000	9,822,150.000	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	22,290,000.000	18,871,828.500	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	22,290,000.000	16,939,741.550	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	16,850,000.000	16,168,417.500	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	4,805,000.000	4,704,163.030	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	31,672,000.000	30,336,580.200	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	19,146,000.000	18,236,388.260	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	26,648,000.000	23,797,787.980	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	19,707,000.000	15,130,275.470	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	13,035,000.000	10,967,950.880	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	17,461,000.000	13,489,057.060	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	18,419,000.000	17,445,324.680	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	21,642,000.000	18,524,643.250		
メキシコ・ペソ 小計		298,545,000.000 (2,278,973,112)	263,951,467.800 (2,014,899,925)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,280,000.000	1,116,316.160	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,360,000.000	1,148,606.360	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	770,000.000	465,388.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	640,000.000	458,304.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,396,880.000	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,190,000.000	1,139,816.510	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	360,000.000	153,996.740	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,055,000.000	999,974.360	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	333,328.660	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,330,000.000	1,292,259.560		

AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	124,589.000	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	600,000.000	524,439.000	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	108,376.000	
AUSTRIA 1.85 05/23/49	460,000.000	352,878.360	
AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	457,452.750	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	281,038.870	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	2,370,000.000	2,253,454.060	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,150,000.000	1,145,869.770	
AUSTRIA 2.9 02/20/34	450,000.000	445,680.000	
AUSTRIA 2.9 05/23/29	400,000.000	404,525.600	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	538,635.620	
AUSTRIA 3.15 10/20/53	420,000.000	406,761.530	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	480,000.000	530,813.920	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,109,935.460	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	670,386.030	
BELGIUM 0.0 10/22/27	1,030,000.000	962,835.990	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	854,998.030	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,100,000.000	952,380.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,050,000.000	864,570.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	780,000.000	493,705.290	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	328,963.900	
BELGIUM 0.8 06/22/27	960,000.000	923,082.240	
BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	883,224.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,240,000.000	1,148,634.930	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,340,000.000	1,313,841.520	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,440,000.000	1,281,664.800	
BELGIUM 1.25 04/22/33	1,260,000.000	1,097,460.000	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,540,000.000	922,040.340	
BELGIUM 1.45 06/22/37	1,060,000.000	856,419.040	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	635,532.770	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,020,000.000	687,944.840	
BELGIUM 1.9 06/22/38	500,000.000	419,406.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	305,010.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	280,115.550	
BELGIUM 2.7 10/22/29	250,000.000	249,701.250	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	295,658.560	
BELGIUM 2.85 10/22/34	720,000.000	699,016.320	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,200,000.000	1,190,976.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	580,000.000	572,861.070	
BELGIUM 3.3 06/22/54	420,000.000	385,927.080	
BELGIUM 3.45 06/22/43	240,000.000	235,358.690	
BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	651,682.560	
BELGIUM 4.0 03/28/32	740,000.000	787,725.560	
BELGIUM 4.25 03/28/41	880,000.000	956,994.720	
BELGIUM 4.5 03/28/26	670,000.000	686,296.410	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,170,000.000	1,346,924.460	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,742,921.910	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,010,000.000	982,780.500	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	2,460,000.000	2,340,643.100	

BUNDESOBL 0.0 10/09/26	2,760,000.000	2,655,396.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,580,000.000	2,517,564.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,050,000.000	2,000,595.000	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,400,000.000	1,385,230.000	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	500,000.000	494,875.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,700,000.000	1,696,005.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	2,000,000.000	2,005,400.000	
BUNDESOBL 2.5 10/11/29	1,500,000.000	1,506,450.000	
BUNDESSCHAT 2.7 09/17/26	2,100,000.000	2,113,440.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,020,000.000	1,795,376.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,340,000.000	1,161,445.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,350,000.000	1,138,568.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,460,000.000	1,114,783.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,780,000.000	1,316,221.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,530,000.000	1,343,875.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,390,000.000	1,221,254.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,490,000.000	1,273,875.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,800,000.000	1,540,354.490	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,040,000.000	1,017,552.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,140,000.000	568,005.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,290,000.000	608,428.500	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,521,747.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,660,000.000	1,523,753.420	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,970,000.000	2,852,239.500	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,630,000.000	1,503,587.790	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,770,000.000	1,649,817.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,120,000.000	2,012,198.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	3,110,000.000	2,978,823.310	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,290,000.000	2,211,995.730	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,390,000.000	1,252,709.700	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	2,160,000.000	1,736,748.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,420,000.000	1,784,321.040	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,880,000.000	1,781,582.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	2,400,000.000	1,930,800.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	900,000.000	724,500.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	2,500,000.000	2,466,375.000	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	2,100,000.000	2,037,630.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,150,000.000	1,132,060.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,600,000.000	1,575,920.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	1,300,000.000	1,298,050.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,720,000.000	1,636,064.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	2,129,108.800	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	1,460,000.000	1,369,553.000	
DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,300,000.000	1,259,960.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,900,000.000	1,907,695.000	

DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34	2,100,000.000	2,100,735.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,080,000.000	1,141,992.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,030,000.000	2,293,836.450	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,280,000.000	1,498,048.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,276,229.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,720,000.000	2,031,922.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	1,997,124.500	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,720,000.000	2,010,594.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,140,000.000	1,249,098.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	840,000.000	988,974.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,250,000.000	1,375,937.500	
FINLAND 0.0 09/15/26	100,000.000	96,100.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	110,000.000	94,345.350	
FINLAND 0.125 04/15/36	180,000.000	129,202.560	
FINLAND 0.125 04/15/52	560,000.000	251,490.680	
FINLAND 0.125 09/15/31	700,000.000	586,652.500	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	184,100.180	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	449,433.800	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	236,778.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	380,704.870	
FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	603,630.360	
FINLAND 0.5 09/15/29	770,000.000	697,467.540	
FINLAND 0.75 04/15/31	700,000.000	618,761.500	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	407,583.500	
FINLAND 1.375 04/15/27	210,000.000	205,204.230	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	197,967.000	
FINLAND 1.5 09/15/32	450,000.000	406,633.270	
FINLAND 2.625 07/04/42	400,000.000	366,934.000	
FINLAND 2.75 04/15/38	370,000.000	351,835.480	
FINLAND 2.75 07/04/28	320,000.000	322,644.800	
FINLAND 2.875 04/15/29	400,000.000	403,280.000	
FINLAND 2.95 04/15/55	60,000.000	55,926.000	
FINLAND 3.0 09/15/33	1,000,000.000	1,001,295.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,100,000.000	3,887,627.160	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	4,990,000.000	3,951,581.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,610,000.000	3,136,649.580	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,980,000.000	3,339,800.060	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,370,000.000	2,724,841.290	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,120,000.000	2,994,108.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	4,660,000.000	4,540,692.340	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,790,000.000	2,520,274.640	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,950,000.000	1,223,673.750	

FRANCE OAT 0.5 05/25/72	1,790,000.000	572,012.830	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,490,000.000	829,611.500	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	4,180,000.000	3,938,939.400	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,690,000.000	4,394,061.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,250,000.000	1,085,397.750	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,460,000.000	1,155,548.100	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,000,000.000	3,699,952.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,960,000.000	3,819,693.240	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,260,000.000	2,705,710.340	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,090,000.000	2,435,229.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,800,000.000	1,345,320.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,780,000.000	3,437,345.810	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,420,000.000	1,507,730.180	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	940,000.000	542,631.210	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,450,000.000	1,935,134.950	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,404,046.800	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,650,000.000	2,419,173.070	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,650,000.000	3,563,300.310	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,450,000.000	1,204,310.550	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,320,000.000	4,320,885.600	
FRANCE OAT 2.5 09/24/27	4,200,000.000	4,184,331.900	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,710,000.000	3,693,011.910	
FRANCE OAT 2.75 02/25/30	2,600,000.000	2,569,551.400	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,240,000.000	4,252,219.680	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	2,700,000.000	2,635,989.750	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,550,000.000	1,300,767.750	
FRANCE OAT 3.0 06/25/49	500,000.000	434,684.370	
FRANCE OAT 3.0 11/25/34	2,700,000.000	2,599,645.050	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,340,000.000	2,159,988.480	
FRANCE OAT 3.25 05/25/55	1,300,000.000	1,139,853.000	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	2,600,000.000	2,624,970.400	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,546,114.720	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,478,133.200	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,540,000.000	1,597,425.820	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,490,000.000	2,720,266.700	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,588,832.710	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,500,000.000	3,864,287.690	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,310,000.000	2,705,887.800	
IRISH 0.0 10/18/31	670,000.000	559,371.270	
IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	400,034.460	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	305,779.670	
IRISH 0.4 05/15/35	520,000.000	404,645.280	
IRISH 0.55 04/22/41	290,000.000	197,175.770	
IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	677,197.290	
IRISH 1.0 05/15/26	890,000.000	874,619.910	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	689,030.210	
IRISH 1.3 05/15/33	290,000.000	258,945.060	
IRISH 1.35 03/18/31	540,000.000	501,163.200	
IRISH 1.5 05/15/50	550,000.000	396,468.600	

IRISH 1.7 05/15/37	780,000.000	675,024.080	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	699,783.000	
IRISH 2.4 05/15/30	670,000.000	664,734.610	
IRISH 3.0 10/18/43	280,000.000	277,120.610	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,961,218.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,850,000.000	1,780,995.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,347,726.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,900,000.000	1,717,790.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	410,000.000	401,580.650	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,120,000.000	940,590.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,651,860.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,510,000.000	1,306,310.430	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,180,000.000	849,010.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	2,000,000.000	1,677,000.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,195,830.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,880,000.000	1,795,024.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,400,000.000	1,192,024.400	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,900,000.000	1,836,350.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,480,000.000	1,444,894.400	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,690,539.250	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,320,000.000	1,036,860.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,210,000.000	777,546.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,290,000.000	1,148,100.000	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,340,000.000	2,138,186.700	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,170,000.000	715,650.970	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	839,155.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,160,000.000	1,133,920.880	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,673,726.500	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,840,000.000	1,829,144.000	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	860,000.000	525,976.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,460,000.000	971,922.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,575,690.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	750,000.000	638,025.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,080,000.000	990,878.400	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,180,000.000	855,972.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,247,808.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,520,000.000	1,516,960.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,270,000.000	999,744.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	500,000.000	365,250.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,800,000.000	1,782,720.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,933,889.000	
ITALY BTPS 2.95 02/15/27	1,300,000.000	1,306,890.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	720,000.000	640,728.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,710,000.000	1,708,210.900	
ITALY BTPS 3.0 10/01/29	500,000.000	497,100.000	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	960,000.000	855,821.990	
ITALY BTPS 3.15 11/15/31	1,400,000.000	1,375,220.000	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	555,000.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,196,625.600	

ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,420,000.000	1,374,325.700	
ITALY BTPS 3.35 07/01/29	1,400,000.000	1,415,260.000	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,150,000.000	1,168,860.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,140,000.000	1,011,356.970	
ITALY BTPS 3.45 07/15/27	1,500,000.000	1,524,750.000	
ITALY BTPS 3.45 07/15/31	1,600,000.000	1,604,320.000	
ITALY BTPS 3.5 02/15/31	1,400,000.000	1,411,900.000	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,000,000.000	1,022,700.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,522,344.300	
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	300,000.000	308,910.000	
ITALY BTPS 3.85 02/01/35	1,000,000.000	1,004,900.000	
ITALY BTPS 3.85 07/01/34	2,180,000.000	2,198,966.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.000	1,034,229.900	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	1,600,000.000	1,631,360.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,754,570.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,040,000.000	2,073,864.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,560,000.000	1,595,412.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,500,000.000	1,560,000.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	1,037,100.000	
ITALY BTPS 4.05 10/30/37	1,300,000.000	1,317,550.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	800,000.000	832,800.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	1,260,000.000	1,268,820.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	720,000.000	748,368.000	
ITALY BTPS 4.3 10/01/54	400,000.000	394,080.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	2,200,000.000	2,317,700.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,400,000.000	1,484,140.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,500,000.000	1,543,650.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,155,576.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	770,000.000	791,175.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,180,000.000	2,318,866.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	860,000.000	923,734.160	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,860,000.000	2,053,998.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,090,000.000	1,201,834.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,050,000.000	1,154,580.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,899,248.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,160,000.000	1,336,668.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,560,000.000	1,801,020.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,211,804.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,250,000.000	1,352,625.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,280,000.000	1,223,023.360	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,240,000.000	1,123,833.690	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,240,000.000	845,739.520	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,330,000.000	619,672.060	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,200,000.000	1,043,681.390	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,900,000.000	1,604,248.100	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	760,000.000	687,833.240	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	760,000.000	534,631.120	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,560,000.000	1,519,065.600	

NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,400,000.000	1,209,052.320	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	962,065.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	630,000.000	594,675.900	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	790,000.000	646,938.730	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	380,000.000	379,071.840	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,310,000.000	1,288,612.940	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	350,000.000	342,948.720	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	800,000.000	778,160.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,290,000.000	1,247,618.340	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	590,000.000	611,472.460	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,490,000.000	1,637,368.450	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,020,000.000	1,129,140.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,290,000.000	1,403,262.000	
PORTUGUESE 0.3 10/17/31	2,100,000.000	1,789,824.220	
PORTUGUESE 1.0 04/12/52	400,000.000	224,721.700	
PORTUGUESE 1.15 04/11/42	400,000.000	281,114.300	
PORTUGUESE 1.65 07/16/32	500,000.000	460,726.250	
PORTUGUESE 2.125 10/17/28	1,600,000.000	1,582,723.200	
PORTUGUESE 2.25 04/18/34	1,400,000.000	1,318,826.600	
PORTUGUESE 4.1 02/15/45	400,000.000	430,640.000	
PORTUGUESE 4.1 04/15/37	1,500,000.000	1,628,370.300	
PORTUGUESE 4.125 04/14/27	1,700,000.000	1,767,945.940	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,010,000.000	1,911,510.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,880,000.000	1,737,966.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	2,530,000.000	2,122,923.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,300,000.000	2,038,936.200	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,040,000.000	883,397.840	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,130,000.000	1,019,676.400	
SPAIN 0.7 04/30/32	2,850,000.000	2,421,402.750	
SPAIN 0.8 07/30/27	2,400,000.000	2,296,560.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,557,880.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,600,000.000	1,171,755.990	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,440,000.000	944,352.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,290,000.000	704,327.100	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,020,000.000	720,738.360	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,050,000.000	960,120.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,130,000.000	2,089,201.980	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,470,000.000	1,413,666.660	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,470,000.000	1,408,186.500	
SPAIN 1.45 04/30/29	2,050,000.000	1,944,992.850	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,803,884.730	
SPAIN 1.45 10/31/71	660,000.000	317,879.100	



	SPAIN 1.5 04/30/27	2,060,000.000	2,015,504.000	
	SPAIN 1.85 07/30/35	1,640,000.000	1,424,335.080	
	SPAIN 1.9 10/31/52	1,370,000.000	917,804.100	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,521,840.510	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,070,000.000	1,020,867.200	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,570,000.000	1,469,677.000	
	SPAIN 2.5 05/31/27	2,300,000.000	2,296,435.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	2,020,000.000	1,945,264.040	
	SPAIN 2.7 10/31/48	960,000.000	796,685.280	
	SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,807,920.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,600,000.000	1,395,477.990	
	SPAIN 3.1 07/30/31	1,700,000.000	1,711,972.760	
	SPAIN 3.15 04/30/33	2,170,000.000	2,170,302.710	
	SPAIN 3.25 04/30/34	1,270,000.000	1,269,130.050	
	SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	708,273.040	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	1,002,027.090	
	SPAIN 3.45 10/31/34	1,650,000.000	1,670,466.100	
	SPAIN 3.5 05/31/29	1,300,000.000	1,338,590.500	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,020,000.000	1,045,296.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	560,000.000	576,819.600	
	SPAIN 4.0 10/31/54	900,000.000	910,778.130	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,060,000.000	1,137,742.520	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,080,000.000	1,215,648.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,181,220.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,660,000.000	1,806,578.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,443,951.300	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,635,000.000	1,930,092.150	
	SPAIN 5.9 07/30/26	830,000.000	873,020.720	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,206,698.920	
	ユーロ 小計	524,545,000.000 (84,677,299,350)	485,455,343.950 (78,367,056,174)	
国債証券 合計		291,848,901,050 (291,848,901,050)	267,368,681,692 (267,368,681,692)	
合計			267,368,681,692 (267,368,681,692)	

(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 264銘柄	47.31	47.82
イギリス・ポンド	国債証券 60銘柄	4.95	5.00
イスラエル・シケル	国債証券 12銘柄	0.33	0.34
オーストラリア・ドル	国債証券 25銘柄	1.19	1.20
オフショア・人民元	国債証券 64銘柄	11.27	11.39
カナダ・ドル	国債証券 37銘柄	1.94	1.96

シンガポール・ドル	国債証券	19銘柄	0.38	0.39
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.16	0.16
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.21	0.22
ニュージーランド・ドル	国債証券	14銘柄	0.26	0.26
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.14	0.15
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	0.53	0.54
マレーシア・リングgit	国債証券	27銘柄	0.51	0.52
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.75	0.75
ユーロ	国債証券	363銘柄	29.00	29.31

(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)

2025年1月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,372,376,856
コール・ローン	103,933,430
株式	97,829,987,795
投資信託受益証券	480,586,574
投資証券	79,547,593
派生商品評価勘定	755,777
未収配当金	163,363,908
差入委託証拠金	2,169,126,251
流動資産合計	105,199,678,184
資産合計	105,199,678,184
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	329,951,729
未払金	15,182
未払解約金	2,777,000
流動負債合計	332,743,911
負債合計	332,743,911
純資産の部	
元本等	
元本	58,521,513,324
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	46,345,420,949
元本等合計	104,866,934,273
純資産合計	104,866,934,273
負債純資産合計	105,199,678,184

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	54,509,988,915円
同期中追加設定元本額	23,943,788,194円
同期中一部解約元本額	19,932,263,785円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	10,979,632,519円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>	6,305,347,168円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,877,528円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	9,713,538円

MITO ラップ型ファンド(積極型)	24,234,776円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	23,524,084円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	27,498,819円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,295,234円
たわらノーロード 新興国株式	15,647,507,657円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	5,494,644,613円
たわらノーロード バランス(堅実型)	32,654,737円
たわらノーロード バランス(標準型)	156,033,760円
たわらノーロード バランス(積極型)	318,605,679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)	106,895,523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)	208,857,499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)	333,327,085円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	11,703円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,172,829円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,225,261円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,481,456円
たわらノーロード 全世界株式	4,981,816,792円
One DC 新興国株式インデックスファンド	2,086,981,591円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	378,708,940円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	341,063,213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)	1,180,426,301円
投資のソムリエ	3,436,426,386円
クルーズコントロール	279,422,867円
投資のソムリエ<DC年金>	452,918,732円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	498,139,712円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	526,363,882円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,361,214,157円
ワールドアセットバランス(基本コース)	492,859,760円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,065,475,417円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	101,479,379円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	55,326,997円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,343,421円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	109,355,522円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	229,281,925円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	302,053,414円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	40,401,542円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	58,408,291円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	36,080,267円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	9,711,066円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	14,276,483円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	55,499円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	66,115,597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)	1,771,281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)	83,167,862円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	38,044,813円
計	58,521,513,324円

2. 受益権の総数

58,521,513,324口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14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	2025年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	4,747,807,857

投資信託受益証券	72,786,204
投資証券	17,766,161
合計	4,657,255,492

（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4月19日から2025年1月14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	2025年1月14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	3,324,965	-	3,281,393	43,572
ブラジル・リアル	3,324,965	-	3,281,393	43,572
買建	140,550,056	-	140,505,776	44,280
アメリカ・ドル	140,550,056	-	140,505,776	44,280
合計	143,875,021	-	143,787,169	708

（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	2025年1月14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	6,913,100,124	-	6,583,904,880	329,195,244
合計	6,913,100,124	-	6,583,904,880	329,195,244

（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）

2025年1月14日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7919円 (17,919円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2025年1月14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	12.460	175,386.960	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	5,768	180.040	1,038,470.720	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,386	94.750	699,823.500	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	219,522	1.372	301,184.180	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	1.998	177,822.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	61,882	1.529	94,617.570	
	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	28,813	12.680	365,348.840	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	35,582	9.370	333,403.340	
	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	17,509	30.390	532,098.510		



	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	QIFU TECHNOLOGY INC ADR	10,000	36.090	360,900.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	63,763	10.280	655,483.640	
	STONECO LTD	20,058	8.140	163,272.120	
	AUTOHOME INC ADR	4,983	25.210	125,621.430	
	XP INC	29,992	11.550	346,407.600	
	KANZHUN LTD ADR	21,614	13.330	288,114.620	
	KE HOLDINGS INC ADR	54,492	16.380	892,578.960	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	6,582	32.500	213,915.000	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS	248,744	11.080	2,756,083.520	
	INTER & CO INC	19,206	4.330	83,161.980	
	PDD HOLDINGS INC ADR	58,428	95.980	5,607,919.440	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	32,286	43.130	1,392,495.180	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
アメリカ・ドル	小計	3,439,567		16,604,109.110 (2,616,309,472)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	118,172	14.980	1,770,216.560	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	243,692	7.260	1,769,203.920	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	294,584	16.280	4,795,827.520	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	240,846	10.800	2,601,136.800	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	375,193	14.200	5,327,740.600	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	560,125	12.750	7,141,593.750	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	323,840	7.700	2,493,568.000	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	161,247	21.800	3,515,184.600	
	ADNOC DRILLING CO PJSC	278,329	5.450	1,516,893.050	
	MULTIPLY GROUP	279,807	2.160	604,383.120	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC - FOREIGN CO	250,589	2.200	551,295.800	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	268,290	3.400	912,186.000	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	3,394,714		32,999,229.720 (1,417,976,901)	
インド・ル ピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	512,343	1,239.850	635,228,468.550	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	125,631	265.300	33,329,904.300	
	ASIAN PAINTS LTD	31,831	2,252.650	71,704,102.150	
	BANK OF BARODA	82,954	217.690	18,058,256.260	

