

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年9月12日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 杉原 規之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ワールドアセットバランス（基本コース） ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	ワールドアセットバランス（基本コース） 1兆円を上限とします。 ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ワールドアセットバランス（基本コース）

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

（以下、総称して「ワールドアセットバランス」、「ワールドアセットバランス（基本コース）／（リスク抑制コース）」または「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「ワールドアセットバランス（基本コース）」は「（基本コース）」、「ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）」は「（リスク抑制コース）」という場合があります。

各ファンドを総称した愛称として「ワールドOne」という名称を用いる場合があります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「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1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://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、2.2%(税抜2.0%)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:2023年9月13日から2024年3月11日まで

取得またはスイッチングの申込日が、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」という場合があります。)には、取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

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

(8) 【申込取扱場所】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(1 1) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、海外休業日には取得またはスイッチングのお申込みの受付は行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)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。

<スイッチング>

(基本コース)(リスク抑制コース)の2つのファンド間でスイッチングができます。スイッチングとは、すでに保有しているファンドを解約すると同時に他のファンドの取得の申込みを行うことをいい、ファンドの解約代金が買付代金に充当されます。

スイッチングの際には、税金および各販売会社が定めるお申込手数料がかかる場合があります。

販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせ下さい。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドの信託金限度額は、各々2,000億円とします。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 日本を除く先進国の株式、債券、不動産投資信託証券(リート)および新興国の株式、債券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。

●上記資産に関しては、主としてマザーファンド(*)を通じて実質的に投資します。また、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等へ直接投資する場合があります。

●DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

(*)外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

2 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、為替リスクの低減をめざします。

※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

3 基本コース、リスク抑制コースの2コースからお選びいただけます。

●各資産への基本投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直します。

※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、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

●基本コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行います。

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

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

(*) 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5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本投資比率をもとに運用を行います。

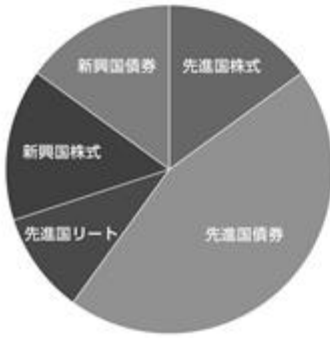
●各コース間でスイッチングが可能です。

※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。

基本投資比率のイメージ

基本コース リスク抑制コース



※基本投資比率は、原則として年1回見直しします。
 ※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。

基本コース

投資対象資産の合計資産比率の変更は行いません。



※この図においては、左記の5つの資産への投資比率の合計を「合計資産比率」として表示しています。以下同じ。
 ※合計資産比率には、ETFおよび有価証券指数等先物取引等を含みます。

リスク抑制コース

基本投資比率をもとに投資対象資産の合計資産比率を、現金等*を用いて機動的に変更し、基準価額の下落の抑制をめざします。



※合計資産比率は、10%～100%程度とします。それにあわせて現金等*の比率は変動します。

リスク抑制コースでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等は機動的に合計資産比率を減少(現金等*比率を増加)させることで基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることをめざします。その後、市場環境回復局面では合計資産比率を増加(現金等*比率を減少)させます。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。

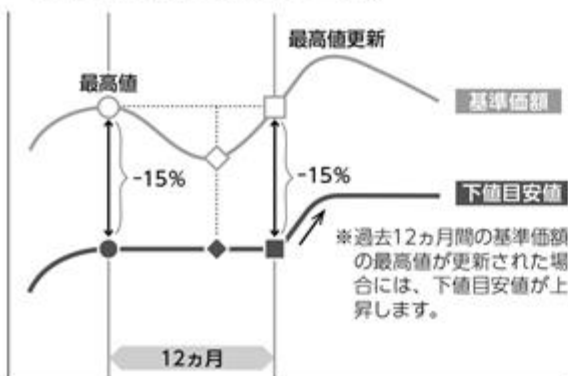
*現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(リスク抑制コース)の下値目安値について

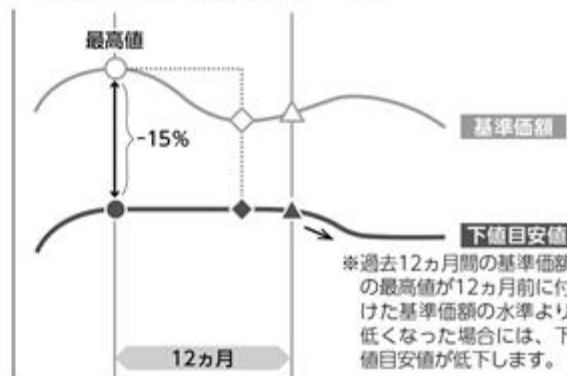
下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。

※(基本コース)は、下値目安値を定めておりません。
 ※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

下値目安値が上昇するケース



下値目安値が低下するケース



※下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去12ヵ月間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去12ヵ月間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

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

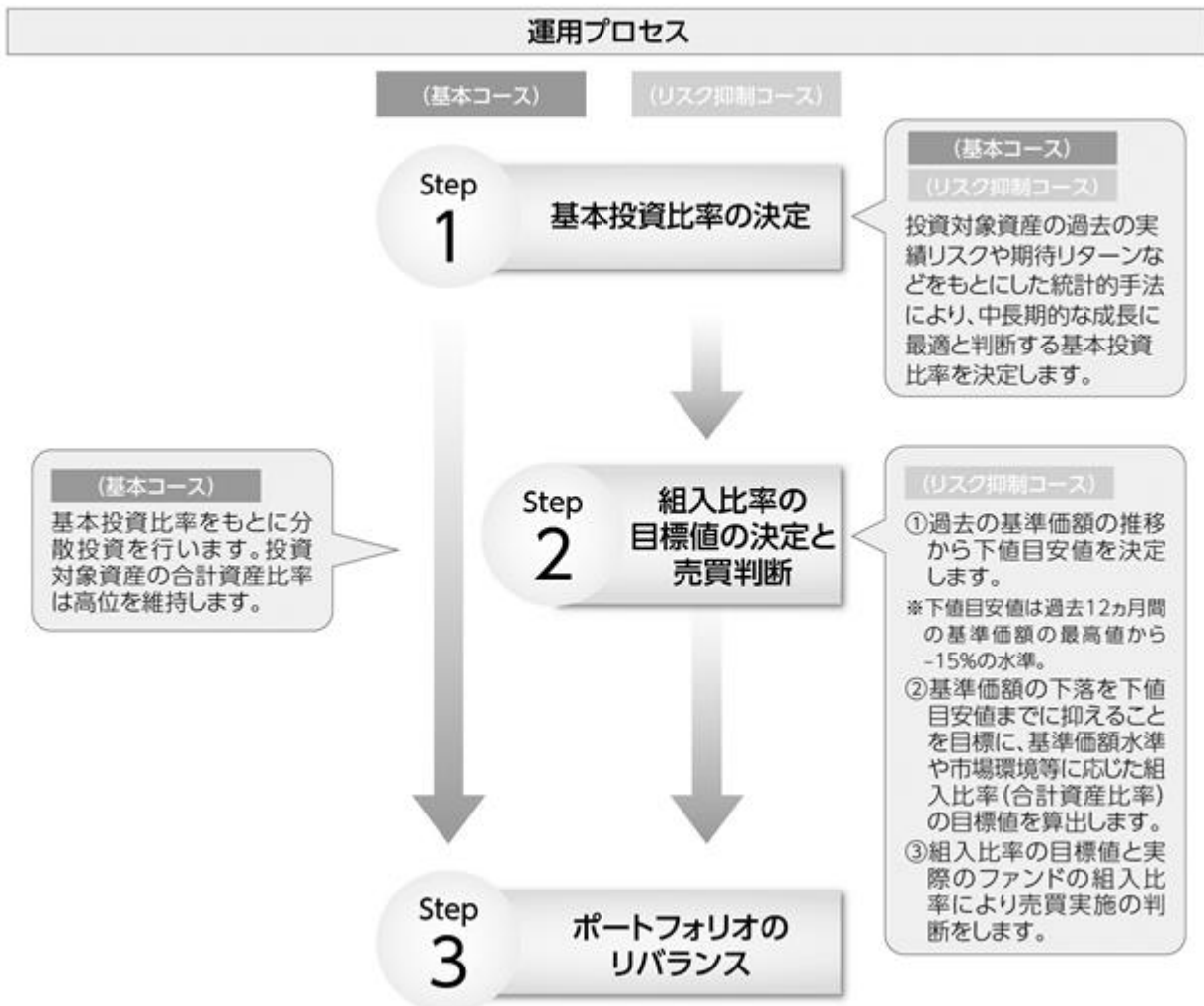
4 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

5 年2回決算を行います。

- 毎年6月、12月の各11日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

※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

各ファンド

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	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 () 資産複合

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
海外	目論見書または投資信託約款において、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

各ファンド

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	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本除く) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)
不動産投信 その他資産 ()	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東)	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
資産複合 (投資信託証 券(債券、株 式、不動産投 信)、先物、 ETF、短期 金融資産) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

資産複合(投資信託証券 (債券、株式、 不動産投信)、先物、E TF、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 (日本除く)	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除く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。
為替ヘッジあり (フルヘッジ)	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

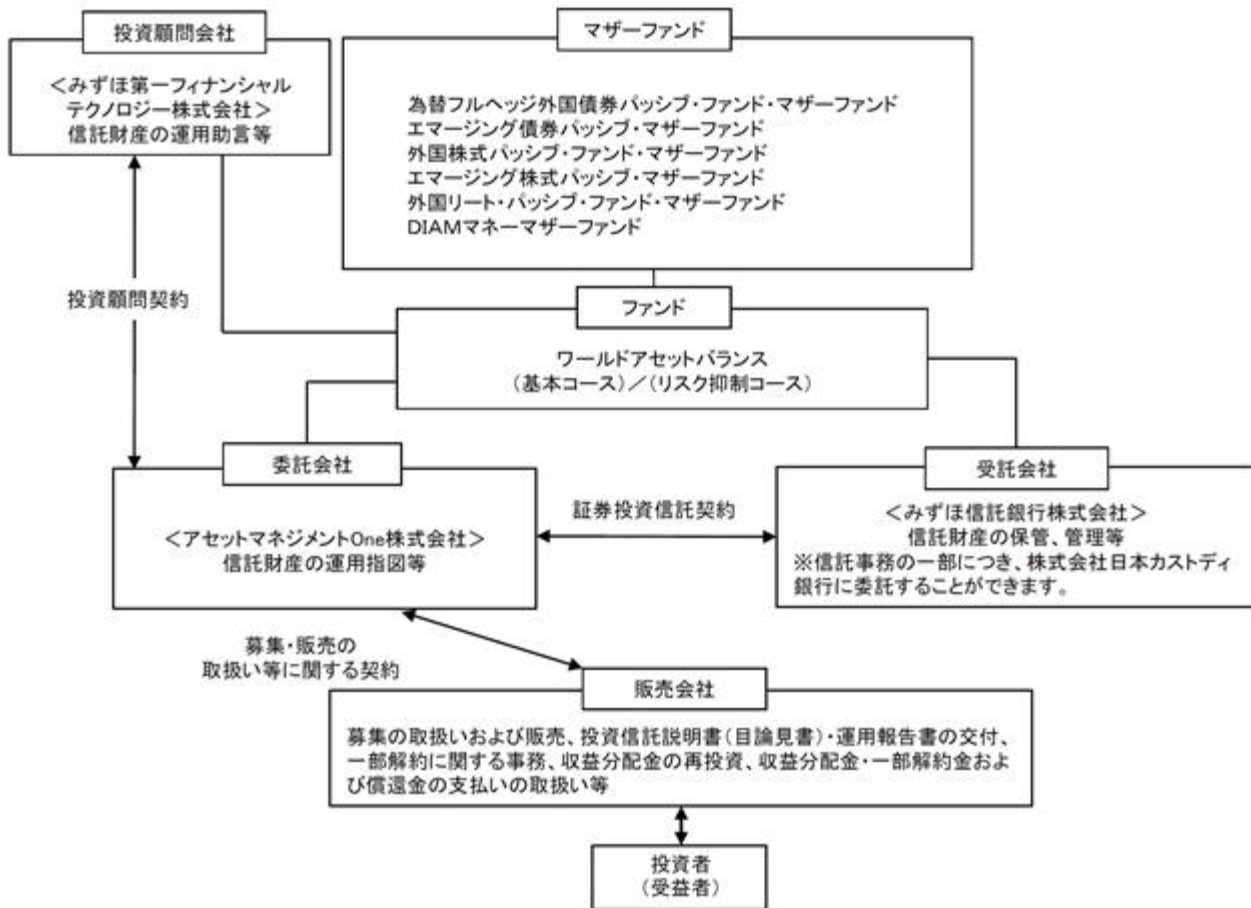
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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】

2017年1月18日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・ 「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

