投資信託説明書（請求目論見書）

使用開始日
2025年4月15日

Asset Management One

クルーズコントロール

追加型投信／内外／資産複合

■この目論見書により行う「クルーズコントロール」の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第５条の規定により、有価証券届出書を2025年４月14日に関東財務局長に提出しており、2025年４月15日にその効力が生じております。

■「クルーズコントロール」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

アセットマネジメントOne株式会社

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
ファンドは、課税上「株式投資信託」として取り扱われます。

■委託会社への照会先

【コールセンター】0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時～午後５時）
【ホームページアドレス】https://www.am-one.co.jp/

発行者名	アセットマネジメントOne株式会社
代表者の役職氏名	取締役社長　　杉原　規之
本店の所在の場所	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当事項はありません。

目　　次

第一部【証券情報】・・・

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

クルーズコントロール

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

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

（５）【申込手数料】

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2025年4月15日から2025年10月10日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時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を行いません。

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

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

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

①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

②当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

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

●国内外の株式および公社債に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。
- 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

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

●各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

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

●資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。

●資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。

●下値目安値は、3ヵ月毎に下値目安値の改定日(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には、翌営業日。)を設け、改定日における基準価額から−2.0%の水準とします。ただし、当該水準は、委託会社の判断により今後変更する場合があります。

●上記の運用目標は、現金等(**)を活用し、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(***)を機動的に変更することで行います。

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

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

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

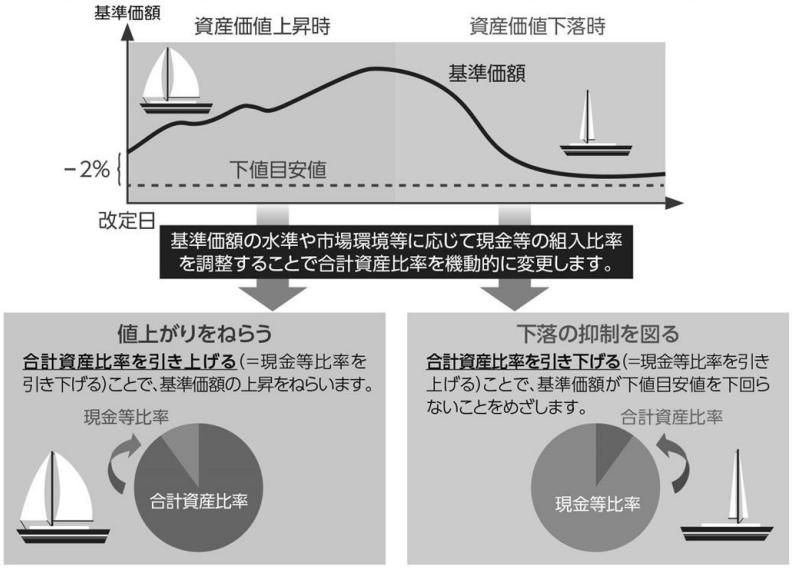
※各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

当ファンドの合計資産比率の変更（イメージ）

●資産価値上昇時は、合計資産比率*1を増加（=現金等*2比率の減少）させることで値上がり益の獲得をめざします。

●一方、資産価値下落時は、機動的に合計資産比率を減少（=現金等比率の増加）させることで基準価額下落の抑制をめざします。

＊1 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。
＊2 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
※合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。



※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。
※ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。
※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

分配方針

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

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

○商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　　内 海　　外 内　　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

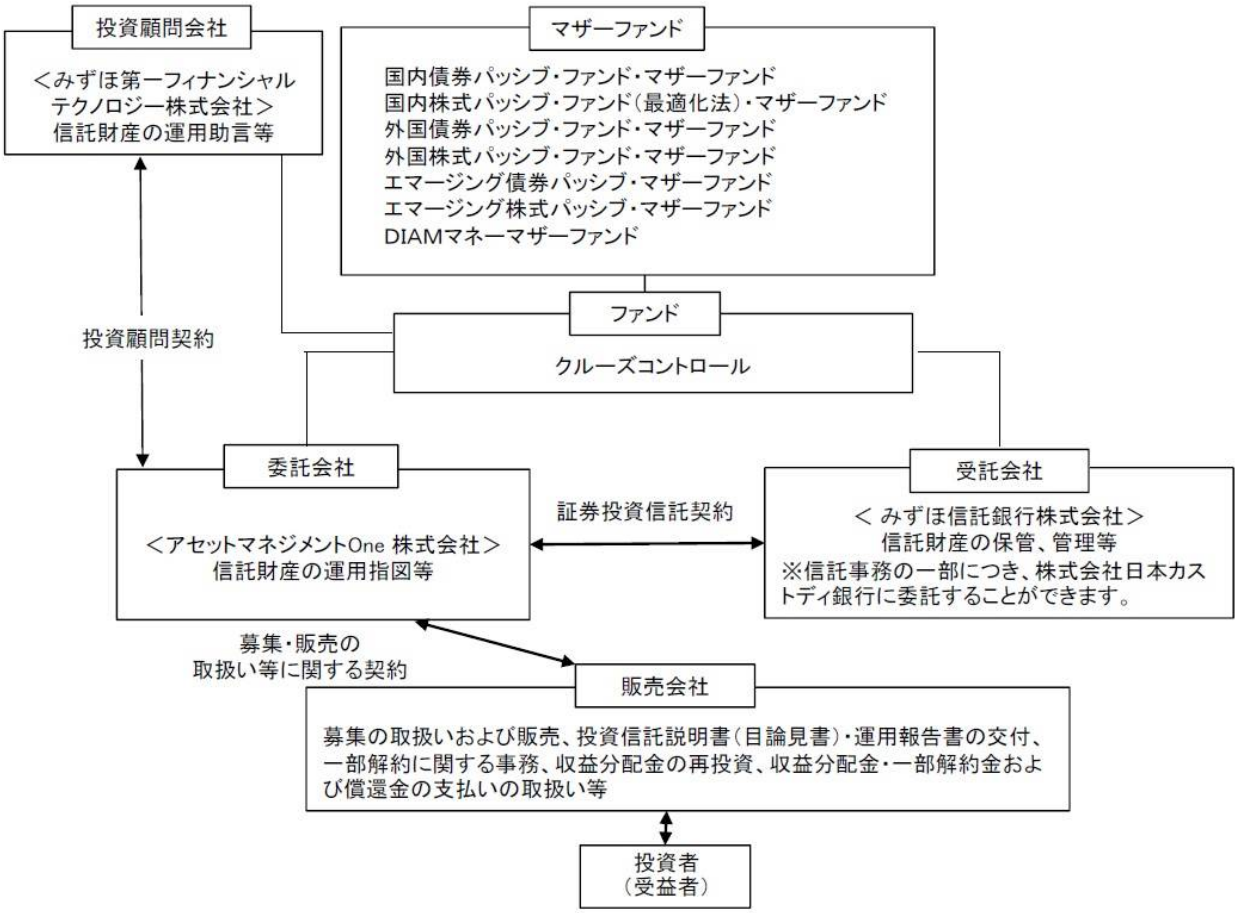
資産複合 （投資信託証券 （債券、株式）、 先物、ＥＴＦ、 短期金融資産） 資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、ＥＴＦ、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、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

※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

（２）【ファンドの沿革】

2012年10月26日　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2013年 5月17日　投資対象、投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

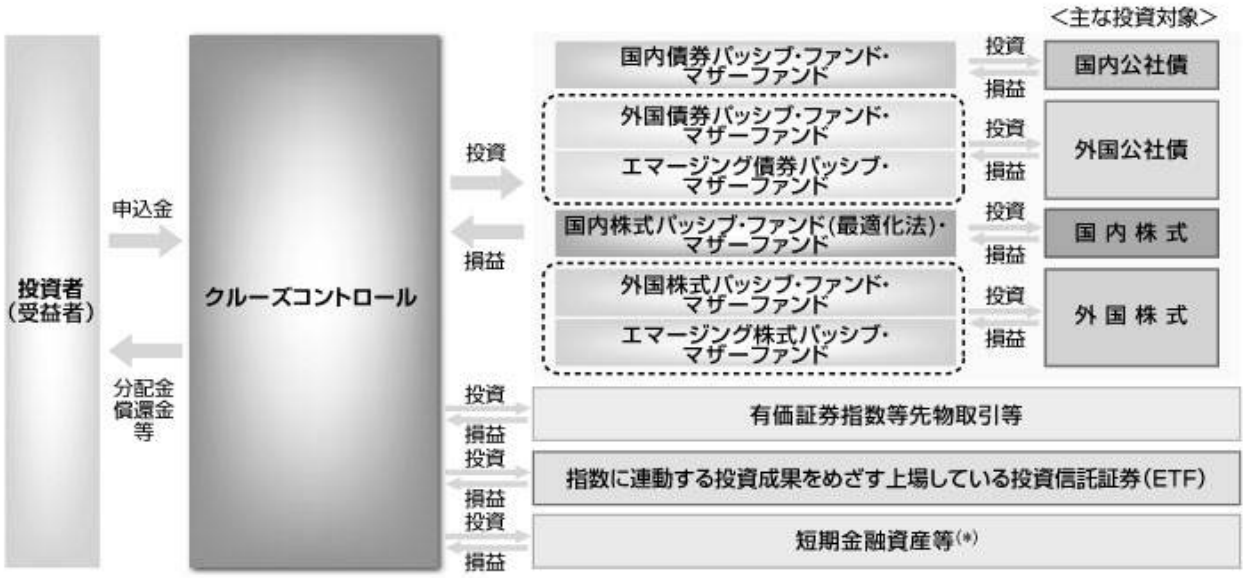
・「投資顧問契約」の概要

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

●「ファミリーファンド方式」とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を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1月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2025年1月31日現在）

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

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

＜投資態度＞

①以下のマザーファンドへの投資を通じて、国内外の株式、公社債に実質的に分散投資を行います。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

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

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

②各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年１回見直すこととします。

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

③基準価額の下落を一定水準（下値目安値(*)）までに抑えることを目標とします。

・資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。

・資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。

・下値目安値は、四半期毎に、委託会社の判断により基準価額から一定の水準に設定します。

・上記の運用目標は、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(**)を機動的に変更することで行います。

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

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

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

・資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

＜運用プロセス＞

・基本配分比率の決定

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

・下値目安値の決定

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

・リバランスの実施

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

・みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言

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

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

ｂ.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1. 株券または新株引受権証書
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。

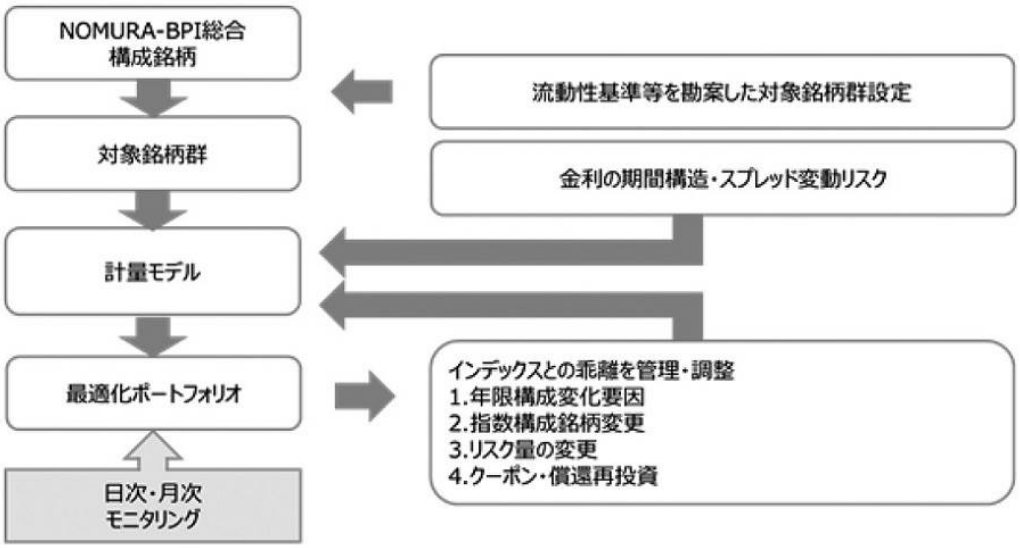
③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 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。 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。 ※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
運用プロセス	1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2. 最適化法によるポートフォリオの構築 1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2）金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1）、2）が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資

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

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

投資態度	1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50％以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10％以下とします。 ※①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。 ②ＪＰＸ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。 ③ＪＰＸ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。 ④ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥ＪＰＸ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。 ⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。
運用プロセス	1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

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

3. インデックスとの乖離を管理

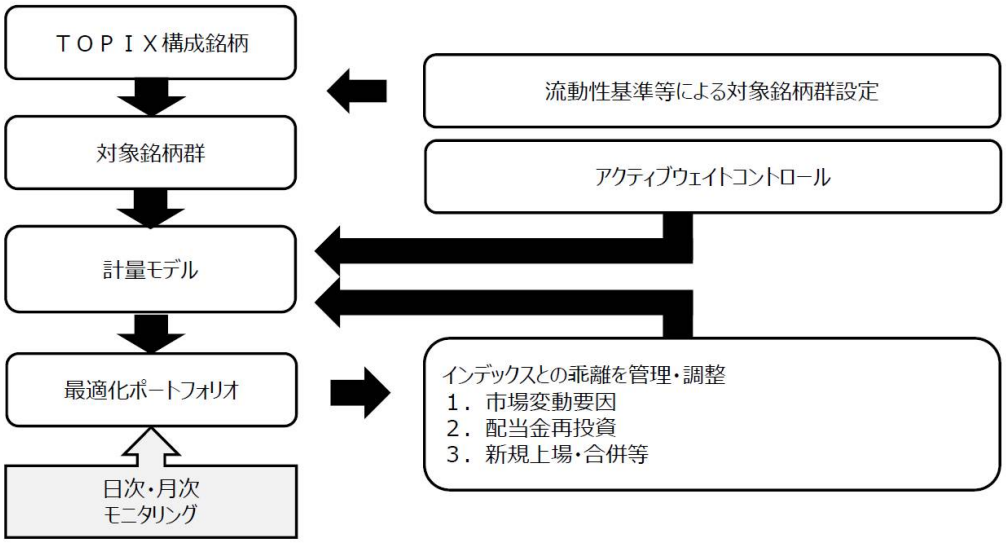
日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施