EICHER MOTORS LTD	11,149	4,939.100	55,066,025.900	
GRASIM INDUSTRIES LTD	22,688	2,288.150	51,913,547.200	
HDFC BANK LTD	475,198	1,630.850	774,976,658.300	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	78,680	2,999.650	236,012,462.000	
SHREE CEMENT LTD	759	24,874.500	18,879,745.500	
ICICI BANK LTD	438,105	1,229.750	538,759,623.750	
INDUSIND BANK LTD	24,739	941.700	23,296,716.300	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	83,808	364.400	30,539,635.200	
STATE BANK OF INDIA LTD	150,038	729.500	109,452,721.000	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	19,695	728.400	14,345,838.000	
TATA STEEL LTD	644,848	122.930	79,271,164.640	
TATA MOTORS LTD	171,623	751.000	128,888,873.000	
JSW STEEL LTD	50,437	883.750	44,573,698.750	
TATA COMMUNICATIONS LTD	9,618	1,632.300	15,699,461.400	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	49,572	965.450	47,859,287.400	
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,347	10,314.800	24,208,835.600	
TATA POWER CO LTD	132,581	339.950	45,070,910.950	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	9,390	4,927.050	46,264,999.500	
NESTLE INDIA LTD	28,843	2,237.350	64,531,886.050	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	82,126	192.580	15,815,825.080	
GAIL INDIA LTD	200,526	172.150	34,520,550.900	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	92,070	1,738.400	160,054,488.000	
VEDANTA LTD	118,499	413.700	49,023,036.300	
SUPREME INDUSTRIES LTD	5,257	4,289.300	22,548,850.100	
AXIS BANK LTD	192,695	1,049.300	202,194,863.500	
TITAN COMPANY LTD	30,158	3,382.750	102,016,974.500	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	269,443	255.730	68,904,658.390	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,612	2,752.050	31,956,804.600	
BHARAT ELECTRONICS LTD	310,508	259.600	80,607,876.800	
LUPIN LTD	19,050	2,154.450	41,042,272.500	
NMDC LTD	244,746	60.000	14,684,760.000	
MPHASIS LTD	8,706	2,777.500	24,180,915.000	
BAJAJ FINANCE LTD	23,500	7,150.950	168,047,325.000	
INFOSYS LTD	279,509	1,962.200	548,452,559.800	
WIPRO LTD	220,500	291.850	64,352,925.000	
TATA ELXSI LTD	2,960	5,941.600	17,587,136.000	
MRF LTD	194	113,003.800	21,922,737.200	
INDIAN OIL CORP LTD	231,980	121.990	28,299,240.200	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	69,517	2,451.000	170,386,167.000	
TRENT LTD	15,359	6,224.400	95,600,559.600	

APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,712	6,839.600	59,586,595.200	
CUMMINS INDIA LTD	11,753	2,873.350	33,770,482.550	
HCL TECHNOLOGIES LTD	80,014	1,989.400	159,179,851.600	
DABUR INDIA LTD	46,381	510.750	23,689,095.750	
HERO MOTOCORP LTD	10,404	4,043.650	42,070,134.600	
SRF LTD	11,493	2,516.000	28,916,388.000	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,405	2,595.750	16,625,778.750	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	47,940	1,335.100	64,004,694.000	
BHARTI AIRTEL LTD	215,877	1,597.200	344,798,744.400	
PUNJAB NATIONAL BANK LTD	205,251	95.420	19,585,050.420	
ORACLE FINANCIAL SERVICES SOFTWARE LTD	1,746	10,846.850	18,938,600.100	
UNITED SPIRITS LTD	25,098	1,483.550	37,234,137.900	
UNION BANK OF INDIA LTD	119,319	101.250	12,081,048.750	
CANARA BANK	149,548	88.520	13,237,988.960	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	80,715	1,746.900	141,001,033.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	10,063	5,732.500	57,686,147.500	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,722	11,497.700	123,278,339.400	
AUROBINDO PHARMA LTD	21,722	1,161.400	25,227,930.800	
HAVELLS INDIA LTD	21,928	1,532.050	33,594,792.400	
TVS MOTOR COMPANY LTD	20,542	2,176.600	44,711,717.200	
JINDAL STEEL & POWER LTD	34,526	876.700	30,268,944.200	
JINDAL STAINLESS LTD	27,489	606.400	16,669,329.600	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	258,789	139.760	36,168,350.640	
SHRIRAM FINANCE LTD	120,705	521.100	62,899,375.500	
PETRONET LNG LTD	61,507	314.900	19,368,554.300	
CIPLA LTD/INDIA	44,866	1,439.200	64,571,147.200	
LARSEN & TOUBRO LTD	56,754	3,464.300	196,612,882.200	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,684	10,615.150	102,797,112.600	
ASHOK LEYLAND LTD	121,319	202.450	24,561,031.550	
BOSCH LTD	592	30,979.750	18,340,012.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	76,076	4,291.100	326,449,723.600	
ADANI ENTERPRISES LTD	12,036	2,225.150	26,781,905.400	
NTPC LTD	368,351	298.200	109,842,268.200	
YES BANK LTD	1,178,292	17.120	20,172,359.040	
AMBUJA CEMENTS LTD	53,912	493.200	26,589,398.400	
BHARAT FORGE LTD	21,319	1,169.850	24,940,032.150	
SUZLON ENERGY LTD	819,552	54.450	44,624,606.400	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	114,277	563.750	64,423,658.750	
ITC LTD	252,222	481.600	121,470,115.200	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	13,091	2,796.700	36,611,599.700	

UNITED PHOSPHORUS LTD	38,855	533.650	20,734,970.750	
SUNDARAM FINANCE LTD	5,486	4,458.600	24,459,879.600	
PHOENIX MILLS LTD	16,344	1,529.300	24,994,879.200	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,201	3,235.350	26,533,105.350	
THERMAX LTD	3,487	3,635.800	12,678,034.600	
SIEMENS INDIA LTD	7,243	5,803.300	42,033,301.900	
INFO EDGE INDIA LTD	6,037	7,253.150	43,787,266.550	
GMR AIRPORTS LTD	221,624	69.700	15,447,192.800	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	50,227	615.100	30,894,627.700	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	35,847	1,159.000	41,546,673.000	
TECH MAHINDRA LTD	45,864	1,659.650	76,118,187.600	
VOLTAS LTD	17,808	1,591.900	28,348,555.200	
INDIAN HOTELS CO LTD	70,981	756.100	53,668,734.100	
TORRENT POWER LTD	13,970	1,309.750	18,297,207.500	
VODAFONE IDEA LTD	1,888,461	7.740	14,616,688.140	
MARICO LTD	43,191	668.400	28,868,864.400	
POWER FINANCE CORP LTD	126,294	389.300	49,166,254.200	
PAGE INDUSTRIES LTD	508	45,911.600	23,323,092.800	
ABB LTD/INDIA	4,375	6,109.250	26,727,968.750	
DLF LTD	61,541	710.800	43,743,342.800	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	393,418	287.600	113,147,016.800	
NHPC LTD	249,136	72.570	18,079,799.520	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	9,382	6,003.400	56,323,898.800	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	44,341	1,066.650	47,296,327.650	
REC LTD	107,503	446.750	48,026,965.250	
BAJAJ FINSERV LTD	31,224	1,674.150	52,273,659.600	
BAJAJ AUTO LTD	5,635	8,596.250	48,439,868.750	
JUBILANT FOODWORKS LTD	30,266	706.600	21,385,955.600	
ADANI POWER LTD	49,121	449.900	22,099,537.900	
OIL INDIA LTD	39,185	452.400	17,727,294.000	
MUTHOOT FINANCE LTD	9,935	2,096.500	20,828,727.500	
OBEROI REALTY LTD	10,695	2,013.350	21,532,778.250	
PRESTIGE ESTATES PROJECTS LTD	14,313	1,426.650	20,419,641.450	
JSW ENERGY LTD	36,281	517.750	18,784,487.750	
COAL INDIA LTD	159,509	362.900	57,885,816.100	
INDUS TOWERS LTD	96,139	320.500	30,812,549.500	
PI INDUSTRIES LTD	6,463	3,400.300	21,976,138.900	
VARUN BEVERAGES LTD	97,412	574.750	55,987,547.000	
BSE LTD	5,555	5,156.600	28,644,913.000	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	8,731	3,230.900	28,208,987.900	
LTIMINDTREE LTD	6,071	6,030.750	36,612,683.250	
ADANI GREEN ENERGY LTD	17,208	889.750	15,310,818.000	

HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	83,639	599.750	50,162,490.250	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,495	560.300	17,086,348.500	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	16,628	3,788.250	62,991,021.000	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	8,321	3,834.550	31,907,290.550	
GODREJ PROPERTIES LTD	12,290	2,248.900	27,638,981.000	
POLYCAB INDIA LTD	4,354	6,251.800	27,220,337.200	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	36,261	1,222.550	44,330,885.550	
RAIL VIKAS NIGAM LTD	42,297	357.950	15,140,211.150	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	26,315	713.550	18,777,068.250	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	22,862	746.850	17,074,484.700	
ZOMATO LTD	561,078	227.150	127,448,867.700	
MACROTECH DEVELOPERS LTD	24,489	1,165.300	28,537,031.700	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	66,464	1,082.450	71,943,956.800	
KALYAN JEWELLERS INDIA LTD	34,590	573.100	19,823,529.000	
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	2,845	15,835.150	45,051,001.750	
APL APOLLO TUBES LTD	15,555	1,424.100	22,151,875.500	
SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	36,048	561.900	20,255,371.200	
PB FINTECH LTD	26,534	1,697.150	45,032,178.100	
MANKIND PHARMA LTD	8,411	2,595.950	21,834,535.450	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	237,284	266.150	63,153,136.600	
ASTRAL POLYTECHNIK LTD	12,169	1,471.500	17,906,683.500	
ZYDUS LIFESCIENCES LTD	19,977	975.100	19,479,572.700	
AVENUE SUPERMARTS LTD	13,403	3,507.450	47,010,352.350	
IDFC BANK LTD	288,299	59.330	17,104,779.670	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	20,168	1,836.950	37,047,607.600	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	30,106	636.450	19,160,963.700	
ALKEM LABORATORIES LTD	3,499	5,227.400	18,290,672.600	
INTERGLOBE AVIATION LTD	15,603	4,001.400	62,433,844.200	
SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	2,247	8,922.400	20,048,632.800	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	37,204	1,467.400	54,593,149.600	
インド・ルビー 小計	16,170,086		10,281,945,405.660 (18,815,960,092)	

インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	2,181,173	1,010.000	2,202,984,730.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	135,001	25,400.000	3,429,025,400.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	364,000	7,725.000	2,811,900,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	591,600	1,720.000	1,017,552,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,654,200	4,750.000	7,857,450,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,103,900	2,670.000	10,957,413,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	620,600	4,560.000	2,829,936,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	192,100	6,700.000	1,287,070,000.000	
	BANK MANDIRI	3,178,600	5,525.000	17,561,765,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,827,900	3,850.000	22,437,415,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,320,300	4,210.000	5,558,463,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,953,000	1,265.000	2,470,545,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,652,400	9,675.000	45,011,970,000.000	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	633,400	6,975.000	4,417,965,000.000	
	ALAMTRI RESOURCES INDONESIA TBK PT	1,190,100	2,350.000	2,796,735,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	194,100	11,100.000	2,154,510,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,482,800	2,830.000	4,196,324,000.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	74,896,200	79.000	5,916,799,800.000	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL PT	528,400	8,500.000	4,491,400,000.000	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	794,082	1,475.000	1,171,270,950.000		
インドネシア・ルピア 小計	106,493,856		150,578,493,880.000 (1,460,611,391)		
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	11,532	43.050	496,452.600	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	69.500	403,100.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	40.630	241,342.200	
	ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	4,100	48.050	197,005.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	10.760	129,120.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	5,180	34.340	177,881.200	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	15.680	191,296.000	

KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	12,100	40.450	489,445.000	
UNISPLENDOR CORP LTD	18,640	24.010	447,546.400	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	13.960	266,636.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	49.660	59,592.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	20.680	335,016.000	
HUAGONG TECH CO LTD	2,200	37.970	83,534.000	
CHANGCHUN HIGH-TECH INDUSTRY GROUP CO LTD	2,100	92.700	194,670.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	26.000	306,800.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	25.190	204,039.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	29.440	409,216.000	
SHANJIN INTERNATIONAL GOLD CO LTD	23,900	17.000	406,300.000	
SHANDONG HIMILE MECHANICAL SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	5,600	50.810	284,536.000	
GEM CO LTD	29,100	6.350	184,785.000	
HANGZHOU GREATSTAR INDUSTRIAL CO LTD	6,200	31.300	194,060.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	19.240	325,156.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	10,560	71.670	756,835.200	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	6.880	107,279.840	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,812	21.750	126,411.000	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	15.760	210,553.600	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	30.490	155,499.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	47.610	442,773.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	20.360	211,744.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	1,000	34.200	34,200.000	
ZHEJIANG WANFENG AUTO WHEEL CO LTD	11,100	16.340	181,374.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	24,000	36.250	870,000.000	

CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	8,950	24.490	219,185.500	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	7.630	137,340.000	
TIANQI LITHIUM CORP	4,300	32.290	138,847.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	13.400	150,080.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	11.260	279,248.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	27.860	334,320.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	15.580	121,524.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	8.720	449,516.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	7,800	42.560	331,968.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,239	57.950	129,750.050	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	7,770	46.630	362,315.100	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.670	135,509.000	
O-FILM TECH CO LTD	16,900	11.050	186,745.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	39,729	12.300	488,666.700	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	36.500	394,200.000	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	7,900	28.880	228,152.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	58,700	7.240	424,988.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	60.850	298,165.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	10.070	154,071.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	6,200	32.340	200,508.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	37.000	185,000.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	70,900	3.280	232,552.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	14.400	228,960.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	19.930	195,314.000	



LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,600	116.290	883,804.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	4,800	58.350	280,080.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	8.260	112,955.500	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	35.090	319,319.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,800	252.880	708,064.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.020	219,609.600	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	37,754	37.860	1,429,366.440	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	16.090	481,091.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.450	459,885.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	8.440	167,956.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	14.550	277,905.000	
IFLYTEK CO LTD	11,500	45.130	518,995.000	
GOERTEK INC	18,100	23.890	432,409.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.760	165,288.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	24.630	866,976.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	30,200	22.350	674,970.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	91,909	4.810	442,082.290	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	6.270	177,441.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	12.400	502,051.200	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	7.530	170,931.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,300	24.900	306,270.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	56.150	590,698.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	77,918	22.120	1,723,546.160	
JIANGSU YANGHE DISTILLERY CO LTD	7,800	78.620	613,236.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	18,600	129.200	2,403,120.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	58,900	6.620	389,918.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	137,400	4.160	571,584.000	

CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	10.090	463,131.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	44.900	543,290.000	
MIDEA GROUP CO LTD	16,200	74.300	1,203,660.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	10.190	431,037.000	
PING AN BANK CO LTD	97,200	11.200	1,088,640.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	40,080	15.800	633,264.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	113,500	4.920	558,420.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	6.760	372,476.000	
ZTE CORP	16,500	39.000	643,500.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	6.610	188,385.000	
WEICHAO POWER CO LTD	44,200	13.900	614,380.000	
GF SECURITIES CO LTD	31,600	15.210	480,636.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	9.830	207,413.000	
BYD CO LTD	8,400	266.000	2,234,400.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	7.480	255,068.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	18.110	174,942.600	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	35.140	183,430.800	
LB GROUP CO LTD	11,000	16.670	183,370.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	8.310	355,668.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,800	382.460	1,070,888.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	27.190	348,032.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	7.590	259,578.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	47,800	3.890	185,942.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	169.700	288,490.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	28.490	188,034.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	53.240	31,944.000	
NINESTAR CORP	10,400	25.520	265,408.000	

HISENSE HOME APPLIANCES GROUP CO LTD	5,700	31.220	177,954.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	6.440	246,008.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	17.900	302,510.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	70.000	127,400.000	
SF HOLDING CO LTD	24,400	39.390	961,116.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	61.380	153,450.000	
VICTORY GIANT TECHNOLOGY HUIZHOU CO LTD	4,200	46.730	196,266.000	
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC LTD	3,900	110.290	430,131.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	80,290	8.730	700,931.700	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	9.590	373,051.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	34,900	6.650	232,085.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	43.840	100,832.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	21,800	23.690	516,442.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	15.260	98,594.860	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	24,800	14.840	368,032.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	11.240	252,900.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	19.100	291,809.800	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	36.700	161,847.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,700	29.860	110,482.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	62.160	130,536.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	28.520	259,988.320	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	13.530	128,535.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	5,640	110.800	624,912.000	
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY NETWORK & TECHNOLOGY HOLDINGS CO LTD	27,500	13.150	361,625.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	100	56.080	5,608.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	3,340	123.180	411,421.200	

HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	103.670	311,010.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	31.750	152,400.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	28.720	89,032.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.430	94,361.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	51.150	122,760.000	
HUANENG LANCANG RIVER HYDROPOWER INC	19,000	8.910	169,290.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	16.680	355,284.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	140	45.530	6,374.200	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	21.690	255,942.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	68,700	19.720	1,354,764.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,800	231.450	1,342,410.000	
SG MICRO CORP	3,395	74.130	251,671.350	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	22,640	246.910	5,590,042.400	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	117.850	355,435.600	
WUXI APPTPEC CO LTD	13,972	53.170	742,891.240	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	30,200	7.030	212,306.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	17.850	183,855.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,400	5.790	135,486.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	3.490	287,925.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	31.330	228,709.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	77.020	197,171.200	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	25,300	16.720	423,016.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	24.410	181,244.250	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,540	180.010	277,215.400	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	70.210	77,231.000	

WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	41.980	105,789.600	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	178.960	536,880.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	62.910	339,714.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	53,400	5.690	303,846.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	28,700	9.480	272,076.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	5,030	99.750	501,742.500	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	26,100	8.140	212,454.000	
TIANFENG SECURITIES CO LTD	43,200	4.090	176,688.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.780	317,754.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	2.700	190,890.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	35.450	379,315.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	7.540	186,992.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	53.300	154,570.000	
CGN POWER CO LTD	69,500	3.580	248,810.000	
CITIC PACIFIC SPECIAL STEEL GROUP CO LTD	21,200	11.080	234,896.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	227,000	5.690	1,291,630.000	
GONEO GROUP CO LTD	2,755	66.660	183,648.300	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	121.000	387,200.000	
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO LTD	2,800	86.690	242,732.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	97.600	149,913.600	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	5,520	26.500	146,280.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	117,600	5.240	616,224.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.190	213,990.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	52.590	168,288.000	
ACM RESEARCH SHANGHAI INC	2,200	95.980	211,156.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	8.560	372,360.000	

GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	53.910	75,474.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	30.490	185,989.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	12.470	144,302.840	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.080	216,448.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	6,577	68.470	450,327.190	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	61.120	177,248.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	75.400	196,040.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	14,400	30.650	441,360.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	43.120	198,352.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	4,000	123.600	494,400.000	
PIOTECH INC	876	144.240	126,354.240	
RANGE INTELLIGENT COMPUTING TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9,100	50.000	455,000.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	6.400	257,280.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,200	719.000	1,581,800.000	
GALAXYCORE INC	10,400	13.160	136,864.000	
EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD	2,400	108.110	259,464.000	
ANKER INNOVATIONS TECHNOLOGY CO LTD	3,400	103.440	351,696.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,540	169.360	260,814.400	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	4,480	88.310	395,628.800	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	255.000	623,985.000	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	18.570	352,830.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	1,176	219.990	258,708.240	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	21.860	187,996.000	
LOONGSON TECHNOLOGY CORP LTD	1,600	122.190	195,504.000	
HWATSING TECHNOLOGY CO LTD	1,200	150.800	180,960.000	

CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.180	404,608.000	
WINTIME ENERGY GROUP CO LTD	149,700	1.550	232,035.000	
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	11,700	34.380	402,246.000	
PETROCHINA CO LTD	117,300	8.870	1,040,451.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	305,700	6.600	2,017,620.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	413,100	5.030	2,077,893.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	5.350	1,048,600.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	160,800	6.210	998,568.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	37.430	516,534.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,900	38.890	1,318,371.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	100,000	39.070	3,907,000.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	51,800	48.590	2,516,962.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	99,900	19.290	1,927,071.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	139,600	10.000	1,396,000.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	133,400	3.930	524,262.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	16.270	691,475.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	6,200	1,443.980	8,952,676.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	194,300	7.270	1,412,561.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	59,700	26.510	1,582,647.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	38,900	30.620	1,191,118.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	117,200	28.810	3,376,532.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	6.230	514,598.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	3.610	831,383.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	204,500	5.490	1,122,705.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	10.370	575,535.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	7.430	525,301.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	29,600	28.450	842,120.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	138,300	5.860	810,438.000	

CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	168,900	4.740	800,586.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	117,500	6.510	764,925.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	23.810	552,392.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	17.350	716,555.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	6.270	369,930.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	24.760	289,692.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	55,700	8.630	480,691.000	
CRRC CORP LTD	108,900	7.400	805,860.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	32,652	42.810	1,397,832.120	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	21.310	370,794.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	16.350	658,905.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	85,600	5.810	497,336.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,600	44.850	296,010.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	25,700	27.200	699,040.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	45,600	15.310	698,136.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.230	428,499.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	8.290	465,898.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	23.480	291,152.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	6.050	159,720.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	38,100	11.080	422,148.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	14,500	66.690	967,005.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	6.940	546,178.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GENERATION CO LTD	81,400	2.610	212,454.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	103,500	16.400	1,697,400.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	7.610	419,311.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	14.840	566,888.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	41,712	23.200	967,718.400	



CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	60.170	589,666.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	8.380	258,942.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.790	398,275.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	74.500	327,800.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	76,300	7.430	566,909.000	
AIR CHINA LTD	44,800	7.280	326,144.000	
TBEA CO LTD	24,180	11.950	288,951.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	7.310	317,985.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	3.040	170,848.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	4.950	515,790.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	21,200	32.160	681,792.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,600	32.400	375,840.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	26.640	183,816.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	20.860	310,814.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	4.280	146,804.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	5,800	15.820	91,756.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	25,200	8.060	203,112.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	9.400	310,200.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	15.650	370,905.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	19.880	226,632.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	38.770	360,561.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.410	596,493.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	20,450	4.810	98,364.500	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	72,870	14.190	1,034,025.300	
CMOC GROUP LIMITED	79,800	6.940	553,812.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	31,700	12.840	407,028.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	5.750	194,350.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	37.030	333,270.000	

SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	24.540	493,744.800	
JIANGSU PHOENIX PUBLISHING & MEDIA CORP LTD	12,400	10.250	127,100.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	20.850	162,630.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	10.200	282,540.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.640	440,012.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	27,300	13.120	358,176.000	
YUTONG BUS CO LTD	6,000	26.760	160,560.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	8.810	377,949.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	3.720	295,740.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	14.120	212,068.280	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	4.990	289,420.000	
CHINA XD ELECTRIC CO LTD	25,700	6.900	177,330.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	16,400	13.420	220,088.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	25.280	259,473.920	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	9.900	160,875.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	19.200	63,360.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	6.030	271,953.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	59.700	608,940.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.570	180,873.000	
YOUNGOR FASHION CO LTD	25,600	8.030	205,568.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	37.000	170,200.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	7.280	122,304.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	11,400	20.930	238,602.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	31,800	12.680	403,224.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	6.680	149,298.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.920	193,848.000	

WESTERN MINING CO LTD	15,100	17.200	259,720.000	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,500	205.000	512,500.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	6,080	173.560	1,055,244.800	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	6.620	376,016.000	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-TECH PARK DEVELOPMENT CO LTD	9,200	25.210	231,932.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	5,550	45.170	250,693.500	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	24.600	499,380.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	3.920	114,464.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	3,240	19.150	62,046.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	12.800	161,280.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	15,900	12.730	202,407.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.550	268,460.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	7.080	336,016.800	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	21.140	268,478.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	15.700	91,531.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	9.070	203,168.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	15,400	24.660	379,764.000	
SHANXI COAL INTERNATIONAL ENERGY GROUP CO LTD	11,100	11.040	122,544.000	
TONGWEI CO LTD	17,000	20.180	343,060.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	12,784	27.080	346,190.720	
JCET GROUP CO LTD	10,900	38.900	424,010.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	24.380	165,784.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	57.300	143,250.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	20.550	215,569.500	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	11.000	222,706.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	8,424	52.000	438,048.000	

HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	15.180	297,528.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	14.230	280,331.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	11.900	186,830.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	33.080	162,092.000	
NINGBO SANXING MEDICAL ELECTRIC CO LTD	9,004	28.520	256,794.080	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	2,100	34.170	71,757.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	2,156	84.810	182,850.360	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	2,500	267.010	667,525.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	48.680	77,888.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	44.420	315,382.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	17.600	195,360.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	4.140	628,452.000	
CAPITAL SECURITIES CO LTD	9,600	19.310	185,376.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	29.500	342,200.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	52,200	8.040	419,688.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	7,760	46.090	357,658.400	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	12,200	143.400	1,749,480.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	44,968	14.630	657,881.840	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	13.150	167,005.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	134.000	241,200.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	5.140	376,762.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	700	27.740	19,418.000	
HEILAN HOME CO LTD	44,100	7.380	325,458.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	45,651	22.110	1,009,343.610	
HUAQIN TECHNOLOGY CO LTD	3,800	67.220	255,436.000	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	25,519	42.280	1,078,943.320	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	4,400	42.470	186,868.000	

	DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	10.570	139,524.000	
	NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	10,150	53.100	538,965.000	
	JUNEYAO AIRLINES CO LTD	18,100	12.690	229,689.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	17.280	703,296.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	9.310	977,550.000	
	SERES GROUP CO LTD	9,000	132.000	1,188,000.000	
	ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	55.140	292,242.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	9.480	788,736.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	33,900	14.180	480,702.000	
	SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	17.210	196,194.000	
	AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	40.060	56,084.000	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	21,200	13.420	284,504.000	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	3,100	74.970	232,407.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	13.470	409,488.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	6.820	288,486.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	19.780	363,952.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,616	13.400	75,254.400	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,804	24.200	116,256.800	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	62.830	184,720.200	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	19.600	221,676.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	44,800	9.540	427,392.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	53.300	351,780.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	16.860	269,760.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	28.190	126,855.000	
	オフショア・人民元 小計	12,903,680		185,447,471.860 (3,977,291,929)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	389,484	16.450	6,407,011.800	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	268,621	4.120	1,106,718.520	
	OOREDOO QSC	60,920	11.760	716,419.200	
	QATAR FUEL QSC	46,222	14.740	681,312.280	

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,416	15.500	579,948.000	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	83,628	10.290	860,532.120	
	INDUSTRIES QATAR QSC	123,793	13.000	1,609,309.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	145,929	20.000	2,918,580.000	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	239,235	4.170	997,609.950	
	MASRAF AL RAYAN	479,150	2.410	1,154,751.500	
	BARWA REAL ESTATE CO	190,141	2.789	530,303.240	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	555,481	1.426	792,115.900	
	DUKHAN BANK	178,162	3.608	642,808.490	
カタール・リアル 小計		2,798,182		18,997,420.000 (822,588,286)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	849,495	0.751	637,970.740	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	177,519	0.459	81,481.220	
	GULF BANK KSCP	154,340	0.310	47,845.400	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	663,586	0.907	601,872.500	
	MABANEE CO KPSC	64,122	0.779	49,951.030	
	BOUBYAN BANK KSCP	134,857	0.605	81,588.480	
クウェート・ディナール 小計		2,043,919		1,500,709.370 (767,252,673)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	40,305	17,040.000	686,797,200.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,049	37,520.000	752,238,480.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	39,539	34,960.000	1,382,283,440.000	
コロンビア・ペソ 小計		99,893		2,821,319,120.000 (103,147,427)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	21,587	37.400	807,353.800	
	JARIR MARKETING CO	45,430	12.660	575,143.800	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,633	150.000	994,950.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	31,195	55.700	1,737,561.500	
	SAUDI BRITISH BANK	83,723	33.450	2,800,534.350	
	AL RAJHI BANK	164,647	95.800	15,773,182.600	
	ARAB NATIONAL BANK	74,025	20.920	1,548,603.000	
	BANK ALBILAD	50,864	38.500	1,958,264.000	
	BANK AL-JAZIRA	44,736	18.520	828,510.720	
	BANQUE SAUDI FRANSI	108,986	15.520	1,691,462.720	
	RIYAD BANK	125,685	28.000	3,519,180.000	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	56,260	14.220	800,017.200	
	SAUDI TELECOM CO	167,194	41.250	6,896,752.500	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	20,002	108.800	2,176,217.600		

SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	76,374	67.000	5,117,058.000	
SAUDI ELECTRICITY CO	70,794	16.600	1,175,180.400	
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	27,847	17.680	492,334.960	
ALMARAI CO JSC	40,613	55.500	2,254,021.500	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,121	270.600	844,542.600	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	30,296	22.960	695,596.160	
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,164	31.250	317,625.000	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	60,476	6.830	413,051.080	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	45,204	15.900	718,743.600	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	36,059	10.240	369,244.160	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	7,295	204.800	1,494,016.000	
ALINMA BANK	105,138	29.800	3,133,112.400	
SAUDI ARABIAN MINING CO	109,268	47.150	5,151,986.200	
AL RAJHI CO FOR CO- OPERATIVE INSURANCE	3,239	175.400	568,120.600	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,975	86.800	692,230.000	
DALLAH HEALTHCARE CO	3,410	152.600	520,366.000	
SAUDI ARABIAN OIL CO	487,951	28.050	13,687,025.550	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	7,316	296.600	2,169,925.600	
ACWA POWER CO	12,380	396.600	4,909,908.000	
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	3,981	109.800	437,113.800	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,198	289.800	636,980.400	
NAHDI MEDICAL CO	3,277	118.000	386,686.000	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,900	212.200	827,580.000	
ELM CO	1,959	1,174.000	2,299,866.000	
POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	6,635	51.700	343,029.500	
ADES HOLDING CO	26,333	18.580	489,267.140	
SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	2,057	270.000	555,390.000	
THE SAUDI NATIONAL BANK	248,427	33.250	8,260,197.750	
サウジアラビア・リアル 小計	2,444,654		101,067,932.190	

(4,248,895,869)

タイ・パーツ	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	303,000	22.000	6,666,000.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	45,400	162.000	7,354,800.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,204,900	1.840	4,057,016.000	
	SHIN CORP PCL	85,000	97.750	8,308,750.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	21.700	6,510,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	100,500	282.000	28,341,000.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	516,920	8.800	4,548,896.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	263,800	148.500	39,174,300.000	
	PTT PCL	806,100	31.250	25,190,625.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	80,500	50.000	4,025,000.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	65,050	151.500	9,855,075.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	347,800	56.500	19,650,700.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	177,300	53.250	9,441,225.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	911,100	23.900	21,775,290.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	53,100	192.500	10,221,750.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	274,010	23.800	6,521,438.000	
	THAI OIL PCL NVDR	110,700	25.500	2,822,850.000	
	CP ALL PCL NVDR	480,400	54.500	26,181,800.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	119,045	127.000	15,118,715.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	183,408	22.800	4,181,702.400	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	629,900	6.850	4,314,815.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	253,500	58.000	14,703,000.000		
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	158,333	33.750	5,343,738.750		
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	328,000	11.700	3,837,600.000		
SCB X PCL NVDR	67,700	121.000	8,191,700.000		
TRUE CORP PCL NVDR	896,328	11.000	9,859,608.000		
CP AXTRA PCL NVDR	157,001	26.750	4,199,776.750		
タイ・パーツ 小計	9,918,795		310,397,170.900 (1,409,203,156)		
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,881	866.000	5,092,946.000	
	CEZ	13,485	991.000	13,363,635.000	



	MONETA MONEY BANK AS	23,959	127.400	3,052,376.600	
チェコ・コルナ	小計	43,325		21,508,957.600 (137,627,216)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,279,808	46.000	242,871,168.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	7,027	27,607.000	193,994,389.000	
	BANCO DE CHILE	3,896,607	113.900	443,823,537.300	
	EMPRESAS CMPC SA	84,902	1,615.600	137,167,671.200	
	EMPRESAS COPEC SA	29,969	6,205.000	185,957,645.000	
	ENEL AMERICAS SA	1,683,461	88.690	149,306,156.090	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	13,823,587	13.200	182,471,348.400	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	12,501	38,705.000	483,851,205.000	
	FALABELLA SA	72,570	3,460.000	251,092,200.000	
	CENCOSUD SA	116,272	2,205.000	256,379,760.000	
	ENEL CHILE SA	2,582,189	57.650	148,863,195.850	
チリ・ペソ	小計	27,588,893		2,675,778,275.840 (418,309,769)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	260,091	62.800	16,333,714.800	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	16,795	163.500	2,745,982.500	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	108,854	78.800	8,577,695.200	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	265,342	23.100	6,129,400.200	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,691	914.000	5,201,574.000	
	KOC HOLDING AS	64,676	177.200	11,460,587.200	
	SASA POLYESTER SANAYI	841,840	3.870	3,257,920.800	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	109,000	39.320	4,285,880.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,686	289.750	12,947,768.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	105,442	94.650	9,980,085.300	
	TURKIYE IS BANKASI	737,684	14.140	10,430,851.760	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	79,870	143.900	11,493,293.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	281,190	29.860	8,396,333.400	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	100,371	97.050	9,741,005.550	
	COCA-COLA ICECEK AS	69,740	55.400	3,863,596.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	39,489	524.000	20,692,236.000	
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	16,769	210.300	3,526,520.700		
トルコ・リラ	小計	3,147,530		149,064,444.910 (662,218,797)	
ハンガリー・ フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	11,886	10,670.000	126,823,620.000	

	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	32,609	2,808.000	91,566,072.000	
	OTP BANK NYRT	19,016	22,960.000	436,607,360.000	
ハンガリー・フォリント 小計		63,511		654,997,052.000 (256,328,511)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	587,800	25.250	14,841,950.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	144,448	118.100	17,059,308.800	
	AYALA CORP	21,463	583.000	12,512,929.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	84,580	392.200	33,172,276.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	204,960	19.320	3,959,827.200	
	JOLLIBEE FOODS CORP	43,740	255.000	11,153,700.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	153,485	71.100	10,912,783.500	
	BDO UNIBANK INC	189,682	146.700	27,826,349.400	
	PLDT INC	5,690	1,294.000	7,362,860.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	843,375	23.800	20,072,325.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	75,450	75.000	5,658,750.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,383	834.000	16,165,422.000	
MANILA ELECTRIC COMPANY	24,420	484.000	11,819,280.000		
フィリピン・ペソ 小計		2,398,476		192,517,760.900 (516,679,167)	
ブラジル・リアル	BRF SA	43,000	23.550	1,012,650.000	
	VALE SA	288,489	51.510	14,860,068.390	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	83,500	8.830	737,305.000	
	RAIA DROGASIL SA	113,564	20.950	2,379,165.800	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,450	37.400	764,830.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	104,000	33.970	3,532,880.000	
	BANCO DO BRASIL SA	146,500	24.210	3,546,765.000	
	ITAUSA SA	462,112	8.720	4,029,616.640	
	GERDAU SA	111,337	16.990	1,891,615.630	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	317,810	40.950	13,014,319.500	
	VIBRA ENERGIA SA	84,500	17.500	1,478,750.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	374,312	37.070	13,875,745.840	
	CCR SA	79,920	10.150	811,188.000	
	WEG SA	141,944	53.250	7,558,518.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	439,502	11.220	4,931,212.440	
	BANCO BRADESCO SA	152,592	10.330	1,576,275.360	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	48,206	7.680	370,222.080	
	SUZANO SA	58,175	62.080	3,611,504.000	
CPFL ENERGIA SA	16,900	32.020	541,138.000		
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	407,847	30.860	12,586,158.420		

	ENGIE BRASIL SA	15,287	34.670	530,000.290	
	LOCALIZA RENT A CAR	77,089	28.760	2,217,079.640	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	62,004	15.510	961,682.040	
	COSAN SA	108,400	8.210	889,964.000	
	TOTVS SA	51,500	26.730	1,376,595.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	104,900	27.140	2,846,986.000	
	EMBRAER SA	60,500	56.550	3,421,275.000	
	JBS SA	63,800	35.450	2,261,710.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	160,340	10.490	1,681,966.600	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	39,298	88.160	3,464,511.680	
	HYPERA SA	29,800	17.980	535,804.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	450,048	9.790	4,405,969.920	
	PRIO SA	66,200	42.530	2,815,486.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	35,328	46.840	1,654,763.520	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	57,900	36.180	2,094,822.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	404,761	2.160	874,283.760	
	AMBEV SA	401,295	11.240	4,510,555.800	
	NATURA &CO HOLDING SA	68,800	12.080	831,104.000	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACOES S/A	52,100	14.110	735,131.000	
	TIM SA	74,400	13.840	1,029,696.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	64,100	26.060	1,670,446.000	
	RUMO SA	116,900	17.110	2,000,159.000	
	ブラジル・リアル 小計	6,059,410		135,919,919.350 (3,511,015,397)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,196	548.000	655,408.000	
	BUDIMEX SA	1,092	464.600	507,343.200	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,446	121.150	1,386,682.900	
	BANK PEKAO SA	15,205	143.500	2,181,917.500	
	ORLEN SA	47,436	50.210	2,381,761.560	
	LPP SA	91	14,920.000	1,357,720.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,706	466.800	1,729,960.800	
	CD PROJEKT RED SA	5,128	190.000	974,320.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	74,973	60.080	4,504,377.840	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	80,249	5.982	480,049.510	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	50,840	47.650	2,422,526.000	
	ALIOR BANK SA	8,827	87.820	775,187.140	

	DINO POLSKA SA	3,914	397.500	1,555,815.000	
	ALLEGRO.EU SA	47,943	25.670	1,230,696.810	
ポーランド・ズロチ 小計		352,046		22,143,766.260 (836,901,502)	
マレーシア・ リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	201,900	5.470	1,104,393.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	620,200	8.100	5,023,620.000	
	CELCOMDIGI BHD	307,100	3.680	1,130,128.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	82,820	10.920	904,394.400	
	RHB BANK BHD	130,580	6.280	820,042.400	
	GAMUDA BHD	350,200	4.790	1,677,458.000	
	GENTING BHD	164,900	3.600	593,640.000	
	YTL CORP BHD	263,000	2.300	604,900.000	
	HONG LEONG BANK BHD	49,008	20.100	985,060.800	
	IOI CORP BHD	206,713	3.780	781,375.140	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,900	21.100	926,290.000	
	MALAYAN BANKING BHD	447,575	10.080	4,511,556.000	
	MISC BHD	123,180	7.200	886,896.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,000	92.500	555,000.000	
	PPB GROUP BHD	50,260	12.100	608,146.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,900	19.260	441,054.000	
	PETRONAS GAS BHD	61,000	17.560	1,071,160.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	240,100	2.160	518,616.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,300	6.550	624,215.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	238,150	13.900	3,310,285.000	
	QL RESOURCES BHD	130,575	4.510	588,893.250	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	1,225,250	4.450	5,452,362.500	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	193,300	4.000	773,200.000	
	SIME DARBY BERHAD	234,400	2.180	510,992.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	264,700	2.240	592,928.000	
	MAXIS BHD	228,800	3.610	825,968.000	
	INARI AMERTRON BHD	221,900	2.780	616,882.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	265,400	4.730	1,255,342.000		
SUNWAY BHD	188,500	4.490	846,365.000		
IHH HEALTHCARE BHD	190,200	7.100	1,350,420.000		
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	325,000	4.700	1,527,500.000		
SD GUTHRIE BHD	161,500	4.820	778,430.000		
MR DIY GROUP M BHD	321,100	1.760	565,136.000		
マレーシア・リンギット 小計		7,655,411		42,762,648.490 (1,496,863,748)	
メキシコ・ペ ソ	ALFA SAB DE CV	303,256	15.520	4,706,533.120	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	105,200	50.670	5,330,484.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,115	327.140	5,271,861.100	

	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	15,860	181.880	2,884,616.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	47,400	114.970	5,449,578.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	220,800	141.810	31,311,648.000	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	17,495	282.950	4,950,210.250	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	121,600	29.490	3,585,984.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	15,550	535.340	8,324,537.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	263,152	101.560	26,725,717.120	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	153,200	44.070	6,751,524.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,700	181.970	7,770,119.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	442,300	57.890	25,604,747.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	32,725	387.480	12,680,283.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	22,800	186.840	4,259,952.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	22,500	124.700	2,805,750.000	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	104,000	11.220	1,166,880.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,545,278	14.410	22,267,455.980	
メキシコ・ペソ	小計	3,491,931		181,847,880.370 (1,388,153,980)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	93,045	4.121	383,438.440	
	ALPHA BANK A.E.	185,591	1.699	315,319.100	
	NATIONAL BANK OF GREECE	72,116	8.020	578,370.320	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,453	14.750	213,181.750	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	220,148	2.286	503,258.320	
	METLEN ENERGY & METALS SA	8,906	33.140	295,144.840	
	OPAP SA	16,444	15.600	256,526.400	
	JUMBO SA	9,605	25.420	244,159.100	
	PUBLIC POWER CORP	16,875	12.260	206,887.500	
ユーロ	小計	640,313		2,996,285.770 (483,690,412)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	150,800.000	259,376,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,928	162,400.000	475,507,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,524	359,500.000	907,378,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,055	99,800.000	404,689,000.000	