- ・ 「投資顧問契約」の概要

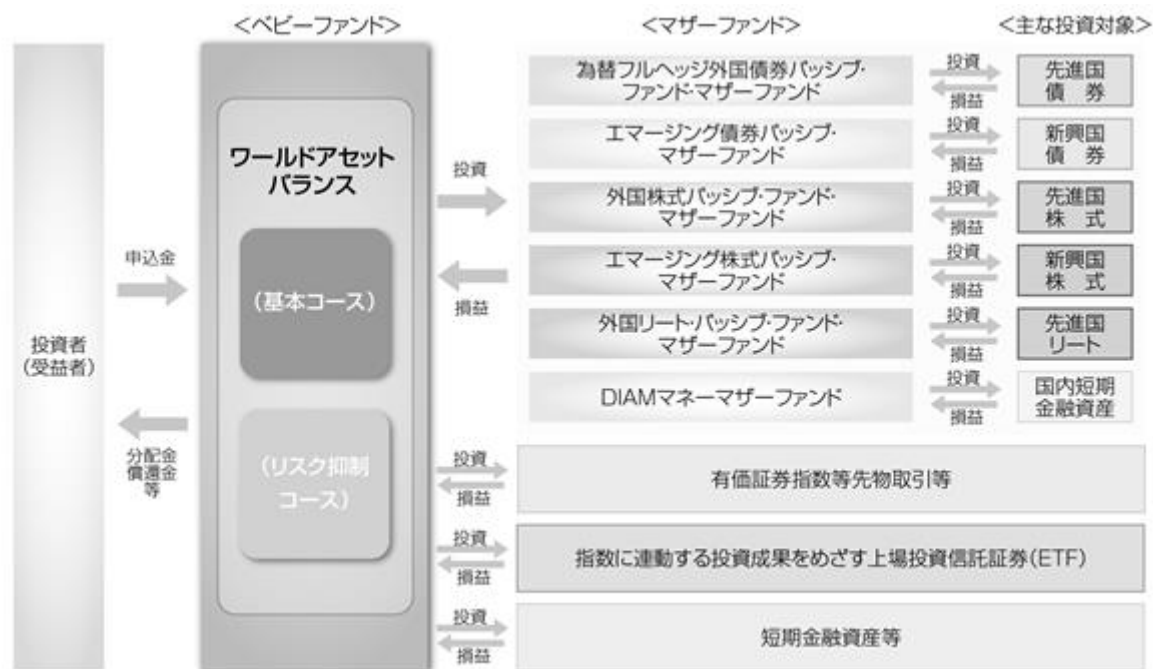
委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

「ファミリーファンド方式」とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（各ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を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（2023年6月30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

（2023年6月30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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

<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>

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、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投資信託証券（ETF）を主要投資対象とします。なお、「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があります。

<投資態度>

以下のマザーファンド受益証券、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

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、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

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、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

「D I A Mマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとE T Fおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率は、原則として高位を保ちます。

各資産への投資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。

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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

<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>

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、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投資信託証券(E T F)を主要投資対象とします。なお、「D I A Mマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

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

- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・上記のほか、D I A Mマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

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、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

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、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

基準価額の下落を一定水準(下値目安値^(*))までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去12ヵ月間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

(**) 合計資産比率とは、「D I A Mマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。
各資産への投資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。
資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、D I A Mマネーマザーファンドの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。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
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。

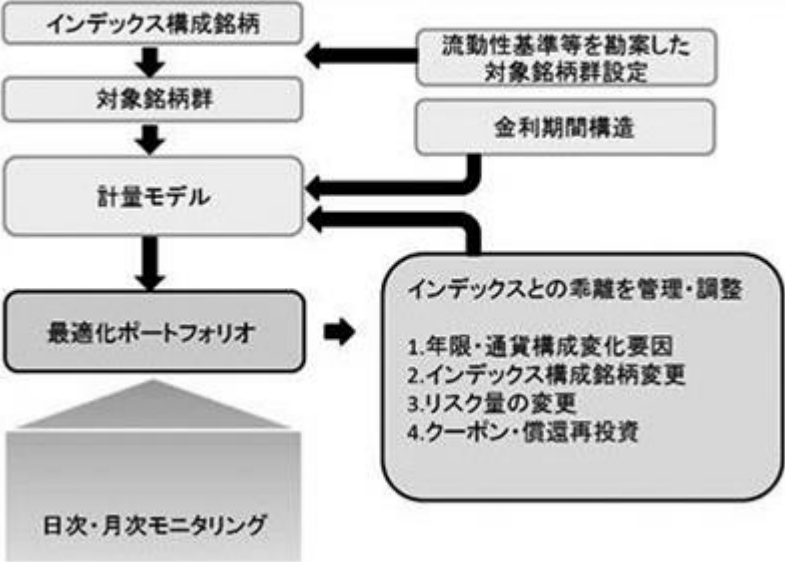
運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

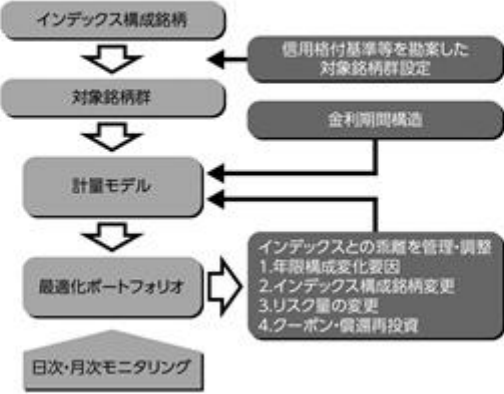
(参考)各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

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

<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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等への投資は、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割合には、制限を設けません。 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。
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>エマージング債券パッシブ・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>新興国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 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。ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>

<p>運用プロセス</p>	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> 
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 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。

<p>ファンド名</p>	<p>外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の株式を主要投資対象とします。</p>

投資態度	<ol style="list-style-type: none">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

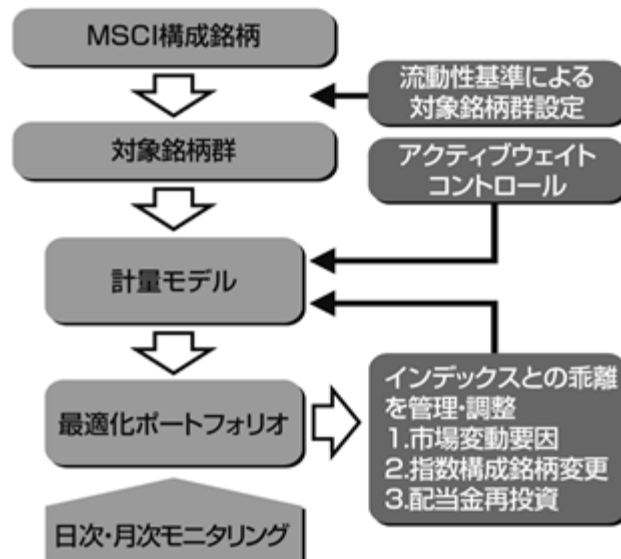
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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	<ol style="list-style-type: none"> 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	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*)DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージン・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。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

	<p>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。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[アクティブウェイトコントロール] --> B F --> C G["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --> D </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 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	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券(*)を主要投資対象とします。 (*) 海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券とします。

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

S & P 先進国 R E I Tインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 R E I Tインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび/または特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S & P 先進国 R E I Tインデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I Tインデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I Tインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務また

	<p>は責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 R E I Tインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日次・月次モニタリング] E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] --> B </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券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割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができます。 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	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	<ol style="list-style-type: none"> 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	<ol style="list-style-type: none">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



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2023年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年6月、12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。

収益の分配方式

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

1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、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この信託の信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

「分配金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】

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)

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)

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)

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

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

スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場におい

て取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

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

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- 2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払

金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額の買付代金等実需の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占め

るヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建て、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつで規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

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

- 5)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

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

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

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

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

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第29条)

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファ

ンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

資金の借入れ(約款第35条)

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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

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。

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

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

・金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

・リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

・為替リスク

為替ヘッジを行っても、為替相場の変動による基準価額への影響を完全には排除できません。

ファンドは、実質組入外貨建資産については原則として対円で為替ヘッジを行い為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。

なお、実質組入資産の直接ヘッジのほか、一部の新興国通貨については代替通貨を用いた為替ヘッジを行う場合があります。代替通貨を用いた為替ヘッジの場合、通貨間の値動きが異なる場

合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、代替通貨と一部の新興国通貨間の為替変動の影響を受ける可能性があります。

また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨および代替通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

・信用リスク

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

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

・流動性リスク

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

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。

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>

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

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

(基本コース)(リスク抑制コース)の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

リスク抑制コースでは、過去12カ月間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に15%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

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

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(スイッチングのお申込みを含みます。)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(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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。

注意事項

イ. ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(リート)などの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。

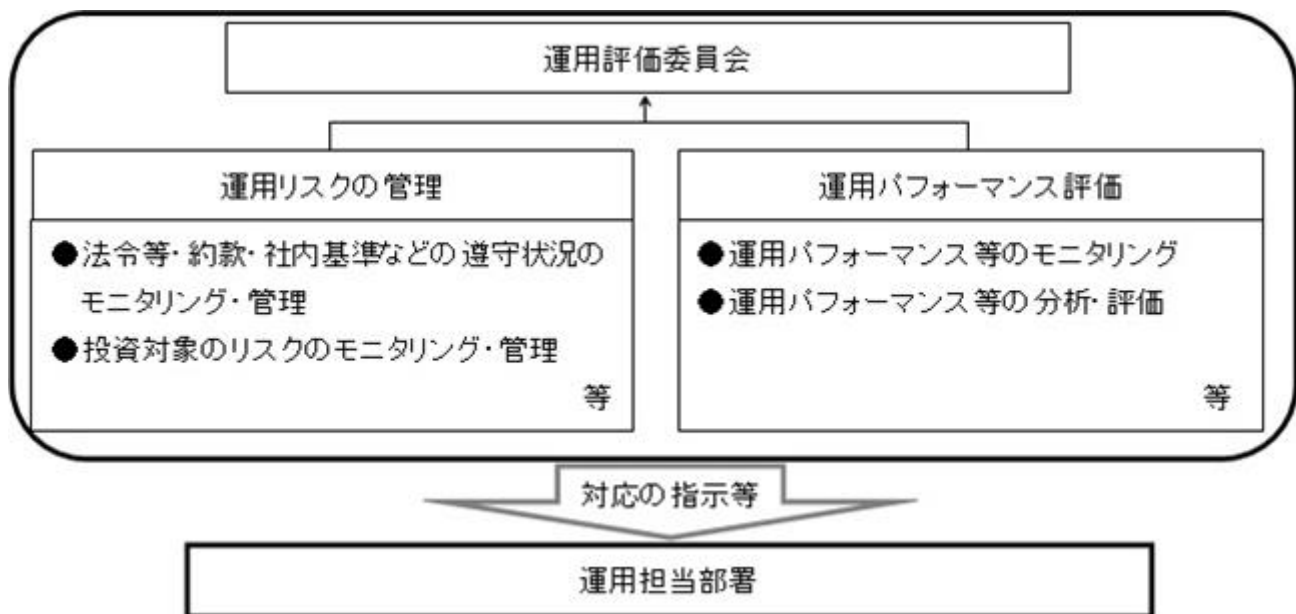
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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2023年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

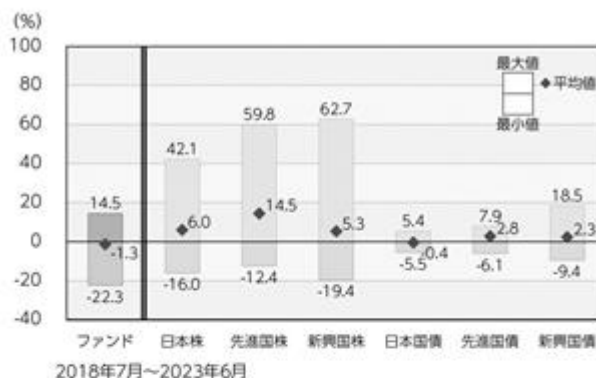
<参考情報>

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

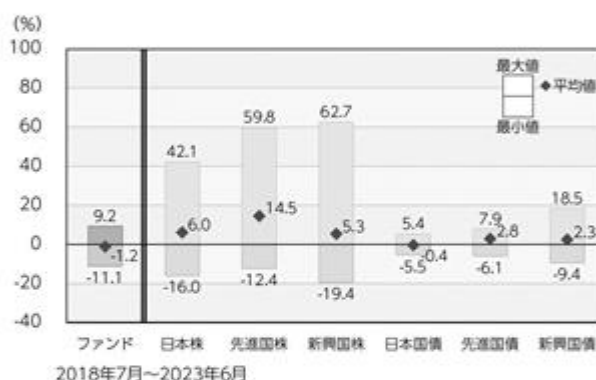
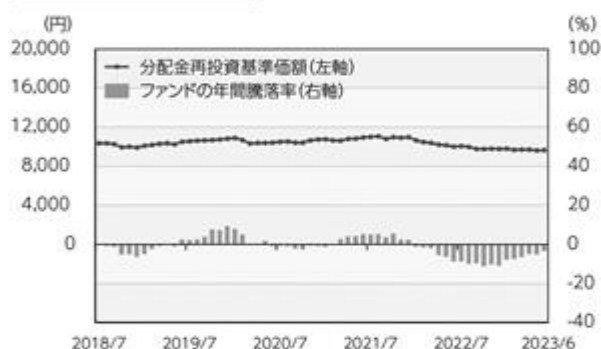
(基本コース)