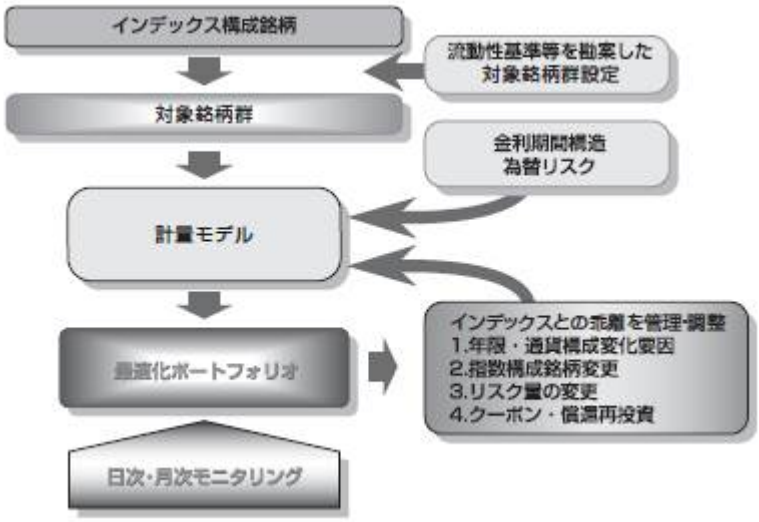
・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定



主な投資制限	1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 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。 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。 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。

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	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。 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。 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。 ※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資

	
主な投資制限	1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 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。 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。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	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	1. 主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

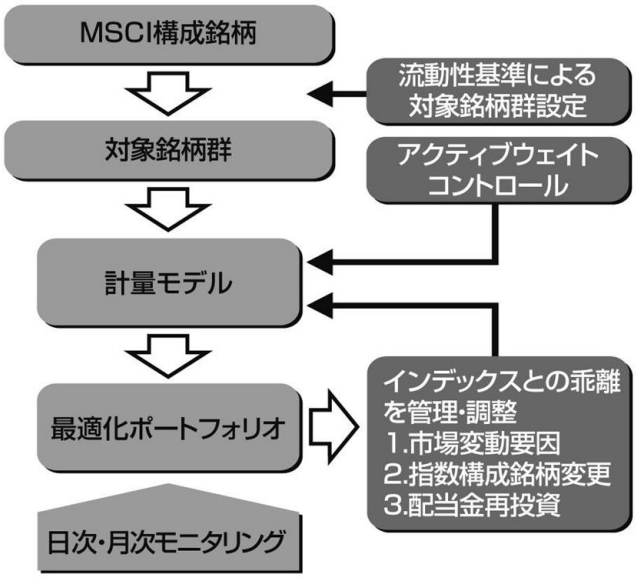
3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

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

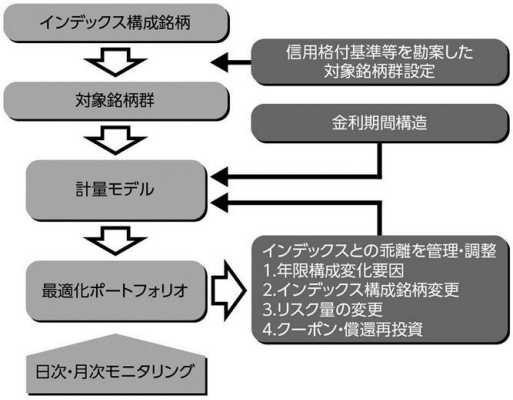
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、または

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	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。

	3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3. 組入債券は、当初組入時において、Ｓ＆ＰもしくはＭｏｏｄｙ’ｓの外貨建て長期格付がＢＢ－格もしくはＢａ３格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ※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。
運用プロセス	

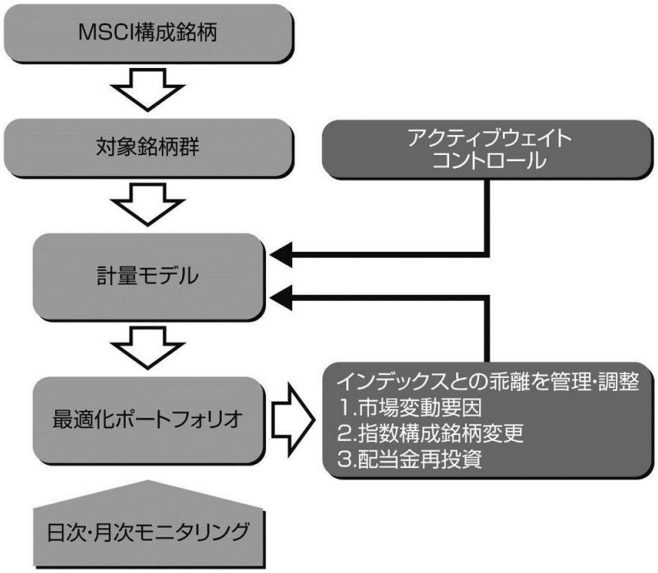
	信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 
主な投資制限	1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）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。
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	1. 主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、株式の組入比率は高位を維持します。 3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ※本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会

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

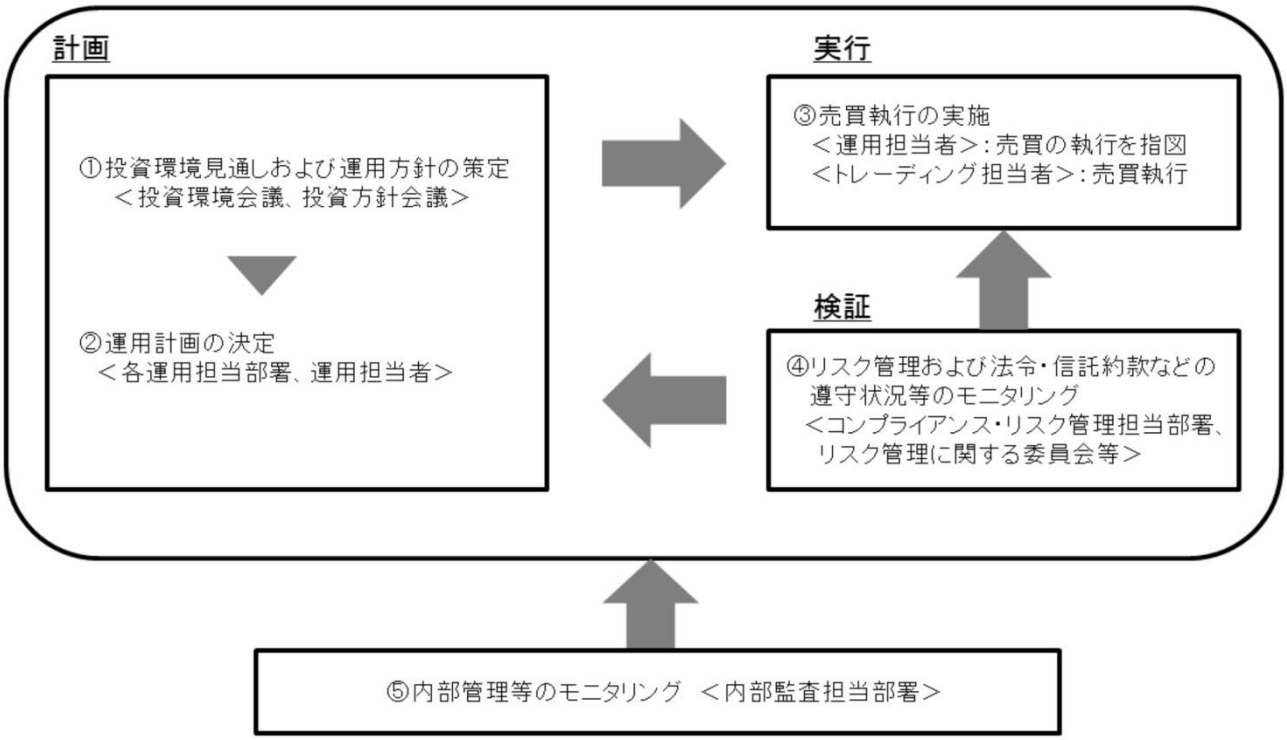
ファンド名	ＤＩＡＭマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにＣＤ、ＣＰ、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

投資態度	①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（＊）の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がＡＡ-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のＣＤ、ＣＰを主要投資対象とします。 （＊）主要格付機関とは、Ｒ＆Ｉ、ＪＣＲ、Ｍｏｏｄｙ’ｓ、Ｓ＆Ｐとします。 ②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。 ③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。
運用プロセス	マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。
主な投資制限	①株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 ②同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥外貨建て資産への投資は行いません。 ⑦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。 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。

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



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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。

③ 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。

④ モニタリング

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

定期的に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。

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2025年1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】

①収益分配方針

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

(1)分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2)分配対象額についての分配方針

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

(3)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

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

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

お、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

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

（５）【投資制限】

①各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2．運用方法　(3) 投資制限）

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

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

④外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2．運用方法　(3) 投資制限）

⑤非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）については制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2．運用方法　(3) 投資制限）

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。（約款「運用の基本方針」2．運用方法　(3) 投資制限）

⑦投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑧信用取引の指図および範囲（約款第21条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（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

⑨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。

⑩スワップ取引の運用指図（約款第23条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

4)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑪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たときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑫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。

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.～2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

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

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

⑭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。

⑮外国為替予約取引の指図（約款第27条）

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

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

3)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑯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。

⑰同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

３【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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

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

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

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

・金利リスク

金利の上昇（債券の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

・為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

・信用リスク

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

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

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

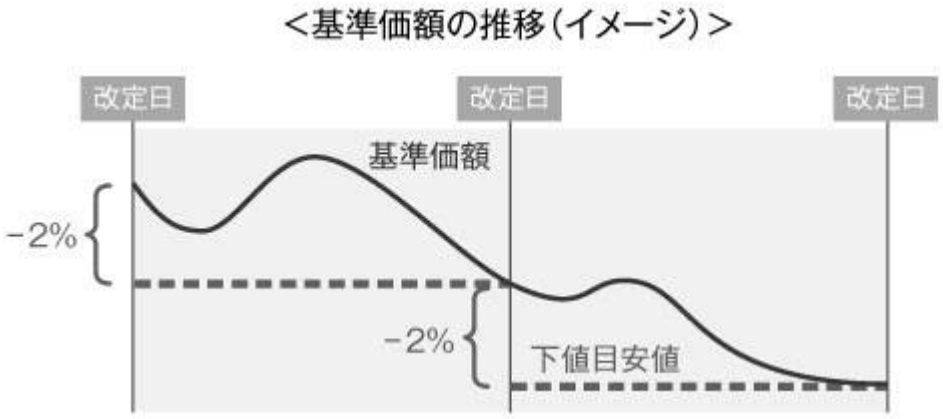
○当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

ださい。

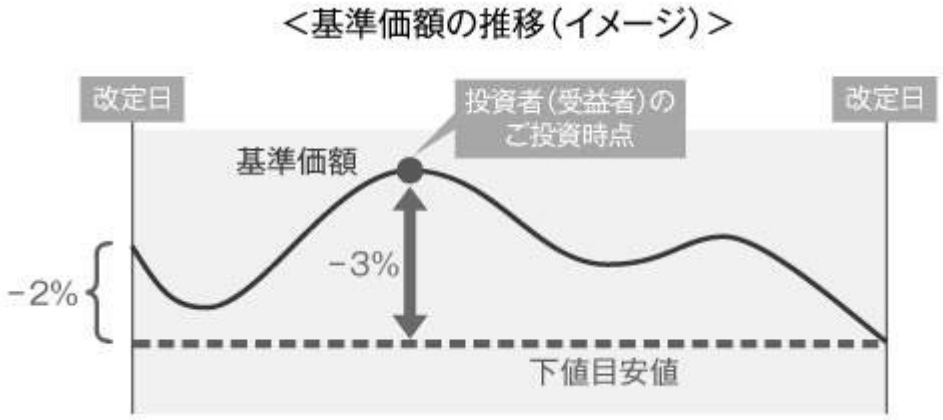
＜ケース①＞下値目安値の切下げについて

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



＜ケース②＞四半期途中の投資について

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



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

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

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

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

○当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のため有利と認められる場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃

された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

〇注意事項

イ．当ファンドは、実質的に債券および株式等など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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。

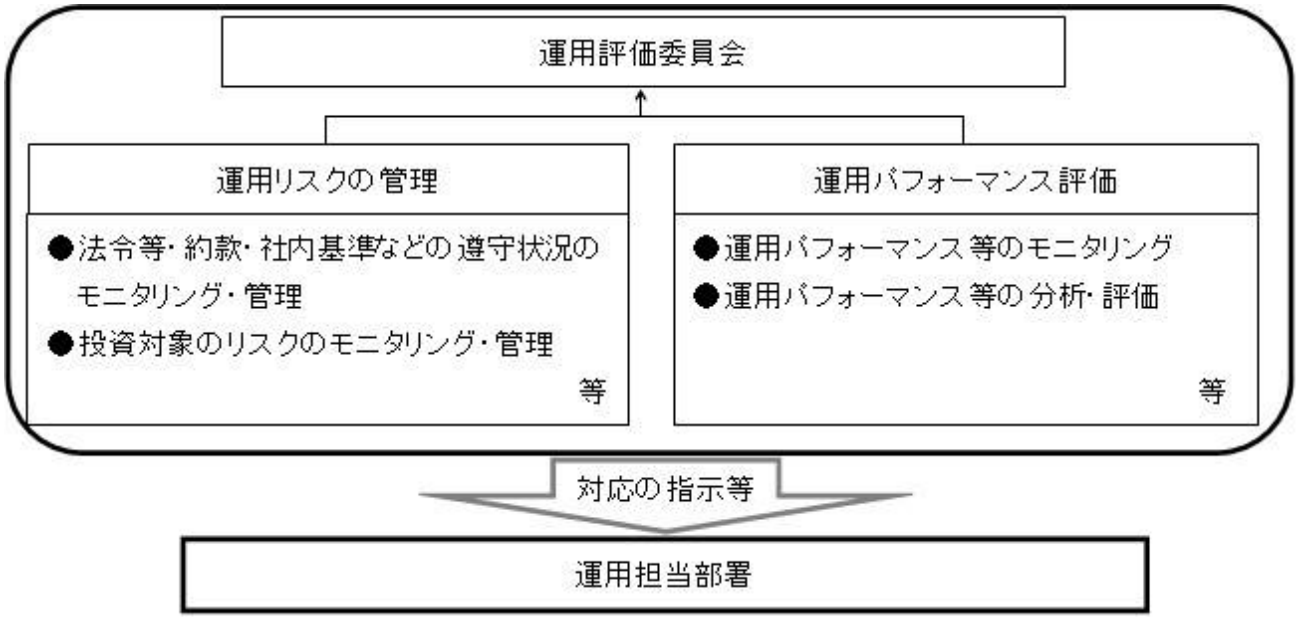
＜リスク管理体制＞

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。

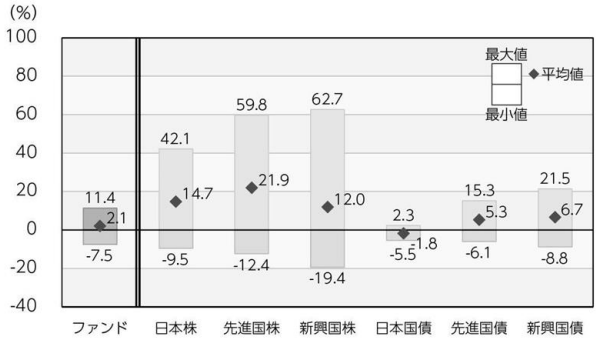
※リスク管理体制は2025年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2020年2月～2025年1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。
先 進 国 株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新 興 国 株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日 本 国 債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先 進 国 債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新 興 国 債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.54%（税抜1.40％）