COWAY CO LTD	4,884	70,000.000	341,880,000.000	
KT&G CORP	8,943	109,500.000	979,258,500.000	
KAKAO CORP	25,719	36,500.000	938,743,500.000	
HANWHA OCEAN CO LTD	7,741	45,150.000	349,506,150.000	
SK TELECOM CO LTD	4,637	56,000.000	259,672,000.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	22,468	8,010.000	179,968,680.000	
NCSOFT CORPORATION	1,142	181,200.000	206,930,400.000	
LG UPLUS CORP	17,131	10,460.000	179,190,260.000	
DOOSAN ENERBILITY	38,573	20,100.000	775,317,300.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	4,225	42,900.000	181,252,500.000	
LG H&H CO LTD	762	301,000.000	229,362,000.000	
LG CHEM LTD	4,278	241,000.000	1,030,998,000.000	
LG CHEM LTD	599	154,300.000	92,425,700.000	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	1,210	179,600.000	217,316,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	36,569	50,000.000	1,828,450,000.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	23,327	18,580.000	433,415,660.000	
S-OIL CORP	4,084	64,000.000	261,376,000.000	
POSCO FUTURE M CO LTD	2,767	149,400.000	413,389,800.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,819	57,100.000	103,864,900.000	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,523	235,000.000	827,905,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,109	254,000.000	1,297,686,000.000	
SK HYNIX INC	45,984	194,300.000	8,934,691,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,864	157,800.000	294,139,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	11,563	220,000.000	2,543,860,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,785	14,690.000	320,021,650.000	
KIA CORPORATION	20,341	105,400.000	2,143,941,400.000	
KOREA ZINC CO LTD	416	843,000.000	350,688,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,038	20,150.000	423,915,700.000	
KOREAN AIR CO LTD	16,333	23,000.000	375,659,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,209	91,500.000	110,623,500.000	
HLB INC	10,130	78,200.000	792,166,000.000	
LG ELECTRONICS INC	8,803	84,300.000	742,092,900.000	
LG CORP	7,791	73,900.000	575,754,900.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,334	13,510.000	180,142,340.000	
NAVER CORP	12,293	204,000.000	2,507,772,000.000	
L&F CO LTD	2,034	80,600.000	163,940,400.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,443	72,800.000	250,650,400.000	

POSCO HOLDINGS INC	5,851	257,000.000	1,503,707,000.000	
SAMSUNG E&A CO LTD	12,226	17,520.000	214,199,520.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,702	229,500.000	1,079,109,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,673	126,600.000	591,601,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	402,199	54,100.000	21,758,965,900.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	54,110	11,700.000	633,087,000.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	2,639	395,500.000	1,043,724,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	69,056	44,500.000	3,072,992,000.000	
YUHAN CORP	4,700	137,700.000	647,190,000.000	
GS HOLDINGS CORP	3,803	39,350.000	149,648,050.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,592	9,100.000	214,687,200.000	
CELLTRION INC	13,469	183,800.000	2,475,602,200.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3,614	106,900.000	386,336,600.000	
HANA FINANCIAL GROUP	24,400	58,600.000	1,429,840,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	3,240	131,100.000	424,764,000.000	
POSCO DX CO LTD	4,364	19,610.000	85,578,040.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,563	93,900.000	616,265,700.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,280	117,600.000	268,128,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,207	125,500.000	653,478,500.000	
ECOPRO CO LTD	8,650	60,500.000	523,325,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	713	241,500.000	172,189,500.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,135	162,200.000	184,097,000.000	
SK INC	2,945	143,000.000	421,135,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	31,535	89,300.000	2,816,075,500.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,445	52,200.000	336,429,000.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,719	109,100.000	842,142,900.000	
HANMI PHARM CO LTD	585	260,500.000	152,392,500.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,531	40,250.000	222,622,750.000	
HANJIN KAL CORP	2,068	80,000.000	165,440,000.000	
HYUNDAI ELECTRIC & ENERGY SYSTEM CO LTD	1,995	389,000.000	776,055,000.000	
HD HYUNDAI CO LTD	3,598	83,800.000	301,512,400.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,013	100,000.000	201,300,000.000	
NETMARBLE CORP	2,112	50,000.000	105,600,000.000	
HYUNDAI ROTEM CO LTD	6,379	55,400.000	353,396,600.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	54,067	15,560.000	841,282,520.000	
ECOPRO BM CO LTD	4,306	118,100.000	508,538,600.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,438	115,200.000	280,857,600.000	

	ENCHEM CO LTD	1,059	147,800.000	156,520,200.000	
	KRAFTON INC	2,500	333,500.000	833,750,000.000	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	1,376	76,300.000	104,988,800.000	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,930	309,500.000	597,335,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	7,635	91,200.000	696,312,000.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,340	50,100.000	117,234,000.000	
	HYBE CO LTD	1,832	214,000.000	392,048,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,951	347,500.000	1,372,972,500.000	
	KAKAOBANK CORP	13,292	21,100.000	280,461,200.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,513	125,000.000	439,125,000.000	
	ALTEOGEN INC	3,259	299,000.000	974,441,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	7,611	119,800.000	911,797,800.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,466	1,012,000.000	1,483,592,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,542	42,300.000	192,126,600.000	
韓国・ウォン 小計		1,280,326		88,890,918,120.000 (9,564,662,790)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	88,000	12.740	1,121,120.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	8.220	838,440.000	
	GUANGDONG LAND HOLDINGS LTD	47,092	0.295	13,892.140	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	8,700	108.810	946,647.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	100,000	19.540	1,954,000.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,500	26.850	1,141,125.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	320,000	3.880	1,241,600.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	476,000	3.250	1,547,000.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	258,700	7.870	2,035,969.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	51,000	20.000	1,020,000.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	691,600	4.350	3,008,460.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	320,120	12.080	3,867,049.600	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	273,388	22.000	6,014,536.000	
	CITIC LTD	495,000	8.320	4,118,400.000	
	LENOVO GROUP LTD	686,000	9.270	6,359,220.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,780,000	6.250	11,125,000.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	116,390	10.560	1,229,078.400	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,073,200	4.290	8,894,028.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	74,000	8.960	663,040.000		



KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	254,000	7.970	2,024,380.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,100	53.200	3,410,120.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	324,000	7.520	2,436,480.000	
HISENSE KELON ELECTRICAL HOLDINGS CO LTD	28,000	26.300	736,400.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	108,000	12.820	1,384,560.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	310,000	4.660	1,444,600.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	247,600	6.230	1,542,548.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	513,000	13.580	6,966,540.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	77,000	27.650	2,129,050.000	
BYD CO LTD	88,500	249.200	22,054,200.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	7.050	1,128,000.000	
MMG LTD	324,000	2.670	865,080.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,000	109.600	1,096,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	583,788	11.780	6,877,022.640	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.600	788,400.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	165,200	17.020	2,811,704.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	190,000	12.760	2,424,400.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	630,000	13.000	8,190,000.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	467,000	15.320	7,154,440.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	194,400	4.150	806,760.000	
WEICHAI POWER CO LTD	152,440	12.700	1,935,988.000	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	7.250	826,500.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	10.940	1,969,200.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	50,000	51.650	2,582,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	244,000	6.090	1,485,960.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	141,333	23.050	3,257,725.650	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	134,000	5.280	707,520.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	823,250	2.850	2,346,262.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	263,000	15.160	3,987,080.000	

TENCENT HOLDINGS LTD	546,200	366.000	199,909,200.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	566,500	40.950	23,198,175.000	
LI NING CO LTD	193,500	14.660	2,836,710.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	268,000	2.330	624,440.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	348,000	2.850	991,800.000	
ZTE CORP	63,288	23.200	1,468,281.600	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	285,000	30.450	8,678,250.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	221,250	11.820	2,615,175.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	735,205	6.100	4,484,750.500	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	170,250	11.760	2,002,140.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	63,000	35.450	2,233,350.000	
BAIDU INC	192,200	75.900	14,587,980.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,060,530	5.880	47,395,916.400	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	71,200	58.750	4,183,000.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	408,000	3.350	1,366,800.000	
BANK OF CHINA LTD	5,913,200	3.760	22,233,632.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	330,470	38.250	12,640,477.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,830,235	4.850	28,276,639.750	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	126,500	12.160	1,538,240.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	183,600	4.120	756,432.000	
CHINA COAL ENERGY CO	171,000	8.820	1,508,220.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	20.750	1,141,250.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	37,600	29.450	1,107,320.000	
CMOC GROUP LIMITED	315,000	5.690	1,792,350.000	
CHINA CITIC BANK-H	733,800	5.170	3,793,746.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	58,700	60.900	3,574,830.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	108,200	78.000	8,439,600.000	
FOSUN INTERNATIONAL	242,028	4.090	989,894.520	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	316,000	3.580	1,131,280.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,200	32.850	2,503,170.000	

GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,821,000	1.070	1,948,470.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	22.500	1,226,250.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	351,000	3.600	1,263,600.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	63,500	37.250	2,365,375.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	423,000	4.470	1,890,810.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	219,200	21.850	4,789,520.000	
CRRG CORP LTD - H	400,000	4.700	1,880,000.000	
SINOPHARM GROUP CO	115,600	19.880	2,298,128.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	230,500	11.420	2,632,310.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	264,000	5.580	1,473,120.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	70,400	12.140	854,656.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	168,800	6.600	1,114,080.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	180,000	9.460	1,702,800.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	85,200	21.400	1,823,280.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	3.380	2,123,167.280	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.770	628,790.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,325,000	4.170	9,695,250.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	68,000	11.720	796,960.000	
FAR EAST HORIZON LTD	169,000	5.420	915,980.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	129,000	19.440	2,507,760.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	239,600	6.090	1,459,164.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	780,000	3.610	2,815,800.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	297,500	6.440	1,915,900.000	
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	4.430	2,968,100.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	106,000	9.000	954,000.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	64,000	14.240	911,360.000	

CHINA TOWER CORP LTD	3,674,000	1.080	3,967,920.000	
XIAOMI CORP	1,289,200	32.800	42,285,760.000	
BEIGENE LTD	59,400	106.600	6,332,040.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	24,112	52.000	1,253,824.000	
MEITUAN	416,910	137.400	57,283,434.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	104,800	17.780	1,863,344.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	136,000	13.800	1,876,800.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,000	3.060	1,181,160.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	105,500	33.850	3,571,175.000	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	40,300	30.000	1,209,000.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	102,000	16.260	1,658,520.000	
CHINA FEIHE LTD	317,000	5.070	1,607,190.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,368,968	78.100	106,916,400.800	
JD.COM INC	207,985	129.000	26,830,065.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	162,000	12.560	2,034,720.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	226,900	38.800	8,803,720.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	206,400	24.550	5,067,120.000	
BILIBILI INC	19,180	125.300	2,403,254.000	
AKESO INC	50,000	55.400	2,770,000.000	
NETEASE INC	163,200	148.600	24,251,520.000	
NONGFU SPRING CO LTD	173,000	33.450	5,786,850.000	
LI AUTO INC	105,200	85.300	8,973,560.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	98,350	27.550	2,709,542.500	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	63,200	28.150	1,779,080.000	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	36,100	140.400	5,068,440.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	163,161	4.830	788,067.630	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	125,600	48.000	6,028,800.000	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	45,800	84.400	3,865,520.000	
JD LOGISTICS INC	165,100	11.760	1,941,576.000	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	24,000	48.750	1,170,000.000	
TRIP.COM GROUP LTD	52,100	496.400	25,862,440.000	
XPENG INC	101,300	46.650	4,725,645.000	
NIO INC	120,100	32.850	3,945,285.000	
MIDEA GROUP CO LTD	25,600	75.300	1,927,680.000	
MINISO GROUP HOLDING LTD	28,600	45.300	1,295,580.000	

	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	51,000	21.550	1,099,050.000	
	CGN POWER CO LTD	931,000	2.470	2,299,570.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	48,400	51.400	2,487,760.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	106,000	11.980	1,269,880.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	172,500	5.150	888,375.000	
	CHINA LITERATURE LTD	37,600	24.200	909,920.000	
	BOC AVIATION LTD	18,300	58.000	1,061,400.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	98,000	11.780	1,154,440.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	122,800	11.740	1,441,672.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	301,500	16.900	5,095,350.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	520,000	2.500	1,300,000.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	11.780	706,800.000	
香港・ドル	小計	66,066,079		1,014,214,956.410 (20,527,710,718)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	43,633	699.000	30,499,467.000	
	ACER INC	237,661	36.300	8,627,094.300	
	ASUSTEK COMPUTER INC	60,108	609.000	36,605,772.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	41,932	515.000	21,594,980.000	
	ASIA CEMENT CORP	197,320	39.450	7,784,274.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	555,714	14.700	8,168,995.800	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	83,996	94.500	7,937,622.000	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	44,968	260.000	11,691,680.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,335	183.500	10,520,972.500	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	118,525	140.000	16,593,500.000	
	QUANTA COMPUTER INC	227,954	270.500	61,661,557.000	
	EVA AIRWAYS CORP	228,765	45.950	10,511,751.750	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50,554	197.000	9,959,138.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	517,676	17.700	9,162,865.200	
	CHINA AIRLINES	231,823	25.150	5,830,348.450	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	160,684	49.850	8,010,097.400	
	CHINA STEEL CORP	1,043,670	18.100	18,890,427.000	
	ADVANTECH CO LTD	38,979	357.500	13,934,992.500	

COMPAL ELECTRONICS INC	353,445	36.000	12,724,020.000	
DELTA ELECTRONICS INC	164,235	400.000	65,694,000.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	110,788	25.400	2,814,015.200	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	312,973	123.000	38,495,679.000	
AUO CORP	526,500	13.400	7,055,100.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	147,784	111.500	16,477,916.000	
EVERGREEN MARINE CORP	88,482	205.000	18,138,810.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	266,768	30.150	8,043,055.200	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	40,131	130.000	5,217,030.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	16,492	514.000	8,476,888.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	49,961	484.000	24,181,124.000	
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	11,648	484.000	5,637,632.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	347,857	32.350	11,253,173.950	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	328,026	25.550	8,381,064.300	
MEDIATEK INC	128,686	1,390.000	178,873,540.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	688,749	89.800	61,849,660.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	735,202	26.800	19,703,413.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	25,419	600.000	15,251,400.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	150,343	87.600	13,170,046.800	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	880,744	34.050	29,989,333.200	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	808,894	64.200	51,930,994.800	
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,331,782	16.650	22,174,170.300	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,224,893	27.050	33,133,355.650	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,050,546	171.500	180,168,639.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	979,242	38.450	37,651,854.900	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,159	2,655.000	21,662,145.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	971,766	17.250	16,762,963.500	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,212,875	11.800	14,311,925.000	
INVENTEC CO LTD	220,927	50.000	11,046,350.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	175,114	102.000	17,861,628.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	904,694	22.650	20,491,319.100	

CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,407,673	38.300	53,913,875.900	
ASIA VITAL COMPONENTS CO LTD	26,609	516.000	13,730,244.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	925,948	27.350	25,324,677.800	
NAN YA PLASTICS CORP	438,405	28.700	12,582,223.500	
WISTRON CORP	234,307	103.000	24,133,621.000	
POU CHEN CORP	196,225	35.200	6,907,120.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	411,625	78.000	32,106,750.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	50,796	260.000	13,206,960.000	
E INK HOLDINGS INC	71,304	262.500	18,717,300.000	
INTERNATIONAL GAMES SYSTEM CO LTD	19,907	930.000	18,513,510.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121,517	40.350	4,903,210.950	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	106,935	71.000	7,592,385.000	
TCC GROUP HOLDINGS	589,163	30.500	17,969,471.500	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,072,722	1,075.000	2,228,176,150.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	960,537	40.900	39,285,963.300	
WAN HAI LINES LTD	63,482	77.900	4,945,247.800	
WALSIN LIHWA CORP	221,605	21.950	4,864,229.750	
YAGEO CORP	35,457	516.000	18,295,812.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	144,188	69.900	10,078,741.200	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	145,465	26.300	3,825,729.500	
GLOBAL UNICHIP CORP	6,904	1,180.000	8,146,720.000	
INNOLUX CORPORATION	608,428	13.600	8,274,620.800	
WPG HOLDINGS CO LTD	133,481	67.900	9,063,359.900	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,266	3,010.000	15,850,660.000	
JENTECH PRECISION INDUSTRIAL CO LTD	7,057	1,350.000	9,526,950.000	
PEGATRON CORP	173,874	91.900	15,979,020.600	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	6,436	2,795.000	17,988,620.000	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,248	836.000	9,403,328.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	122,739	110.000	13,501,290.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	56,562	113.000	6,391,506.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	866,244	24.150	20,919,792.600	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	322,570	40.900	13,193,113.000	

	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	5,243	1,790.000	9,384,970.000	
	WIWYNN CORP	9,269	2,425.000	22,477,325.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	281,472	162.500	45,739,200.000	
	SILERGY CORP	26,396	371.000	9,792,916.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	19,205	706.000	13,558,730.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	22,335	341.000	7,616,235.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,658	416.500	6,105,057.000	
台湾・ドル 小計		29,147,679		4,098,594,418.700 (19,492,095,336)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	27,835	252.770	7,035,852.950	
	CLICKS GROUP LTD	19,196	369.300	7,089,082.800	
	DISCOVERY LTD	46,619	191.670	8,935,463.730	
	GOLD FIELDS LTD	76,204	282.680	21,541,346.720	
	REMGRO LTD	41,148	141.000	5,801,868.000	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	47,198	176.620	8,336,110.760	
	EXXARO RESOURCES LTD	21,000	150.550	3,161,550.000	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,299	2,995.010	21,860,577.990	
	MTN GROUP LTD	145,477	87.940	12,793,247.380	
	FIRSTRAND LTD	426,421	73.430	31,312,094.030	
	NASPERS LTD	14,274	3,563.930	50,871,536.820	
	NEDBANK GROUP LTD	40,019	272.000	10,885,168.000	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	8,295	632.740	5,248,578.300	
	SASOL LTD	48,138	97.480	4,692,492.240	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	42,948	289.800	12,446,330.400	
	STANDARD BANK GROUP LTD	113,336	215.830	24,461,308.880	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	78,996	59.270	4,682,092.920	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,167	166.270	5,015,867.090	
	ABSA GROUP LTD	70,074	189.380	13,270,614.120	
	SANLAM LTD	149,259	83.410	12,449,693.190	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	75,256	101.650	7,649,772.400	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,386	337.760	1,819,175.360	
	OUTSURANCE GROUP LTD	70,350	64.420	4,531,947.000	
	VODACOM GROUP PTY LTD	51,779	99.840	5,169,615.360	
	NEPI ROCKCASTLE NV	49,815	136.000	6,774,840.000	
	OLD MUTUAL LTD	391,487	12.000	4,697,844.000	
	REINET INVESTMENTS SCA	11,620	422.480	4,909,217.600	
PEPKOR HOLDINGS LTD	209,592	27.000	5,658,984.000		
SIBANYE STILLWATER LTD	224,039	16.870	3,779,537.930		
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	42,835	486.680	20,846,937.800		
BID CORP LTD	27,561	432.080	11,908,556.880		



南アフリカ・ランド 小計	2,613,623		349,637,304.650 (2,898,493,256)	
合計	310,255,899		97,829,987,795 (97,829,987,795)	

## (2) 株式以外の有価証券

2025年1月14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	98,200.000	2,781,024.000	
		ENERGISA SA	19,900.000	725,156.000	
		KLABIN SA	65,450.000	1,446,445.000	
	ブラジル・レアル 小計		183,550.000	4,952,625.000 (127,933,733)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,287,375.000	14,328,483.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,100.000	6,765,407.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	145,250.000	25,103,557.500	
	メキシコ・ペソ 小計		1,475,725.000	46,197,448.250 (352,652,841)	
	投資信託受益証券 合計			1,659,275	480,586,574 (480,586,574)
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	261,300.000	5,291,325.000	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA DE CV	90,100.000	5,129,393.000	
	メキシコ・ペソ 小計		351,400.000	10,420,718.000 (79,547,593)	
投資証券 合計			351,400	79,547,593 (79,547,593)	
合計				560,134,167 (560,134,167)	

(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 41銘柄	2.49	-	-	2.66
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 12銘柄	1.35	-	-	1.44
インド・ルピー	株式 156銘柄	17.94	-	-	19.12
インドネシア・ルピア	株式 20銘柄	1.39	-	-	1.48

オフショア・人民元	株式	398銘柄	3.79	-	-	4.04
カタール・リアル	株式	13銘柄	0.78	-	-	0.84
クウェート・ディナール	株式	6銘柄	0.73	-	-	0.78
コロンビア・ペソ	株式	3銘柄	0.10	-	-	0.10
サウジアラビア・リアル	株式	42銘柄	4.05	-	-	4.32
タイ・バーツ	株式	27銘柄	1.34	-	-	1.43
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.13	-	-	0.14
チリ・ペソ	株式	11銘柄	0.40	-	-	0.43
トルコ・リラ	株式	17銘柄	0.63	-	-	0.67
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.24	-	-	0.26
フィリピン・ペソ	株式	13銘柄	0.49	-	-	0.53
ブラジル・レアル	株式 投資信託受益証券	42銘柄 3銘柄	3.35 -	- 0.12	- -	3.70
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.80	-	-	0.85
マレーシア・リンギット	株式	33銘柄	1.43	-	-	1.52
メキシコ・ペソ	株式 投資信託受益証券 投資証券	18銘柄 3銘柄 2銘柄	1.32 - -	- 0.34 -	- - 0.08	1.85
ユーロ	株式	10銘柄	0.46	-	-	0.49
韓国・ウォン	株式	92銘柄	9.12	-	-	9.72
香港・ドル	株式	153銘柄	19.58	-	-	20.86
台湾・ドル	株式	88銘柄	18.59	-	-	19.81
南アフリカ・ランド	株式	31銘柄	2.76	-	-	2.95