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



(リスク抑制コース)



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

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

各資産クラスの指数

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

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）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】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.243%（税抜1.13%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	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0.55%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社（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。

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

<2024年1月1日以降>

少額投資非課税制度（NISA）をご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2023年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

<個別元本について>

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

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

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

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

<収益分配金の課税について>

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

…(参考情報)ファンドの総経費率…

ファンド名	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
基本コース	1.32%	1.24%	0.08%
リスク抑制コース	1.28%	1.24%	0.04%

※対象期間:2022年12月13日~2023年6月12日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	43,156,853	0.75
内 アメリカ	43,156,853	0.75
親投資信託受益証券	5,648,439,057	98.59
内 日本	5,648,439,057	98.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	37,421,389	0.65
純資産総額	5,729,017,299	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。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	66,519,962	0.36
内 アメリカ	66,519,962	0.36
親投資信託受益証券	15,423,693,524	84.43
内 日本	15,423,693,524	84.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,776,895,446	15.20
純資産総額	18,267,108,932	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）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,027,702,802,912	95.74
内 アメリカ	729,896,595,200	68.00
内 イギリス	42,852,382,729	3.99
内 カナダ	36,493,704,788	3.40
内 フランス	34,761,572,397	3.24
内 スイス	33,925,409,514	3.16
内 ドイツ	26,066,459,595	2.43
内 オーストラリア	20,962,140,990	1.95
内 オランダ	20,736,925,579	1.93
内 アイルランド	19,608,844,072	1.83
内 スウェーデン	9,248,985,417	0.86
内 デンマーク	9,238,393,938	0.86
内 スペイン	7,803,488,287	0.73
内 香港	5,913,863,762	0.55
内 イタリア	5,635,659,118	0.53
内 ジャージー	3,689,558,998	0.34
内 フィンランド	3,369,180,844	0.31
内 シンガポール	3,325,406,794	0.31
内 ベルギー	2,250,677,515	0.21
内 ノルウェー	1,916,218,517	0.18

内	イスラエル	1,902,649,581	0.18
内	ケイマン諸島	1,772,922,643	0.17
内	バミューダ	1,598,409,674	0.15
内	オランダ領キュラソー	1,356,662,675	0.13
内	ニュージーランド	835,060,893	0.08
内	オーストリア	543,234,449	0.05
内	ルクセンブルグ	529,811,956	0.05
内	ポルトガル	502,543,523	0.05
内	リベリア	468,746,795	0.04
内	パナマ	329,143,765	0.03
内	マン島	168,148,904	0.02
投資信託受益証券		1,586,167,613	0.15
内	オーストラリア	1,143,356,412	0.11
内	シンガポール	442,811,201	0.04
投資証券		19,993,320,020	1.86
内	アメリカ	18,775,753,251	1.75
内	イギリス	413,660,939	0.04
内	フランス	365,706,402	0.03
内	香港	282,242,907	0.03
内	ベルギー	78,613,237	0.01
内	カナダ	77,343,284	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		24,171,665,589	2.25
純資産総額		1,073,453,956,134	100.00

その他資産の投資状況

2023年6月30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）	24,684,661,710	2.30	
内	アメリカ	18,233,001,777	1.70
内	ドイツ	4,058,893,440	0.38
内	イギリス	1,054,000,563	0.10
内	カナダ	842,040,460	0.08
内	オーストラリア	496,725,470	0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
国債証券	217,850,097,491	102.61	
内	アメリカ	107,141,427,732	50.47
内	フランス	18,015,391,729	8.49
内	イタリア	16,597,582,635	7.82
内	ドイツ	14,355,522,531	6.76
内	中国	11,804,608,719	5.56
内	スペイン	11,034,942,688	5.20
内	イギリス	10,468,682,610	4.93
内	カナダ	4,463,658,146	2.10

内 ベルギー	4,172,422,006	1.97
内 オランダ	3,445,801,577	1.62
内 オーストラリア	3,313,029,529	1.56
内 オーストリア	2,768,408,513	1.30
内 メキシコ	2,144,289,312	1.01
内 アイルランド	1,267,143,701	0.60
内 マレーシア	1,139,592,876	0.54
内 フィンランド	1,139,402,550	0.54
内 ポーランド	1,060,900,559	0.50
内 シンガポール	976,953,519	0.46
内 デンマーク	685,925,499	0.32
内 イスラエル	637,249,599	0.30
内 ニュージーランド	452,780,063	0.21
内 スウェーデン	426,013,567	0.20
内 ノルウェー	338,367,831	0.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,551,063,655	2.61
純資産総額	212,299,033,836	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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	22,258,642	0.03
内 イギリス	22,258,642	0.03
投資信託受益証券	8,493,324,797	10.11
内 オーストラリア	5,425,798,200	6.46
内 シンガポール	2,999,409,227	3.57
内 香港	68,117,370	0.08
投資証券	74,806,217,223	89.01
内 アメリカ	65,178,511,401	77.55
内 イギリス	3,595,495,651	4.28
内 フランス	1,421,812,024	1.69
内 カナダ	1,393,780,556	1.66
内 香港	1,053,578,444	1.25
内 ベルギー	827,327,635	0.98
内 ニュージーランド	328,246,481	0.39
内 スペイン	323,496,389	0.38
内 韓国	195,061,521	0.23
内 ガーンジー	159,629,710	0.19
内 オランダ	153,985,882	0.18
内 イスラエル	102,010,432	0.12
内 ドイツ	35,507,746	0.04
内 アイルランド	29,950,037	0.04
内 イタリア	7,823,314	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	723,250,837	0.86
純資産総額	84,045,051,499	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

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	99,715,205,970	96.00
内 ケイマン諸島	16,680,931,057	16.06
内 台湾	15,424,442,361	14.85
内 インド	14,710,929,276	14.16
内 韓国	12,357,242,445	11.90
内 中国	11,677,108,359	11.24
内 ブラジル	5,332,063,678	5.13
内 サウジアラビア	4,264,136,762	4.11
内 南アフリカ	3,092,646,329	2.98
内 メキシコ	2,182,588,402	2.10
内 インドネシア	2,023,676,678	1.95
内 タイ	1,897,330,481	1.83
内 マレーシア	1,339,253,540	1.29
内 アラブ首長国連邦	1,309,654,268	1.26
内 香港	1,055,603,698	1.02
内 カタール	905,669,171	0.87
内 クエート	837,446,368	0.81
内 ポーランド	773,752,056	0.74
内 フィリピン	655,662,651	0.63
内 トルコ	557,567,851	0.54
内 チリ	537,700,675	0.52
内 ギリシャ	455,489,620	0.44
内 アメリカ	445,866,899	0.43
内 バミューダ	442,994,202	0.43
内 ハンガリー	238,527,930	0.23
内 チェコ	153,461,808	0.15
内 コロンビア	101,170,721	0.10
内 ルクセンブルグ	96,154,379	0.09
内 オランダ	63,993,543	0.06
内 エジプト	49,690,254	0.05
内 シンガポール	27,069,200	0.03
内 ペルー	25,381,308	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	817,813,337	0.79
内 メキシコ	585,432,996	0.56
内 ブラジル	232,380,341	0.22
投資証券	93,464,096	0.09
内 メキシコ	65,259,683	0.06
内 南アフリカ	28,204,413	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,246,142,735	3.13
純資産総額	103,872,626,138	100.00

その他資産の投資状況

2023年6月30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）		3,173,197,493	3.05
内 アメリカ		3,173,197,493	3.05

（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

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	126,245,834,967	95.93
内 サウジアラビア	14,487,138,479	11.01
内 メキシコ	12,478,319,175	9.48
内 アラブ首長国連邦	10,768,420,200	8.18
内 カタール	10,183,276,375	7.74
内 チリ	8,563,220,644	6.51
内 ブラジル	8,184,451,487	6.22
内 コロンビア	7,967,819,903	6.05
内 ドミニカ共和国	7,826,186,138	5.95
内 パナマ	6,734,501,640	5.12
内 ハンガリー	6,231,097,853	4.73
内 インドネシア	6,073,324,863	4.62
内 南アフリカ	5,142,398,605	3.91
内 ペルー	4,762,551,734	3.62
内 オマーン	4,216,152,610	3.20
内 フィリピン	3,893,894,556	2.96
内 ルーマニア	3,322,131,800	2.52
内 ポーランド	2,652,166,357	2.02
内 ウルグアイ	1,859,881,128	1.41
内 中国	898,901,420	0.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,352,051,951	4.07
純資産総額	131,597,886,918	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】

【投資有価証券の主要銘柄】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,945,895,782	1.1905 2,316,588,929	1.1840 2,303,940,605	- -	40.22
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	131,925,815	6.7568 891,409,539	7.1589 944,443,717	- -	16.49

3	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	428,714,394	2.0977 899,357,055	2.1872 937,684,122	- -	16.37
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	561,734,015	1.4784 830,467,568	1.5194 853,498,662	- -	14.90
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	347,351,219	1.6870 586,016,241	1.7529 608,871,951	- -	10.63
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	13,300	3,318.82 44,140,320	3,244.87 43,156,853	- -	0.75

(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

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.75
親投資信託受益証券	98.59
合計	99.35

(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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,425,857,664	1.1905 6,459,592,167	1.1840 6,424,215,474	- -	35.17
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	354,106,194	6.7817 2,401,456,400	7.1589 2,535,010,832	- -	13.88
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,104,957,587	2.1017 2,322,305,574	2.1872 2,416,763,234	- -	13.23
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,590,128,991	1.4823 2,357,128,049	1.5194 2,416,041,988	- -	13.23
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	930,835,756	1.6916 1,574,647,650	1.7529 1,631,661,996	- -	8.93
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	20,500	3,318.82 68,035,832	3,244.87 66,519,962	- -	0.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.36
親投資信託受益証券	84.43
合計	84.80

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,175,793	22,404.38 48,747,303,120	27,488.65 59,809,621,170	- -	5.57
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	972,419	39,670.66 38,576,508,934	48,578.89 47,239,044,872	- -	4.40
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,269,989	14,530.54 18,453,626,240	18,544.22 23,550,956,683	- -	2.19
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	339,903	34,488.68 11,722,806,357	59,187.81 20,118,116,833	- -	1.87
5	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	392,650	30,045.35 11,797,308,472	37,334.92 14,659,558,301	- -	1.37
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	817,691	13,908.41 11,372,783,789	17,268.30 14,120,140,854	- -	1.32
7	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	740,543	13,879.13 10,278,097,686	17,400.24 12,885,633,261	- -	1.20

8	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	304,705	26,537.60 8,086,140,148	40,819.03 12,437,763,968	- -	1.16
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	128,462	71,393.15 9,171,307,171	69,079.03 8,874,031,071	- -	0.83
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	177,835	45,082.53 8,017,252,999	48,848.58 8,686,987,384	- -	0.81
11	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	556,010	16,849.85 9,368,687,028	15,470.43 8,601,715,452	- -	0.80
12	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	357,763	23,380.84 8,364,800,113	23,792.85 8,512,204,614	- -	0.79
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	401,955	20,600.26 8,280,379,098	20,795.91 8,359,022,295	- -	0.78
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	223,475	33,197.48 7,418,807,743	33,974.05 7,592,352,343	- -	0.71
15	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	111,341	50,524.26 5,625,421,894	67,346.40 7,498,416,090	- -	0.70
16	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	57,386	88,336.10 5,069,255,749	125,064.02 7,176,924,098	- -	0.67
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	324,485	20,332.66 6,597,644,690	21,658.60 7,027,892,832	- -	0.65
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	117,138	53,528.89 6,270,268,092	56,208.27 6,584,124,717	- -	0.61
19	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	378,536	17,915.34 6,781,604,321	17,234.43 6,523,854,011	- -	0.61
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	139,221	45,713.96 6,364,344,057	44,630.82 6,213,547,641	- -	0.58
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	55,636	97,754.61 5,438,675,556	105,339.83 5,860,687,338	- -	0.55

22	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	349,501	15,773.41 5,512,824,110	16,462.16 5,753,542,989	- -	0.54
23	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	248,161	24,904.49 6,180,325,342	22,653.23 5,621,650,096	- -	0.52
24	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	228,298	21,300.88 4,862,949,621	22,573.48 5,153,482,163	- -	0.48
25	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・ア パレル・ 贅沢品	38,083	128,270.67 4,884,932,050	134,748.00 5,131,608,084	- -	0.48
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	189,524	25,584.13 4,848,808,424	26,660.76 5,052,854,105	- -	0.47
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	565,896	8,679.31 4,911,590,677	8,702.29 4,924,596,647	- -	0.46
28	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	61,090	72,802.39 4,447,498,231	77,089.73 4,709,411,795	- -	0.44
29	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	243,196	22,198.17 5,398,508,096	19,317.01 4,697,821,436	- -	0.44
30	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	203,949	21,128.53 4,309,144,172	22,369.05 4,562,146,846	- -	0.42