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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

①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。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

③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。

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①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。

②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。

③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ます。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定

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

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

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、2025年1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＞

①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。

②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ついては販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

③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、①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、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（参考情報）ファンドの総経費率

総経費率（①+②）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.55%	1.54%	0.01%

（表示桁数未満を四捨五入）

※対象期間:2024年7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、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。
※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2025年1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		6,246,891,893	83.14
	内　日本	6,246,891,893	83.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,266,909,834	16.86
純資産総額		7,513,801,727	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		364,420,897,650	83.42
	内　日本	364,420,897,650	83.42
地方債証券		25,690,648,448	5.88
	内　日本	25,690,648,448	5.88
特殊債券		24,409,271,440	5.59
	内　日本	24,409,271,440	5.59
社債券		20,907,453,800	4.79
	内　日本	20,515,001,800	4.70
	内　フランス	392,452,000	0.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,436,659,805	0.33
純資産総額		436,864,931,143	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2025年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		599,745,746,320	97.10
	内　日本	599,745,746,320	97.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		17,932,178,099	2.90
純資産総額		617,677,924,419	100.00

その他資産の投資状況

2025年1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）		17,946,130,000	2.91
	内　日本	17,946,130,000	2.91

（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1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）

国債証券		265,257,989,761	98.37
	内　アメリカ	126,242,165,619	46.81
	内　中国	30,181,957,756	11.19
	内　フランス	19,044,713,777	7.06
	内　イタリア	18,002,145,571	6.68
	内　ドイツ	15,003,523,892	5.56
	内　イギリス	13,499,389,013	5.01
	内　スペイン	11,428,380,966	4.24
	内　カナダ	5,196,586,552	1.93
	内　ベルギー	4,120,090,072	1.53
	内　オランダ	3,462,996,274	1.28
	内　オーストラリア	3,225,348,308	1.20
	内　オーストリア	2,891,260,334	1.07
	内　メキシコ	2,002,692,664	0.74
	内　ポルトガル	1,536,307,308	0.57
	内　ポーランド	1,460,671,467	0.54
	内　マレーシア	1,383,282,167	0.51
	内　フィンランド	1,302,452,884	0.48
	内　アイルランド	1,225,020,787	0.45
	内　シンガポール	1,035,918,670	0.38
	内　イスラエル	902,630,382	0.33
	内　ニュージーランド	691,689,433	0.26
	内　デンマーク	576,541,497	0.21
	内　スウェーデン	442,757,664	0.16
	内　ノルウェー	399,466,704	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,407,666,785	1.63
純資産総額		269,665,656,546	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1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		1,806,253,835,779	96.32
	内　アメリカ	1,355,035,232,736	72.26
	内　イギリス	64,309,168,063	3.43
	内　カナダ	59,218,075,085	3.16
	内　スイス	49,250,943,161	2.63
	内　フランス	46,950,446,940	2.50
	内　ドイツ	43,229,428,413	2.31
	内　アイルランド	33,928,213,441	1.81
	内　オーストラリア	30,317,571,774	1.62
	内　オランダ	29,121,610,760	1.55
	内　スウェーデン	14,541,110,752	0.78
	内　スペイン	12,477,437,478	0.67
	内　デンマーク	12,227,103,641	0.65
	内　イタリア	10,388,949,048	0.55
	内　香港	6,280,104,027	0.33
	内　シンガポール	5,483,520,184	0.29
	内　フィンランド	4,557,248,060	0.24

	内　イスラエル	4,354,568,226	0.23
	内　ジャージィー	3,676,470,021	0.20
	内　ベルギー	3,164,285,012	0.17
	内　ルクセンブルグ	3,123,846,454	0.17
	内　ケイマン諸島	2,923,131,853	0.16
	内　ノルウェー	2,670,882,739	0.14
	内　バミューダ	1,981,586,349	0.11
	内　リベリア	1,774,156,750	0.09
	内　オランダ領キュラソー	1,551,619,639	0.08
	内　ニュージーランド	1,364,152,950	0.07
	内　オーストリア	823,658,896	0.04
	内　パナマ	804,055,929	0.04
	内　ポルトガル	595,090,392	0.03
	内　マン島	130,167,006	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		2,419,060,691	0.13
	内　オーストラリア	1,971,375,036	0.11
	内　シンガポール	447,685,655	0.02
投資証券		30,088,551,764	1.60
	内　アメリカ	28,540,775,508	1.52
	内　フランス	659,050,041	0.04
	内　イギリス	419,654,347	0.02
	内　香港	260,924,821	0.01
	内　カナダ	105,200,860	0.01
	内　ベルギー	102,946,187	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		36,436,853,795	1.94
純資産総額		1,875,198,302,029	100.00

その他資産の投資状況

2025年1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）		37,150,685,194	1.98
	内　アメリカ	29,293,313,220	1.56
	内　ドイツ	4,655,738,294	0.25
	内　イギリス	1,357,456,568	0.07
	内　カナダ	1,195,328,952	0.06
	内　オーストラリア	648,848,160	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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2025年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		114,204,202,317	97.59
	内　サウジアラビア	13,450,129,914	11.49
	内　メキシコ	11,561,583,214	9.88
	内　ポーランド	9,282,038,659	7.93

	内　コロンビア	9,064,103,334	7.75
	内　アラブ首長国連邦	8,233,066,118	7.04
	内　ブラジル	8,214,001,518	7.02
	内　チリ	7,806,688,237	6.67
	内　ハンガリー	7,703,936,365	6.58
	内　ルーマニア	7,391,868,981	6.32
	内　ドミニカ共和国	6,615,676,186	5.65
	内　ペルー	4,667,493,127	3.99
	内　南アフリカ	4,469,627,142	3.82
	内　カタール	3,732,304,081	3.19
	内　インドネシア	3,579,141,710	3.06
	内　パナマ	3,540,365,098	3.03
	内　オマーン	1,575,845,646	1.35
	内　中国	1,116,299,361	0.95
	内　フィリピン	1,113,229,056	0.95
	内　ウルグアイ	1,086,804,570	0.93
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,819,608,425	2.41
純資産総額		117,023,810,742	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1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		100,711,787,964	92.44
	内　台湾	19,994,941,463	18.35
	内　インド	18,499,985,243	16.98
	内　ケイマン諸島	16,863,739,756	15.48
	内　中国	10,681,104,734	9.80
	内　韓国	9,641,790,933	8.85
	内　サウジアラビア	4,262,504,399	3.91
	内　ブラジル	3,783,947,868	3.47
	内　南アフリカ	2,771,642,659	2.54
	内　インドネシア	1,438,569,746	1.32
	内　マレーシア	1,437,896,121	1.32
	内　アラブ首長国連邦	1,437,785,838	1.32
	内　タイ	1,417,340,438	1.30
	内　メキシコ	1,390,076,967	1.28
	内　ポーランド	874,242,283	0.80
	内　カタール	833,927,727	0.77
	内　クエート	788,081,971	0.72
	内　香港	774,444,479	0.71
	内　トルコ	672,286,012	0.62
	内　ギリシャ	506,443,727	0.46
	内　フィリピン	488,994,634	0.45
	内　チリ	448,321,490	0.41
	内　バミューダ	376,588,132	0.35
	内　アメリカ	342,958,705	0.31
	内　ハンガリー	265,001,827	0.24
	内　イギリス	194,171,993	0.18

	内　チェコ	146,688,042	0.13
	内　コロンビア	122,274,375	0.11
	内　ルクセンブルグ	98,770,923	0.09
	内　オランダ	58,157,612	0.05
	内　エジプト	50,105,355	0.05
	内　ペルー	27,802,347	0.03
	内　シンガポール	21,200,165	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		509,566,634	0.47
	内　メキシコ	366,963,452	0.34
	内　ブラジル	142,603,182	0.13
投資証券		85,880,485	0.08
	内　メキシコ	85,880,485	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,642,557,820	7.01
純資産総額		108,949,792,903	100.00

その他資産の投資状況

2025年1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）		7,633,141,331	7.01
	内　アメリカ	7,633,141,331	7.01

（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。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

2025年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		849,081,000	78.94
	内　日本	849,081,000	78.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		226,532,850	21.06
純資産総額		1,075,613,850	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2025年1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	652,501,132	2.4286 1,584,721,917	2.4242 1,581,793,244	－ －	21.05
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	219,955,581	4.8086	4.9801	－	14.58

	日本			1,057,696,694	1,095,400,788	－	
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	882,620,905	1.1968 1,056,340,018	1.1978 1,057,203,320	－ －	14.07
4	ＤＩＡＭマネーマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	891,852,987	1.0057 896,966,070	1.0058 897,025,734	－ －	11.94
5	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	294,456,342	1.8022 530,697,834	1.8474 543,978,646	－ －	7.24
6	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	52,398,822	10.1246 530,520,368	10.3340 541,489,426	－ －	7.21
7	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	215,106,431	2.4552 528,130,437	2.4639 530,000,735	－ －	7.05

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年1月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	83.14
合計	83.14

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年1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	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	6,800,000,000	99.02 6,733,360,000	97.95 6,661,008,000	0.1 2028/3/20	1.52
2	３４９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	6,050,000,000	99.05 5,992,679,000	98.16 5,939,224,500	0.1 2027/12/20	1.36
3	３４８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,570,000,000	99.49 5,541,832,000	98.36 5,478,819,100	0.1 2027/9/20	1.25
4	３４５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,060,000,000	99.61 5,040,302,000	98.90 5,004,643,600	0.1 2026/12/20	1.15
5	１５０回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,570,000,000	99.17 4,532,081,000	98.73 4,511,961,000	0.005 2026/12/20	1.03
6	３４６回　利付国庫債券（１０年）	国債証券	4,540,000,000	99.84	98.73	0.1	1.03

	日本			4,533,008,400	4,482,523,600	2027/3/20	
7	３４７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,500,000,000	99.73 4,488,030,000	98.55 4,434,840,000	0.1 2027/6/20	1.02
8	３５７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,200,000,000	97.92 4,112,651,000	96.21 4,041,114,000	0.1 2029/12/20	0.93
9	３７０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,150,000,000	97.91 4,063,265,000	95.59 3,967,275,500	0.5 2033/3/20	0.91
10	３６３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,170,000,000	96.90 4,040,730,000	94.80 3,953,326,800	0.1 2031/6/20	0.90
11	３６０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,100,000,000	97.82 4,010,661,000	95.58 3,919,067,000	0.1 2030/9/20	0.90
12	３６１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,100,000,000	97.57 4,000,370,000	95.34 3,909,268,000	0.1 2030/12/20	0.89
13	３６６回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,040,000,000	97.01 3,919,204,000	94.61 3,822,526,800	0.2 2032/3/20	0.87
14	３７４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,900,000,000	99.13 3,866,440,000	96.87 3,777,930,000	0.8 2034/3/20	0.86
15	３６７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,970,000,000	96.33 3,824,444,000	94.31 3,744,107,000	0.2 2032/6/20	0.86
16	３６２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,910,000,000	97.30 3,804,430,000	95.08 3,717,667,100	0.1 2031/3/20	0.85
17	３５９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,850,000,000	98.04 3,774,540,000	95.82 3,689,224,000	0.1 2030/6/20	0.84
18	３５５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,730,000,000	98.61 3,678,170,000	96.69 3,606,648,900	0.1 2029/6/20	0.83
19	１６３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,650,000,000	99.88 3,645,810,000	98.53 3,596,600,500	0.4 2028/9/20	0.82
20	３５３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,690,000,000	98.83 3,646,900,800	97.20 3,586,790,700	0.1 2028/12/20	0.82
21	３４４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,570,000,000	99.92 3,567,215,400	99.08 3,537,227,400	0.1 2026/9/20	0.81
22	１４７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,350,000,000	99.58 3,336,141,000	99.35 3,328,292,000	0.005 2026/3/20	0.76
23	３５１回　利付国庫債券（１０年）	国債証券	3,400,000,000	99.18	97.71	0.1	0.76

	日本			3,372,224,000	3,322,310,000	2028/6/20	
24	３５２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,370,000,000	99.00 3,336,300,000	97.46 3,284,503,100	0.1 2028/9/20	0.75
25	３５６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,400,000,000	98.51 3,349,652,000	96.44 3,279,164,000	0.1 2029/9/20	0.75
26	３７６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,300,000,000	98.39 3,247,161,000	97.15 3,206,247,000	0.9 2034/9/20	0.73
27	１４９回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	3,180,000,000	99.25 3,156,150,000	98.92 3,145,942,200	0.005 2026/9/20	0.72
28	３４３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,090,000,000	99.94 3,088,146,000	99.27 3,067,443,000	0.1 2026/6/20	0.70
29	４６４回　利付国庫債券 （２年） 日本	国債証券	3,000,000,000	99.99 2,999,853,000	99.57 2,987,130,000	0.4 2026/9/1	0.68
30	３７５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	2,880,000,000	101.69 2,928,778,000	99.19 2,856,931,200	1.1 2034/6/20	0.65

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	83.42
地方債証券	5.88
特殊債券	5.59
社債券	4.79
合計	99.67

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2025年1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	8,014,800	3,224.34 25,842,460,565	2,973.50 23,832,007,800	－ －	3.86
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,524,400	1,451.55 13,825,209,551	1,978.50 18,844,025,400	－ －	3.05
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,202,500	2,846.18 14,807,298,238	3,440.00 17,896,600,000	－ －	2.90
4	日立製作所	株式	3,921,200	2,597.69	3,946.00	－	2.51