(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)

2025年1月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	602,151,979
コール・ローン	267,219,811
国債証券	119,517,195,591
未収利息	1,555,400,294
前払費用	362,488,628
流動資産合計	122,304,456,303
資産合計	122,304,456,303
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	49,864,238,744
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	72,440,217,559
元本等合計	122,304,456,303
純資産合計	122,304,456,303
負債純資産合計	122,304,456,303

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,108,629,278円
同期中追加設定元本額	48,723,644,210円
同期中一部解約元本額	41,968,034,744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）	4,086,360,408円
たわらノーロード バランス（堅実型）	195,512,964円
たわらノーロード バランス（標準型）	700,656,582円
たわらノーロード バランス（積極型）	357,307,707円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	656,824円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	4,462,538円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	55,328,259円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	7,887,826円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	6,401,921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）	257,980,135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）	870,913,712円
投資のソムリエ	9,637,933,313円
クルーズコントロール	215,733,860円
投資のソムリエ<DC年金>	1,269,480,463円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	372,349,891円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,377,506,047円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,556,023,812円
ワールドアセットバランス（基本コース）	180,751,156円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	394,493,736円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	100,430,204円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	53,053,379円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	13,990,647円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	306,565,997円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,287,141,392円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	227,029,752円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	113,271,294円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	57,813,357円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	35,432,806円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	9,523,586円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,995,209円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	10,738,079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）	19,755,762,907円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	184,905,606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）	969,566,912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）	637,727,480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）	4,958,223円
DIAM世界アセットバランスファンド２VA（適格機関投資家限定）	62,659,664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）	28,637,949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）	1,963,104,098円
計	49,864,238,744円
２． 受益権の総数	49,864,238,744口

## （金融商品に関する注記）

## １．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年1月14日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	4,638,411,918	
合計	4,638,411,918	

(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2025年1月14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)

2025年1月14日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4527円 (24,527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

2025年1月14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	2,666,700.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	4,000,000.000	3,281,809.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	7,000,000.000	5,707,100.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	3,000,000.000	2,982,030.000	

ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	8,000,000.000	7,157,610.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	7,000,000.000	3,629,867.500	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	6,000,000.000	5,465,292.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	5,000,000.000	3,197,687.500	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	2,000,000.000	1,472,980.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 4.875 04/30/29	3,000,000.000	2,974,536.570	
ABU DHABI GOVT INT'L 5.0 04/30/34	3,000,000.000	2,952,933.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 5.5 04/30/54	3,000,000.000	2,841,242.250	
BRAZIL 3.75 09/12/31	9,000,000.000	7,596,768.780	
BRAZIL 3.875 06/12/30	9,000,000.000	7,927,512.570	
BRAZIL 4.5 05/30/29	9,000,000.000	8,411,069.880	
BRAZIL 4.75 01/14/50	2,000,000.000	1,347,043.040	
BRAZIL 6.0 10/20/33	10,000,000.000	9,339,327.200	
BRAZIL 6.125 01/22/32	7,000,000.000	6,708,275.280	
BRAZIL 6.125 03/15/34	2,000,000.000	1,866,986.580	
BRAZIL 6.25 03/18/31	9,000,000.000	8,778,771.450	
BRAZIL 7.125 05/13/54	3,000,000.000	2,736,304.050	
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	4,000,000.000	3,360,363.560	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,796,165.160	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	10,000,000.000	8,288,054.700	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	18,000,000.000	14,200,049.880	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	13,000,000.000	9,874,319.650	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	3,000,000.000	1,685,781.510	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	6,000,000.000	5,858,205.660	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	7,000,000.000	7,086,614.710	
COLOMBIA 8.0 11/14/35	5,000,000.000	4,963,222.450	
COLOMBIA 8.375 11/07/54	3,000,000.000	2,859,233.190	
COLOMBIA 8.75 11/14/53	5,000,000.000	4,966,923.250	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	6,000,000.000	5,439,307.680	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	14,000,000.000	12,328,352.540	
DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41	4,000,000.000	3,296,408.520	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	9,000,000.000	8,644,849.830	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	6,000,000.000	4,922,773.740	

DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	9,200,000.000	8,721,745.450	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	1,000,000.000	911,306.660	
HUNGARY 2.125 09/22/31	13,000,000.000	10,194,453.750	
HUNGARY 3.125 09/21/51	6,000,000.000	3,420,303.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	13,000,000.000	12,671,418.500	
HUNGARY 5.5 03/26/36	2,000,000.000	1,842,025.000	
HUNGARY 6.125 05/22/28	9,000,000.000	9,089,190.000	
HUNGARY 6.25 09/22/32	14,000,000.000	14,037,800.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	5,200,000.000	4,232,234.130	
INDONESIA 3.05 03/12/51	5,000,000.000	3,146,744.400	
INDONESIA 3.4 09/18/29	3,200,000.000	2,960,165.370	
INDONESIA 3.85 10/15/30	4,400,000.000	4,072,945.930	
INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,199,834.970	
INDONESIA 4.2 10/15/50	5,000,000.000	3,950,437.750	
INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,578,508.510	
INDONESIA 4.75 01/08/26	1,000,000.000	1,001,115.810	
INDONESIA 7.75 01/17/38	3,500,000.000	4,149,857.210	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	3,000,000.000	2,981,580.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	6,000,000.000	6,024,225.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	3,000,000.000	3,049,848.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	10,000,000.000	6,996,647.400	
PANAMA 3.16 01/23/30	6,000,000.000	5,012,338.800	
PANAMA 4.5 01/19/63	8,000,000.000	4,670,402.640	
PANAMA 4.5 04/01/56	5,000,000.000	2,950,199.800	
PANAMA 6.4 02/14/35	3,000,000.000	2,709,780.570	
PERU 2.78 12/01/60	8,000,000.000	4,079,709.360	
PERU 2.783 01/23/31	17,000,000.000	14,388,599.570	
PERU 3.0 01/15/34	8,000,000.000	6,355,800.880	
PERU 3.55 03/10/51	9,000,000.000	5,877,251.280	
PERU 5.875 08/08/54	1,000,000.000	925,992.200	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	6,000,000.000	3,657,191.100	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	8,000,000.000	5,350,124.640	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	2,200,000.000	1,868,443.140	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	5,200,000.000	4,311,031.660	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	11,000,000.000	8,746,724.250	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	10,200,000.000	9,733,024.720	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	3,000,000.000	1,705,686.330	



REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	4,000,000.000	2,797,254.040	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	4,000,000.000	2,676,662.120	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	4,200,000.000	3,566,596.060	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	7,000,000.000	4,607,659.420	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	4,000,000.000	3,280,130.880	
REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29	5,000,000.000	4,922,141.000	
REPUBLIC OF CHILE 4.95 01/05/36	5,000,000.000	4,659,982.350	
REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	13,000,000.000	12,766,780.000	
REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	7,000,000.000	6,628,580.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34	7,000,000.000	6,676,080.250	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	12,000,000.000	10,777,542.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	9,000,000.000	8,094,015.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	6,000,000.000	6,098,137.500	
REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	10,500,000.000	10,579,059.750	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	5,000,000.000	4,812,756.200	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	4,000,000.000	4,024,817.360	
ROMANIA 3.0 02/14/31	8,000,000.000	6,383,486.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	8,000,000.000	4,831,800.000	
ROMANIA 5.75 03/24/35	2,000,000.000	1,745,035.000	
ROMANIA 5.875 01/30/29	13,000,000.000	12,538,334.250	
ROMANIA 6.375 01/30/34	5,000,000.000	4,678,860.000	
ROMANIA 6.625 02/17/28	11,000,000.000	11,082,593.500	
ROMANIA 7.125 01/17/33	7,000,000.000	6,924,960.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	10,000,000.000	7,845,045.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	2,000,000.000	1,969,712.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	12,200,000.000	10,895,191.700	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	3,000,000.000	1,780,164.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	4,400,000.000	2,875,301.000	

SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	10,000,000.000	9,670,320.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	7,000,000.000	6,729,957.500	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	2,980,722.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30	4,000,000.000	3,895,485.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	4,000,000.000	3,955,290.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	9,000,000.000	8,559,450.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/16/34	3,000,000.000	2,866,545.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	2,000,000.000	1,646,408.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	16,000,000.000	15,911,604.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54	4,000,000.000	3,650,600.000	
SOUTH AFRICA 7.1 11/19/36	6,000,000.000	5,780,008.680	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	22,000,000.000	19,591,000.000	
SOUTH AFRICA 7.95 11/19/54	3,000,000.000	2,813,379.390	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	3,000,000.000	2,977,200.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	4,000,000.000	3,761,965.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	3,000,000.000	2,898,240.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	8,000,000.000	6,587,200.000	
STATE OF QATAR 4.75 05/29/34	4,000,000.000	3,908,428.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	7,000,000.000	6,157,576.250	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	3,000,000.000	1,889,150.250	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	5,000,000.000	4,663,131.250	
UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	4,000,000.000	3,922,280.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	11,000,000.000	8,872,417.510	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	8,000,000.000	6,971,388.240	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	2,000,000.000	1,569,695.720	

	UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	4,000,000.000	2,156,144.640	
	UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	2,000,000.000	1,116,821.360	
	UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	7,000,000.000	5,055,921.640	
	UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	4,000,000.000	2,651,460.480	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	8,000,000.000	5,505,108.400	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	6,000,000.000	5,699,630.820	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	4,000,000.000	3,593,170.800	
	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	6,000,000.000	5,312,732.280	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	1,000,000.000	735,673.370	
	UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/07/36	10,000,000.000	9,274,110.700	
	UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	5,000,000.000	4,370,426.050	
	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	5,000,000.000	4,832,120.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54	6,000,000.000	5,263,625.820	
	アメリカ・ドル 小計	878,200,000.000 (138,377,974,000)	758,502,224.990 (119,517,195,591)	
国債証券	合計	138,377,974,000 (138,377,974,000)	119,517,195,591 (119,517,195,591)	
合計			119,517,195,591 (119,517,195,591)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 140銘柄	97.72	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2025年1月14日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,463,407,865
投資証券	154,528,600,653
派生商品評価勘定	49,683,230
未収配当金	1,890,598,136
差入委託証拠金	258,407,892
流動資産合計	161,190,697,776
資産合計	161,190,697,776
負債の部	
流動負債	
前受金	77,139,000
未払金	1,283,917,795
未払解約金	550,004,000
流動負債合計	1,911,060,795
負債合計	1,911,060,795
純資産の部	
元本等	
元本	71,503,052,428
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	87,776,584,553
元本等合計	159,279,636,981
純資産合計	159,279,636,981
負債純資産合計	161,190,697,776

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	82,686,701,762円
同期中追加設定元本額	31,512,587,280円
同期中一部解約元本額	42,696,236,614円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	141,690円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	727,720円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,825,931円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	1,772,797円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	2,062,270円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	926,589円
たわらノーロード 国内リート	5,957,998,627円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,523,085,872円
たわらノーロード バランス(堅実型)	53,992,142円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,289,928,919円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,712,051,587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)	358,225,032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)	988,244,856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)	697,570,733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)	836,035,305円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	4,381,510円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	76,351,652円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	17,414,562円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	28,300,351円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,179,347円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	468,518,503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)	159,030,271円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	274,781,713円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	575,775,923円
投資のソムリエ	1,407,289,145円
投資のソムリエ<DC年金>	185,472,348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	214,139,933円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	552,896,126円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	14,661,967円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,746,802円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,176,317円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	44,756,193円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	569,430,744円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	148,046,576円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	16,539,307円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	8,441,427円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,172,208円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,388,661円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	47,801,946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)	87,808,028円
MHAM J-REITインデックスファンド(隔月決算型)	24,125,400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)	106,876,412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)	516,127,361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)	107,257,060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)	107,119,692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)	64,106,299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)	200,104,977円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	82,893,289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)	557,320,531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)	107,045,504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)	271,080,370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)	117,935,095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)	194,658,822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)	135,914,333円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	82,448,568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)	73,926,714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)	135,472,277円

固定比率マルチアセット戦略ファンド2021-10(適格機関投資家限定)	197,078,820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)	195,537,970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)	634,569,075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)	202,891,288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)	286,291,498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)	641,607,993円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	3,014,685,378円 26,947,978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)	26,154,871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)	177,837,897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)	725,593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)	784,002,074円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	6,570,006,418円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	26,995,517,614円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,486,830,758円
たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>	4,354,350,848円
計	71,503,052,428円
2. 受益権の総数	71,503,052,428口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14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	2025年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	9,005,976,217
合計	9,005,976,217

(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2025年1月14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	2025年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	
		評価損益（円）		
市場取引 先物取引 買建	4,578,342,500	-	4,628,340,000	49,997,500
合計	4,578,342,500	-	4,628,340,000	49,997,500

## (注)時価の算定方法

## 不動産投信指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。



## 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2025年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2,2276円 (22,276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

2025年1月14日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	7,003	969,915,500	
	GLP投資法人	54,644	6,628,317,200	
	KDX不動産投資法人	45,513	6,617,590,200	
	NTT都市開発リート投資法人	16,535	1,956,090,500	
	Oneリート投資法人	2,838	660,402,600	
	SOSILA物流リート投資法人	8,117	852,285,000	
	いちごオフィスリート投資法人	11,870	942,478,000	
	いちごホテルリート投資法人	2,692	389,801,600	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	7,907	2,593,496,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	15,988	4,622,130,800	
	イオンリート投資法人	19,955	2,470,429,000	
	インヴィンシブル投資法人	89,631	5,906,682,900	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,600	402,480,000	
	オリックス不動産投資法人	32,414	5,244,585,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	11,781	1,173,387,600	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	8,237	2,281,649,000	
	サムティ・レジデンシャル投資 法人	4,432	416,164,800	
	サンケイリアルエステート投資 法人	5,211	393,951,600	
	ザイマックス・リート投資法人	2,785	316,654,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資 法人	59,765	4,195,503,000	
ジャパンエクセレント投資法人	13,969	1,639,960,600		

ジャパンリアルエステイト投資法人	83,552	8,764,604,800	
スターアジア不動産投資法人	29,979	1,549,914,300	
スターツプロシード投資法人	2,820	485,886,000	
タカラレーベン不動産投資法人	10,624	910,476,800	
トーセイ・リート投資法人	3,537	442,125,000	
ヒューリックリート投資法人	14,375	1,955,000,000	
フロンティア不動産投資法人	30,180	2,326,878,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	4,011	423,160,500	
マリモ地方創生リート投資法人	2,954	309,283,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	36,128	5,126,563,200	
ラサールロジポート投資法人	20,827	2,940,772,400	
阪急阪神リート投資法人	7,756	946,232,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	35,461	3,478,785,903	
三菱地所物流リート投資法人	5,617	1,923,822,500	
産業ファンド投資法人	29,786	3,386,668,200	
森トラストリート投資法人	31,357	1,922,184,100	
森ヒルズリート投資法人	19,130	2,331,947,000	
星野リゾート・リート投資法人	6,880	1,451,680,000	
積水ハウス・リート投資法人	48,884	3,720,072,400	
大和ハウスリート投資法人	24,260	5,533,706,000	
大和証券オフィス投資法人	6,669	1,908,667,800	
大和証券リビング投資法人	24,027	2,109,570,600	
投資法人みらい	22,401	901,640,250	
東海道リート投資法人	2,779	295,407,700	
東急リアル・エステート投資法人	10,907	1,684,040,800	
日本アコモデーションファンド投資法人	5,617	3,235,392,000	
日本ビルファンド投資法人	94,890	11,538,624,000	
日本プライムリアルティ投資法人	11,126	3,549,194,000	
日本プロロジスリート投資法人	28,340	6,407,674,000	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	3,431	220,270,200	
日本リート投資法人	21,136	1,625,358,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	10,930	2,836,335,000	
日本都市ファンド投資法人	84,356	7,549,862,000	
福岡リート投資法人	9,179	1,331,872,900	
平和不動産リート投資法人	11,929	1,461,302,500	
野村不動産マスターファンド投資法人	52,075	7,269,670,000	
投資証券 合計	1,272,797	154,528,600,653	
合計		154,528,600,653	

(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。

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)

2025年1月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	823,542,476
コール・ローン	68,657,925
投資信託受益証券	10,814,894,194
投資証券	93,491,301,302
派生商品評価勘定	13,431
未収入金	619,064
未収配当金	389,976,389
差入委託証拠金	329,643,370
流動資産合計	105,918,648,151
資産合計	105,918,648,151
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,963,739
流動負債合計	46,963,739
負債合計	46,963,739
純資産の部	
元本等	
元本	49,778,319,009
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	56,093,365,403
元本等合計	105,871,684,412
純資産合計	105,871,684,412
負債純資産合計	105,918,648,151

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	44,985,698,714円
同期中追加設定元本額	26,062,311,823円
同期中一部解約元本額	21,269,691,528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＞	4,904,618,239円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,491,530円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,909,631円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	32,211,262円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	31,216,550円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	36,547,452円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	16,341,198円
たわらノーロード 先進国リート	16,410,656,085円
たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	277,345,245円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	4,683,782,615円

たわらノーロード バランス(堅実型)	27,937,639円
たわらノーロード バランス(標準型)	669,251,341円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,636,915,585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)	45,952,502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)	460,407,888円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	595,772,571円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	999,350,275円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	565,270円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	31,380,093円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	13,424,047円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	38,789,947円
One DC 先進国リートインデックスファンド	3,320,116,185円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	15,361,846円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	590,818,962円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	77,596,840円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	175,455,082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)	593,804,168円
投資のソムリエ	7,271,268,694円
投資のソムリエ<DC年金>	958,512,803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	445,843,752円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,148,400,874円
ワールドアセットバランス(基本コース)	201,200,415円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	441,704,551円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	75,870,167円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	40,077,490円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,525,605円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	231,562,548円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	195,770,080円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	150,337,182円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	85,559,456円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	43,670,270円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	26,766,795円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	7,192,919円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	65,111,193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	253,965,248円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	420,935,566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)	4,334,308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)	139,911,423円

AM 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）	6,364,264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（FOF s用）（適格機関投資家専用）	3,744,646円
D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）	34,709,336円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	71,148,312円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,186,280,130円
計	49,778,319,009円
2. 受益権の総数	49,778,319,009口

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年1月12日 至 2025年1月14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	2025年1月14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	2025年1月14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		98,520,691
投資証券		223,192,249
合計		124,671,558

(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2025年1月14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	2025年1月14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 カナダ・ドル	32,877,780	-	32,880,180	2,400
	32,877,780	-	32,880,180	2,400
合計	32,877,780	-	32,880,180	2,400

(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	2025年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引				



買建	1,629,812,689	-	1,582,859,981	46,952,708
合計	1,629,812,689	-	1,582,859,981	46,952,708

## (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)

	2025年1月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1269円 (21,269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

2025年1月14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	466,200.000	251,748.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	291,800.000	58,360.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	72,154.000		
		PRIME US REIT	349,360.000	56,596.320		
		アメリカ・ドル	小計	2,019,060.000	438,858.320 (69,150,905)	
	オーストラリア・ドル		ABACUS GROUP	229,970.000	250,667.300	
			ABACUS STORAGE KING	224,215.000	248,878.650	
			ARENA REIT	196,827.000	751,879.140	
			BWP TRUST	262,595.000	856,059.700	
			CENTURIA CAPITAL GROUP	416,038.000	736,387.260	
			CENTURIA INDUSTRIAL REIT	253,124.000	703,684.720	
			CENTURIA OFFICE REIT	185,985.000	208,303.200	
			CHARTER HALL GROUP	224,279.000	3,195,975.750	
			CHARTER HALL LONG WALE REIT	311,030.000	1,172,583.100	
CHARTER HALL RETAIL REIT			260,555.000	810,326.050		
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	151,479.000	380,212.290		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	748,319.000	299,327.600		

	DEXUS	506,819.000	3,319,664.450	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	93,159.000	246,871.350	
	GOODMAN GROUP	906,412.000	33,201,871.560	
	GPT GROUP	903,816.000	3,949,675.920	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	142,931.000	333,029.230	
	HEALTHCO REIT	202,023.000	187,881.390	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	823,575.000	926,521.870	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	322,822.320	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	177,159.000	800,758.680	
	MIRVAC GROUP	1,882,028.000	3,444,111.240	
	NATIONAL STORAGE REIT	656,696.000	1,516,967.760	
	REGION RE LTD	543,503.000	1,125,051.210	
	RURAL FUNDS GROUP	167,254.000	281,822.990	
	SCENTRE GROUP	2,466,486.000	8,682,030.720	
	STOCKLAND	1,131,913.000	5,365,267.620	
	VICINITY CENTRES	1,834,750.000	3,852,975.000	
	WAYPOINT REIT LTD	322,091.000	750,472.030	
	オーストラリア・ドル 小計	16,310,888.000	77,922,080.100 (7,591,948,268)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	329,295.000	414,911.700	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,187,216.000	1,038,814.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	594,380.000	430,925.500	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,625,809.000	5,094,069.460	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,667,960.000	4,286,657.200	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	295,200.000	253,872.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	0.000	
	ESR REIT	3,019,240.000	769,906.200	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	464,500.000	281,022.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	549,200.000	1,158,812.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,429,064.000	1,236,140.360	
	KEPPEL DC REIT	849,900.000	1,861,281.000	
	KEPPEL REIT	1,113,200.000	957,352.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	869,500.000	469,530.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	971,820.000	2,157,440.400	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,582,920.000	1,994,479.200	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,128,900.000	1,354,680.000	