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	95.74
投資信託受益証券	0.15
投資証券	1.86
合計	97.75

（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

2023年6月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	8.02
半導体・半導体製造装置		5.88
コンピュータ・周辺機器		5.78
銀行		5.18
医薬品		5.12
石油・ガス・消耗燃料		4.46
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.80
金融サービス		3.03

保険	2.98
資本市場	2.93
大規模小売り	2.60
ヘルスケア機器・用品	2.40
自動車	2.08
ホテル・レストラン・レジャー	2.08
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.07
化学	1.91
機械	1.84
バイオテクノロジー	1.81
飲料	1.72
電力	1.71
生活必需品流通・小売り	1.70
航空宇宙・防衛	1.67
専門小売り	1.61
食品	1.58
金属・鉱業	1.51
繊維・アパレル・贅沢品	1.37
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.28
情報技術サービス	1.27
娯楽	1.12
家庭用品	1.10
専門サービス	1.05
陸上運輸	1.03
各種電気通信サービス	0.97
コングロマリット	0.91
電気設備	0.86
総合公益事業	0.77
メディア	0.70
通信機器	0.66
建設関連製品	0.61
タバコ	0.60
パーソナルケア用品	0.59
航空貨物・物流サービス	0.56
商業サービス・用品	0.54
電子装置・機器・部品	0.52
商社・流通業	0.44
消費者金融	0.38
建設資材	0.30
建設・土木	0.30
家庭用耐久財	0.29
不動産管理・開発	0.28
エネルギー設備・サービス	0.25
無線通信サービス	0.23
容器・包装	0.21
自動車用部品	0.18
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.13
ガス	0.12
運送インフラ	0.11
販売	0.11

水道	0.10
紙製品・林産品	0.08
旅客航空輸送	0.06
海上運輸	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.02
合計	95.74

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30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 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,739,880,000	82.97 1,443,692,606	82.11 1,428,672,553	1.125 2031/2/15	0.67
2	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,593,440,100	81.61 1,300,520,894	80.79 1,287,449,803	0.875 2030/11/15	0.61
3	FRANCE OAT 6.0 10/25/25 フランス	国債証券	1,129,992,000	106.46 1,203,005,936	106.19 1,199,995,004	6 2025/10/25	0.57
4	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,420,902,000	82.74 1,175,785,395	81.92 1,164,029,560	1.25 2031/8/15	0.55
5	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	1,106,742,150	100.06 1,107,445,965	100.09 1,107,763,451	2.68 2030/5/21	0.52
6	US T N/B 1.5 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,159,920,000	94.59 1,097,257,131	94.38 1,094,742,459	1.5 2025/2/15	0.52
7	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,058,427,000	103.01 1,090,341,744	101.95 1,079,099,401	4.125 2032/11/15	0.51
8	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 10/22/25 中国	国債証券	1,056,888,900	101.77 1,075,654,780	101.73 1,075,252,661	3.02 2025/10/22	0.51
9	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,014,930,000	98.14 996,058,645	97.17 986,305,807	3.5 2033/2/15	0.46
10	US T N/B 1.25 11/30/26 アメリカ	国債証券	1,087,425,000	90.65 985,791,880	90.10 979,786,910	1.25 2026/11/30	0.46
11	FRANCE OAT 0.0 02/25/26 フランス	国債証券	1,040,160,000	92.41 961,232,659	92.18 958,874,438	- 2026/2/25	0.45
12	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	805,336,000	118.12 951,312,180	117.34 944,995,758	4.5 2041/4/25	0.45
13	CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31 中国	国債証券	917,299,800	101.27 928,993,950	101.11 927,518,794	2.89 2031/11/18	0.44
14	US T N/B 3.875 04/30/25 アメリカ	国債証券	942,435,000	98.40 927,440,859	98.05 924,101,698	3.875 2025/4/30	0.44
15	US T N/B 5.375 02/15/31 アメリカ	国債証券	840,942,000	110.46 928,988,627	109.47 920,601,541	5.375 2031/2/15	0.43
16	US T N/B 0.5 02/28/26 アメリカ	国債証券	1,014,930,000	90.28 916,305,717	89.84 911,910,636	0.5 2026/2/28	0.43

17	US T N/B 4.625 02/28/25 アメリカ	国債証券	913,437,000	99.56 909,494,230	99.23 906,479,176	4.625 2025/2/28	0.43
18	US T N/B 4.0 10/31/29 アメリカ	国債証券	898,938,000	100.57 904,079,254	99.67 895,988,359	4 2029/10/31	0.42
19	US T N/B 0.5 03/31/25 アメリカ	国債証券	942,435,000	92.78 874,438,314	92.49 871,660,336	0.5 2025/3/31	0.41
20	US T N/B 4.5 11/15/25 アメリカ	国債証券	869,940,000	99.94 869,461,533	99.50 865,624,279	4.5 2025/11/15	0.41
21	US T N/B 1.875 02/28/27 アメリカ	国債証券	942,435,000	92.27 869,660,169	91.66 863,911,022	1.875 2027/2/28	0.41
22	US T N/B 4.25 05/31/25 アメリカ	国債証券	869,940,000	99.13 862,415,019	98.75 859,099,729	4.25 2025/5/31	0.40
23	US T N/B 3.875 12/31/27 アメリカ	国債証券	869,940,000	99.30 863,920,015	98.59 857,757,438	3.875 2027/12/31	0.40
24	US T N/B 3.875 11/30/27 アメリカ	国債証券	869,940,000	99.30 863,850,420	98.58 857,672,488	3.875 2027/11/30	0.40
25	US T N/B 4.0 02/15/26 アメリカ	国債証券	869,940,000	98.97 860,988,317	98.49 856,839,930	4 2026/2/15	0.40
26	US T N/B 4.0 12/15/25 アメリカ	国債証券	869,940,000	98.92 860,614,243	98.47 856,670,013	4 2025/12/15	0.40
27	US T N/B 4.125 01/31/25 アメリカ	国債証券	869,940,000	98.71 858,759,913	98.44 856,449,135	4.125 2025/1/31	0.40
28	US T N/B 3.875 01/15/26 アメリカ	国債証券	869,940,000	98.61 857,900,030	98.16 853,968,440	3.875 2026/1/15	0.40
29	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	913,437,000	93.47 853,880,907	92.51 845,054,109	2.875 2032/5/15	0.40
30	US T N/B 3.5 01/31/28 アメリカ	国債証券	869,940,000	97.81 850,949,209	97.09 844,674,358	3.5 2028/1/31	0.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	102.61
合計	102.61

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	418,536	17,497.68 7,323,411,356	17,616.28 7,373,049,458	- -	8.77
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	42,380	111,349.57 4,718,994,833	112,661.57 4,774,597,747	- -	5.68
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	71,803	41,724.57 2,995,949,442	41,842.66 3,004,428,810	- -	3.57

4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	305,528	8,643.69 2,640,889,406	8,731.29 2,667,655,954	- -	3.17
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	225,569	11,454.34 2,583,746,219	11,655.74 2,629,174,992	- -	3.13
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	148,408	16,057.30 2,383,033,050	16,639.05 2,469,368,488	- -	2.94
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	132,250	15,136.18 2,001,759,917	16,221.48 2,145,290,888	- -	2.55
8	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	455,859	4,515.01 2,058,211,676	4,549.78 2,074,060,987	- -	2.47
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	64,469	27,452.27 1,769,820,840	27,263.91 1,757,677,632	- -	2.09
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	777,081	1,959.75 1,522,891,057	1,926.89 1,497,351,473	- -	1.78
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	154,861	9,496.64 1,470,659,254	9,485.24 1,468,894,649	- -	1.75
12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	61,339	21,172.58 1,298,705,380	21,454.17 1,315,977,352	- -	1.57
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	264,036	4,955.37 1,308,398,415	4,948.50 1,306,584,443	- -	1.55
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	181,719	6,521.34 1,185,052,231	6,904.42 1,254,664,988	- -	1.49
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	71,520	16,414.69 1,173,978,861	16,437.51 1,175,611,165	- -	1.40
16	MID AMERICA アメリカ	投資証券	52,997	21,993.00 1,165,563,290	22,048.62 1,168,511,207	- -	1.39
17	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	132,501	8,053.09 1,067,042,748	8,142.63 1,078,907,730	- -	1.28
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	56,527	19,134.88 1,081,637,751	18,641.36 1,053,740,399	- -	1.25
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	29,167	33,731.43 983,844,677	33,792.81 985,635,160	- -	1.17
20	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	97,206	9,894.65 961,819,645	9,794.07 952,042,805	- -	1.13
21	LINK REIT 香港	投資証券	1,160,620	836.83 971,244,223	807.52 937,229,665	- -	1.12
22	UDR INC アメリカ	投資証券	140,655	6,154.27 865,629,716	6,217.17 874,476,215	- -	1.04
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	119,409	7,060.93 843,139,429	7,040.71 840,724,665	- -	1.00
24	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	279,669	2,769.23 774,468,353	2,856.30 798,819,403	- -	0.95
25	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	323,392	2,412.40 780,152,712	2,419.88 782,570,835	- -	0.93
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	48,544	16,080.49 780,611,482	15,747.36 764,440,033	- -	0.91

27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	78,969	9,841.34 777,161,232	9,624.43 760,032,102	- -	0.90
28	LIFE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	38,395	18,902.93 725,778,236	19,177.82 736,332,679	- -	0.88
29	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証 券	142,892	5,064.44 723,668,550	5,115.24 730,927,902	- -	0.87
30	SEGRO PLC イギリス	投資証 券	556,558	1,341.67 746,719,389	1,300.77 723,956,454	- -	0.86

(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

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	0.03
投資信託受益証券	10.11
投資証券	89.01
合計	99.14

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
不動産管理・開発	外国	0.03
合計		0.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年6月30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	2,560,824	2,444.96 6,261,134,776	2,670.98 6,839,915,321	- -	6.58
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	646,800	6,803.36 4,400,415,704	6,171.60 3,991,790,880	- -	3.84
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	496,257	7,242.10 3,593,943,932	7,964.00 3,952,190,748	- -	3.80

4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,720,368	1,719.06 2,957,417,597	1,520.69 2,616,163,617	- -	2.52
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	316,531	4,234.10 1,340,224,104	4,502.50 1,425,183,992	- -	1.37
6	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・ レストラ ン・レ ジャー	526,010	2,483.69 1,306,448,484	2,306.94 1,213,478,769	- -	1.17
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	9,992,530	99.07 990,016,143	93.42 933,552,115	- -	0.90
8	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	535,856	1,611.23 863,388,855	1,668.66 894,162,008	- -	0.86
9	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 金融サー ビス	180,705	4,865.67 879,251,856	4,946.61 893,878,967	- -	0.86
10	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	345,402	2,245.63 775,645,226	2,302.16 795,171,704	- -	0.77
11	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	56,829	9,940.59 564,914,206	12,782.00 726,388,278	- -	0.70
12	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	353,689	2,296.42 812,219,050	1,954.43 691,263,378	- -	0.67
13	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,292,932	486.61 629,162,927	526.73 681,036,674	- -	0.66
14	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	658,500	998.73 657,665,665	924.07 608,503,387	- -	0.59
15	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	244,135	2,730.92 666,715,132	2,458.64 600,242,517	- -	0.58
16	BAIDU INC 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	235,150	2,426.57 570,608,441	2,490.10 585,547,015	- -	0.56
17	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	205,200	2,712.73 556,653,468	2,823.10 579,300,120	- -	0.56

18	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	203,464	2,950.42 600,305,199	2,827.28 575,251,732	- -	0.55
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	85,363	6,171.98 526,858,956	6,655.00 568,090,765	- -	0.55
20	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	94,948	5,609.42 532,603,438	5,723.50 543,434,972	- -	0.52
21	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	52,633	10,045.28 528,713,352	9,989.81 525,793,722	- -	0.51
22	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信 サービス	3,280,178	165.44 542,676,659	159.20 522,223,756	- -	0.50
23	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小 売り	20,378	25,771.26 525,166,744	25,593.96 521,553,749	- -	0.50
24	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	158,223	3,266.68 516,863,923	3,244.33 513,328,321	- -	0.49
25	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	5,735,500	87.61 502,543,141	88.75 509,054,302	- -	0.49
26	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	8,267,200	58.29 481,969,479	57.90 478,712,216	- -	0.46
27	BYD CO LTD 中国	株式 自動車	102,500	4,340.78 444,930,705	4,584.30 469,890,750	- -	0.45
28	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	494,812	802.50 397,089,174	925.75 458,074,794	- -	0.44
29	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,876,235	79.89 469,479,134	76.95 452,235,045	- -	0.44
30	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	306,025	1,457.95 446,169,698	1,425.26 436,166,415	- -	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	96.00
投資信託受益証券	0.79
投資証券	0.09
合計	96.87