	日本	電気機器		10,186,077,207	15,473,055,200	－	
5	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,209,300	6,430.78 7,776,744,378	10,930.00 13,217,649,000	－ －	2.14
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,097,700	2,676.44 8,290,837,255	3,868.00 11,981,903,600	－ －	1.94
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	150,800	64,410.42 9,713,092,000	67,250.00 10,141,300,000	－ －	1.64
8	任天堂 日本	株式 その他製品	952,000	8,332.52 7,932,563,183	10,230.00 9,738,960,000	－ －	1.58
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,004,200	2,803.09 5,617,958,710	4,307.00 8,632,089,400	－ －	1.40
10	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	319,100	28,615.68 9,131,265,334	26,205.00 8,362,015,500	－ －	1.35
11	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,072,300	6,813.06 7,305,645,609	7,183.00 7,702,330,900	－ －	1.25
12	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,449,700	4,083.68 5,920,121,347	5,160.00 7,480,452,000	－ －	1.21
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	2,948,000	2,813.01 8,292,769,810	2,489.50 7,339,046,000	－ －	1.19
14	三井物産 日本	株式 卸売業	2,343,600	2,973.82 6,969,444,872	3,086.00 7,232,349,600	－ －	1.17
15	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	745,900	6,919.84 5,161,513,049	9,411.00 7,019,664,900	－ －	1.14
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	44,979,400	179.61 8,078,914,401	152.70 6,868,354,380	－ －	1.11
17	信越化学工業 日本	株式 化学	1,343,400	5,832.90 7,835,930,522	4,877.00 6,551,761,800	－ －	1.06
18	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	294,500	18,558.60 5,465,508,041	20,975.00 6,177,137,500	－ －	1.00
19	三菱重工業 日本	株式 機械	2,663,000	1,161.11 3,092,044,449	2,296.00 6,114,248,000	－ －	0.99
20	第一三共 日本	株式 医薬品	1,427,100	4,614.99 6,586,063,918	4,277.00 6,103,706,700	－ －	0.99
21	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,112,100	4,605.04 5,121,271,195	5,186.00 5,767,350,600	－ －	0.93
22	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,345,500	4,217.50 5,674,651,848	4,209.00 5,663,209,500	－ －	0.92
23	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,572,300	1,695.40 6,056,505,943	1,478.50 5,281,645,550	－ －	0.86
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	24,194,300	194.01 4,694,011,497	200.20 4,843,698,860	－ －	0.78

25	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	89,700	40,163.99 3,602,710,324	51,030.00 4,577,391,000	－ －	0.74
26	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	1,762,200	2,045.09 3,603,870,501	2,469.50 4,351,752,900	－ －	0.70
27	富士通 日本	株式 電気機器	1,401,300	2,343.67 3,284,188,228	3,018.00 4,229,123,400	－ －	0.68
28	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	475,200	6,500.86 3,089,208,798	8,659.00 4,114,756,800	－ －	0.67
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,548,900	2,083.11 3,226,531,611	2,571.50 3,982,996,350	－ －	0.64
30	キヤノン 日本	株式 電気機器	752,100	4,180.47 3,144,134,108	5,018.00 3,774,037,800	－ －	0.61

（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1月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.10
合計	97.10

（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。

投資株式の業種別投資比率

2025年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	17.30
銀行業		8.83
輸送用機器		7.36
情報・通信業		7.34
卸売業		6.30
機械		5.45
サービス業		5.03
化学		4.81
小売業		4.44
医薬品		4.13
保険業		3.06
食料品		2.86
その他製品		2.77
精密機器		2.37
陸運業		2.21
建設業		2.06
不動産業		1.80
電気・ガス業		1.16
その他金融業		1.13
証券、商品先物取引業		0.93
非鉄金属		0.81
鉄鋼		0.81
海運業		0.62
ガラス・土石製品		0.62
ゴム製品		0.57

石油・石炭製品		0.51
金属製品		0.48
繊維製品		0.41
空運業		0.34
鉱業		0.23
倉庫・運輸関連業		0.14
パルプ・紙		0.13
水産・農林業		0.08
合計		97.10

（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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年1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 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証券	1,312,655,000	101.77 1,335,975,653	98.96 1,299,015,700	4.375 2034/5/15	0.48
2	US T N/B 3.875 08/15/34 アメリカ	国債証券	1,235,440,000	99.80 1,233,085,793	95.05 1,174,343,635	3.875 2034/8/15	0.44
3	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,173,668,000	98.25 1,153,190,790	97.95 1,149,690,322	4.125 2032/11/15	0.43
4	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証券	1,158,225,000	97.94 1,134,475,803	96.25 1,114,882,043	4 2034/2/15	0.41
5	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,081,010,000	100.86 1,090,338,875	100.06 1,081,664,519	4.5 2033/11/15	0.40
6	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,210,731,200	89.86 1,088,012,728	89.20 1,080,033,710	2.75 2032/8/15	0.40
7	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 中国	国債証券	1,057,995,000	100.02 1,058,258,315	101.36 1,072,469,217	2.18 2026/8/15	0.40
8	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証券	1,047,415,050	100.31 1,050,701,183	101.31 1,061,154,516	2.3 2026/5/15	0.39
9	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,291,034,800	80.82 1,043,475,085	82.17 1,060,968,369	1.25 2031/8/15	0.39
10	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,081,010,000	96.78 1,046,214,604	95.70 1,034,539,239	3.875 2033/8/15	0.38
11	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証券	986,051,340	101.31 999,041,279	102.23 1,008,076,374	2.69 2026/8/12	0.37
12	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,088,731,500	90.28 982,990,571	90.34 983,579,600	2.875 2032/5/15	0.36
13	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,133,516,200	83.71 948,943,022	84.85 961,894,758	1.625 2031/5/15	0.36
14	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	1,034,681,000	93.91 971,684,824	92.41 956,231,160	3.375 2033/5/15	0.35
15	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,093,364,400	83.71 915,285,278	84.66 925,750,783	1.875 2032/2/15	0.34
16	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証券	926,580,000	98.40 911,812,631	99.44 921,440,371	3.75 2026/4/15	0.34

17	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	965,187,500	94.12 908,501,780	93.50 902,544,570	3.5 2033/2/15	0.33
18	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証券	926,580,000	92.22 854,516,684	95.82 887,906,142	0.75 2026/4/30	0.33
19	US T N/B 6.25 05/15/30 アメリカ	国債証券	812,147,370	111.82 908,208,160	108.96 884,955,113	6.25 2030/5/15	0.33
20	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	883,339,600	92.49 817,054,625	96.10 848,903,152	0.75 2026/3/31	0.31
21	US T N/B 0.75 05/31/26 アメリカ	国債証券	869,440,900	91.97 799,630,906	95.55 830,774,548	0.75 2026/5/31	0.31
22	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証券	849,365,000	91.41 776,430,027	91.09 773,735,017	1.125 2028/2/29	0.29
23	US T N/B 1.625 05/15/26 アメリカ	国債証券	798,403,100	93.93 749,968,724	96.78 772,704,499	1.625 2026/5/15	0.29
24	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	823,111,900	92.69 762,958,941	93.82 772,294,384	2.625 2029/2/15	0.29
25	US T N/B 1.875 02/28/27 アメリカ	国債証券	804,580,300	92.98 748,102,532	95.38 767,478,460	1.875 2027/2/28	0.28
26	US T N/B 0.5 02/28/26 アメリカ	国債証券	798,403,100	92.19 736,121,419	96.08 767,140,347	0.5 2026/2/28	0.28
27	US T N/B 2.875 05/15/52 アメリカ	国債証券	1,082,554,300	73.04 790,761,264	70.34 761,572,717	2.875 2052/5/15	0.28
28	US T N/B 4.25 02/28/29 アメリカ	国債証券	761,339,900	98.44 749,510,254	99.79 759,748,820	4.25 2029/2/28	0.28
29	CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26 中国	国債証券	740,596,500	100.68 745,669,873	101.98 755,301,265	2.39 2026/11/15	0.28
30	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	710,972,640	101.61 722,423,446	106.18 754,960,303	2.68 2030/5/21	0.28

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.37
合計	98.37

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー	2,635,025	29,474.16 77,665,153,526	36,691.02 96,681,764,725	－ －	5.16

		タ・周辺機器					
2	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	4,251,484	12,524.86 53,249,280,385	19,249.69 81,839,789,429	－ －	4.36
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,223,807	63,615.07 77,852,577,559	64,086.90 78,430,003,803	－ －	4.18
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小売り	1,637,306	26,939.10 44,107,554,560	36,235.45 59,328,528,211	－ －	3.16
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	378,848	74,555.48 28,245,198,229	106,093.40 40,193,276,191	－ －	2.14
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	1,017,053	23,132.57 23,527,056,385	31,020.35 31,549,344,198	－ －	1.68
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	498,452	30,772.51 15,338,622,554	61,815.24 30,811,930,207	－ －	1.64
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	869,909	23,261.72 20,235,585,950	31,292.15 27,221,323,697	－ －	1.45
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	769,198	20,494.13 15,764,047,090	33,304.37 25,617,657,718	－ －	1.37
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	493,174	28,142.29 13,879,049,227	41,422.75 20,428,627,697	－ －	1.09
11	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	140,058	119,049.32 16,673,810,446	127,131.40 17,805,770,867	－ －	0.95
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	229,406	62,600.98 14,361,041,846	72,945.01 16,734,023,078	－ －	0.89
13	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	289,661	43,364.15 12,560,905,794	52,977.21 15,345,432,060	－ －	0.82
14	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ	160,224	80,659.27 12,923,551,667	84,252.37 13,499,252,548	－ －	0.72

		ア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス					
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	769,857	15,836.67 12,191,977,276	16,920.89 13,026,669,539	－ －	0.69
16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	143,004	72,252.35 10,332,375,384	87,408.92 12,499,825,810	－ －	0.67
17	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	767,194	9,106.66 6,986,579,633	15,234.51 11,687,831,953	－ －	0.62
18	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	76,821	115,049.70 8,838,233,487	151,188.51 11,614,452,857	－ －	0.62
19	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	74,451	92,397.41 6,879,079,582	150,297.45 11,189,795,688	－ －	0.60
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	172,452	55,679.50 9,602,042,023	64,011.23 11,038,865,498	－ －	0.59
21	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	407,122	24,276.57 9,883,526,067	25,853.12 10,525,376,485	－ －	0.56
22	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	417,379	23,993.81 10,014,513,676	23,607.71 9,853,364,103	－ －	0.53
23	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	166,029	44,449.06 7,379,834,333	53,057.51 8,809,086,174	－ －	0.47
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,211,331	5,299.46 6,419,405,538	7,214.96 8,739,716,340	－ －	0.47
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	306,376	27,091.55 8,300,202,956	27,125.62 8,310,641,863	－ －	0.44
26	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	69,429	135,395.88 9,400,400,593	113,326.41 7,868,139,458	－ －	0.42
27	SAP SE ドイツ	株式 ソフトウェア	181,335	27,341.01 4,957,883,130	42,984.49 7,794,593,944	－ －	0.42
28	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	288,473	18,487.11 5,333,033,526	26,311.78 7,590,239,092	－ －	0.40
29	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗	301,172	23,360.94 7,035,661,138	24,140.49 7,270,441,943	－ －	0.39

		燃料					
30	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	559,879	18,183.11 10,180,346,574	12,973.51 7,263,597,484	－ －	0.39

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年1月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.32
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.13
投資証券	1.60
合計	98.06

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2025年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	8.50
半導体・半導体製造装置		8.45
銀行		5.85
コンピュータ・周辺機器		5.46
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.39
医薬品		4.17
石油・ガス・消耗燃料		3.66
資本市場		3.60
大規模小売り		3.57
金融サービス		3.29
保険		2.95
ヘルスケア機器・用品		2.17
自動車		2.08
航空宇宙・防衛		2.06
ホテル・レストラン・レジャー		1.93
生活必需品流通・小売り		1.83
機械		1.77
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.66
専門小売り		1.63
電力		1.52
化学		1.51
バイオテクノロジー		1.51
情報技術サービス		1.43
娯楽		1.37
飲料		1.14
電気設備		1.10
金属・鉱業		1.09
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.99
繊維・アパレル・贅沢品		0.97
食品		0.96
専門サービス		0.94
家庭用品		0.91

各種電気通信サービス		0.89
陸上運輸		0.89
通信機器		0.74
総合公益事業		0.65
コングロマリット		0.64
建設関連製品		0.60
商業サービス・用品		0.60
タバコ		0.56
消費者金融		0.50
電子装置・機器・部品		0.49
パーソナルケア用品		0.49
メディア		0.46
商社・流通業		0.44
航空貨物・物流サービス		0.36
建設資材		0.32
建設・土木		0.31
不動産管理・開発		0.27
家庭用耐久財		0.26
無線通信サービス		0.23
容器・包装		0.19
エネルギー設備・サービス		0.19
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
自動車用部品		0.08
ガス		0.07
水道		0.07
ヘルスケア・テクノロジー		0.07
紙製品・林産品		0.07
販売		0.06
旅客航空輸送		0.05
海上運輸		0.04
各種消費者サービス		0.02
合計		96.32

（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1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 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証券	2,934,170,000	95.60 2,805,136,013	90.81 2,664,651,814	7.3 2052/4/20	2.28
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証券	2,470,880,000	104.19 2,574,570,479	101.56 2,509,641,312	5.5 2032/10/25	2.14
3	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,625,310,000	85.93 2,256,125,120	86.22 2,263,780,765	2.783 2031/1/23	1.93
4	COLOMBIA 3.125 04/15/31 コロンビア	国債証券	2,779,740,000	80.34 2,233,516,071	80.33 2,233,152,663	3.125 2031/4/15	1.91
5	HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証	2,162,020,000	104.89	101.86	6.25	1.88