		OUÉ REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	965,900.000	280,111.000	
		PARKWAY LIFE REIT	193,200.000	720,636.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	242,300.000	163,552.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	730,400.000	361,548.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,020,290.000	1,234,550.900	
	シンガポール・ドル 小計		21,942,594.000	26,520,291.920 (3,051,159,585)	
	ユーロ	STONEWEG EUROPEAN REIT	173,740.000	272,771.800	
	ユーロ 小計		173,740.000	272,771.800 (44,033,552)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	733,000.000	2,895,350.000	
	香港・ドル 小計		733,000.000	2,895,350.000 (58,601,884)	
投資信託受益証券 合計			41,179,282	10,814,894,194 (10,814,894,194)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	56,736.000	1,273,723.200	
		AGREE REALTY CORP	48,981.000	3,405,159.120	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	35,815.000	614,943.550	
		ALEXANDER'S INC.	977.000	181,370.280	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	73,751.000	7,203,260.170	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,384.000	72,818.240	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	23,488.000	567,704.960	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	72,080.000	1,955,530.400	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	150,419.000	5,329,345.170	
		AMERICOLD REALTY TRUST	123,399.000	2,593,846.980	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	62,529.000	562,761.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	105,801.000	1,545,752.610	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	37,788.000	368,055.120	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,355.000	14,533,861.900	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	59,429.460	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	86,415.000	434,667.450	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	142,576.000	3,764,006.400	
		BROADSTONE NET LEASE INC	89,402.000	1,368,744.620	
		BRT APARTMENTS CORP	3,973.000	67,620.460	
		BXP INC	68,830.000	4,771,295.600	
CAMDEN PROPERTY TRUST	50,536.000	5,642,849.760			

CARETRUST REIT INC	88,821.000	2,345,762.610	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	7,096.000	205,642.080	
CENTERSPACE	7,858.000	477,923.560	
CHATHAM LODGING TRUST	25,414.000	220,847.660	
CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	87,361.170	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	120,342.000	641,422.860	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	13,267.000	250,082.950	
COPT DEFENCE PROPERTIES	52,675.000	1,562,340.500	
COUSINS PROPERTIES INC	79,343.000	2,304,914.150	
CTO REALTY GROUTH INC	12,508.000	243,155.520	
CUBESMART	106,652.000	4,314,073.400	
CURBLINE PROPERTIES CORP	45,754.000	1,071,558.680	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	101,442.000	883,559.820	
DIGITAL REALTY TRUST INC	147,849.000	25,418,200.080	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	91,922.000	187,520.880	
DOUGLAS EMMETT INC	79,392.000	1,325,052.480	
EAST GROUP	23,436.000	3,712,731.120	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	48,112.000	544,146.720	
ELME COMMUNITIES	43,317.000	627,230.160	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	66,512.000	635,189.600	
EPR PROPERTIES	35,909.000	1,618,418.630	
EQUINIX INC	45,751.000	41,159,887.150	
EQUITY COMMONWEALTH	49,891.000	84,315.790	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,589.000	5,892,814.450	
EQUITY RESIDENTIAL	161,889.000	11,204,337.690	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	82,733.000	2,551,485.720	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	30,473.000	8,622,335.350	
EXTRA SPACE STORAGE INC	100,515.000	14,815,911.000	
FARMLAND PARTNERS INC	18,774.000	214,023.600	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	36,258.000	3,742,550.760	
FIRST INDUSTRIAL RT	62,525.000	3,073,729.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	45,272.000	1,212,384.160	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,375.000	81,620.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	130,107.000	6,039,566.940	
GETTY REALTY CORP	24,508.000	730,583.480	

GLADSTONE COMMERCIAL CORP	21,664.000	344,457.600	
GLADSTONE LAND CORP	13,328.000	139,011.040	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,662.000	207,430.360	
GLOBAL NET LEASE INC	97,430.000	673,241.300	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	168,038.000	2,708,772.560	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	331,651.000	6,633,020.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	51,338.000	1,480,587.920	
HOST HOTELS & RESORTS INC	331,455.000	5,687,767.800	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	72,334.000	181,558.340	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	106,558.000	1,992,634.600	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	95,158.740	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	13,224.000	859,956.720	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	36,572.000	1,055,467.920	
INVITATION HOMES INC	270,142.000	8,358,193.480	
IRON MOUNTAIN INC	139,148.000	14,226,491.520	
JBG SMITH PROPERTIES	40,057.000	590,840.750	
KILROY REALTY CORP	51,035.000	1,841,853.150	
KIMCO REALTY	319,626.000	7,054,145.820	
KITE REALTY GROUP TRUST	103,661.000	2,354,141.310	
LAMAR ADVERTISING CO	41,627.000	4,979,005.470	
LINEAGE INC	28,720.000	1,596,832.000	
LTC PROPERTIES INC	21,345.000	726,583.800	
LXP INDUSTRIAL TRUST	139,646.000	1,100,410.480	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	287,669.000	1,124,785.790	
MID AMERICA	55,420.000	8,323,529.800	
MODIV INC	3,617.000	52,048.630	
NATIONAL HEALTH INVS INC	21,102.000	1,419,742.560	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	34,000.000	1,233,860.000	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	7,828.000	236,170.760	
NETSTREIT CORP	38,535.000	532,168.350	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	16,136.000	87,779.840	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	11,070.000	422,984.700	
NNN REIT INC	88,918.000	3,431,345.620	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	20,374.700	

OMEGA HEALTHCARE INVS INC	128,000.000	4,757,760.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,397.000	186,774.250	
ORION OFFICE REIT INC	20,368.000	77,805.760	
OUTFRONT MEDIA INC	66,495.000	1,127,755.200	
PARAMOUNT GROUP INC	82,249.000	374,232.950	
PARK HOTELS & RESORTS INC	97,870.000	1,340,819.000	
PEAKSTONE REALTY TRUST	16,612.000	174,758.240	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	56,754.000	751,990.500	
PHILLIPS EDISON & CO INC	58,133.000	2,072,441.450	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	61,399.000	518,821.550	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,802.000	297,827.460	
POSTAL REALTY TRUST INC	9,772.000	124,593.000	
PROLOGIS INC	439,160.000	46,274,289.200	
PUBLIC STORAGE	74,727.000	21,688,764.480	
REALTY INCOME CORP	414,994.000	21,774,735.180	
REGENCY CENTERS CORP	77,388.000	5,475,974.880	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	59,216.000	1,027,989.760	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	105,258.000	4,028,223.660	
RLJ LODGING TRUST	71,927.000	699,130.440	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,296.000	2,861,291.520	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	113,106.000	1,878,690.660	
SAFEHOLD INC	22,880.000	373,859.200	
SAUL CENTERS INC	5,700.000	211,014.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	69,326.000	180,247.600	
SILA REALTY TRUST INC	26,088.000	608,893.920	
SIMON PROPERTY GROUP INC	145,423.000	25,129,094.400	
SITE CENTERS CORP	23,960.000	352,930.800	
SL GREEN	33,515.000	2,097,368.700	
STAG INDUSTRIAL INC	86,009.000	2,833,996.550	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	55,567.000	365,630.860	
SUN COMMUNITIES INC	56,780.000	6,939,083.800	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	95,260.000	1,095,490.000	
TANGER INC	52,884.000	1,755,748.800	
TERRENO REALTY CORP	47,291.000	2,777,873.340	
THE MACERICH COMPANY	116,420.000	2,256,219.600	
UDR INC	142,856.000	5,854,238.880	
UMH PROPERTIES INC	33,818.000	603,313.120	

	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,726.000	206,193.260	
	URBAN EDGE PROPERTIES	59,252.000	1,173,189.600	
	VENTAS INC	198,917.000	11,537,186.000	
	VERIS RESIDENTIAL INC	39,819.000	629,538.390	
	VICI PROPERTIES INC	499,852.000	14,360,747.960	
	VORNADO REALTY TRUST	78,298.000	3,008,209.160	
	WELLTOWER INC	280,495.000	35,263,831.400	
	WHITESTONE REIT	18,939.000	250,941.750	
	WP CAREY INC	103,688.000	5,547,308.000	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	50,163.000	729,871.650	
アメリカ・ドル	小計	10,864,380.000	529,848,469.480 (83,488,223,335)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	175,713.000	11,421.340	
	AEW UK REIT PLC	76,762.000	75,610.570	
	ASSURA PLC	1,397,442.000	504,476.560	
	BIG YELLOW GROUP PLC	93,781.000	829,961.850	
	BRITISH LAND CO PLC	469,852.000	1,605,014.430	
	CARE REIT PLC	209,602.000	167,891.200	
	CLS HOLDINGS PLC	80,477.000	59,794.410	
	CUSTODIAN REIT PLC	186,443.000	134,611.840	
	DERWENT LONDON PLC	53,314.000	976,179.340	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	307,038.000	247,165.590	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	190,159.000	502,019.760	
	HAMMERSON PLC	212,210.000	567,025.120	
	HELICAL PLC	60,932.000	104,681.170	
	HOME REIT PLC	286,621.000	0.000	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	353,223.000	1,884,444.700	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	147,597.000	49,297.390	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	981,179.000	1,702,345.560	
	NEWRIVER REIT PLC	153,885.000	107,411.730	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	233,467.000	140,780.600	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	625,381.000	538,453.040	
	PRS REIT PLC/THE	265,154.000	277,351.080	
	REGIONAL REIT LTD	80,094.000	91,787.720	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	101,597.000	651,236.770	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	203,492.000	98,286.630	
	SEGRO PLC	641,478.000	4,303,034.420	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	913,285.000	1,065,803.590	

	SOCIAL HOUSING REIT PLC	156,311.000	91,441.930	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	620,295.000	411,875.880	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	315,818.000	255,180.940	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,181,447.000	1,525,248.070	
	UNITE GROUP PLC	195,569.000	1,552,817.860	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	240,859.000	242,785.870	
	WAREHOUSE REIT PLC	182,285.000	138,718.880	
	WORKSPACE GROUP PLC	69,696.000	297,950.400	
イギリス・ポンド	小計	11,693,498.000	21,212,106.240 (4,080,997,120)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	399,054.000	784,141.110	
	REIT 1 LTD	93,422.000	1,789,031.300	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	95,498.000	899,973.150	
イスラエル・シュケル	小計	587,974.000	3,473,145.560 (150,734,170)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	28,040.000	463,501.200	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,895.000	154,140.800	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,074.000	684,373.200	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	38,273.000	1,582,971.280	
	CHOICE PROPERTIES REIT	77,262.000	1,005,951.240	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	27,324.000	359,583.840	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,325.000	387,195.250	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	63,673.000	738,606.800	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	2,585.000	45,134.100	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	49,580.000	823,523.800	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,779.000	1,005,119.790	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	61,557.000	568,786.680	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	36,859.000	371,170.130	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,128.000	470,300.160	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,186.000	130,584.520	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,000.000	138,160.000	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	108,701.600		
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	59,216.000	264,103.360		



	PRIMARIS REIT	24,384.000	355,031.040	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	70,718.000	1,294,846.580	
	SLATE GROCERY REIT	12,169.000	158,683.760	
	SMARTCENTRES REIT	33,583.000	813,380.260	
カナダ・ドル 小計		721,065.000	11,923,849.390 (1,306,973,132)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	501,598.000	1,033,291.880	
ニュージーランド・ドル 小計		501,598.000	1,033,291.880 (91,177,675)	
ユーロ	AEDIFICA	22,252.000	1,222,747.400	
	ALTAREA	2,270.000	217,693.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	19,092.000	207,720.960	
	CARMILA SA	24,693.000	389,655.540	
	COFINIMMO SA	18,280.000	960,614.000	
	COVIVIO	25,665.000	1,187,776.200	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,931.000	444,783.750	
	GECINA SA	24,804.000	2,156,707.800	
	HAMBORNER REIT AG	34,630.000	218,169.000	
	ICADE	14,600.000	316,236.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	48,509.800	
	IMMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	162,762.000	813,158.950	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	255,735.000	221,977.980	
	KLEPIERRE	104,306.000	2,874,673.360	
	MERCIALYS	44,137.000	444,459.590	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	186,395.000	1,847,174.450	
	MONTEA SCA	9,714.000	597,411.000	
	NSI NV	7,519.000	141,958.720	
	RETAIL ESTATES	5,662.000	319,336.800	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	14,926.000	517,185.900	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	47,579.000	3,393,334.280		
WAREHOUSES DE PAUW	83,954.000	1,548,951.300		
WERELDHAVE NV	18,224.000	250,397.760		
XIOR STUDENT HOUSING NV	16,600.000	473,930.000		
ユーロ 小計		1,185,285.000	20,814,563.540 (3,360,094,992)	
韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	71,792.000	322,346,080.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	21,537.000	92,932,155.000	
	JR REIT XXVII	87,309.000	233,115,030.000	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	27,629.000	110,654,145.000	

	LOTTE REIT CO LTD	73,305.000	228,711,600.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	50,464.000	292,186,560.000	
	SK REITS CO LTD	66,611.000	313,737,810.000	
	韓国・ウォン 小計	398,647.000	1,593,683,380.000 (171,480,332)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	944,070.000	1,548,274.800	
	LINK REIT	1,221,720.000	38,362,008.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	342,000.000	615,600.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,148,000.000	1,056,160.000	
	香港・ドル 小計	3,655,790.000	41,582,042.800 (841,620,546)	
投資証券 合計		29,608,237	93,491,301,302 (93,491,301,302)	
合計			104,306,195,496 (104,306,195,496)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 5銘柄 投資証券 137銘柄	0.07	-	80.11
イギリス・ポンド	投資証券 35銘柄	-	3.85	3.91
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-	0.14	0.14
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	7.17	-	7.28
カナダ・ドル	投資証券 22銘柄	-	1.23	1.25
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 22銘柄	2.88	-	2.93
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 投資証券 24銘柄	0.04	-	3.26
韓国・ウォン	投資証券 7銘柄	-	0.16	0.16
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 4銘柄	0.06	-	0.86

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)  
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)  
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期中間計算期間(2025年1月15日から2025年7月14日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 2025年1月14日現在	第14期中間計算期間末 2025年7月14日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	535,476,391	527,450,287
親投資信託受益証券	11,929,789,238	12,031,200,612
未収入金	354,000	668,000
流動資産合計	12,465,619,629	12,559,318,899
資産合計	12,465,619,629	12,559,318,899
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,688,911	5,703,893
未払受託者報酬	2,441,722	2,358,538
未払委託者報酬	19,534,017	18,868,610
その他未払費用	248,269	239,811
流動負債合計	32,912,919	27,170,852
負債合計	32,912,919	27,170,852
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,028,945,747	7,071,728,912
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,403,760,963	5,460,419,135
(分配準備積立金)	1,637,033,612	1,570,424,081
元本等合計	12,432,706,710	12,532,148,047
純資産合計	12,432,706,710	12,532,148,047
負債純資産合計	12,465,619,629	12,559,318,899

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期中間計算期間 自 2024年1月12日 至 2024年7月11日	第14期中間計算期間 自 2025年1月15日 至 2025年7月14日
<b>営業収益</b>		
受取利息	107,600	1,148,913
有価証券売買等損益	593,856,142	43,030,374
営業収益合計	593,963,742	44,179,287
<b>営業費用</b>		
支払利息	7,383	-
受託者報酬	2,327,644	2,358,538
委託者報酬	18,621,456	18,868,610
その他費用	236,664	239,811
営業費用合計	21,193,147	21,466,959
営業利益又は営業損失( )	572,770,595	22,712,328
経常利益又は経常損失( )	572,770,595	22,712,328
中間純利益又は中間純損失( )	572,770,595	22,712,328
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	11,051,239	4,963,160
期首剰余金又は期首欠損金( )	4,974,945,757	5,403,760,963
剰余金増加額又は欠損金減少額	271,093,538	253,822,811
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	271,093,538	253,822,811
剰余金減少額又は欠損金増加額	226,480,716	224,840,127
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	226,480,716	224,840,127
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,581,277,935	5,460,419,135

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第14期中間計算期間	
	自 2025年1月15日	至 2025年7月14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. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1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2025年1月14日、当中間計算期間末日を2025年7月14日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期	第14期中間計算期間末
	2025年1月14日現在	2025年7月14日現在
1. 期首元本額	6,888,287,393円	7,028,945,747円
期中追加設定元本額	720,012,282円	335,317,696円
期中一部解約元本額	579,353,928円	292,534,531円
2. 受益権の総数	7,028,945,747口	7,071,728,912口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期	第14期中間計算期間末
	2025年1月14日現在	2025年7月14日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第13期 2025年1月14日現在	第14期中間計算期間末 2025年7月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7688円 (17,688円)	1.7721円 (17,721円)

## 【DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 2025年1月14日現在	第14期中間計算期間末 2025年7月14日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	347,161,880	357,878,424
親投資信託受益証券	10,223,650,914	10,788,881,489
未収入金	-	2,331,000
流動資産合計	10,570,812,794	11,149,090,913
<b>資産合計</b>	<b>10,570,812,794</b>	<b>11,149,090,913</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,242,699	8,769,665
未払受託者報酬	2,054,427	2,030,549
未払委託者報酬	18,196,793	17,985,163
その他未払費用	208,876	206,453
流動負債合計	25,702,795	28,991,830
<b>負債合計</b>	<b>25,702,795</b>	<b>28,991,830</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,251,305,310	4,379,058,329
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,293,804,689	6,741,040,754
(分配準備積立金)	2,158,347,415	2,063,787,902
元本等合計	10,545,109,999	11,120,099,083
<b>純資産合計</b>	<b>10,545,109,999</b>	<b>11,120,099,083</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>10,570,812,794</b>	<b>11,149,090,913</b>



## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期中間計算期間 自 2024年1月12日 至 2024年7月11日	第14期中間計算期間 自 2025年1月15日 至 2025年7月14日
<b>営業収益</b>		
受取利息	67,821	756,594
有価証券売買等損益	1,018,466,089	276,783,575
<b>営業収益合計</b>	<b>1,018,533,910</b>	<b>277,540,169</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	4,540	-
受託者報酬	1,907,218	2,030,549
委託者報酬	16,892,877	17,985,163
その他費用	193,908	206,453
<b>営業費用合計</b>	<b>18,998,543</b>	<b>20,222,165</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>999,535,367</b>	<b>257,318,004</b>
経常利益又は経常損失( )	999,535,367	257,318,004
<b>中間純利益又は中間純損失( )</b>	<b>999,535,367</b>	<b>257,318,004</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	19,541,784	3,735,620
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>5,358,147,296</b>	<b>6,293,804,689</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	422,420,510	471,999,548
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	422,420,510	471,999,548
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>262,724,553</b>	<b>285,817,107</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	262,724,553	285,817,107
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金( )</b>	<b>6,497,836,836</b>	<b>6,741,040,754</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第14期中間計算期間	
	自	至
	2025年1月15日	2025年7月14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. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1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2025年1月14日、当中間計算期間末日を2025年7月14日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期	第14期中間計算期間末
	2025年1月14日現在	2025年7月14日現在
1. 期首元本額	4,071,030,378円	4,251,305,310円
期中追加設定元本額	544,419,066円	320,853,059円
期中一部解約元本額	364,144,134円	193,100,040円
2. 受益権の総数	4,251,305,310口	4,379,058,329口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期	第14期中間計算期間末
	2025年1月14日現在	2025年7月14日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第13期 2025年1月14日現在	第14期中間計算期間末 2025年7月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,480円 (24,804円)	2,539円 (25,394円)

## 【DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 2025年1月14日現在	第14期中間計算期間末 2025年7月14日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	335,638,955	340,435,002
親投資信託受益証券	13,946,097,820	14,816,323,196
未収入金	-	656,000
流動資産合計	14,281,736,775	15,157,414,198
資産合計	14,281,736,775	15,157,414,198
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	15,871,463	13,652,427
未払受託者報酬	2,754,694	2,740,221
未払委託者報酬	26,760,264	26,619,662
その他未払費用	280,104	278,648
流動負債合計	45,666,525	43,290,958
負債合計	45,666,525	43,290,958
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,185,897,916	4,246,192,939
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	10,050,172,334	10,867,930,301
(分配準備積立金)	3,579,592,274	3,305,366,355
元本等合計	14,236,070,250	15,114,123,240
純資産合計	14,236,070,250	15,114,123,240
負債純資産合計	14,281,736,775	15,157,414,198

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期中間計算期間 自 2024年1月12日 至 2024年7月11日	第14期中間計算期間 自 2025年1月15日 至 2025年7月14日
<b>営業収益</b>		
受取利息	64,023	725,128
有価証券売買等損益	2,018,731,954	700,329,376
営業収益合計	2,018,795,977	701,054,504
<b>営業費用</b>		
支払利息	4,112	-
受託者報酬	2,515,831	2,740,221
委託者報酬	24,439,957	26,619,662
その他費用	255,808	278,648
営業費用合計	27,215,708	29,638,531
営業利益又は営業損失( )	1,991,580,269	671,415,973
経常利益又は経常損失( )	1,991,580,269	671,415,973
中間純利益又は中間純損失( )	1,991,580,269	671,415,973
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	57,297,742	3,977,114
期首剰余金又は期首欠損金( )	8,117,712,179	10,050,172,334
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,018,537,802	950,843,822
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,018,537,802	950,843,822
剰余金減少額又は欠損金増加額	627,889,796	808,478,942
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	627,889,796	808,478,942
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	10,442,642,712	10,867,930,301