(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

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
銀行	外国	15.23
半導体・半導体製造装置		9.47
コンピュータ・周辺機器		5.81
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.23
石油・ガス・消耗燃料		4.84
大規模小売り		4.53
金属・鉱業		3.58
化学		2.97
自動車		2.90
電子装置・機器・部品		2.76
保険		2.67
ホテル・レストラン・レジャー		2.44
情報技術サービス		1.97
食品		1.70
無線通信サービス		1.70
金融サービス		1.64
不動産管理・開発		1.60
生活必需品流通・小売り		1.53
各種電気通信サービス		1.39
飲料		1.32
コングロマリット		1.26
医薬品		1.23
電気設備		1.15
娯楽		1.08
電力		1.02
繊維・アパレル・贅沢品		0.95
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス		0.93
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.90
建設資材		0.88
資本市場		0.88
専門小売り		0.80
パーソナルケア用品		0.75
運送インフラ		0.70
バイオテクノロジー		0.67
消費者金融		0.66
建設・土木		0.63
自動車用部品		0.61
ライフサイエンス・ツール / サービス		0.60
機械		0.52
ガス		0.43
家庭用耐久財		0.38
タバコ		0.36
陸上運輸		0.35
旅客航空輸送		0.35
海上運輸		0.33
航空貨物・物流サービス		0.33
航空宇宙・防衛		0.29
ソフトウェア		0.28

通信機器	0.22
ヘルスケア機器・用品	0.19
紙製品・林産品	0.18
各種消費者サービス	0.15
商社・流通業	0.14
水道	0.11
メディア	0.10
家庭用品	0.10
商業サービス・用品	0.06
エネルギー設備・サービス	0.05
レジャー用品	0.03
総合公益事業	0.03
容器・包装	0.03
建設関連製品	0.02
合計	96.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年6月30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	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	2,754,810,000	100.66 2,773,187,482	97.74 2,692,678,015	4.375 2029/4/16	2.05
2	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	2,464,830,000	95.29 2,348,847,399	93.79 2,311,886,706	5.5 2029/2/22	1.76
3	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	2,319,840,000	98.38 2,282,470,857	96.36 2,235,574,131	4.817 2049/3/14	1.70
4	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証券	2,029,860,000	101.90 2,068,453,293	100.44 2,038,844,160	6 2029/8/1	1.55
5	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 ドミニカ共和国	国債証券	2,464,830,000	76.77 1,892,451,959	77.16 1,901,972,241	5.875 2060/1/30	1.45
6	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証券	2,029,860,000	93.74 1,902,790,764	91.64 1,860,163,704	4.4 2050/4/16	1.41
7	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	1,884,870,000	100.01 1,885,136,256	98.67 1,859,881,128	4.375 2031/1/23	1.41
8	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 カタール	国債証券	1,884,870,000	98.00 1,847,172,600	97.27 1,833,413,049	3.4 2025/4/16	1.39
9	BRAZIL 2.875 06/06/25 ブラジル	国債証券	1,884,870,000	95.89 1,807,570,588	95.46 1,799,469,499	2.875 2025/6/6	1.37
10	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,029,860,000	85.72 1,740,118,697	85.37 1,733,068,242	2.783 2031/1/23	1.32

11	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,594,890,000	106.72 1,702,210,148	106.24 1,694,490,880	7.125 2033/1/17	1.29
12	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,884,870,000	89.38 1,684,711,413	88.75 1,672,956,535	3.875 2030/6/12	1.27
13	BRAZIL 4.75 01/14/50 ブラジル	国債証券	2,174,850,000	73.29 1,594,103,740	73.69 1,602,769,561	4.75 2050/1/14	1.22
14	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,594,890,000	100.19 1,598,063,831	98.05 1,563,789,645	4 2029/3/14	1.19
15	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	2,174,850,000	72.08 1,567,740,622	70.59 1,535,335,357	5.75 2049/9/30	1.17
16	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25 サウジアラビア	国債証券	1,594,890,000	96.74 1,542,954,582	95.42 1,521,844,038	2.9 2025/10/22	1.16
17	PANAMA 6.4 02/14/35 パナマ	国債証券	1,449,900,000	104.14 1,509,944,038	104.01 1,508,055,691	6.4 2035/2/14	1.15
18	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	1,623,888,000	92.54 1,502,768,646	92.14 1,496,321,755	6 2033/2/22	1.14
19	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28 サウジアラビア	国債証券	1,449,900,000	102.07 1,479,949,177	99.40 1,441,242,647	4.75 2028/1/18	1.10
20	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,594,890,000	89.63 1,429,639,097	87.95 1,402,825,371	4.85 2029/9/30	1.07
21	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証券	1,449,900,000	98.73 1,431,619,660	96.62 1,400,997,772	3.75 2030/4/16	1.06
22	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証券	1,449,900,000	96.35 1,397,064,194	96.09 1,393,252,407	2.125 2024/9/30	1.06
23	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,449,900,000	96.56 1,400,023,440	95.70 1,387,554,300	2.5 2025/4/16	1.05
24	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証券	1,304,910,000	105.75 1,379,985,826	104.73 1,366,678,867	6.35 2035/2/9	1.04
25	OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28 オマーン	国債証券	1,304,910,000	100.63 1,313,130,933	99.02 1,292,121,882	5.625 2028/1/17	0.98
26	COLOMBIA 7.5 02/02/34 コロンビア	国債証券	1,304,910,000	96.81 1,263,352,452	97.45 1,271,672,245	7.5 2034/2/2	0.97
27	PANAMA 3.87 07/23/60 パナマ	国債証券	1,884,870,000	65.51 1,234,906,435	65.73 1,239,111,728	3.87 2060/7/23	0.94
28	REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27 チリ	国債証券	1,333,908,000	94.36 1,258,715,632	92.85 1,238,560,695	2.75 2027/1/31	0.94
29	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,594,890,000	77.08 1,229,442,705	77.53 1,236,676,111	2.125 2031/9/22	0.94

30	BRAZIL 4.5 05/30/29 ブラジル	国債証 券	1,304,910,000	94.82 1,237,335,522	94.60 1,234,470,488	4.5 2029/5/30	0.94
----	-----------------------------	----------	---------------	------------------------	------------------------	------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	95.93
合計	95.93

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

ワールドアセットバランス(基本コース)

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

該当事項はありません。

(参考)

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

ワールドアセットバランス(基本コース)

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30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 Sep23	買建	567	18,078,931,778	18,233,001,777	1.70

EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep23	買建	588	4,037,148,580	4,058,893,440	0.38
ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep23	買建	77	1,066,361,579	1,054,000,563	0.10
モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep23	買建	32	839,189,967	842,040,460	0.08
シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Sep23	買建	29	493,900,255	496,725,470	0.05

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年6月30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-U S	MINI MSCI EMG MKT Sep23	買建	442	3,251,309,043	3,173,197,493	3.05

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

直近日(2023年6月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月12日)	6,004	6,004	1.0341	1.0341
第2計算期間末 (2017年12月11日)	13,684	13,684	1.0542	1.0542
第3計算期間末 (2018年6月11日)	16,409	16,409	1.0376	1.0376
第4計算期間末 (2018年12月11日)	14,083	14,083	1.0007	1.0007
第5計算期間末 (2019年6月11日)	12,878	12,878	1.0565	1.0565

第6計算期間末 (2019年12月11日)	12,003	12,003	1.0853	1.0853
第7計算期間末 (2020年6月11日)	11,343	11,343	1.0724	1.0724
第8計算期間末 (2020年12月11日)	10,467	10,467	1.1486	1.1486
第9計算期間末 (2021年6月11日)	9,706	9,706	1.1869	1.1869
第10計算期間末 (2021年12月13日)	8,589	8,589	1.1896	1.1896
第11計算期間末 (2022年6月13日)	6,748	6,748	1.0025	1.0025
第12計算期間末 (2022年12月12日)	6,104	6,104	0.9632	0.9632
第13計算期間末 (2023年6月12日)	5,766	5,766	0.9493	0.9493
2022年6月末日	6,626	-	0.9890	-
7月末日	6,801	-	1.0195	-
8月末日	6,510	-	0.9916	-
9月末日	5,945	-	0.9157	-
10月末日	5,925	-	0.9231	-
11月末日	6,098	-	0.9565	-
12月末日	5,953	-	0.9405	-
2023年1月末日	6,148	-	0.9731	-
2月末日	5,927	-	0.9430	-
3月末日	5,891	-	0.9494	-
4月末日	5,858	-	0.9493	-
5月末日	5,766	-	0.9400	-
6月末日	5,729	-	0.9474	-

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

直近日(2023年6月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月12日)	10,386	10,386	1.0337	1.0337
第2計算期間末 (2017年12月11日)	47,243	47,243	1.0544	1.0544
第3計算期間末 (2018年6月11日)	64,853	64,853	1.0356	1.0356
第4計算期間末 (2018年12月11日)	53,883	53,883	0.9975	0.9975
第5計算期間末 (2019年6月11日)	49,438	49,438	1.0392	1.0392
第6計算期間末 (2019年12月11日)	46,310	46,310	1.0681	1.0681
第7計算期間末 (2020年6月11日)	41,188	41,188	1.0437	1.0437

第8計算期間末 (2020年12月11日)	36,032	36,032	1.0685	1.0685
第9計算期間末 (2021年6月11日)	30,943	30,943	1.0971	1.0971
第10計算期間末 (2021年12月13日)	26,061	26,061	1.0983	1.0983
第11計算期間末 (2022年6月13日)	22,061	22,061	1.0041	1.0041
第12計算期間末 (2022年12月12日)	20,162	20,162	0.9801	0.9801
第13計算期間末 (2023年6月12日)	18,479	18,479	0.9676	0.9676
2022年6月末日	21,864	-	0.9993	-
7月末日	21,789	-	1.0047	-
8月末日	21,362	-	0.9963	-
9月末日	20,657	-	0.9759	-
10月末日	20,427	-	0.9755	-
11月末日	20,278	-	0.9795	-
12月末日	19,880	-	0.9750	-
2023年1月末日	19,696	-	0.9802	-
2月末日	19,346	-	0.9680	-
3月末日	19,036	-	0.9706	-
4月末日	18,875	-	0.9691	-
5月末日	18,420	-	0.9607	-
6月末日	18,267	-	0.9647	-

【分配の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
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

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
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

【収益率の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	収益率(%)
第1計算期間	3.4
第2計算期間	1.9
第3計算期間	1.6
第4計算期間	3.6
第5計算期間	5.6
第6計算期間	2.7
第7計算期間	1.2
第8計算期間	7.1
第9計算期間	3.3
第10計算期間	0.2
第11計算期間	15.7
第12計算期間	3.9
第13計算期間	1.4

(注) 収益率は期間騰落率です。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	収益率(%)
第1計算期間	3.4
第2計算期間	2.0
第3計算期間	1.8
第4計算期間	3.7
第5計算期間	4.2
第6計算期間	2.8
第7計算期間	2.3
第8計算期間	2.4
第9計算期間	2.7
第10計算期間	0.1
第11計算期間	8.6
第12計算期間	2.4
第13計算期間	1.3

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,868,621,462	62,212,876
第2計算期間	7,912,713,431	738,193,959

第3計算期間	4,414,882,467	1,581,611,324
第4計算期間	527,482,147	2,267,181,143
第5計算期間	180,523,898	2,065,395,074
第6計算期間	287,056,004	1,416,879,908
第7計算期間	213,369,846	696,011,702
第8計算期間	122,826,944	1,586,765,325
第9計算期間	227,608,795	1,163,074,115
第10計算期間	159,562,024	1,117,350,709
第11計算期間	48,454,636	537,462,741
第12計算期間	34,334,302	427,232,156
第13計算期間	46,465,749	310,561,024

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722
第2計算期間	37,154,151,069	2,394,963,569
第3計算期間	23,144,363,900	5,324,740,324
第4計算期間	2,278,919,156	10,886,978,597
第5計算期間	226,859,362	6,670,815,337
第6計算期間	398,143,626	4,613,079,433
第7計算期間	284,570,545	4,182,089,512
第8計算期間	108,436,378	5,849,150,571
第9計算期間	107,132,818	5,624,497,695
第10計算期間	92,831,691	4,569,076,002
第11計算期間	36,964,114	1,793,363,306
第12計算期間	25,965,966	1,426,678,849
第13計算期間	23,048,616	1,495,063,349

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

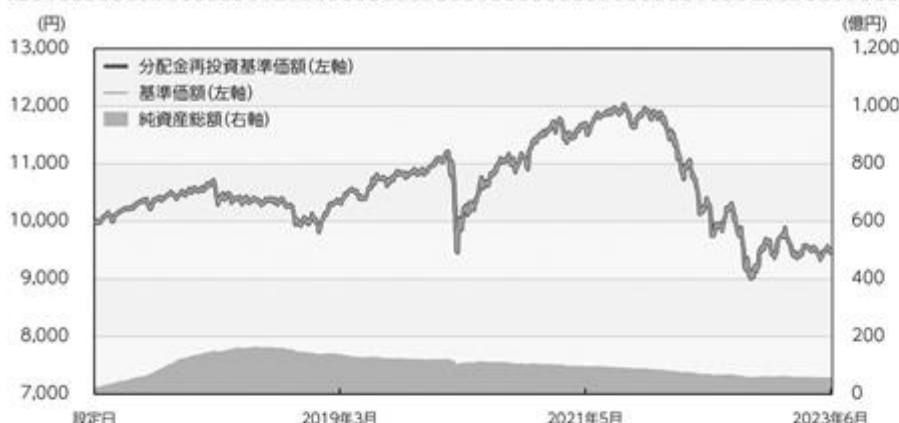
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2023年6月30日