	ハンガリー	券		2,267,941,992	2,202,233,572	2032/9/22	
6	REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29 ポーランド	国債証券	2,007,590,000	99.76 2,002,887,606	99.32 1,994,038,767	4.625 2029/3/18	1.70
7	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証券	2,007,590,000	98.48 1,977,195,087	99.12 1,990,008,530	5.25 2029/6/16	1.70
8	ROMANIA 5.875 01/30/29 ルーマニア	国債証券	2,007,590,000	101.21 2,031,946,699	98.20 1,971,543,721	5.875 2029/1/30	1.68
9	ROMANIA 6.625 02/17/28 ルーマニア	国債証券	1,698,730,000	103.28 1,754,517,991	101.71 1,727,856,628	6.625 2028/2/17	1.48
10	REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54 ポーランド	国債証券	1,853,160,000	96.35 1,785,643,204	93.15 1,726,354,747	5.5 2054/3/18	1.48
11	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 サウジアラビア	国債証券	1,884,046,000	90.91 1,712,845,210	91.08 1,716,031,487	3.25 2030/10/22	1.47
12	REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32 ポーランド	国債証券	1,621,515,000	104.60 1,696,110,867	102.84 1,667,604,942	5.75 2032/11/16	1.43
13	DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32 ドミニカ共和国	国債証券	1,698,730,000	91.91 1,561,447,135	90.40 1,535,651,920	4.875 2032/9/23	1.31
14	REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27 チリ	国債証券	1,575,186,000	93.77 1,477,057,939	96.15 1,514,691,673	2.75 2027/1/31	1.29
15	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	1,544,300,000	97.23 1,501,650,140	97.90 1,511,923,750	4.375 2029/4/16	1.29
16	UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/07/36 メキシコ	国債証券	1,544,300,000	98.86 1,526,732,651	94.92 1,465,929,477	6 2036/5/7	1.25
17	HUNGARY 6.125 05/22/28 ハンガリー	国債証券	1,389,870,000	102.54 1,425,253,310	102.15 1,419,839,071	6.125 2028/5/22	1.21
18	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 メキシコ	国債証券	1,698,730,000	82.82 1,407,051,628	82.67 1,404,383,374	2.659 2031/5/24	1.20
19	BRAZIL 6.25 03/18/31 ブラジル	国債証券	1,389,870,000	102.01 1,417,888,234	99.79 1,387,026,325	6.25 2031/3/18	1.19
20	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	1,420,756,000	97.77 1,389,078,855	97.38 1,383,603,230	6 2033/2/22	1.18
21	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	1,389,870,000	97.05 1,348,908,021	98.17 1,364,504,872	5.5 2029/2/22	1.17
22	SOUTH AFRICA 7.1 11/19/36 南アフリカ	国債証券	1,389,870,000	98.60 1,370,411,820	97.80 1,359,418,476	7.1 2036/11/19	1.16
23	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33 サウジアラビア	国債証券	1,389,870,000	99.39 1,381,518,425	97.09 1,349,461,614	4.875 2033/7/18	1.15
24	BRAZIL 4.5 05/30/29 ブラジル	国債証券	1,389,870,000	95.19 1,323,102,035	94.86 1,318,518,007	4.5 2029/5/30	1.13

25	COLOMBIA 3.0 01/30/30 コロンビア	国債証券	1,544,300,000	82.46 1,273,565,329	84.18 1,300,112,674	3 2030/1/30	1.11
26	REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53 ポーランド	国債証券	1,389,870,000	97.34 1,352,967,407	93.18 1,295,172,944	5.5 2053/4/4	1.11
27	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,235,440,000	107.06 1,322,662,064	101.61 1,255,370,118	7.125 2033/1/17	1.07
28	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,389,870,000	88.63 1,231,911,638	89.87 1,249,144,606	3.875 2030/6/12	1.07
29	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,544,300,000	81.90 1,264,814,130	80.34 1,240,690,620	2.125 2031/9/22	1.06
30	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33 サウジアラビア	国債証券	1,544,300,000	79.31 1,224,785,874	80.32 1,240,449,709	2.25 2033/2/2	1.06

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.59
合計	97.59

（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1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	2,072,722	3,843.45 7,966,405,558	5,359.69 11,109,161,885	－ －	10.20
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	546,200	6,059.06 3,309,463,037	7,951.78 4,343,264,420	－ －	3.99
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小売り	1,368,968	1,378.65 1,887,328,311	1,750.10 2,395,839,110	－ －	2.20
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	402,199	8,278.36 3,329,549,316	5,713.67 2,298,036,382	－ －	2.11

5	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	475,198	2,908.88 1,382,294,655	3,027.78 1,438,797,376	－ －	1.32
6	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・レストラン・レジャー	416,910	1,983.54 826,961,128	2,937.32 1,224,599,748	－ －	1.12
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	512,343	2,609.31 1,336,865,520	2,242.95 1,149,164,599	－ －	1.05
8	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	45,984	19,018.17 874,531,826	23,514.39 1,081,286,169	－ －	0.99
9	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小売り	58,428	17,217.33 1,005,974,325	17,821.22 1,041,258,359	－ －	0.96
10	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,060,530	96.18 775,333,824	125.46 1,011,278,930	－ －	0.93
11	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	438,105	1,931.90 846,378,883	2,247.52 984,651,502	－ －	0.90
12	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	1,289,200	333.62 430,113,498	759.10 978,639,455	－ －	0.90
13	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	279,509	2,568.77 717,996,656	3,329.31 930,572,248	－ －	0.85
14	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,050,546	703.97 739,561,957	849.99 892,959,897	－ －	0.82
15	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	128,686	5,038.72 648,413,833	6,918.02 890,252,707	－ －	0.82
16	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	164,647	3,332.29 548,652,834	4,082.75 672,214,185	－ －	0.62
17	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小売り	207,985	2,009.77 418,002,947	3,109.75 646,783,017	－ －	0.59
18	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 無線通信サービス	215,877	2,285.98 493,491,826	2,936.94 634,018,336	－ －	0.58
19	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,830,235	80.98 472,149,953	104.84 611,287,313	－ －	0.56
20	TRIP.COM GROUP LTD	株式	52,100	7,970.85	10,861.36	－	0.52

	ケイマン諸島	ホテル・レストラン・レジャー		415,281,797	565,876,856	－	
21	SAUDI ARABIAN OIL CO サウジアラビア	株式 石油・ガス・消耗燃料	487,951	1,192.90 582,079,656	1,146.47 559,422,158	－ －	0.51
22	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	76,076	6,962.99 529,716,503	7,339.08 558,328,572	－ －	0.51
23	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	163,200	2,797.78 456,599,200	3,191.02 520,774,464	－ －	0.48
24	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS ケイマン諸島	株式 銀行	248,744	2,298.03 571,622,848	2,075.53 516,277,922	－ －	0.47
25	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	566,500	616.58 349,297,370	864.15 489,542,108	－ －	0.45
26	BYD CO LTD 中国	株式 自動車	88,500	4,109.62 363,701,391	5,410.86 478,861,110	－ －	0.44
27	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	5,913,200	65.37 386,575,757	79.67 471,142,488	－ －	0.43
28	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小売り	14,274	26,877.11 383,643,932	32,431.93 462,933,448	－ －	0.42
29	MAHINDRA & MAHINDRA LTD インド	株式 自動車	78,680	3,730.22 293,493,818	5,318.89 418,490,697	－ －	0.38
30	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	288,489	1,627.94 469,643,731	1,445.43 416,991,950	－ －	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1月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	92.44
投資信託受益証券	0.47
投資証券	0.08
合計	92.99

（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1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
銀行	外国	16.71
半導体・半導体製造装置		13.37
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.00
コンピュータ・周辺機器		4.65
大規模小売り		4.46

石油・ガス・消耗燃料	4.13
金属・鉱業	3.06
自動車	2.79
保険	2.75
ホテル・レストラン・レジャー	2.52
電子装置・機器・部品	2.33
情報技術サービス	2.20
無線通信サービス	1.56
化学	1.51
不動産管理・開発	1.38
電気設備	1.33
食品	1.26
医薬品	1.15
生活必需品流通・小売り	1.09
各種電気通信サービス	1.09
金融サービス	1.00
電力	0.99
コングロマリット	0.99
娯楽	0.95
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.93
飲料	0.88
資本市場	0.86
バイオテクノロジー	0.75
機械	0.72
繊維・アパレル・贅沢品	0.69
消費者金融	0.67
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.67
建設・土木	0.62
専門小売り	0.60
運送インフラ	0.60
建設資材	0.59
自動車用部品	0.56
パーソナルケア用品	0.55
航空宇宙・防衛	0.55
家庭用耐久財	0.42
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.42
旅客航空輸送	0.36
タバコ	0.32
海上運輸	0.30
ガス	0.29
通信機器	0.27
航空貨物・物流サービス	0.23
ソフトウェア	0.22
陸上運輸	0.17
各種消費者サービス	0.15
ヘルスケア機器・用品	0.14
水道	0.13
紙製品・林産品	0.12
エネルギー設備・サービス	0.10
商社・流通業	0.09

総合公益事業		0.07
メディア		0.06
商業サービス・用品		0.04
家庭用品		0.03
建設関連製品		0.03
販売		0.01
合計		92.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

2025年1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	１２８０回　国庫短期証券 日本	国債証券	300,000,000	99.93 299,815,500	99.93 299,808,000	－ 2025/4/14	27.87
2	１２７９回　国庫短期証券 日本	国債証券	300,000,000	99.83 299,490,000	99.85 299,559,000	－ 2025/7/10	27.85
3	１２６１回　国庫短期証券 日本	国債証券	100,000,000	99.95 99,950,000	99.94 99,940,000	－ 2025/4/10	9.29
4	１２４４回　国庫短期証券 日本	国債証券	100,000,000	99.82 99,820,000	99.83 99,838,000	－ 2025/7/22	9.28
5	１２３８回　国庫短期証券 日本	国債証券	50,000,000	99.85 49,925,000	99.87 49,936,000	－ 2025/6/20	4.64

（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1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	78.94
合計	78.94

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2025年1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　０７０３月	買建	643	17,635,007,190	17,946,130,000	2.91

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年1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 Mar25	買建	622	29,002,119,240	29,293,313,220	1.56
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar25	買建	548	4,427,141,105	4,655,738,294	0.25
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar25	買建	82	1,307,273,085	1,357,456,568	0.07
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar25	買建	36	1,154,557,764	1,195,328,952	0.06
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Mar25	買建	32	636,039,928	648,848,160	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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2025年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	MINI MSCI EMG MKT Mar25	買建	896	7,574,357,551	7,633,141,331	7.01

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2025年1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7計算期間末（2015年7月13日）	16,373	16,373	1.2816	1.2816
第8計算期間末（2016年1月12日）	29,373	29,373	1.2200	1.2200
第9計算期間末（2016年7月11日）	30,524	30,524	1.1796	1.1796
第10計算期間末（2017年1月11日）	33,083	33,083	1.2331	1.2331
第11計算期間末（2017年7月11日）	32,461	32,461	1.2524	1.2524
第12計算期間末（2018年1月11日）	28,678	28,678	1.2864	1.2864
第13計算期間末（2018年7月11日）	27,026	27,026	1.2537	1.2537
第14計算期間末（2019年1月11日）	24,449	24,449	1.2062	1.2062
第15計算期間末（2019年7月11日）	22,938	22,938	1.2287	1.2287
第16計算期間末（2020年1月14日）	20,607	20,607	1.2590	1.2590
第17計算期間末（2020年7月13日）	18,748	18,748	1.2562	1.2562
第18計算期間末（2021年1月12日）	16,160	16,160	1.2941	1.2941
第19計算期間末（2021年7月12日）	13,725	13,725	1.3111	1.3111
第20計算期間末（2022年1月11日）	12,268	12,268	1.2898	1.2898
第21計算期間末	11,212	11,212	1.2429	1.2429

(2022年7月11日)				
第22計算期間末 (2023年1月11日)	10,436	10,436	1.1999	1.1999
第23計算期間末 (2023年7月11日)	10,240	10,240	1.2573	1.2573
第24計算期間末 (2024年1月11日)	9,300	9,300	1.2833	1.2833
第25計算期間末 (2024年7月11日)	8,575	8,575	1.3992	1.3992
第26計算期間末 (2025年1月14日)	7,505	7,505	1.3577	1.3577
2024年1月末日	9,111	－	1.2899	－
2月末日	8,886	－	1.3182	－
3月末日	8,808	－	1.3442	－
4月末日	8,600	－	1.3433	－
5月末日	8,448	－	1.3451	－
6月末日	8,530	－	1.3770	－
7月末日	8,269	－	1.3721	－
8月末日	8,171	－	1.3680	－
9月末日	7,987	－	1.3672	－
10月末日	7,913	－	1.3740	－
11月末日	7,721	－	1.3624	－
12月末日	7,656	－	1.3817	－
2025年1月末日	7,513	－	1.3680	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000
第25計算期間	0.0000
第26計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第7計算期間	1.2
第8計算期間	△4.8
第9計算期間	△3.3
第10計算期間	4.5
第11計算期間	1.6
第12計算期間	2.7
第13計算期間	△2.5
第14計算期間	△3.8
第15計算期間	1.9
第16計算期間	2.5
第17計算期間	△0.2
第18計算期間	3.0
第19計算期間	1.3
第20計算期間	△1.6
第21計算期間	△3.6
第22計算期間	△3.5
第23計算期間	4.8
第24計算期間	2.1
第25計算期間	9.0
第26計算期間	△3.0

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

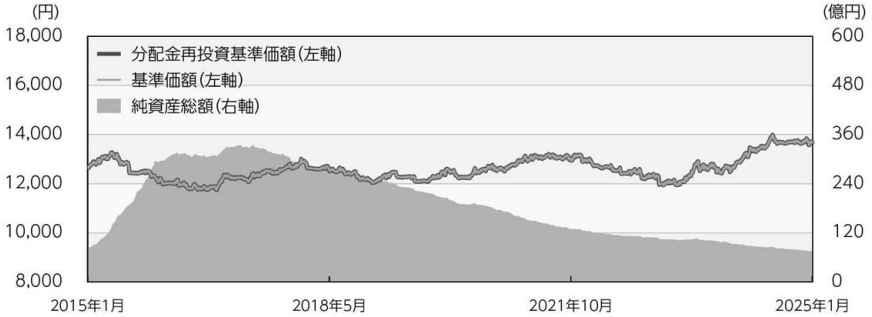
	設定口数	解約口数
第7計算期間	8,113,284,548	1,391,102,184
第8計算期間	12,475,200,872	1,174,643,755
第9計算期間	4,218,169,651	2,417,079,166
第10計算期間	3,726,999,882	2,774,409,766
第11計算期間	2,943,838,417	3,853,950,424
第12計算期間	2,426,808,751	6,053,103,346
第13計算期間	2,339,206,033	3,075,836,809
第14計算期間	967,336,189	2,254,647,937
第15計算期間	639,297,067	2,240,826,501
第16計算期間	513,000,084	2,813,656,675
第17計算期間	306,020,884	1,748,348,178
第18計算期間	306,787,422	2,744,453,780
第19計算期間	269,416,421	2,288,470,279
第20計算期間	328,483,921	1,285,084,124
第21計算期間	196,469,949	687,342,399
第22計算期間	156,928,133	479,916,329
第23計算期間	153,313,399	706,379,922
第24計算期間	108,201,861	1,005,962,085
第25計算期間	69,441,005	1,187,847,806
第26計算期間	62,680,822	663,523,256

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2025年1月31日

基準価額・純資産の推移 《2015年1月30日～2025年1月31日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2012年10月26日)