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第14期中間計算期間	
	自 2025年1月15日	至 2025年7月14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. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1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2025年1月14日、当中間計算期間末日を2025年7月14日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期	第14期中間計算期間末
	2025年1月14日現在	2025年7月14日現在
1. 期首元本額	3,966,063,126円	4,185,897,916円
期中追加設定元本額	786,581,506円	397,071,718円
期中一部解約元本額	566,746,716円	336,776,695円
2. 受益権の総数	4,185,897,916口	4,246,192,939口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期	第14期中間計算期間末
	2025年1月14日現在	2025年7月14日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第13期 2025年1月14日現在	第14期中間計算期間末 2025年7月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,4010円 (34,010円)	3,5595円 (35,595円)

（参考）

「DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）」、「DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）」、「DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2025年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,156,784,670
株式	635,441,686,170
派生商品評価勘定	151,303,510
未収入金	107,421,801
未収配当金	1,030,989,905
差入委託証拠金	662,787,556
流動資産合計	649,550,973,612
資産合計	649,550,973,612
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,225,260
前受金	132,000,000
未払解約金	407,532,000
流動負債合計	558,757,260
負債合計	558,757,260
純資産の部	
元本等	
元本	127,042,056,491
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	521,950,159,861
元本等合計	648,992,216,352
純資産合計	648,992,216,352
負債純資産合計	649,550,973,612



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年1月15日 至 2025年7月14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	2025年7月14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	123,691,325,442円
同期中追加設定元本額	22,655,875,290円
同期中一部解約元本額	19,305,144,241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	2,263,659,751円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,918,468,218円
One DC 国内株式インデックスファンド	36,304,995,033円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,610,380,617円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,434,310円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	6,243,157円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	14,531,906円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	16,098,737円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,504,721円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	5,615,983円
たわらノーロード TOPIX	4,110,503,427円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,279,510,996円
たわらノーロード バランス(堅実型)	50,383,628円
たわらノーロード バランス(標準型)	441,669,606円
たわらノーロード バランス(積極型)	868,230,472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)	2,859,820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)	185,381,368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)	589,728,989円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	496,704,578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)	695,068,116円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	514,322円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,297,267円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	41,724,186円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	14,240,129円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	23,489,853円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	21,644,184円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	110,055,429円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	44,486,912円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	31,590,367,373円
O n eグローバルバランス	116,526,520円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/ ~ 1 9 7 2年生まれ向け)	110,542円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/ 1 9 7 3 ~ 1 9 7 7年生まれ向け)	127,286円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/ 1 9 7 8 ~ 1 9 8 2年生まれ向け)	144,628円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/ 1 9 8 3 ~ 1 9 8 7年生まれ向け)	161,705円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/ 1 9 8 8 ~ 1 9 9 2年生まれ向け)	178,976円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/ 1 9 9 3 ~ 1 9 9 7年生まれ向け)	184,537円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/ 1 9 9 8 ~ 2 0 0 2年生まれ向け)	184,732円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/ 2 0 0 3 ~ 2 0 0 7年生まれ向け)	184,732円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型	901,753,091円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	3,301,853,012円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	4,011,748,948円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	240,827,004円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	831,722,161円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,028,125,913円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,862,882円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,007,082,023円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,770,585円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	249,589,211円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	324,143,547円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	582,612,020円
投資のソムリエ	6,388,094,232円
クルーズコントロール	120,904,584円
投資のソムリエ< D C年金>	979,213,170円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	365,003,700円
4資産分散投資・ハイクラス< D C年金>	1,461,734,545円
投資のソムリエ< D C年金>リスク抑制型	586,162,325円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,305,202,725円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	133,261,625円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	71,995,210円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	6,567,201円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	272,861,175円
4資産分散投資・スタンダード< D C年金>	700,136,606円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	518,450,827円
9資産分散投資・スタンダード< D C年金>	215,460,010円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	122,606,566円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	76,607,499円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	46,374,168円
4資産分散投資・ミドルクラス< D C年金>	848,036,354円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	14,756,876円
O n eグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,354,280円

Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	31,790,923円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	386,747円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	8,381,009円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	8,354,169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)	14,457,048円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	5,064,470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)	1,669,139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)	21,186,370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)	118,910,911円
日本株40・外債60配分戦略ファンド2021-07(適格機関投資家限定)	279,600,946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)	5,718,182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)	120,471,443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)	333,159,260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)	8,845,778円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2024-05(適格機関投資家限定)	336,949,684円
AMOne TOPIXインデックスファンド2025-01(適格機関投資家限定)	1,641,866,744円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	66,145,007円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	17,377,225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)	28,738,314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)	13,993,738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)	4,095,215円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	17,816,436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)	52,588,806円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,906,061円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,242,614円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,493,308円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	74,223円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	39,410円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	766,987円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	165,668,046円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	305,924,807円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	977,565,813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)	7,554,888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)	10,973,127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)	86,580,616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)	17,818,429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)	47,631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)	83,227,390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)	6,449,373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)	17,850,062円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	38,598,314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)	49,516,944円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	13,027,089円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	4,809,896円
動的パッケージファンド<DC年金>	22,317,106円
コア資産形成ファンド	8,900,009円
MHAMトピックスファンド	725,266,464円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	29,305,371円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,413,874,693円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,077,283,803円
計	127,042,056,491円
2. 受益権の総数	127,042,056,491口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	2025年7月14日現在		
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)
市場取引 先物取引			

買建	13,277,015,000	-	13,409,250,000	132,235,000
合計	13,277,015,000	-	13,409,250,000	132,235,000

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2025年7月14日現在
1口当たり純資産額	5.1085円
(1万口当たり純資産額)	(51,085円)

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2025年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,351,799,920
国債証券	391,293,852,500
地方債証券	23,962,250,852
特殊債券	20,945,758,425
社債券	16,671,590,000
未収利息	835,835,661
前払費用	74,312,590
流動資産合計	455,135,399,948
資産合計	455,135,399,948
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	661,874,000
流動負債合計	861,874,000
負債合計	861,874,000
純資産の部	
元本等	
元本	391,420,526,682
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	62,852,999,266
元本等合計	454,273,525,948
純資産合計	454,273,525,948
負債純資産合計	455,135,399,948

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年1月15日 至 2025年7月14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	2025年7月14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	415,533,630,878円
同期中追加設定元本額	250,044,812,291円
同期中一部解約元本額	274,157,916,487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	33,088,099,281円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	37,989,934円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	77,155,258円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	42,269,795円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	434,011,212円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	166,113,490円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	16,340,179円
たわらノーロード 国内債券	21,380,100,430円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	9,525,426,144円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,958,952,363円
たわらノーロード バランス（標準型）	4,528,276,602円
たわらノーロード バランス（積極型）	728,324,531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）	200,287,428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）	2,668,274,357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）	3,236,890,268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）	787,598,367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）	65,212,624円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	25,223,785円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	206,113,615円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	13,672,942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）	17,119,374円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	25,806,163円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C 年金 >	12,521,236,762円
Oneグローバルバランス	341,587,824円
未来のわたし（ターゲット・イヤーノ～1972年生まれ向け）	838,194円
未来のわたし（ターゲット・イヤーノ1973～1977年生まれ向け）	642,476円
未来のわたし（ターゲット・イヤーノ1978～1982年生まれ向け）	435,667円
未来のわたし（ターゲット・イヤーノ1983～1987年生まれ向け）	247,502円

未来のわたし(ターゲット・イヤー/1988~1992年生まれ向け)	77,156円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	13,180,810,153円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	19,306,665,013円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	9,548,492,736円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,709,881,691円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	3,031,645,496円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	618,213,761円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	89,172,258円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,612,804,481円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,475,193円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	6,004,516,804円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,900,362,851円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	611,630,747円
投資のソムリエ	32,184,103,597円
クルーズコントロール	526,775,672円
投資のソムリエ<DC年金>	5,000,243,733円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	8,813,680,528円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	3,476,825,072円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	11,109,907,009円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	24,720,964,904円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	398,609,306円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	215,676,078円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	126,410,545円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,388,672,165円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,926,965,954円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,566,696,596円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,046,821,536円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	590,167,976円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	229,424,313円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	138,711,372円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	4,543,382,283円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	43,826,078円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	171,478,011円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	1,152,708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)	1,219,904,905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)	1,223,933,354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)	804,135,843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)	733,348,658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)	1,213,598,126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)	3,095,071,889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)	2,073,895,318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)	821,534,342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)	2,101,200,123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)	1,336,464,020円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,464,364,989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)	923,699,258円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	338,247,151円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	250,673,611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)	1,708,593,033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)	1,707,086,028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)	1,697,743,493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)	2,043,122,757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)	20,908,256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)	301,690,326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)	93,929,444円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	92,240,675円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	19,541,177円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	54,320,898円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	27,359,112円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	433,407円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	258,099円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,055,064円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,940,657,102円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,014,127,802円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,290,366,202円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	49,778,115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)	120,529,302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)	1,144,193,432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)	78,238,736円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	628,531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)	974,459,182円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	28,311,726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)	156,796,277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)	225,987,889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)	362,409,537円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	187,482,207円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	49,284,925円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	291,842,252円
動的パッケージファンド<DC年金>	282,050,891円
コア資産形成ファンド	112,113,212円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	17,672,181,251円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	30,444,953,310円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	26,550,603,241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]	135,381,830円
計	391,420,526,682円

2. 受益権の総数	391,420,526,682口
-----------	------------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2025年7月14日現在
1口当たり純資産額	1.1606円
(1万口当たり純資産額)	(11,606円)

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2025年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	8,004,623,896
コール・ローン	1,581,317,197
株式	1,913,303,286,128
投資信託受益証券	2,430,223,020
投資証券	30,640,119,582
派生商品評価勘定	521,824,206
未収配当金	1,202,789,746
差入委託証拠金	14,403,637,535
流動資産合計	1,972,087,821,310
資産合計	1,972,087,821,310
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,921,700
未払解約金	2,031,225,000
流動負債合計	2,033,146,700
負債合計	2,033,146,700
純資産の部	
元本等	
元本	188,854,700,520
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,781,199,974,090
元本等合計	1,970,054,674,610
純資産合計	1,970,054,674,610
負債純資産合計	1,972,087,821,310

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年1月15日 至 2025年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年7月14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	180,152,640,719円
同期中追加設定元本額	26,740,405,867円
同期中一部解約元本額	18,038,346,066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	3,719,323,730円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,000,377円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	4,952,766円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	11,693,560円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	11,232,316円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	10,715,523円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	4,520,827円
たわらノーロード 先進国株式	81,677,675,796円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	3,104,071,730円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,152,266,803円
たわらノーロード バランス(堅実型)	76,142,586円
たわらノーロード バランス(標準型)	849,195,542円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,320,817,592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)	52,345,419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)	293,506,114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)	387,574,466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)	616,661,478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)	518,740円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	17,671,429円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	9,046,773円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	18,193,293円
たわらノーロード 全世界株式	11,500,802,953円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	12,351,088円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	49,637,994円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	24,769,540円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	58,586,812,071円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	4,059,928,460円
O n eグローバルバランス	59,465,918円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	124,527,350円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	692,929,283円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	960,708,786円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	61,944,618円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	181,012,772円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	208,649,557円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	13,743,465円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	559,853,139円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	108,251,992円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	127,780,364円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	164,790,466円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	299,010,458円
投資のソムリエ	4,395,241,959円
クルーズコントロール	29,659,584円
投資のソムリエ<DC年金>	690,582,131円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	184,345,094円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	352,315,515円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	341,612,564円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	755,673,115円
ワールドアセットバランス(基本コース)	84,930,791円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	118,913,923円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	84,461,417円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	46,112,597円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,889,508円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	190,517,159円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	176,582,518円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	179,600,447円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	109,037,333円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	85,502,362円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	48,972,463円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	29,799,688円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	217,010,694円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	9,424,998円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	24,620,875円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	245,609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)	2,239,234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)	2,174,009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)	8,145,488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)	1,362,835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)	184,224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)	5,533,316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)	10,046,566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)	1,485,514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)	10,137,837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)	1,223,115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)	377,734,055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)	13,274,384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)	964,672,653円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,144,333,887円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	47,631,798円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	3,784,669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)	3,658,893円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	2,945,701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)	9,066,736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)	26,720,792円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	969,989円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,292,637円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	633,765円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	25,209円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,114円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	585,587円

D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	56,157,659円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	136,134,716円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	497,158,970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)	19,246,281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)	16,766,490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)	88,309,225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)	3,015,367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)	109,372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)	28,189,935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)	3,280,109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)	9,080,038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)	13,078,884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)	25,182,983円
動的パッケージファンド<DC年金>	12,050,703円
コア資産形成ファンド	4,714,812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>	2,162,465,570円
MHAM外国株式インデックスファンド	124,911,734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>	774,731,655円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,286,224,332円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,653,856,418円
計	188,854,700,520円
2. 受益権の総数	188,854,700,520口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2025年7月14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	905,128,745	-	907,027,636	1,898,891
アメリカ・ドル	717,588,454	-	718,970,932	1,382,478
イギリス・ポンド	22,645,416	-	22,624,326	21,090
オーストラリア・ドル	9,518,652	-	9,580,289	61,637
カナダ・ドル	52,666,041	-	52,747,396	81,355
ユーロ	102,710,182	-	103,104,693	394,511
合計	905,128,745	-	907,027,636	1,898,891

(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	2025年7月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引				
買建	22,796,411,116	-	23,318,212,513	521,801,397
合計	22,796,411,116	-	23,318,212,513	521,801,397

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2025年7月14日現在	
1口当たり純資産額	10.4316円
(1万口当たり純資産額)	(104,316円)



外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

（単位：円）

2025年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	616,812,194
コール・ローン	927,945,003
国債証券	292,568,970,249
未収利息	2,430,297,987
前払費用	315,224,986
流動資産合計	296,859,250,419
資産合計	296,859,250,419
負債の部	
流動負債	
未払解約金	335,009,000
流動負債合計	335,009,000
負債合計	335,009,000
純資産の部	
元本等	
元本	120,866,276,672
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	175,657,964,747
元本等合計	296,524,241,419
純資産合計	296,524,241,419
負債純資産合計	296,859,250,419

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年1月15日 至 2025年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年7月14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	111,389,638,247円
同期中追加設定元本額	29,053,696,217円
同期中一部解約元本額	19,577,057,792円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	8,515,308,325円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,375,860円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	10,595,744円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	31,067,386円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	15,539,043円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,897,244円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,008,695円
たわらノーロード 先進国債券	24,532,314,291円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,773,243,222円
たわらノーロード バランス(堅実型)	78,808,820円
たわらノーロード バランス(標準型)	527,120,960円
たわらノーロード バランス(積極型)	138,940,732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)	18,252,155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)	960,894,897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)	1,787,320,007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)	936,138,630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)	667,047,240円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,454,670円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	12,450,465円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	169,562,207円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	37,742,276円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	29,641,920円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	54,857,394円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	12,725,900円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	4,254,925円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,952,606,073円
O n e D C 先進国債券インデックスファンド	3,293,955,451円
O n eグローバルバランス	175,729,453円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	772,521,481円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,608,980,983円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,363,452,499円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	378,694,123円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	840,298,768円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	860,992,977円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,589,393円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	952,077,302円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	35,779,126円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	156,797,134円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	176,543,663円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	296,942,647円
クルーズコントロール	376,629,288円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	225,130,824円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,223,622,778円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	1,103,140,108円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,078,200円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	886,135,939円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	3,828,705円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	40,122,130円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	737,129,190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)	493,678,254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)	495,443,194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)	297,267,654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)	296,847,533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)	143,047,476円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	1,252,375,665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)	166,812,173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)	332,454,877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)	169,000,334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)	964,558,723円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,823,670,685円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,347,742,872円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	3,482,396,592円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	36,892,234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)	826,984,857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)	181,788,595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)	178,277,624円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	9,451,731円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	17,501,203円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,293,194円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	52,211円

DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	125,098円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,628,434円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	820,435,126円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	1,053,796,834円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2,072,428,907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）	40,060,579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）	81,538,060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）	733,715,973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）	138,977,013円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	151,496円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	117,512,222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）	108,996,900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）	140,190,621円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	27,552,765円
動的パッケージファンド<DC年金>	60,621,550円
コア資産形成ファンド	24,622,653円
たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジなし）<ラップ専用>	5,083,042,251円
たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジあり）<ラップ専用>	11,624,367,943円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	6,713,758,954円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	6,483,874,369円
計	120,866,276,672円
2. 受益権の総数	120,866,276,672口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	2025年7月14日現在
1口当たり純資産額	2.4533円
（1万口当たり純資産額）	（24,533円）

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2025年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,276,645,020
コール・ローン	131,950,721
株式	128,678,841,264
投資信託受益証券	699,580,524
投資証券	124,064,473
派生商品評価勘定	78,553,521
未収入金	2,730,438
未収配当金	498,427,473
差入委託証拠金	2,665,698,895
流動資産合計	136,156,492,329
資産合計	136,156,492,329
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,752,846
未払金	180,361
未払解約金	147,500,000
流動負債合計	149,433,207
負債合計	149,433,207
純資産の部	
元本等	
元本	67,858,869,520
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	68,148,189,602
元本等合計	136,007,059,122
純資産合計	136,007,059,122
負債純資産合計	136,156,492,329

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年1月15日 至 2025年7月14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	2025年7月14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	58,521,513,324円
同期中追加設定元本額	16,667,382,889円
同期中一部解約元本額	7,330,026,693円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	11,132,328,339円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>	9,268,919,751円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,543,286円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	7,728,774円

MITO ラップ型ファンド(積極型)	18,222,165円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	17,582,132円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	16,723,772円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	7,044,983円
たわらノーロード 新興国株式	17,243,551,317円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	5,958,492,102円
たわらノーロード バランス(堅実型)	32,144,512円
たわらノーロード バランス(標準型)	163,017,486円
たわらノーロード バランス(積極型)	342,215,935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)	110,437,380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)	217,038,460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)	347,103,909円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	11,703円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,115,810円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	7,030,431円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,786,341円
たわらノーロード 全世界株式	7,334,916,154円
One DC 新興国株式インデックスファンド	2,537,815,344円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1972年生まれ向け)	80,326円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1973~1977年生まれ向け)	92,975円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1978~1982年生まれ向け)	105,624円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1983~1987年生まれ向け)	117,076円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1988~1992年生まれ向け)	126,338円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1993~1997年生まれ向け)	131,318円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1998~2002年生まれ向け)	131,318円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/2003~2007年生まれ向け)	131,318円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	370,407,528円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	337,830,315円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	577,462,095円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,166,598,994円
投資のソムリエ	5,577,460,971円
クルーズコントロール	155,264,643円
投資のソムリエ<DC年金>	855,030,513円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	492,573,359円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	510,456,272円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,137,913,976円
ワールドアセットバランス(基本コース)	327,962,451円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	459,664,494円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	58,892,223円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	31,777,042円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,717,958円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	234,322,984円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	196,326,093円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	285,261,755円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	54,383,283円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	33,797,654円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	20,512,452円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,498,724円
Oneグローバル最適化バランス(成長型) <ラップ向け>	11,907,046円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	162,805円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	57,612,717円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,573,097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)	72,584,365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)	33,643,212円
計	67,858,869,520円
2. 受益権の総数	67,858,869,520口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2025年7月14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 売建 アメリカ・ドル	98,058,006	-	98,334,771	276,765
	98,058,006	-	98,334,771	276,765
合計	98,058,006	-	98,334,771	276,765

## (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	2025年7月14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	6,389,215,007	-	6,466,292,447	77,077,440	
合計	6,389,215,007	-	6,466,292,447	77,077,440	

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2025年7月14日現在
1口当たり純資産額	2.0043円
(1万口当たり純資産額)	(20,043円)

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2025年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	871,899,545
コール・ローン	379,386,800
国債証券	96,065,536,291
未収利息	1,134,445,813
前払費用	364,450,119
流動資産合計	98,815,718,568
資産合計	98,815,718,568
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	203
未払解約金	285,537,000
流動負債合計	285,537,203
負債合計	285,537,203
純資産の部	
元本等	
元本	40,227,880,812
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	58,302,300,553
元本等合計	98,530,181,365
純資産合計	98,530,181,365
負債純資産合計	98,815,718,568

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年1月15日 至 2025年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年7月14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	49,864,238,744円
同期中追加設定元本額	20,612,805,337円
同期中一部解約元本額	30,249,163,269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）	4,804,470,903円
たわらノーロード バランス（堅実型）	210,992,648円
たわらノーロード バランス（標準型）	798,783,654円
たわらノーロード バランス（積極型）	418,855,280円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	735,113円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	4,378,758円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	52,193,328円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	9,540,571円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	4,787,459円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	45,501,356円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	256,152,844円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	453,732,465円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	920,383,941円
投資のソムリエ	8,494,085,302円
クルーズコントロール	126,122,078円
投資のソムリエ<DC年金>	1,311,607,052円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	375,852,870円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,567,046,231円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,472,784,581円
ワールドアセットバランス（基本コース）	178,982,685円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	250,700,445円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	120,026,039円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	64,867,098円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	17,585,606円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	359,330,732円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,207,078,733円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	229,130,929円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	133,476,465円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	68,893,813円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	41,919,128円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	13,242,591円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	1,936,216円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	6,492,746円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070）	351,174円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	12,879,391,719円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	88,564,529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）	561,897,451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）	433,108,725円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	5,484,909円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	59,432,437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）	27,578,189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）	150,402,019円
計	40,227,880,812円
2. 受益権の総数	40,227,880,812口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年7月14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。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2025年7月14日現在		
	契約額等（円）	時価（円）	
		うち 1年超	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引			