(基本コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2023年6月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2017年1月18日)

分配の推移(税引前)

2021年 6月	0円
2021年 12月	0円
2022年 6月	0円
2022年 12月	0円
2023年 6月	0円
設定来累計	0円

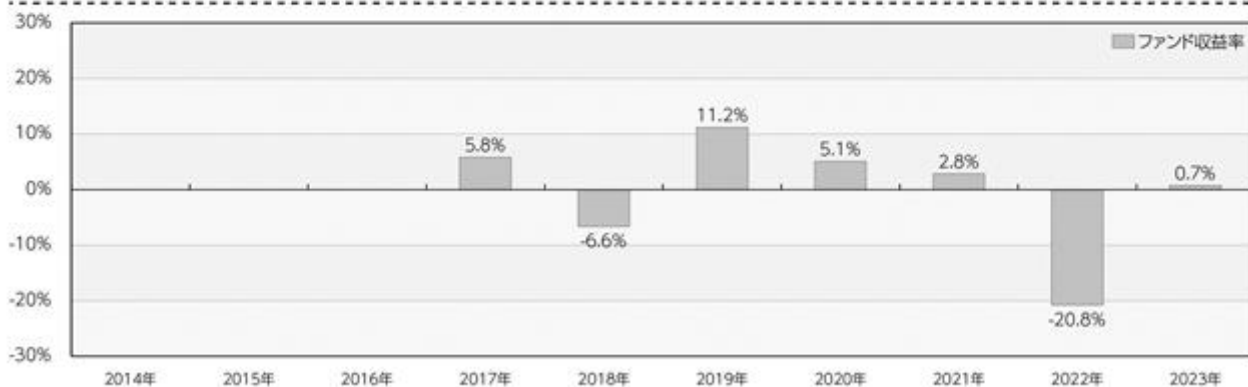
※分配金は1万口当たりです。

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	種類	国/地域	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	40.22
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	16.49
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	16.37
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.90
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.63
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.75

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。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2023年6月30日

(リスク抑制コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2023年6月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2017年1月18日)

分配の推移(税引前)

2021年 6月	0円
2021年12月	0円
2022年 6月	0円
2022年12月	0円
2023年 6月	0円
設定来累計	0円

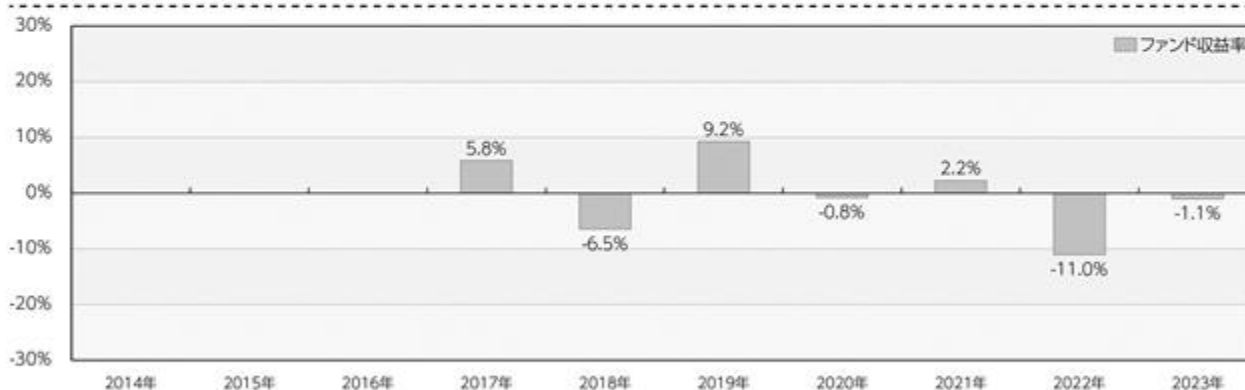
※分配金は1万口当たりです。

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	種類	国/地域	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	35.17
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	13.88
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	13.23
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	13.23
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	8.93
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.36

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。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2023年6月30日

主要な資産の状況

■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	5.57
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.40
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.19
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.87
5	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.37

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.67
2	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.61
3	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	フランス	6	2025/10/25	0.57
4	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.55
5	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	中国	2.68	2030/5/21	0.52

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	8.77
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.68
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.57
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.17
5	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	3.13

■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	6.58
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	3.84
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.80
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.52
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.37

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2023年6月30日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	サウジアラビア	4.375	2029/4/16	2.05
2	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	ドミニカ共和国	5.5	2029/2/22	1.76
3	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	1.70
4	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	国債証券	オマーン	6	2029/8/1	1.55
5	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	国債証券	ドミニカ共和国	5.875	2060/1/30	1.45

○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。

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

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

ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には取得またはスイッチングの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、取得のお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付を中止することおよびすでに受付けた取得のお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）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。委託会社は、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1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://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、2.2%（税抜2.0%）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、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・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します。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位としします。

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
不動産投資信託証券	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
上場先物取引等	計算日 における主たる金融商品取引所等が発表する清算値段または最終相場
上場投資信託証券	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

す。
各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://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、2017年1月18日（設定日）から原則として2027年6月11日までです。

下記(5)その他 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。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（4）【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年6月12日から12月11日まで、および12月12日から翌年6月11日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日よ

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

(5) 【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信

託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、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します。
- b. 委託会社は、上記a. の事項（上記a. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b. の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 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は、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて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、原則として期間満了の1ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、半年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二．公告

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

(URL <http://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6月11日、12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 <http://www.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

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委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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。

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

ワールドアセットバランス(基本コース)

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

(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13期計算期間(2022年12月13日から2023年6月12日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ワールドアセットバランス(基本コース)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 2022年12月12日現在	第13期 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	5,421,935	6,126,982
コール・ローン	245,708,884	110,970,928
投資信託受益証券	40,408,860	42,447,651
親投資信託受益証券	5,849,618,745	5,670,521,762
派生商品評価勘定	4,676,712	-
流動資産合計	6,145,835,136	5,830,067,323
資産合計	6,145,835,136	5,830,067,323
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,849,501	17,301,543
未払解約金	-	9,618,415
未払受託者報酬	1,043,246	978,944
未払委託者報酬	38,254,019	35,896,426
その他未払費用	123,710	116,087
流動負債合計	41,270,476	63,911,415
負債合計	41,270,476	63,911,415
純資産の部		
元本等		
元本	6,338,064,924	6,073,969,649
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	233,500,264	307,813,741
(分配準備積立金)	1,013,784,874	1,007,472,097
元本等合計	6,104,564,660	5,766,155,908
純資産合計	6,104,564,660	5,766,155,908
負債純資産合計	6,145,835,136	5,830,067,323

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期 自 2022年6月14日 至 2022年12月12日	第13期 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
受取配当金	445,334	492,599
受取利息	35,864	107,090
有価証券売買等損益	97,861,050	105,552,895
為替差損益	123,685,277	155,726,318
営業収益合計	221,065,129	49,573,734
営業費用		
支払利息	41,311	25,509
受託者報酬	1,043,246	978,944
委託者報酬	38,254,019	35,896,426
その他費用	1,402,945	1,198,000
営業費用合計	40,741,521	38,098,879
営業利益又は営業損失()	261,806,650	87,672,613
経常利益又は経常損失()	261,806,650	87,672,613
当期純利益又は当期純損失()	261,806,650	87,672,613
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()	12,980,799	4,101,212
期首剰余金又は期首欠損金()	17,110,522	233,500,264
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	11,456,487
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	11,456,487
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,784,935	2,198,563
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,074,591	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	710,344	2,198,563
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	233,500,264	307,813,741

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第13期	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月11日及び12月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2022年12月12日、当計算期間末日を2023年6月12日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期	第13期
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	6,730,962,778円	6,338,064,924円
期中追加設定元本額	34,334,302円	46,465,749円
期中一部解約元本額	427,232,156円	310,561,024円
2. 受益権の総数	6,338,064,924口	6,073,969,649口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は233,500,264円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は307,813,741円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 2022年6月14日 至 2022年12月12日	自 2022年12月13日 至 2023年6月12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（43,335,133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（225,922,694円）及び分配準備積立金（970,449,741円）より分配対象収益は1,239,707,568円（1万口当たり1,955.97円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（43,093,027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（223,718,510円）及び分配準備積立金（964,379,070円）より分配対象収益は1,231,190,607円（1万口当たり2,026.99円）であります。分配を行っておりません。
-------------	--	--

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第12期 自 2022年6月14日 至 2022年12月12日	第13期 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期	第13期
	2022年12月12日現在	2023年6月12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 「(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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期	第13期
	2022年12月12日現在	2023年6月12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)
投資信託受益証券	1,713,411	1,249,878
親投資信託受益証券	96,680,493	108,968,744
合計	98,393,904	110,218,622

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第12期		
	2022年12月12日現在		
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引			評価損益(円)

売建	3,161,066,288	-	3,158,239,077	2,827,211
アメリカ・ドル	2,591,658,013	-	2,589,137,287	2,520,726
イギリス・ポンド	67,679,520	-	68,337,734	658,214
イスラエル・シケル	2,002,835	-	1,989,390	13,445
オーストラリア・ドル	58,516,668	-	58,034,781	481,887
カナダ・ドル	42,708,120	-	41,883,492	824,628
シンガポール・ドル	23,096,186	-	23,124,936	28,750
スイス・フラン	26,156,340	-	26,275,068	118,728
スウェーデン・クローナ	8,742,830	-	8,831,270	88,440
デンマーク・クローネ	6,904,080	-	6,948,360	44,280
ニュージーランド・ドル	2,584,482	-	2,610,018	25,536
ノルウェー・クローネ	2,083,800	-	2,044,695	39,105
メキシコ・ペソ	17,781,599	-	17,304,694	476,905
ユーロ	104,128,660	-	104,768,213	639,553
香港・ドル	179,050,075	-	179,296,075	246,000
南アフリカ・ランド	27,973,080	-	27,653,064	320,016
合計	3,161,066,288	-	3,158,239,077	2,827,211

種類	第13期 2023年6月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	3,245,943,250	-	3,263,244,793	17,301,543
アメリカ・ドル	2,648,031,990	-	2,656,774,400	8,742,410
イギリス・ポンド	68,912,520	-	69,888,000	975,480
イスラエル・シケル	1,860,650	-	1,939,215	78,565
オーストラリア・ドル	58,515,730	-	60,963,500	2,447,770
カナダ・ドル	40,808,080	-	41,652,680	844,600
シンガポール・ドル	23,568,790	-	23,790,441	221,651
スイス・フラン	27,465,606	-	27,732,600	266,994
スウェーデン・クローナ	8,818,890	-	8,850,423	31,533
デンマーク・クローネ	8,358,630	-	8,425,200	66,570
ニュージーランド・ドル	2,494,911	-	2,550,849	55,938
ノルウェー・クローネ	1,753,038	-	1,806,938	53,900
メキシコ・ペソ	21,739,480	-	22,371,160	631,680
ユーロ	115,588,590	-	116,560,626	972,036
香港・ドル	192,994,627	-	193,452,847	458,220
南アフリカ・ランド	25,031,718	-	26,485,914	1,454,196
合計	3,245,943,250	-	3,263,244,793	17,301,543

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

- ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表さ

れている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第12期 2022年12月12日現在	第13期 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9632円 (9,632円)	0.9493円 (9,493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

2023年6月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	13,300.000	304,437.000	
	アメリカ・ドル	小計	13,300.000	304,437.000 (42,447,651)	
投資信託受益証券 合計			13,300	42,447,651 (42,447,651)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	139,068,367	939,671,048	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	347,351,219	586,016,241	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,987,838,573	2,366,521,821	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	594,531,654	878,955,597	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	428,714,394	899,357,055	
日本円 小計			3,497,504,207	5,670,521,762	
親投資信託受益証券 合計			3,497,504,207	5,670,521,762	
合計				5,712,969,413 (42,447,651)	

（注）投資信託受益証券及び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。

（注）

1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.74	0.74

(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。

【ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 2022年12月12日現在	第13期 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	7,945,482	9,017,722
コール・ローン	8,986,189,158	4,758,266,754
国債証券	8,503,960,000	-
投資信託受益証券	62,284,333	65,426,830
親投資信託受益証券	2,783,762,313	13,810,885,612
派生商品評価勘定	2,322,206	-
流動資産合計	20,346,463,492	18,643,596,918
資産合計	20,346,463,492	18,643,596,918
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	939,730	41,097,621
未払解約金	51,953,217	3,255,956
未払受託者報酬	3,473,986	3,168,447
未払委託者報酬	127,381,556	116,178,104
その他未払費用	401,297	375,869
流動負債合計	184,149,786	164,075,997
負債合計	184,149,786	164,075,997
純資産の部		
元本等		
元本	20,570,943,228	19,098,928,495
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	408,629,522	619,407,574
(分配準備積立金)	1,335,701,854	1,251,015,034
元本等合計	20,162,313,706	18,479,520,921
純資産合計	20,162,313,706	18,479,520,921
負債純資産合計	20,346,463,492	18,643,596,918