分配の推移(税引前)

2023年 1月	0円
2023年 7月	0円
2024年 1月	0円
2024年 7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	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.05
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	14.58
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.07
4	DIAMマネーマザーファンド	11.94
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	7.24
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.21
7	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.05

■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	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.52
2	349回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/12/20	1.36
3	348回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/9/20	1.25
4	345回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	1.15
5	150回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2026/12/20	1.03

■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	3.86
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	3.05
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.90
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.51
5	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	2.14

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 4.375 05/15/34	国債証券	アメリカ	4.375	2034/5/15	0.48
2	US T N/B 3.875 08/15/34	国債証券	アメリカ	3.875	2034/8/15	0.44
3	US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	アメリカ	4.125	2032/11/15	0.43
4	US T N/B 4.0 02/15/34	国債証券	アメリカ	4	2034/2/15	0.41
5	US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	アメリカ	4.5	2033/11/15	0.40

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.16
2	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	4.36
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.18
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	3.16
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	2.14

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	国債証券	南アフリカ	7.3	2052/4/20	2.28
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	国債証券	サウジアラビア	5.5	2032/10/25	2.14
3	PERU 2.783 01/23/31	国債証券	ペルー	2.783	2031/1/23	1.93
4	COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	コロンビア	3.125	2031/4/15	1.91
5	HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証券	ハンガリー	6.25	2032/9/22	1.88

■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	10.20
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.99
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.20
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	2.11
5	HDFC BANK LTD	株式	インド	銀行	1.32

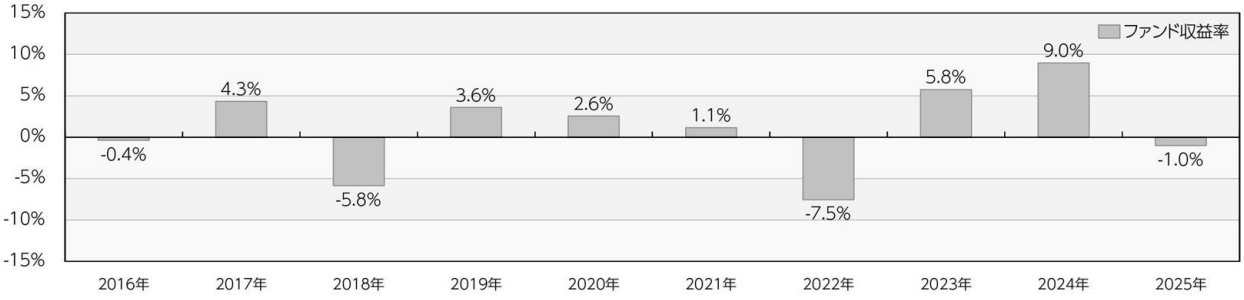
■DIAMマネーマザーファンド

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

組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	1280回　国庫短期証券	国債証券	日本	－	2025/4/14	27.87
2	1279回　国庫短期証券	国債証券	日本	－	2025/7/10	27.85
3	1261回　国庫短期証券	国債証券	日本	－	2025/4/10	9.29
4	1244回　国庫短期証券	国債証券	日本	－	2025/7/22	9.28
5	1238回　国庫短期証券	国債証券	日本	－	2025/6/20	4.64

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。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時30分までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

２【換金（解約）手続等】

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

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

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社への問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、2012年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

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

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

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

（５）【その他】

イ.償還規定

a.委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b.委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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.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。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申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発します。

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にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

h.委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。

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

ハ．関係法人との契約の更改

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

ニ．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。
（URL　https://www.am-one.co.jp/）
なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載して行います。

ホ．運用報告書

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

４【受益者の権利等】

①収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。
受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。
収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。
なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

②償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。
受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、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。

③一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、解約の請求をすることができます。

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期計算期間（2024年7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。

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
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、「ファンドの経理状況」に掲げられているクルーズコントロールの２０２４年7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、クルーズコントロールの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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

１【財務諸表】

【クルーズコントロール】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第25期 2024年7月11日現在	第26期 2025年1月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	895,073,329	1,787,030,011
親投資信託受益証券	7,780,432,640	5,789,033,582
流動資産合計	8,675,505,969	7,576,063,593
資産合計	8,675,505,969	7,576,063,593
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,559,676	7,489,947
未払受託者報酬	2,393,722	2,246,654
未払委託者報酬	64,631,663	60,661,161
その他未払費用	170,341	159,876
流動負債合計	99,755,402	70,557,638
負債合計	99,755,402	70,557,638
純資産の部		
元本等		
元本	6,128,922,680	5,528,080,246
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,446,827,887	1,977,425,709
（分配準備積立金）	922,246,649	822,923,349
元本等合計	8,575,750,567	7,505,505,955
純資産合計	8,575,750,567	7,505,505,955
負債純資産合計	8,675,505,969	7,576,063,593

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第25期 自　2024年1月12日 至　2024年7月11日	第26期 自　2024年7月12日 至　2025年1月14日
営業収益		
受取利息	276,244	1,999,826
有価証券売買等損益	822,570,674	△185,399,058
営業収益合計	822,846,918	△183,399,232
営業費用		
支払利息	30,433	－
受託者報酬	2,393,722	2,246,654
委託者報酬	64,631,663	60,661,161
その他費用	170,341	165,816
営業費用合計	67,226,159	63,073,631
営業利益又は営業損失（△）	755,620,759	△246,472,863
経常利益又は経常損失（△）	755,620,759	△246,472,863
当期純利益又は当期純損失（△）	755,620,759	△246,472,863
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（△）	48,486,731	△18,568,049
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,053,284,622	2,446,827,887
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,097,076	23,304,444
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	23,097,076	23,304,444
剰余金減少額又は欠損金増加額	336,687,839	264,801,808
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	336,687,839	264,801,808
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,446,827,887	1,977,425,709

（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26期 自　2024年7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日及び7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25期 2024年7月11日現在	第26期 2025年1月14日現在
１．　期首元本額	7,247,329,481円	6,128,922,680円
期中追加設定元本額	69,441,005円	62,680,822円
期中一部解約元本額	1,187,847,806円	663,523,256円
２．　受益権の総数	6,128,922,680口	5,528,080,246口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第25期 自　2024年1月12日 至　2024年7月11日	第26期 自　2024年7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（70,562,545円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（404,516,588円）、信託約款に規定される収益調整金（1,572,040,947円）及び分配準備積立金（447,167,516円）より分配対象収益は2,494,287,596円（1万口当たり4,069.69円）でありますが、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（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,426,857,815円）及び分配準備積立金（822,923,349円）より分配対象収益は2,249,781,164円（1万口当たり4,069.73円）でありますが、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25期 自　2024年1月12日 至　2024年7月11日	第26期 自　2024年7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	同左

	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。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第25期 2024年7月11日現在	第26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25期 2024年7月11日現在	第26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	534,247,660	△70,980,652
合計	534,247,660	△70,980,652

（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25期 2024年7月11日現在	第26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）	1.3992円 （13,992円）	1.3577円 （13,577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	218,517,056	1,046,696,698	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	870,831,258	1,041,340,018	
	ＤＩＡＭマネーマザーファンド	394,637,405	396,926,301	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	54,566,254	549,520,374	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	710,873,761	1,724,721,918	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	279,422,867	500,697,835	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	215,733,860	529,130,438	
親投資信託受益証券　合計		2,744,582,461	5,789,033,582	
合計			5,789,033,582	

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

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

（参考）
当ファンドは、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	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
特殊債券	24,399,593,093
社債券	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7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	453,279,566,821円
同期中追加設定元本額	279,888,471,646円
同期中一部解約元本額	317,634,407,589円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	31,548,161,277円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	44,590,897円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	88,729,570円
ＭＩＴＯ　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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	12,659,863,913円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	19,024,084,401円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	9,077,882,549円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,666,877,408円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	3,045,688,330円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	5,927,079,880円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	2,745,857,566円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　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
ＤＩＡＭ　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
Ｏｎｅ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Ⅱ　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
ＤＩＡＭ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
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）	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
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）	201,232,629円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	262,099,951円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（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Ⅲ（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Ⅳ（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7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。

（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	1,000,000,000	978,280,000	

年)			
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（１	3,350,000,000	3,220,656,500	

０年）			
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	1,030,000,000	1,010,914,100	

年)			
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	110,000,000	113,061,300	

年)			
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（２	2,240,000,000	2,349,267,200	

０年）			
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	
国債証券　合計		451,705,000,000	423,105,966,600	
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　２	300,000,000	308,001,000	

	０年			
	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　２０年	100,000,000	105,076,000	
	１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	318,990,000	
	１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	105,014,000	
	４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	98,728,000	
	４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	98,712,000	
	４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	189,104,000	
	４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	189,604,000	
	４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	188,742,000	
	４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	187,734,000	
	４７４回　大阪府公募公債　１０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	300,000,000	295,665,000	

５年			
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	
４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	288,501,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	197,062,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	282,423,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	396,964,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,811,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	89,468,000	
９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	492,975,000	
９８回　政保地方公共団体金	100,000,000	98,576,000	

	融機構債券			
	１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,254,000	
	１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,741,000	
	７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	238,053,000	
	１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	195,960,000	
	１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	209,500,000	
	４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,341,830	
	９３回　都市再生債券	100,000,000	100,519,000	
	１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	198,642,000	
	１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	136,146,000	
	１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	102,226,000	
	３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	210,486,000	
	７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	370,842,500	
	８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,347,000	
	１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,489,000	
	１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,667,000	
	１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	245,122,500	
	１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,900,000	
	１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,242,000	
	２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	294,660,000	
	２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	294,477,000	
	２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	86,688,000	
	３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	493,625,000	
	３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	493,625,000	
	２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,176,000	13,437,148	
	２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,525,000	85,685,791	
	３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,712,000	127,468,135	
	３８回貸付債権担保住宅金融	17,866,000	18,187,230	

支援機構債券			
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,270,000	15,581,355	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,838,000	18,101,824	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,927,000	19,192,545	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,976,000	23,155,902	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,040,000	56,894,548	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,629,000	25,638,739	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,285,000	30,844,194	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,591,000	31,134,194	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,045,000	34,385,803	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,686,000	35,733,631	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,977,000	39,958,326	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,081,000	45,098,419	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,245,000	47,385,016	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,143,000	172,197,760	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,815,000	58,939,534	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,349,000	58,617,463	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,870,000	59,015,241	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,801,000	182,121,596	
１２８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（２０１７）	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（２０１６）	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	200,000,000	175,754,000	

ディングス社債			
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	
３２０回　四国電力社債	300,000,000	281,628,000	
４６３回　九州電力社債	100,000,000	85,269,000	

	４６６回　九州電力社債	100,000,000	84,158,000	
	４９１回　九州電力社債	300,000,000	281,880,000	
	４９２回　九州電力社債	100,000,000	77,853,000	
	４９３回　九州電力社債	200,000,000	197,984,000	
	５０７回　九州電力社債	200,000,000	188,584,000	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	296,598,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	169,714,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	98,312,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	186,672,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	175,396,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	81,960,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	78,737,000	
	５７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。

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7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	122,888,680,254円
同期中追加設定元本額	22,372,355,733円
同期中一部解約元本額	21,569,710,545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Ⅱ　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7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）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 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
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）	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	
ニッスイ	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	
ＩＮＰＥＸ	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	
錢高組	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	
ナカノフドー建設	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	

淺沼組	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	

大氣社	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	
ニップン	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	
ＤＭ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	
ＬＩＦＵＬＬ	38,500	184.00	7,084,000	
ＭＩＸＩ	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	
ＵＴ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	
ＣＤＳ	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	
エプコ	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	
綜合警備保障	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	
ブラス	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	
Ａｏｂａ‐ＢＢＴ	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・ヴイ・エス・ベイエリア	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	
キャンドゥ	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	
ＪＰ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	
キユーピー	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	
ＳＲＥホールディングス	5,500	3,040.00	16,720,000	
ＡＤ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	
ＢＥＥＮＯＳ	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	
ソフトクリエイトホールディングス	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	
クリエイト・レストランツ・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	
ビーロット	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	
日本フエルト	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	
ＪＭ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	
クラウディアホールディングス	400	326.00	130,400	
ＴＳＩ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	
ＴＩＳ	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	
ＧＭＯペパボ	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	
ＡＧＳ	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	
ＫＬａｂ	37,800	137.00	5,178,600	
ポー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	
ｅｎｉｓｈ	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	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	
オプティム	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	
マークラインズ	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・パック	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	
高圧ガス工業	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	
ビジョナル	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	
トビラシステムズ	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	
ギフティ	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	
ＤＩＣ	53,500	3,512.00	187,892,000	
サカタインクス	33,500	1,661.00	55,643,500	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	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	
ＴＤＣソフト	25,500	1,471.00	37,510,500	
ＬＩＮＥ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	
ＩＤ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	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	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	
エックスネット	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	
ＳＢＩ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	
ＡＣＣＥＳＳ	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	
ＣＩＪ	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－ｎｅ	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	
ＪＣＵ	16,700	3,540.00	59,118,000	
新田ゼラチン	1,100	723.00	795,300	
ＯＡＴ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	
ビーピー・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	
フジミ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	
中部鋼鈑	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	
日本鋳鉄管	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	
日本軽金属ホールディングス	45,500	1,503.00	68,386,500	
三井金属鉱業	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	
住友金属鉱山	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	

ＵＡＣＪ	22,000	4,965.00	109,230,000	
ＣＫ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	
ＳＷＣＣ	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	
ＡＲＥ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	
ホッカンホールディングス	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	
文化シヤッター	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	
東洋シヤッター	400	803.00	321,200	
ＬＩＸＩＬ	226,800	1,701.00	385,786,800	
日本フイルコン	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	
ＩＢＪ	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	
ＥＲＩ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	
ＦＵＪＩ	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	
ＤＭＧ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	
冨士ダイス	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	
ＳＭＮ	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	
フリュー	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	
ＳＭＣ	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	
日本エアーテック	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	
酉島製作所	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	60,300	2,825.00	170,347,500	

ディングス				
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	
ＩＤＥＣ	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	
ＥＩＺＯ	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	
ＴＤＫ	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	
ＳＭＫ	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	
ＴＯＡ	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	
エスペック	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	
オプテックスグループ	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	
サノヤスホールディングス	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	
日本車輌製造	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	
近畿車輌	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	
ジャパン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	
トピー工業	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	
佐鳥電機	11,100	1,723.00	19,125,300	
カッパ・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	
ナガイレーベン	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	
メディパ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	322,300	4,121.00	1,328,198,300	