売建	100,000,000	-	100,000,203	203
アメリカ・ドル	100,000,000	-	100,000,203	203
合計	100,000,000	-	100,000,203	203

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2025年7月14日現在
1口当たり純資産額	2,4493円
(1万口当たり純資産額)	(24,493円)

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2025年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,456,553,271
投資証券	183,216,561,400
派生商品評価勘定	178,391,080
未収入金	460,233,619
未収配当金	1,675,664,671
差入委託証拠金	192,664,945
流動資産合計	189,180,068,986
資産合計	189,180,068,986
負債の部	
流動負債	
前受金	141,564,350
未払金	46,010,434
未払解約金	516,207,000
流動負債合計	703,781,784
負債合計	703,781,784
純資産の部	
元本等	
元本	74,776,800,915
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	113,699,486,287
元本等合計	188,476,287,202
純資産合計	188,476,287,202
負債純資産合計	189,180,068,986

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年1月15日 至 2025年7月14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	2025年7月14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	71,503,052,428円
同期中追加設定元本額	19,140,440,542円
同期中一部解約元本額	15,866,692,055円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	85,438円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	438,652円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,057,153円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	958,781円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	958,178円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	411,611円
たわらノーロード 国内リート	6,142,110,316円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,662,832,570円
たわらノーロード バランス(堅実型)	51,463,309円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,282,615,089円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,773,617,951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)	343,432,796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)	965,720,351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)	690,145,606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)	827,795,910円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	4,788,135円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	79,713,860円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	22,258,530円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	25,639,174円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	20,703,105円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	62,453,881円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	43,050,982円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	11,877,714円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	468,518,503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)	157,727,543円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	270,731,514円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	533,160,497円
投資のソムリエ	5,492,327,884円
投資のソムリエ<DC年金>	842,211,119円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	231,733,239円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	603,218,949円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,340,980,913円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	77,430,839円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	41,778,568円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,759,247円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	230,799,607円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,001,483,075円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	132,842,437円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	68,497,113円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	44,433,982円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	26,965,255円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	8,541,579円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	34,706,322円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	223,498円
Jリートインデックスファンド(DC)	91,215,906円
MHAM J-REITインデックスファンド(隔月決算型)	31,719,824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)	70,009,791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)	417,618,183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)	70,372,296円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	27,862,612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)	42,009,589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)	186,861,040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)	70,998,807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)	588,212,099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)	95,205,718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)	177,472,279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)	134,848,625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)	222,063,732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)	155,070,367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)	70,969,423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)	47,119,867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)	154,661,865円
固定比率マルチアセット戦略ファンド2021-10(適格機関投資家限定)	184,248,756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)	222,922,670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)	504,860,027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)	143,446,314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)	340,588,977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)	510,916,249円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	1,833,200,746円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	57,128,769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)	169,356,869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)	117,481,953円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,523,376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)	579,873,970円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	6,364,093,830円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	24,836,046,946円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,751,942,662円
たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>	4,869,100,783円
計	74,776,800,915円
2. 受益権の総数	74,776,800,915口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	2025年7月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	4,933,896,150	-	5,112,601,500	178,705,350
合計	4,933,896,150	-	5,112,601,500	178,705,350

## （注）時価の算定方法

## 不動産投信指数先物取引

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

## （1口当たり情報に関する注記）

	2025年7月14日現在
1口当たり純資産額	2.5205円
（1万口当たり純資産額）	（25,205円）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2025年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	352,676,387
コール・ローン	70,179,217
投資信託受益証券	10,867,741,577
投資証券	87,441,158,559
派生商品評価勘定	2,893,353
未収配当金	388,193,776
差入委託証拠金	394,121,254
流動資産合計	99,516,964,123
資産合計	99,516,964,123
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,446,413
未払解約金	8,592,000
流動負債合計	11,038,413
負債合計	11,038,413
純資産の部	
元本等	
元本	47,262,518,546
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	52,243,407,164
元本等合計	99,505,925,710
純資産合計	99,505,925,710
負債純資産合計	99,516,964,123

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年1月15日 至 2025年7月14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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年7月14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	49,778,319,009円
同期中追加設定元本額	14,756,961,256円
同期中一部解約元本額	17,272,761,719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＞	5,584,555,751円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	1,543,294円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	8,155,980円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	19,750,880円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	17,547,584円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	17,486,082円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	7,634,862円
たわらノーロード 先進国リート	17,093,372,037円
たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	289,527,244円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,572,286,949円
たわらノーロード バランス（堅実型）	30,784,324円
たわらノーロード バランス（標準型）	770,465,405円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,962,390,849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）	103,143,287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)	844,280,690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)	829,455,704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)	1,326,912,570円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,277,551円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	52,257,052円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	26,751,111円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	50,432,099円
One DC 先進国リートインデックスファンド	3,844,219,881円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	13,511,697円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	553,920,418円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	77,596,840円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	174,621,042円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	315,178,721円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	639,404,569円
投資のソムリエ	2,662,541,706円
投資のソムリエ<DC年金>	408,248,884円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	261,681,414円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	488,614,375円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,087,345,695円
ワールドアセットバランス(基本コース)	209,074,151円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	292,777,253円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	37,329,654円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	20,174,855円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,469,968円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	111,801,547円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	206,966,906円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	159,393,709円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	41,530,610円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	21,426,404円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	13,037,792円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,089,455円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	68,256,718円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	101,187円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	320,487,783円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	464,349,712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)	980,574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)	27,793,959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)	1,706,434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)	29,731,618円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	69,346,336円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	17,013,795円
計	47,262,518,546円
2. 受益権の総数	47,262,518,546口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	2025年7月14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	1,189,224,197	-		1,189,671,137	446,940
合計	1,189,224,197	-		1,189,671,137	446,940

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2025年7月14日現在
1口当たり純資産額	2.1054円
(1万口当たり純資産額)	(21,054円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

2025年7月31日現在

資産総額	12,756,543,734円
負債総額	17,435,042円
純資産総額( - )	12,739,108,692円
発行済数量	7,093,081,613口
1口当たり純資産額( / )	1.7960円

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

2025年7月31日現在

資産総額	11,435,446,153円
負債総額	12,107,633円
純資産総額( - )	11,423,338,520円
発行済数量	4,408,269,350口
1口当たり純資産額( / )	2.5913円

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

2025年7月31日現在

資産総額	15,616,832,573円
負債総額	23,359,145円
純資産総額( - )	15,593,473,428円
発行済数量	4,263,407,412口
1口当たり純資産額( / )	3.6575円

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産総額	678,665,397,134円
負債総額	3,399,882,700円
純資産総額( - )	675,265,514,434円
発行済数量	126,768,999,147口
1口当たり純資産額( / )	5.3267円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産総額	463,741,498,235円
負債総額	3,678,717,000円
純資産総額( - )	460,062,781,235円
発行済数量	395,289,826,814口
1口当たり純資産額( / )	1.1639円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産総額	2,033,209,320,007円
負債総額	563,116,426円
純資産総額( - )	2,032,646,203,581円
発行済数量	189,704,083,777口
1口当たり純資産額( / )	10.7148円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産総額	300,041,338,688円
負債総額	107,254,008円
純資産総額（ - ）	299,934,084,680円
発行済数量	121,093,741,511口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4769円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産総額	141,057,652,339円
負債総額	15,953,779円
純資産総額（ - ）	141,041,698,560円
発行済数量	68,017,413,162口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0736円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産総額	97,744,590,777円
負債総額	15,143,029円
純資産総額（ - ）	97,729,447,748円
発行済数量	39,023,053,694口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5044円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産総額	196,274,616,365円
負債総額	2,191,809,675円
純資産総額（ - ）	194,082,806,690円
発行済数量	74,650,249,233口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5999円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年7月31日現在

資産総額	102,406,607,147円
負債総額	160,263,095円
純資産総額（ - ）	102,246,344,052円
発行済数量	47,681,841,668口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1443円



## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

### (7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額(2025年7月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構(2025年7月31日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

##### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は原則として月次で開催する「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、運用担当部署の部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。

2025年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,591,323,913,596
追加型株式投資信託	756	18,016,616,437,025
単位型公社債投資信託	18	28,897,576,760
単位型株式投資信託	184	924,851,062,546
合計	984	20,561,688,989,927

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第40期事業年度（自2024年4月1日至2025年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：百万円 )

	第39期 ( 2024年3月31日現在 )	第40期 ( 2025年3月31日現在 )
( 資産の部 )		
流動資産		
現金・預金	41,183	40,201
有価証券	-	0
金銭の信託	28,143	31,340
未収委託者報酬	19,018	19,595
未収運用受託報酬	3,577	4,015
未収投資助言報酬	315	359
未収収益	6	11
前払費用	1,510	1,758
その他	2,088	2,106
流動資産計	95,843	99,390
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 918	1 841
器具備品	1 130	1 352
リース資産	1 5	1 3
建設仮勘定	39	163
無形固定資産		
ソフトウェア	2,951	2,740
ソフトウェア仮勘定	1,543	1,030
電話加入権	0	0
投資その他の資産		
投資有価証券	184	183
関係会社株式	4,447	4,037
長期差入保証金	768	760
繰延税金資産	3,406	3,842
その他	128	215
固定資産計	14,524	14,172
資産合計	110,368	113,562

(単位:百万円)

	第39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,982	227
リース債務	1	1
未払金	8,970	8,823
未払収益分配金	1	1
未払償還金	0	0
未払手数料	8,246	8,596
その他未払金	721	225
未払費用	8,616	9,265
未払法人税等	3,676	4,277
未払消費税等	1,497	1,606
賞与引当金	1,927	2,198
役員賞与引当金	52	60
流動負債計	26,725	26,462
固定負債		
リース債務	4	2
退職給付引当金	2,719	2,715
時効後支払損引当金	73	64
固定負債計	2,796	2,781
負債合計	29,521	29,244
(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	59,294	62,765
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	59,170	62,642
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	27,490	30,962
株主資本計	80,846	84,318
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	80,846	84,318
負債・純資産合計	110,368	113,562

## （２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）		第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	
	営業収益			
委託者報酬	102,113		112,281	
運用受託報酬	17,155		17,981	
投資助言報酬	2,211		2,374	
その他営業収益	26		30	
営業収益計		121,507		132,668
営業費用				
支払手数料	44,366		49,384	
広告宣伝費	329		401	
公告費	0		0	
調査費	35,468		39,013	
調査費	13,277		14,703	
委託調査費	22,190		24,309	
委託計算費	558		522	
営業雑経費	823		774	
通信費	36		38	
印刷費	598		538	
協会費	65		67	
諸会費	44		47	
支払販売手数料	78		81	
営業費用計		81,545		90,097
一般管理費				
給料	10,763		11,477	
役員報酬	164		181	
給料・手当	9,425		10,148	
賞与	1,173		1,147	
交際費	34		59	
寄付金	15		12	
旅費交通費	162		246	
租税公課	489		668	
不動産賃借料	1,030		1,085	
退職給付費用	412		421	
固定資産減価償却費	1,567		1,457	
福利厚生費	46		57	
修繕費	1		0	
賞与引当金繰入額	1,927		2,198	
役員賞与引当金繰入額	52		60	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,379		3,261	
事務用消耗品費	46		43	
器具備品費	3		2	
諸経費	240		313	
一般管理費計		20,172		21,366
営業利益		19,788		21,204



（単位：百万円）

	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）		第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		4		12
受取配当金	1	899	1	450
時効成立分配金・償還金		0		0
雑収入		18		11
時効後支払損引当金戻入額		35		7
営業外収益計		959		482
営業外費用				
為替差損		19		39
金銭の信託運用損		1,008		329
早期割増退職金		6		6
雑損失		0		-
営業外費用計		1,034		374
経常利益		19,712		21,312
特別利益				
固定資産売却益		-	2	6
特別利益計		-		6
特別損失				
固定資産除却損		6		13
関係会社株式評価損		1,362		31
減損損失	3	231		-
関係会社清算損		-		25
特別損失計		1,601		70
税引前当期純利益		18,111		21,247
法人税、住民税及び事業税		5,769		7,356
法人税等調整額		510		435
法人税等合計		5,258		6,920
当期純利益		12,852		14,326

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

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								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	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

第40期（自 2024年4月1日 至 2025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 準備金	その他利益剰余金		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		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	59,294	80,846
当期変動額									
剰余金の配当							10,855	10,855	10,855
当期純利益							14,326	14,326	14,326
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,471	3,471	3,471
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	30,962	62,765	84,318

	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	80,846
当期変動額			
剰余金の配当			10,855
当期純利益			14,326
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	3,471
当期末残高	0	0	84,318

## 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 ... 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、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	<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>
----------------	---

(未適用の会計基準等)

- ・「リースに関する会計基準」(企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会)
- ・「リースに関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会)等

#### (1) 概要

企業会計基準委員会において、日本基準を国際的に整合性のあるものとする取組みの一環として、借手の全てのリースについて資産及び負債を認識するリースに関する会計基準の開発に向けて、国際的な会計基準を踏まえた検討が行われ、基本的な方針として、IFRS第16号の単一の会計処理モデルを基礎とするものの、IFRS第16号の全ての定めを採り入れるのではなく、主要な定めのみを採り入れることにより、簡素で利便性が高く、かつ、IFRS第16号の定めを個別財務諸表に用いても、基本的に修正が不要となることを目指したリース会計基準等が公表されました。

借手の会計処理として、借手のリースの費用配分の方法については、IFRS第16号と同様に、リースがファイナンス・リースであるかオペレーティング・リースであるかにかかわらず、全てのリースについて使用権資産に係る減価償却費及びリース負債に係る利息相当額を計上する単一の会計処理モデルが適用されます。

#### (2) 適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

#### (3) 当該会計基準等の適用による影響

「リースに関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

**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39期 （2024年3月31日現在）	第40期 （2025年3月31日現在）
建物	630	740
器具備品	769	662
リース資産	3	5

（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39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）	第40期 （自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日）
受取配当金	895	438

## 2. 固定資産売却益

固定資産売却益の内容は、次のとおりであります。

	第39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）	第40期 （自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日）
ソフトウェア	-	6

## 3. 減損損失

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当社は、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。

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

当事業年度については、該当事項ありません。

（株主資本等変動計算書関係）

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

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					

## 第40期(自 2024年4月1日 至 2025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(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  
2025年6月16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
2025年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,440	286,000	2025年3月31日	2025年6月17日
	A種種類 株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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	-

## 第40期(2025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) 有価証券	0	0	-
(2) 金銭の信託	31,340	31,340	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	0	0	-
資産計	31,342	31,342	-

(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	-	-

## 第40期（2025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	40,201	-	-	-
(2) 有価証券	0	-	-	-
(3) 金銭の信託	31,340	-	-	-
(4) 未収委託者報酬	19,595	-	-	-
(5) 未収運用受託報酬	4,015	-	-	-
(6) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	0	-	-
合計	95,154	0	-	-

## 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

## 第40期（2025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) 有価証券	-	0	-	0
(2) 金銭の信託	-	31,340	-	31,340
(3) 投資有価証券 其他有価証券	-	0	-	0
資産計	-	31,342	-	31,342

(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（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39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	182	182
関係会社株式		
非上場株式	4,447	4,037

## （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39期の貸借対照表計上額4,447百万円、第40期の貸借対照表計上額4,037百万円）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。

第40期（2025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. 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。

当事業年度において、有価証券について31百万円（関係会社株式31百万円）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

	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）	第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,698	2,760
勤務費用	296	299
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	9	18
退職給付の支払額	246	321
退職給付債務の期末残高	2,760	2,759

（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

	第39期 （2024年3月31日現在）	第40期 （2025年3月31日現在）
非積立型制度の退職給付債務	2,760	2,759
未積立退職給付債務	2,760	2,759
未認識数理計算上の差異	40	44
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	2,719	2,715
退職給付引当金	2,719	2,715
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,719	2,715

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）	第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）
勤務費用	296	299
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	13	14
過去勤務費用の費用処理額	0	0
その他	4	4
確定給付制度に係る退職給付費用	307	312

（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6百万円、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39期 （2024年3月31日現在）	第40期 （2025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104百万円、当事業年度108百万円であります。

## （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39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	195	259
未払事業所税	9	10
賞与引当金	590	673
未払法定福利費	98	106
運用受託報酬	351	555
資産除去債務	17	20
減価償却超過額（一括償却資産）	12	5
減価償却超過額	91	66
繰延資産償却超過額（税法上）	331	407
退職給付引当金	832	855
時効後支払損引当金	22	20
ゴルフ会員権評価損	6	2
関係会社株式評価損	761	774
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	70	73
その他	8	6
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,406	3,842
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	3,406	3,842

## 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39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025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	1.44 %	0.64 %
税制非適格現物配当益金算入項目	-	3.56 %
税率変更による影響	-	0.18 %
その他	0.14 %	0.79 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.04 %	32.57 %

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

税法の改正に伴い、2026年4月1日以後開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等に係る繰延税金資産については、法定実効税率を30.62%から31.52%に変更し計算しております。

この変更により、当事業年度の繰延税金資産が37百万円増加し、法人税等調整額が37百万円減少しております。

## (企業結合等関係)

## (取得による企業結合)

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39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	60,761百万円	53,066百万円
資産合計	60,761百万円	53,066百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	1,957百万円	561百万円
負債合計	1,957百万円	561百万円
純資産	58,804百万円	52,505百万円

(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	47,640百万円	43,829百万円
顧客関連資産	17,109百万円	13,661百万円



## (2) 損益計算書項目

	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	7,649百万円	7,259百万円
経常利益	7,649百万円	7,259百万円
税引前当期純利益	7,649百万円	7,259百万円
当期純利益	6,474百万円	6,298百万円
1株当たり当期純利益	161,850円28銭	157,468円47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	3,837百万円	3,447百万円

## (共通支配下の取引等)

当社は、2024年4月1日に株式会社みずほフィナンシャルグループ(以下「MHFG」という。親会社)及び第一生命ホールディングス株式会社(その他の関係会社)へ以下の現物配当を行いました。

## 1. 取引の概要

## (1) 取引内容

Asset Management One USA Inc.(当社の子会社)株式の現物配当

## (2) 効力発生日

2024年4月1日

## (3) 取引の総額

575百万円

## (4) その他取引の概要に関する事項

本現物配当は、MHFGの子会社である米州みずほLLC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。

## 2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成31年1月16日)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31年1月16日)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

(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

収益の構成は次の通りです。

	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
委託者報酬	102,113百万円	111,988百万円
運用受託報酬	15,156百万円	16,520百万円
投資助言報酬	2,211百万円	2,374百万円
成功報酬(注)	1,999百万円	1,754百万円
その他営業収益	26百万円	30百万円
<b>合計</b>	<b>121,507百万円</b>	<b>132,668百万円</b>

(注) 成功報酬は、損益計算書において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39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)及び第40期(自 2024年4月1日 至 2025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39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

第40期(自 2024年4月1日 至 2025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	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	22,567 億円	持株 会社	(被所 有) 直接 51%	-	持株会社	現物配当	402	-	-
その他 の 関係 会社	第一生命 ホール ディング ス株式 会社	東京都 千代田 区	3,443 億円	持株 会社	(被所 有) 直接 49%	-	持株会社	現物配当	172	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 現物配当の詳細については、(株主資本等変動計算書関係)2. 配当に関する事項及び(企業結合等関係)(共通支配下の取引等)に記載しております。

## (2) 子会社及び関連会社等

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。

第40期(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

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。

## 第40期(自2024年4月1日至2025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	9,048	未払 手数料	1,976
	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	20,086	未払 手数料	3,306

## 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39期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)	第40期 (自2024年4月1日 至2025年3月31日)
1株当たり純資産額	2,021,173円74銭	2,107,956円73銭
1株当たり当期純利益金額	321,310円79銭	358,173円51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39期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)	第40期 (自2024年4月1日 至2025年3月31日)
当期純利益金額	12,852百万円	14,326百万円
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	12,852百万円	14,326百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

委託会社は2025年5月14日付で100%子会社であるAsset Management One Singapore Pte. Ltd. を清算しました。

##### (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（2025年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	( 1 ) 890,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2025年3月末日現在

#### ( 1 ) 出資の総額

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

2025年5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

## 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2025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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

## 利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2025年3月14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DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）の2024年1月12日から2025年1月14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、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）の2025年1月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2025年3月14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DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）の2024年1月12日から2025年1月14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、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）の2025年1月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2025年3月14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DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）の2024年1月12日から2025年1月14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、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）の2025年1月14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

2025年9月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）の2025年1月15日から2025年7月14日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）の2025年7月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年1月15日から2025年7月14日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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



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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2025年9月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）の2025年1月15日から2025年7月14日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）の2025年7月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年1月15日から2025年7月14日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2025年9月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）の2025年1月15日から2025年7月14日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）の2025年7月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年1月15日から2025年7月14日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。