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期 自 2022年6月14日 至 2022年12月12日	第13期 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
受取配当金	686,418	759,269
受取利息	95,560	184,351
有価証券売買等損益	219,442,316	324,749,303
為替差損益	160,806,511	455,950,673
営業収益合計	379,466,849	130,257,750
営業費用		
支払利息	2,284,104	958,088
受託者報酬	3,473,986	3,168,447
委託者報酬	127,381,556	116,178,104
その他費用	1,604,186	1,654,069
営業費用合計	134,743,832	121,958,708
営業利益又は営業損失()	514,210,681	252,216,458
経常利益又は経常損失()	514,210,681	252,216,458
当期純利益又は当期純損失()	514,210,681	252,216,458
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()	21,966,041	12,388,674
期首剰余金又は期首欠損金()	89,695,172	408,629,522
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	29,703,111
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	29,703,111
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,080,054	653,379
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,815,658	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	264,396	653,379
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	408,629,522	619,407,574

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第13期	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> <p>計算期間末日の取扱い</p> <p>当ファンドは、原則として毎年6月11日及び12月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2022年12月12日、当計算期間末日を2023年6月12日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期	第13期
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	21,971,656,111円	20,570,943,228円
期中追加設定元本額	25,965,966円	23,048,616円
期中一部解約元本額	1,426,678,849円	1,495,063,349円
2. 受益権の総数	20,570,943,228口	19,098,928,495口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は408,629,522円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は619,407,574円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第12期	第13期
	自 2022年6月14日 至 2022年12月12日	自 2022年12月13日 至 2023年6月12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（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（589,909,639円）及び分配準備積立金（1,335,701,854円）より分配対象収益は1,925,611,493円（1万口当たり936.08円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,336,885円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（549,153,272円）及び分配準備積立金（1,238,678,149円）より分配対象収益は1,800,168,306円（1万口当たり942.54円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第12期	第13期
	自 2022年6月14日 至 2022年12月12日	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 2022年12月12日現在	第13期 2023年6月12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 「(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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 2022年12月12日現在	第13期 2023年6月12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)
国債証券	2,809,000	-
投資信託受益証券	2,640,972	1,926,504

親投資信託受益証券	57,571,979	321,753,977
合計	63,021,951	323,680,481

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第12期 2022年12月12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	1,576,172,546	-	1,574,790,070	1,382,476
アメリカ・ドル	1,297,873,976	-	1,296,611,624	1,262,352
イギリス・ポンド	34,665,120	-	35,002,254	337,134
イスラエル・シケル	1,201,701	-	1,193,634	8,067
オーストラリア・ドル	30,651,588	-	30,399,171	252,417
カナダ・ドル	22,370,920	-	21,938,972	431,948
シンガポール・ドル	12,050,184	-	12,065,184	15,000
スイス・フラン	13,078,170	-	13,137,534	59,364
スウェーデン・クローナ	4,567,150	-	4,613,350	46,200
デンマーク・クローネ	3,643,820	-	3,667,190	23,370
ニュージーランド・ドル	1,722,988	-	1,740,012	17,024
ノルウェー・クローネ	1,111,360	-	1,090,504	20,856
メキシコ・ペソ	7,731,130	-	7,523,780	207,350
ユーロ	54,203,960	-	54,536,878	332,918
香港・ドル	79,131,399	-	79,240,119	108,720
南アフリカ・ランド	12,169,080	-	12,029,864	139,216
合計	1,576,172,546	-	1,574,790,070	1,382,476

種類	第13期 2023年6月12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	7,682,189,453	-	7,723,287,074	41,097,621
アメリカ・ドル	6,253,951,140	-	6,274,598,400	20,647,260
イギリス・ポンド	161,944,422	-	164,236,800	2,292,378
イスラエル・シケル	4,465,560	-	4,654,116	188,556
オーストラリア・ドル	139,537,510	-	145,374,500	5,836,990
カナダ・ドル	96,919,190	-	98,925,115	2,005,925
シンガポール・ドル	58,409,610	-	58,958,919	549,309
スイス・フラン	64,086,414	-	64,709,400	622,986
スウェーデン・クローナ	20,449,600	-	20,522,720	73,120
デンマーク・クローネ	19,304,455	-	19,458,200	153,745
ニュージーランド・ドル	6,653,096	-	6,802,264	149,168
ノルウェー・クローネ	4,006,944	-	4,130,144	123,200
メキシコ・ペソ	52,795,880	-	54,329,960	1,534,080
ユーロ	271,188,615	-	273,469,161	2,280,546
香港・ドル	467,715,668	-	468,826,148	1,110,480

南アフリカ・ランド	60,761,349	-	64,291,227	3,529,878
合計	7,682,189,453	-	7,723,287,074	41,097,621

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第12期 2022年12月12日現在	第13期 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9801円 (9,801円)	0.9676円 (9,676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

2023年6月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	20,500.000	469,245.000	
	アメリカ・ドル	小計	20,500.000	469,245.000 (65,426,830)	
投資信託受益証券 合計			20,500	65,426,830 (65,426,830)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	322,810,900	2,181,200,970	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	847,154,047	1,429,233,592	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,003,436,058	5,956,590,627	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,442,572,294	2,132,698,879	

	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,006,369,313	2,111,161,544	
	日本円 小計	8,622,342,612	13,810,885,612	
親投資信託受益証券 合計		8,622,342,612	13,810,885,612	
合計			13,876,312,442 (65,426,830)	

(注) 投資信託受益証券及び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。

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.35	0.47

(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。

(参考)

「ワールドアセットバランス(基本コース)」、「ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)」は、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

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)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,561,476,005
コール・ローン	1,737,159,513
株式	970,425,273,834
投資信託受益証券	1,541,796,692
投資証券	19,137,348,399
派生商品評価勘定	361,554,638
未収入金	16,049,400
未収配当金	1,486,903,601
差入委託証拠金	7,234,405,018
流動資産合計	1,009,501,967,100
資産合計	1,009,501,967,100
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	61,435,757
未払解約金	904,154,000
流動負債合計	965,589,757
負債合計	965,589,757
純資産の部	
元本等	
元本	149,259,481,190
剰余金	
剰余金又は欠損金()	859,276,896,153
元本等合計	1,008,536,377,343
純資産合計	1,008,536,377,343
負債純資産合計	1,009,501,967,100

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年6月12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	133,258,330,696円
同期中追加設定元本額	32,368,052,783円
同期中一部解約元本額	16,366,902,289円
元本の内訳 ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,288,582,790円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,125,963円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	9,485,794円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	23,962,547円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,650,332円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,410,783円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,088,043円
たわらノーロード 先進国株式	47,423,752,647円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	328,969,356円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	3,011,987,843円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	859,953,854円
たわらノーロード バランス(堅実型)	86,841,251円
たわらノーロード バランス(標準型)	760,926,573円
たわらノーロード バランス(積極型)	974,350,983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)	70,892,339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)	284,728,333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)	257,601,153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)	430,056,442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)	614,633円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	20,772,356円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,389,014円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,623,506円
たわらノーロード 全世界株式	788,698,161円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,324,670,252円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,938,114,242円
Oneグローバルバランス	10,755,217円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	154,422,273円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	803,737,408円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,045,744,601円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	91,970,206円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	254,201,346円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	250,065,108円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,699,496円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	662,291,338円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	121,332,992円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	172,541,872円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	195,591,596円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	312,730,910円
投資のソムリエ	9,668,821,746円
クルーズコントロール	149,133,786円
投資のソムリエ<DC年金>	770,140,188円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	198,481,509円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	249,455,533円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	759,930,222円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,967,722,919円
ワールドアセットバランス(基本コース)	139,068,367円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	322,810,900円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	52,233,938円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	25,762,198円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,496,937円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	113,499,379円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	138,969,509円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	748,932,500円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	143,913,106円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	54,513,972円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	28,355,150円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	17,425,030円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	115,231,281円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,112,307円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	40,179,319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)	32,076,566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)	32,835,543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)	19,971,885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)	31,468,382円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	78,926,496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)	28,513,433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)	352,039,701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)	39,969,446円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,117,272,869円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	197,881,023円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,283,292,519円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	261,228,582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)	363,221円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	6,619,754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)	53,299,116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)	3,952,147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)	22,909,834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)	46,457,446円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,624,518円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,381,636円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,079,932円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	32,507円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,079,245円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	19,918,725円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	136,710,553円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	233,068,415円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	789,921,566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)	35,259,564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)	31,352,604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)	215,149,100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)	6,766,038円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	153,287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)	91,814,754円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,383,098円

D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	27,179,762円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	41,115,752円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	87,646,349円
動的パッケージファンド<DC年金>	11,694,657円
コア資産形成ファンド	7,812,638円
MHAM外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,127,003,191円
MHAM外国株式インデックスファンド	137,863,360円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	11,126,755円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	1,437,313,157円
MHAM外国株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,392,425,933円
計	149,259,481,190円
2. 受益権の総数	149,259,481,190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 2022年12月13日 至 2023年6月12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	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年6月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	25,379,627,581	
投資信託受益証券	58,092,028	
投資証券	1,430,657,037	
合計	23,890,878,516	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月16日から2023年6月12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	2023年6月12日現在			
	契約額等（円）	うち		評価損益（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	27,342,744	-	27,342,432	312
イギリス・ポンド	27,342,744	-	27,342,432	312
買建	948,883,206	-	950,432,254	1,549,048
アメリカ・ドル	680,273,028	-	681,538,300	1,265,272
イギリス・ポンド	36,838,279	-	36,987,456	149,177
オーストラリア・ドル	29,308,117	-	29,444,962	136,845
カナダ・ドル	30,090,283	-	30,192,785	102,502
ユーロ	172,373,499	-	172,268,751	104,748
合計	976,225,950	-	977,774,686	1,549,360

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

- ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2023年6月12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	17,277,227,931	-	17,575,797,452	298,569,521
合計	17,277,227,931	-	17,575,797,452	298,569,521

(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)