ナルホールディングス				
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	
ハピネット	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	
ＶＴ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	
ＩＤＯＭ	54,100	1,159.00	62,701,900	
日本エム・ディ・エム	11,900	595.00	7,080,500	
ポプラ	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	
ＰＬＡＮＴ	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	
ＪＭＳ	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・テクノロジー	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	
ＳＣＲＥＥＮ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	
ＨＯＹＡ	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	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	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	
前田工繊	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	
ＳＨＯＥＩ	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	
ＴＯＰＰＡＮ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	
ＮＩＳＳＨＡ	25,800	1,597.00	41,202,600	
光村印刷	100	1,392.00	139,200	

ＺＡＣＲＯＳ	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	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	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	
ＪＳＰ	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	
ピジョン	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	
タカラスタンダード	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	
ＭＵＴＯＨ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	
ＧＳＩ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	
トーホー	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	
木曽路	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	
ＰＡＬＴＡＣ	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	
テーオーシー	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　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	14,100	2,985.00	42,088,500	
コー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	
ＮＩＳＳＯ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	
ＧＥＮＯＶＡ	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	
キユ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	
ＴＢＳ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ＪＳＡＴ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－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	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	
ＫＤＤＩ	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	
ＧＭＯ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	
アイド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	
ＤＴＳ	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	
カプコン	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	
アゴーラ　ホスピタリティー　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	
ＳＣＳＫ	123,600	3,149.00	389,216,400	
藤田観光	6,900	7,510.00	51,819,000	
ＫＮＴ－ＣＴ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	
ＮＳＷ	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	
ＴＫＣ	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	
ＮＳＤ	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　ＤＩＮＩＮＧ　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	
アークランズ	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	
ＪＢＣＣホールディングス	10,000	4,255.00	42,550,000	
ＪＫ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	
バ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	
サックスバー　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。

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7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	108,939,825,373円
同期中追加設定元本額	24,584,259,026円
同期中一部解約元本額	22,134,446,152円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,695,567,237円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,342,501円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	9,714,778円
ＭＩＴＯ　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Ⅱ　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	273,021,078円

定）	
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	191,393,258円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,378,598円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,708,113円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,698,267円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,788円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	124,668円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,926,169円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	970,940,688円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,127,422,170円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,178,814,917円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	43,149,023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）	85,408,223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）	884,804,959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）	169,003,651円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	151,379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）	125,740,722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）	114,988,644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）	164,764,607円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,993,277円
動的パッケージファンド＜ＤＣ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
ＭＨＡＭ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
ＭＨＡＭ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7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）
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。

①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。

②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・ポンド　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	23,000,000.000	24,284,796.100	

		2.54 12/25/30			
		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 (799,454,400)	7,899,198.710 (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・シュケル	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・リンギット	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。

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7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。 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。 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。 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。 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．　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。
4．　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	169,125,591,156円
同期中追加設定元本額	29,239,760,624円
同期中一部解約元本額	18,212,711,061円

元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,934,560,727円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,127,962円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	5,835,985円
ＭＩＴＯ　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
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	58,850,429,049円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	3,835,234,942円
Ｏｎｅグローバルバランス	50,102,106円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	115,675,642円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	645,403,749円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	948,458,718円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	59,794,856円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	177,548,697円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	124,782,692円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	160,266,969円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　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Ⅱ　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
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,931円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	693,484円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	66,535,624円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	145,719,366円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	523,126,501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）	20,726,217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）	17,579,268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）	105,998,968円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	3,680,308円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	109,084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）	30,176,422円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,272,083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）	9,667,333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）	13,797,161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）	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7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）		時価（円）	評価損益（円）
		うち １年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,169,372,926	－	2,169,414,593	41,667
アメリカ・ドル	1,747,637,820	－	1,747,673,320	35,500
イギリス・ポンド	69,238,440	－	69,242,760	4,320
オーストラリア・ドル	35,849,088	－	35,846,180	△2,908
カナダ・ドル	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。

①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。

②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）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 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	21,827	103.570	2,260,622.390	

INC				
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	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	

FREEPORT-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	
WW 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	
SYNOPSYS 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	234,186	56.260	13,175,304.360	

INC				
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	
APPLOVIN 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	
	ASHTEAD 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 HAPOALIM 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	117,480	19.520	2,293,209.600	

LTD				
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	
	SEMBCORP 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-GENUSSCHEIN	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・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	647,375.570	
		SEGRO PLC	207,676.000	1,393,090.600	
	イギリス・ポンド　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・ポンド	株式	76銘柄	3.47	－	－	－	3.59
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.02	
イスラエル・シュケル	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。

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7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．　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	50,942,916,967円
同期中追加設定元本額	29,749,408,247円
同期中一部解約元本額	30,828,086,470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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	257,980,135円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	429,785,428円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　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
ＤＩＡＭ　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7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。

（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	2,000,000.000	1,472,980.000	

		3.875 04/16/50			
		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	5,000,000.000	4,659,982.350	

		01/05/36			
		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	2,000,000.000	1,646,408.000	

		5.0 01/18/53			
		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。

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7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。 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。 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。 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．　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。
４．　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	54,421,229,418円
同期中追加設定元本額	11,473,211,288円
同期中一部解約元本額	7,372,927,382円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ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
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,877,528円
ＭＩＴＯ　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7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）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	3,324,965	－	3,281,393	43,572
ブラジル・レアル	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。

①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。

②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）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
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	9,961	0.000	0.000	

	GDR				
	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	8,201	3,235.350	26,533,105.350	

LTD				
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	16,628	3,788.250	62,991,021.000	

	LTD				
	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・ルピー	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	591,600	1,720.000	1,017,552,000.000	

	PT				
	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	
	UNISPLENDOUR 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	24,800	11.260	279,248.000	

CO LTD				
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	36,480	6.020	219,609.600	

CO LTD				
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	113,500	4.920	558,420.000	

CO LTD				
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	
WEICHAI 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	
ASYMCHEM 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	11,800	21.690	255,942.000	

BEVERAGE CO LTD				
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 APPTEC 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	70,700	2.700	190,890.000	

LTD				
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	6,600	44.850	296,010.000	

INSURANCE CO LTD				
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	16,400	13.420	220,088.000	

DEVELOPMENT CO LTD				
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 PIENTZEHUANG 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 TIANTAN 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	12,700	21.140	268,478.000	

LTD				
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・バーツ	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 &	119,045	127.000	15,118,715.000	

	PRODUCTION PCL NVDR				
	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・バーツ　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・フォリント	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・レアル	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	104,000	33.970	3,532,880.000	

	BRASILEIRAS SA				
	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・レアル　小計		6,059,410		135,919,919.350 (3,511,015,397)	
ポーランド・	MBANK	1,196	548.000	655,408.000	

ズロチ					
	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(LOCAL)	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	220,148	2.286	503,258.320	

	SERVICES				
	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	21,038	20,150.000	423,915,700.000	

CORP				
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 &	320,120	12.080	3,867,049.600	

INVESTME				
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	114,000	7.250	826,500.000	

DEVELOPMENT CO				
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	
CRRC 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	986,000	0.000	0.000	

GROUP				
CHINA HUISHAN 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 APPTEC 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	
	HENGTEN 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）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

２．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率(%)	組入投資信託受益証券時価比率(%)	組入投資証券時価比率(%)	有価証券の合計金額に対する比率(%)
アメリカ・ドル	株式　41銘柄	2.49	－	－	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	3.79	－	－	4.04

	柄				
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 42銘柄	3.35	－	－	3.70
	投資信託受益証券 3銘柄	－	0.12	－	
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 18銘柄	1.32	－	－	1.85
	投資信託受益証券 3銘柄	－	0.34	－	
	投資証券 2銘柄	－	－	0.08	
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。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド
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	126,396,387
国債証券	449,631,500
流動資産合計	576,027,887
資産合計	576,027,887
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	572,679,529
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,348,358
元本等合計	576,027,887
純資産合計	576,027,887
負債純資産合計	576,027,887

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7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。

（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	481,035,704円
同期中追加設定元本額	4,583,490,804円
同期中一部解約元本額	4,491,846,979円
元本の内訳	
ファンド名	
バンクローン・ファンド（ヘッジなし）	15,843,407円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり）	13,867,169円
バンクローン・ファンド（ヘッジなし／年１回決算型）	1,088,285円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり／年１回決算型）	98,095円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド１月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド２月号	48,517円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド３月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド４月号	11,377円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド５月号	98,027円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド６月号	989,197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド７月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド８月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド９月号	494,102円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス＜為替ヘッジあり＞	791,316円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス＜為替ヘッジなし＞	2,474,972円
ウエリントン・トータル・リターン債券ファンド（年１回決算型）（為替ヘッジなし）	5,768,275円
ウエリントン・トータル・リターン債券ファンド（年４回決算型）（為替ヘッジなし）	2,884,138円
クルーズコントロール	394,637,405円
ＵＳストラテジック・インカム・ファンド　Ａコース（為替ヘッジあり）	993,740円
ＵＳストラテジック・インカム・ファンド　Ｂコース（為替ヘッジなし）	1,987,479円
ＤＩＡＭ－ジャナス　グローバル債券コアプラス・ファンド＜ＤＣ年金＞	9,935円
マシューズ・アジア株式ファンド	14,723,185円
Ｏｎｅ世界分散セレクト（Ａコース）	99,040円
Ｏｎｅ世界分散セレクト（Ｂコース）	99,040円
Ｏｎｅ世界分散セレクト（Ｃコース）	99,040円
世界８資産リスク分散バランスファンド（目標払出し型）	99,109円
モルガン・スタンレーＵＳハイイールド債券ファンド（毎月決算型）（為替ヘッジあり）	188,380円
モルガン・スタンレーＵＳハイイールド債券ファンド（毎月決算型）	109,063円

（為替ヘッジなし）	
モルガン・スタンレーＵＳハイイールド債券ファンド（年１回決算型）（為替ヘッジあり）	297,442円
モルガン・スタンレーＵＳハイイールド債券ファンド（年１回決算型）（為替ヘッジなし）	118,977円
ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド	99,255,584円
ＰＩＭＣＯストラテジック・インカム・ファンド（為替ヘッジあり）	301,134円
ＰＩＭＣＯストラテジック・インカム・ファンド（為替ヘッジなし）	1,493,740円
Ｏｎｅ／フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド（成長型）	9,943,324円
Ｏｎｅ／フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド（隔月決算・予想分配金提示型）	1,988,665円
計	572,679,529円
２．　受益権の総数	572,679,529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7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。

（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	△124,860
合計	△124,860

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年4月6日から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）	1.0058円 （10,058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	１２３８回　国庫短期証券	50,000,000	49,944,500	
	１２４４回　国庫短期証券	100,000,000	99,861,000	
	１２６１回　国庫短期証券	300,000,000	299,826,000	
国債証券　合計		450,000,000	449,631,500	
合計			449,631,500	

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2025年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	7,525,633,654円
Ⅱ　負債総額	11,831,927円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,513,801,727円
Ⅳ　発行済数量	5,492,666,704口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3680円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	438,830,372,143円
Ⅱ　負債総額	1,965,441,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	436,864,931,143円
Ⅳ　発行済数量	364,717,097,309口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1978円

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1月31日現在

Ⅰ　資産総額	618,792,111,583円
Ⅱ　負債総額	1,114,187,164円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	617,677,924,419円
Ⅳ　発行済数量	124,030,299,212口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.9801円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	273,074,861,549円
Ⅱ　負債総額	3,409,205,003円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	269,665,656,546円
Ⅳ　発行済数量	111,240,731,890口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4242円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,875,350,684,245円
Ⅱ　負債総額	152,382,216円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,875,198,302,029円
Ⅳ　発行済数量	181,459,605,778口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	10.3340円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2025年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	117,023,810,742円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	117,023,810,742円
Ⅳ　発行済数量	47,495,693,236口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4639円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2025年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	108,956,766,329円
Ⅱ　負債総額	6,973,426円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	108,949,792,903円
Ⅳ　発行済数量	58,974,223,171口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8474円

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

2025年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,575,613,850円
Ⅱ　負債総額	500,000,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,075,613,850円
Ⅳ　発行済数量	1,069,401,009口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0058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。

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③上記①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た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1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1月31日現在）

① 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。

② 投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年1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	1,521,319,928,368
追加型株式投資信託	758	17,499,384,399,502
単位型公社債投資信託	22	34,546,612,794
単位型株式投資信託	193	1,022,246,213,515
合計	999	20,077,497,154,179

３【委託会社等の経理状況】

１．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

２．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

３．委託会社は、第39期事業年度（自2023年4月1日至2024年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第40期中間会計期間（自2024年4月1日至2024年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

２０２４年5月２３日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。
監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

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

以　　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第38期 （2023年3月31日現在）		第39期 （2024年3月31日現在）
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		33,770		41,183
金銭の信託		29,184		28,143
未収委託者報酬		16,279		19,018
未収運用受託報酬		3,307		3,577
未収投資助言報酬		283		315
未収収益		15		6
前払費用		1,129		1,510
その他		2,377		2,088
流動資産計		86,346		95,843
固定資産				
有形固定資産		1,127		1,093
建物	※1	1,001	※1	918
器具備品	※1	118	※1	130
リース資産	※1	7	※1	5
建設仮勘定		－		39
無形固定資産		5,021		4,495
ソフトウエア		3,367		2,951
ソフトウエア仮勘定		1,651		1,543
電話加入権		2		0
投資その他の資産		9,768		8,935
投資有価証券		182		184
関係会社株式		5,810		4,447
長期差入保証金		775		768
繰延税金資産		2,895		3,406
その他		104		128
固定資産計		15,918		14,524
資産合計		102,265		110,368

（単位：百万円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第38期（自　2022年4月1日　至　2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第39期（自　2023年4月1日　至　2024年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (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
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	(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物　…　8～18年 器具備品　…　2～20年 (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エアについては、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。 (3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。
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	(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。 (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。 (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。 ①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。 ②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。 (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。
6. 収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1．有形固定資産の減価償却累計額

（百万円）

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

（損益計算書関係）

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

（百万円）

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

※2．減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウエア仮勘定	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エ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エア仮勘定について、回収可能額まで減額し、当該減少額231百万円を減損損失として特別損失に計上いたしました。なお、当該資産の回収可能額は使用価値により測定しており、使用価値については、将来キャッシュ・フローが見込まれないため、備忘価額の1円として評価しております。

（株主資本等変動計算書関係）

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

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

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

（注2）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

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

3．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第38期（2023年3月31日現在）

（百万円）

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

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

第39期（2024年3月31日現在）

（百万円）

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

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

3．事業年度中に売却したその他有価証券

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

該当はありません。

4．減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（百万円）

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

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

（百万円）

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

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

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（企業結合等関係）

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

1．結合当事企業

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

2．企業結合日

2016年10月1日

3．企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A種種類株式15,510株を交付しました。

8．経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9．取得企業を決定するに至った主な根拠

「3．企業結合の方法」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③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. 発生したのれんの金額	76,224百万円
b. 発生原因	被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間	20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12．被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,039百万円	△7,649百万円
経常利益	△8,039百万円	△7,649百万円
税引前当期純利益	△8,039百万円	△7,649百万円
当期純利益	△6,744百万円	△6,474百万円
1株当たり当期純利益	△168,617円97銭	△161,850円28銭

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,228百万円	3,837百万円

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

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

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

（持分法損益等）

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

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	7,474	未払手数料	1,579
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	－	－	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	13,932	未払手数料	2,404

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	8,140	未払手数料	1,870
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	－	－	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	16,655	未払手数料	3,137

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

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

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

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

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

独立監査人の中間監査報告書

２０２４年１１月２２日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

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

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以　　上

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

（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

(1) 中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第40期中間会計期間末 （2024年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		30,451
有価証券		0
金銭の信託		31,850
未収委託者報酬		19,361
未収運用受託報酬		3,548
未収投資助言報酬		315
未収収益		9
前払費用		1,538
その他		2,282
流動資産計		89,360
固定資産		
有形固定資産		1,040
建物	※1	888
器具備品	※1	146
リース資産	※1	4
建設仮勘定		0
無形固定資産		4,122
ソフトウエア		3,011
ソフトウエア仮勘定		1,111
電話加入権		0
投資その他の資産		8,024
投資有価証券		183
関係会社株式		3,840
長期差入保証金		764
繰延税金資産		3,085
その他		150
固定資産計		13,188
資産合計		102,548

（単位：百万円）

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

(2) 中間損益計算書

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（3）中間株主資本等変動計算書

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：百万円）

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法
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	(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 (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エアについては、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。 (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。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②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。 (4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
6. 収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

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

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第40期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券

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

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

（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、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

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

（有価証券関係）

第40期中間会計期間末
（2024年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

（持分法損益等）

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

（企業結合等関係）

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

1.結合当事企業

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

2.企業結合日

2016年10月1日

3.企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A種種類株式15,510株を交付しました。

8.経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9.取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2024年4月1日から2024年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

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

（2）損益計算書項目

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

	第40期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）
委託者報酬	55,266百万円
運用受託報酬	8,186百万円
投資助言報酬	1,200百万円
成功報酬	－百万円
その他営業収益	13百万円
合計	64,667百万円

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（１）サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

(3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

約　　款

追加型証券投資信託
クルーズコントロール
約款

運用の基本方針

約款第19条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1．基本方針
この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

(2)投資態度
①以下のマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式、公社債に実質的に分散投資を行います。
・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
（上記それぞれおよびＤＩＡＭマネーマザーファンドを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）
・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果を目指す上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、ＤＩＡＭマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合もあります。
・実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
②各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年１回見直すこととします。
・経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託者が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。
③基準価額の下落を一定水準（下値目安値(*)）までに抑えることを目標とします。
・資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
・資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
・下値目安値は、四半期毎に、委託者の判断により基準価額から一定の水準に設定します。
・上記の運用目標は、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(**)を機動的に変更することで行います。
(*) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託者が保証等するものではありません（相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります）。
(**) 合計資産比率とは、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」を除く６つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。
・各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

(3)投資制限

①各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。

②株式への実質投資割合には、制限を設けません。

③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。

④有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引は約款の範囲で行なう事ができます。

⑤外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

⑥非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）については制限を設けません。

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、委託者は、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。

3. 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

委託者が基準価額水準、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、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
クルーズコントロール
約款

＜信託の種類、委託者および受託者＞
第1条　この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。
②この信託は、信託法(平成18年法律第108号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

＜信託事務の委託＞
第2条　受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。)を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

＜信託の目的および金額＞
第3条　委託者は、金5,000万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

＜信託金の限度額＞
第4条　委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として、信託金を追加することができます。
②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

＜信託期間＞
第5条　この信託の期間は、信託契約締結日から第46条第1項、第47条第1項、第48条第1項および第50条第2項の規定による信託終了の日までとします。

＜受益権の取得申込の勧誘の種類＞
第6条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

＜当初の受益者＞
第7条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

＜受益権の分割および再分割＞
第8条　委託者は、第3条の規定による受益権については5,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。
②委託者は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)に定めるところにしたがい、受託者と協議のうえ、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。

＜追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法＞
第9条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。
②この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

③外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

④第27条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

＜信託日時の異なる受益権の内容＞

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

＜受益権の帰属と受益証券の不発行＞

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

②委託者は、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、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、委託者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。

③委託者は、第8条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者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。

＜受益権の設定にかかる受託者の通知＞

第12条　受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、また、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。

＜受益権の申込単位および取得価額等＞

第13条　委託者は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口または1円を最低単位とし、取得の申込みに応ずることができるものとします。

②販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口または1円を最低単位とし、販売会社が独自に定める単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。また、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

③前2項の規定にかかわらず、取得申込日がニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」といいます。）である場合には、受益権の取得申込みに応じません。

④第1項および第2項の場合の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に委託者または販売会社がそれぞれ別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以

下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる取得価額は、1口につき1円に委託者または販売会社が別に定める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加算した価額とします。

⑤前項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥第1項および第2項の取得申込者は委託者または販売会社に、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、委託者（第43条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）または販売会社は、当該取得申込みの代金（第4項の受益権の取得価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。

⑦前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。） 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、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

＜受益権の譲渡にかかる記載または記録＞

第14条　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。

②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。

③委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

＜受益権の譲渡の対抗要件＞

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

＜投資の対象とする資産の種類＞

第16条　この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）
   イ. 有価証券
   ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)
   ハ. 金銭債権
   ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
   イ. 為替手形

＜運用の指図範囲等＞

第17条　委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、ＤＩＡＭマネーマザーファンド（以下それぞれを「各マザーファンド」または総称して「マザーファンド」ということがあります。）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書
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、前各号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前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第13号および第18号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第7号までの証券ならびに第13号および第

18号の証券または証書のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号の証券および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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

④前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜利害関係人等との取引等＞

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第28条において同じ。)、第28条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等および当該取引、当該行為を行うことができます。

④前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

＜運用の基本方針＞

第19条　委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

＜投資する株式等の範囲＞

第20条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第20条の2　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

＜信用取引の指図範囲＞

第21条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

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

第22条　委託者は、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委託者は、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委託者は、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＞

第23条　委託者は、信託財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、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

④委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

＜金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図＞

第24条　委託者は、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、原則として第5条に定める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委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または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＞

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＞

第25条　委託者は、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各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受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＞

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＞

第27条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②前項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前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

＜信託業務の委託等＞

第28条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存にかかる業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

＜混蔵寄託＞

第29条　金融機関または第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

＜信託財産の登記等および記載等の留保等＞

第30条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、信託財産に属する旨の記載または記録に代えてその計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

＜一部解約の請求および有価証券の売却等の指図＞

第31条　委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

＜再投資の指図＞

第32条　委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清

算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

＜資金の借入れ＞

第33条　委託者は、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。

＜損益の帰属＞

第34条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

＜受託者による資金の立替え＞

第35条　信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

＜信託の計算期間＞

第36条　この信託の計算期間は、平成25年7月12日以降、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。ただし、第1期計算期間は平成24年10月26日から平成25年1月11日まで、第2計算期間は平成25年1月12日から平成25年4月11日まで、第3計算期間は平成25年4月12日から平成25年7月11日までとします。

②前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第5条に定める信託期間の終了日とします。

＜信託財産に関する報告等＞

第37条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

＜信託事務の諸費用および監査費用＞

第38条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②信託財産の財務諸表の監査に要する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は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

＜信託報酬等の額および支弁の方法＞

第39条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して年10,000分の140の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者の間の配分は別に定めます。

③第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

＜収益の分配方式＞

第40条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、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前項各号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、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責＞

第41条　受託者は、収益分配金については第42条第1項に規定する支払開始日までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第42条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第45条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第42条第5項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

＜収益分配金、償還金および一部解約金の支払い＞

第42条　収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、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委託者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。）に支払います。

②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部または一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申し出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者ごとに当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みに応じたものとします。当該受益権の取得申込に応じたことにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

④償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了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者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。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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。

⑤一部解約金は、第45条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として5営業日目から受益者に支払います。

⑥前各項（第2項および第3項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行うものとします。

⑦収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

＜委託者自らの募集にかかる受益権の口座管理機関＞

第43条　委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

＜収益分配金および償還金の時効＞

第44条　受益者が、収益分配金について第42条第1項に規定する支払い開始日から5年間その支払いを請求しないとき、信託終了による償還金については第42条第4項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

＜信託契約の一部解約＞

第45条　受益者（販売会社を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求日が海外休業日の場合は、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

②委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行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信託契約の一部解約を委託者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。

③前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

④一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者または販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑤委託者は、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、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

⑥前項により一部解約の実行の請求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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。

＜信託契約の解約＞

第46条　委託者は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

②委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④第2項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。

⑤第2項から前項までの規定は、委託者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、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

＜信託契約に関する監督官庁の命令＞

第47条　委託者は、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。

②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの約款を変更しようとするときは、第51条の規定に従います。

＜委託者の登録取消等に伴う取扱い＞

第48条　委託者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、委託者は、信託契約を解約し、信託を終了させます。

②前項の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第51条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者との間において存続します。

＜委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い＞

第49条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を承継させることがあります。

＜受託者の辞任および解任に伴う取扱い＞

第50条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第51条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜信託約款の変更等＞

第51条　委託者は、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、受託者と合意のうえ、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け出ます。なお、この約款は本条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。

②委託者は、前項の事項（前項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、前項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、この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発します。

③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④第2項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。

⑤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。

⑥第2項から前項までの規定は、委託者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、この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。

⑦前各項の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜反対受益者の受益権買取請求の不適用＞

第52条　この信託は、受益者が第45条の規定による一部解約請求を行ったときは、委託者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、第46条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。

＜他の受益者の氏名等の開示の請求の制限＞

第53条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1.他の受益者の氏名または名称および住所

2.他の受益者が有する受益権の内容

第54条　（削除）

＜公告＞

第55条　委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

②前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜運用状況にかかる情報の提供＞

第56条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める事項にかかる情報を電磁的方法により提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

＜質権口記載または記録の受益権の取扱い＞

第57条　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け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

＜約款に関する疑義の取扱い＞

第58条　この約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

（附則）

第1条　この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条　第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第3条　第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した

額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条　第42条第7項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

平成24年10月26日　　（信託契約締結日）

委託者　　ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社

受託者　　みずほ信託銀行株式会社

親投資信託
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

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

2.運用方法
（１）投資対象
わが国の公社債を主要投資対象とします。
（２）投資態度
１)主としてわが国の公社債に投資し､NOMURA－BPI総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。
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。
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。
４）有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
５）信託財産の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。）を行うことができます。
６）信託財産の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ができます。
（３）投資制限
１）株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
２）株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。
３）同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。
４）同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1 項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。
５）外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。
６）有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。
７）スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。
８）金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。
９）外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行ないます。
10）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。
11）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。

12）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、委託者は、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。

親投資信託
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針
この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2.運用方法
（１）投資対象
わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
（２）投資態度
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目指して運用を行います。
２）最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
３）株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
４）株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
５）非株式割合は原則として信託財産総額の50％以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10％以下とします。
６）国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
７）信託財産の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ができます。
（３）投資制限
１）株式への投資割合には、制限を設けません。
２）有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
３）金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
４）デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
５）外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
６）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

親投資信託
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第15条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針
この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2. 運用方法
（1）投資対象
海外の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度
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目指して運用を行います。
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。
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。
4）有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
5）信託財産の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。）を行うことができます。
6）信託財産の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ができます。

（3）投資制限
1）株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
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。
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。
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。
4）外貨建資産への投資には、制限を設けません。
5）有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。
6）スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。
7）金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

８）外国為替予約取引は約款24条の範囲で行ないます。
９）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。
１０）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。
１１）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、委託者は、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。

親投資信託
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針
この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2.運用方法
（１）投資対象
海外の株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度
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）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
２）株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
３）組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
４）有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
５）信託財産に属する資産の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。）を行うことができます。
６）信託財産に属する資産の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ができます。

（３）投資制限
１）株式への投資割合には、制限を設けません。
２）新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20％以下とします。
３）同一銘柄の転換社債、ならびに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。
４）外貨建資産への投資には、制限を設けません。
５）有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。
６）スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。
７）金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。
８）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。

9）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。

１０）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、委託者は、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。

親投資信託
エマージング債券パッシブ・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．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目指して運用を行います。

２．運用方法
（１）投資対象
新興国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度
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目指して運用を行います。
②原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。
③組入債券は、当初組入時において、Ｓ＆ＰもしくはＭｏｏｄｙ’ｓの外貨建て長期格付がＢＢ－格もしくはＢａ３格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。
④外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
⑤信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
⑥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、ならびに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。

（３）投資制限
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。
②外貨建資産への投資には、制限を設けません。
③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。
④有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引は約款の範囲内で行うことができます。
⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

親投資信託
エマージング株式パッシブ・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針
この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式(*)に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
（＊）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及び証書等を含みます。

２．運用方法
（１）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。
（＊）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及び証書等を含みます。

（２）投資態度
①主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
②原則として、株式の組入比率は高位を維持します。
③外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
④信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
⑤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、ならびに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。

（３）投資制限
①株式への投資割合には、制限を設けません。
②外貨建資産への投資には、制限を設けません。
③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。
④有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引は約款の範囲内で行うことができます。
⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

親投資信託
ＤＩＡＭマネーマザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針
この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。

２．運用方法
（１）投資対象
国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにＣＤ、ＣＰ、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

（２）投資態度
①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（＊）の長期発行体格付け（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がＡＡ－格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がａ-1格相当以上のＣＤ、ＣＰを主要投資対象とします。
（＊）主要格付機関とは、R&I、JCR、Moody’s、S&Pとします。
②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する１発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は５％以内とします。
③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは１年未満を基本として運用します。
④資金動向、市況動向に急激な変化が生じた場合、残存信託期間、残存元本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できない場合があります。

（３）投資制限
①株式への投資割合は、純資産総額の１０％以下とします。
②同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。
③同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の５％以下とします。
④新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の５％以下とします。
⑤投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の５％以下とします。
⑥有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引は約款の範囲で行う事ができます。
⑦外貨建て資産への投資は行いません。
⑧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。
⑨一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、委託者は、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。