2023年6月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	6.7569円 (67,569円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年6月12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	1,269,989	123.430	156,754,742.270	
	ABBOTT LABORATORIES	239,645	101.690	24,369,500.050	
	AES CORP	90,680	20.090	1,821,761.200	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	124,595	135.300	16,857,703.500	
	ADVANCED MICRO DEVICES	222,010	124.920	27,733,489.200	
	ADOBE INC	63,152	454.000	28,671,008.000	
	CHUBB LTD	55,721	191.150	10,651,069.150	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	30,190	278.590	8,410,632.100	
	ALLSTATE CORP	36,651	111.960	4,103,445.960	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	90,469	197.890	17,902,910.410	
AMGEN INC	73,868	218.760	16,159,363.680	
HESS CORP	39,151	136.390	5,339,804.890	
AMERICAN EXPRESS CO	85,374	171.720	14,660,423.280	
AMERICAN ELECTRIC POWER	72,574	83.680	6,072,992.320	
AFLAC INC	77,524	68.970	5,346,830.280	
AMERICAN INTL GROUP	101,141	56.880	5,752,900.080	
ANALOG DEVICES	69,871	182.460	12,748,662.660	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	93,288	63.510	5,924,720.880	
VALERO ENERGY CORP	52,681	113.390	5,973,498.590	
ANSYS INC	12,049	325.530	3,922,310.970	
APPLE INC	2,175,793	180.960	393,731,501.280	
APPLIED MATERIALS INC	114,199	136.120	15,544,767.880	
ALBEMARLE CORP	15,528	220.500	3,423,924.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	75,031	72.540	5,442,748.740	
AMEREN CORP	38,938	83.360	3,245,871.680	
ARROW ELECTRONICS INC	9,826	134.160	1,318,256.160	
AUTODESK INC	29,554	201.390	5,951,880.060	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	57,207	215.220	12,312,090.540	
AUTOZONE INC	2,591	2,363.190	6,123,025.290	
AVERY DENNISON CORP	11,542	162.520	1,875,805.840	
BALL CORP	45,691	52.580	2,402,432.780	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	177,835	335.290	59,626,297.150	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	104,946	44.430	4,662,750.780	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	41.970	2,994,013.890	
BECTON DICKINSON & CO	38,402	251.500	9,658,103.000	
AMETEK INC	30,909	150.290	4,645,313.610	
VERIZON COMM INC	577,583	35.470	20,486,869.010	
WR BERKLEY CORP	30,631	57.190	1,751,786.890	
BEST BUY CO INC	29,593	75.240	2,226,577.320	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	361.030	1,090,671.630	
YUM! BRANDS INC	38,365	133.440	5,119,425.600	
FIRSTENERGY CORP	75,630	38.610	2,920,074.300	
BOEING CO	78,181	217.310	16,989,513.110	
ROBERT HALF INTL INC	14,456	72.720	1,051,240.320	
BORGWARNER INC	29,975	45.850	1,374,353.750	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	198,509	51.280	10,179,541.520	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	89.730	1,546,317.090	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	22,659	134.030	3,036,985.770	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,083	1,292.060	3,983,420.980	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	287,363	64.800	18,621,122.400	
ONEOK INC	63,913	59.840	3,824,553.920	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	116.100	1,127,214.900	
UNITED RENTALS INC	9,916	389.020	3,857,522.320	
SEMPRA ENERGY	41,946	147.700	6,195,424.200	
FEDEX CORP	33,799	223.760	7,562,864.240	
VERISIGN INC	13,302	220.970	2,939,342.940	
AMPHENOL CORP	80,212	78.230	6,274,984.760	
BROWN-FORMAN CORP	43,429	64.340	2,794,221.860	
QUANTA SERVICES INC	19,621	182.830	3,587,307.430	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	3.810	387,724.650	
CSX CORP	285,564	32.310	9,226,572.840	
COTERRA ENERGY INC	112,611	24.570	2,766,852.270	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	46.050	1,242,336.900	
CONSTELLATION BRANDS INC	22,672	241.610	5,477,781.920	
CARDINAL HEALTH INC	34,421	86.770	2,986,710.170	
CARLISLE COS INC	7,522	232.660	1,750,068.520	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	13.090	1,731,689.190	
CATERPILLAR INC	69,997	235.030	16,451,394.910	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	126.140	1,593,274.340	
JPMORGAN CHASE & CO	401,955	141.010	56,679,674.550	
CHURCH & DWIGHT CO INC	34,837	94.100	3,278,161.700	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,671	101.930	2,310,855.030	
CINTAS CORP	12,807	480.430	6,152,867.010	
CISCO SYSTEMS INC	561,582	49.660	27,888,162.120	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	16.000	1,109,936.000	
CLOROX COMPANY	16,085	156.660	2,519,876.100	
COCA-COLA CO/THE	565,896	60.470	34,219,731.120	
COPART INC	58,789	85.740	5,040,568.860	
COGNEX CORP	25,772	55.300	1,425,191.600	
COLGATE-PALMOLIVE CO	107,989	75.840	8,189,885.760	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	36,790	179.010	6,585,777.900	
MOLINA HEALTHCARE INC	7,515	284.340	2,136,815.100	
NRG ENERGY, INC.	28,364	34.080	966,645.120	
COMCAST CORP-CL A	582,232	40.230	23,423,193.360	
CONAGRA BRANDS INC	71,055	34.380	2,442,870.900	
CONSOLIDATED EDISON INC	48,354	93.490	4,520,615.460	
CMS ENERGY CORP	43,873	60.690	2,662,652.370	
COOPER COS INC	7,281	346.150	2,520,318.150	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	66.460	1,680,175.260	
CORNING INC	107,051	32.780	3,509,131.780	
WOLFSPEED INC	15,684	53.130	833,290.920	

SEALED AIR CORP	17,610	38.620	680,098.200	
HEICO CORP-CL A	9,463	130.710	1,236,908.730	
CUMMINS INC	19,320	226.630	4,378,491.600	
DARLING INTERNATIONAL INC	20,032	63.090	1,263,818.880	
DR HORTON INC	44,965	114.010	5,126,459.650	
DANAHER CORP	95,803	235.370	22,549,152.110	
MOODY'S CORP	22,447	335.480	7,530,519.560	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	70,798	62.050	4,393,015.900	
TARGET CORP	62,648	126.990	7,955,669.520	
DEERE & CO	38,577	378.870	14,615,667.990	
MORGAN STANLEY	170,897	86.210	14,733,030.370	
REPUBLIC SERVICES INC	30,250	143.300	4,334,825.000	
COSTAR GROUP INC	53,950	80.140	4,323,553.000	
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	488.330	1,820,005.910	
THE WALT DISNEY CO	250,759	91.930	23,052,274.870	
DOLLAR TREE INC	30,183	131.770	3,977,213.910	
DOVER CORP	20,492	141.140	2,892,240.880	
OMNICOM GROUP	26,570	94.490	2,510,599.300	
DTE ENERGY CO	30,474	111.430	3,395,717.820	
DUKE ENERGY CORP	104,098	91.520	9,527,048.960	
DARDEN RESTAURANTS INC	15,676	161.910	2,538,101.160	
EBAY INC	75,181	45.810	3,444,041.610	
BANK OF AMERICA CORP	987,126	29.270	28,893,178.020	
CITIGROUP INC	263,520	48.300	12,728,016.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	80.480	1,351,259.200	
EATON CORP PLC	53,791	187.300	10,075,054.300	
CADENCE DESIGN SYS INC	37,427	229.300	8,582,011.100	
ECOLAB INC	35,033	177.480	6,217,656.840	
REVVITY INC	17,972	111.090	1,996,509.480	
ELECTRONIC ARTS INC	37,893	125.940	4,772,244.420	
SALESFORCE INC	137,515	215.310	29,608,354.650	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	218.200	735,770.400	
EMERSON ELECTRIC CO	80,180	84.200	6,751,156.000	
ATMOS ENERGY CORP	21,185	117.330	2,485,636.050	
ENTERGY CORP	30,815	101.440	3,125,873.600	
EOG RESOURCES INC	80,746	116.250	9,386,722.500	
EQUIFAX INC	17,053	223.840	3,817,143.520	
EQT CORP	51,269	38.550	1,976,419.950	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	31,545	176.530	5,568,638.850	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	20,309	115.310	2,341,830.790	
EXXON MOBIL CORP	556,010	107.390	59,709,913.900	
FMC CORP	17,711	105.630	1,870,812.930	
NEXTERA ENERGY INC	278,694	74.070	20,642,864.580	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	397.580	2,151,702.960	
FAIR ISAAC CORP	3,376	774.710	2,615,420.960	
ASSURANT INC	8,276	125.520	1,038,803.520	

FASTENAL CO	78,930	54.770	4,322,996.100	
FIFTH THIRD BANCORP	102,090	26.410	2,696,196.900	
M&T BANK CORP	24,502	126.920	3,109,793.840	
FIRST HORIZON CORP	69,634	11.710	815,414.140	
FISERV INC	85,633	116.820	10,003,647.060	
FORD MOTOR CO	538,775	13.740	7,402,768.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	26.370	999,844.920	
FREEPORT-MCMORAN INC	200,156	37.890	7,583,910.840	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	1,284.970	2,039,247.390	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,820	206.870	6,168,863.400	
DENTSPLY SIRONA INC	33,798	38.420	1,298,519.160	
GENERAL DYNAMICS CORP	32,087	212.270	6,811,107.490	
GENERAL MILLS INC	78,625	82.300	6,470,837.500	
GENUINE PARTS CO	19,809	155.820	3,086,638.380	
GILEAD SCIENCES INC	172,546	78.120	13,479,293.520	
GARTNER INC	10,481	344.550	3,611,228.550	
MCKESSON CORP	19,309	393.910	7,606,008.190	
NVIDIA CORP	339,903	387.700	131,780,393.100	
GRACO INC	23,985	82.550	1,979,961.750	
GENERAL ELECTRIC CO	149,878	106.300	15,932,031.400	
WW GRAINGER INC	6,276	706.480	4,433,868.480	
HALLIBURTON CO	125,763	32.340	4,067,175.420	
MONSTER BEVERAGE CORP	106,953	57.250	6,123,059.250	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	45,599	336.020	15,322,175.980	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	26,202	188.590	4,941,435.180	
HASBRO INC	21,174	60.290	1,276,580.460	
HENRY SCHEIN INC	17,431	74.860	1,304,884.660	
HEICO CORP	6,878	163.610	1,125,309.580	
HERSHEY FOODS CORP	20,089	255.820	5,139,167.980	
HP INC	124,613	29.800	3,713,467.400	
F5 INC	8,981	146.780	1,318,231.180	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	83.770	1,283,523.940	
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,222	228.490	1,421,664.780	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	30.190	1,319,755.850	
HOLOGIC INC	34,146	77.760	2,655,192.960	
HOME DEPOT INC	139,221	297.350	41,397,364.350	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	91.370	2,404,767.030	
HORMEL FOODS CORP	38,851	40.870	1,587,840.370	
CENTERPOINT ENERGY INC	80,118	28.950	2,319,416.100	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,776	303.380	1,448,942.880	
HUBBELL INC	6,903	306.860	2,118,254.580	
HUMANA INC	17,317	513.340	8,889,508.780	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,380	170.040	1,765,015.200	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	182,806	10.950	2,001,725.700	

BIODEN INC	19,778	308.880	6,109,028.640	
IDEX CORP	11,156	206.860	2,307,730.160	
ILLINOIS TOOL WORKS	41,288	237.510	9,806,312.880	
INTUIT INC	38,669	431.550	16,687,606.950	
IDEX LABORATORIES INC	11,400	450.870	5,139,918.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	31,231	176.230	5,503,839.130	
INTEL CORP	575,239	31.340	18,027,990.260	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	35,897	78.240	2,808,581.280	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	31.680	1,398,767.040	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	39.630	2,142,516.690	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9,506	157.890	1,500,902.340	
INCYTE CORP	24,449	61.040	1,492,366.960	
JOHNSON & JOHNSON	357,763	160.010	57,245,657.630	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	44,033	71.320	3,140,433.560	
KLA CORPORATION	19,222	465.650	8,950,724.300	
DEVON ENERGY CORP	86,347	49.870	4,306,124.890	
KELLOGG CO	40,921	67.160	2,748,254.360	
KEYCORP	118,955	10.680	1,270,439.400	
KIMBERLY-CLARK CORP	46,140	134.500	6,205,830.000	
BLACKROCK INC/NEW YORK	20,627	684.400	14,117,118.800	
KROGER CO	93,167	46.170	4,301,520.390	
LAM RESEARCH CORP	18,529	606.590	11,239,506.110	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	391.990	2,571,846.390	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,551	130.800	1,772,470.800	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	80.550	1,631,943.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	19,837	92.480	1,834,525.760	
LENNAR CORP	32,795	114.200	3,745,189.000	
ELI LILLY & CO	111,341	446.040	49,662,539.640	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	42.230	1,189,027.880	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	98,414	170.490	16,778,602.860	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	40,493	115.790	4,688,684.470	
LOCKHEED MARTIN CORP	31,757	462.690	14,693,646.330	
LOEWS CORP	29,698	59.340	1,762,279.320	
LOWE'S COS INC	81,444	209.120	17,031,569.280	
DOMINION ENERGY INC	114,318	53.090	6,069,142.620	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	41.330	1,669,773.330	
MCCORMICK & CO INC	35,510	90.670	3,219,691.700	
MCDONALD'S CORPORATION	100,043	286.790	28,691,331.970	
S&P GLOBAL INC	44,553	384.000	17,108,352.000	
EVEREST RE GROUP LTD	5,666	344.590	1,952,446.940	

MARKEL GROUP INC	1,713	1,342.270	2,299,308.510	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	82,034	84.100	6,899,059.400	
MARSH & MCLENNAN COS	66,743	178.250	11,896,939.750	
MASCO CORP	28,937	53.960	1,561,440.520	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	8,614	427.260	3,680,417.640	
METLIFE INC	90,251	53.870	4,861,821.370	
MEDTRONIC PLC	183,664	83.730	15,378,186.720	
ACTIVISION BLIZZARD INC	102,651	80.380	8,251,087.380	
CVS HEALTH CORP	177,420	71.760	12,731,659.200	
MERCK & CO. INC.	349,501	110.710	38,693,255.710	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,157	89.020	5,266,156.140	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,455	217.570	2,492,264.350	
MICROSOFT CORP	972,419	326.790	317,776,805.010	
MICRON TECH INC	147,693	65.430	9,663,552.990	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	74,690	80.070	5,980,428.300	
3M CO	75,232	99.900	7,515,676.800	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	95.350	601,753.850	
ENTEGRIS INC	20,987	109.080	2,289,261.960	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	6,445	197.680	1,274,047.600	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,690	277.990	6,307,593.100	
ILLUMINA INC	21,684	200.530	4,348,292.520	
XCEL ENERGY INC	74,522	63.450	4,728,420.900	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,755	93.390	1,377,969.450	
NETAPP INC	28,265	69.710	1,970,353.150	
NEWMONT CORP	107,944	41.460	4,475,358.240	
NVR INC	462	5,817.960	2,687,897.520	
NIKE INC-CL B	169,660	105.860	17,960,207.600	
NORDSON CORP	6,447	232.150	1,496,671.050	
NORFOLK SOUTHERN CORP	31,621	216.180	6,835,827.780	
EVERSOURCE ENERGY	48,081	70.370	3,383,459.970	
NISOURCE INC	53,270	27.090	1,443,084.300	
NORTHERN TRUST CORP	28,092	74.830	2,102,124.360	
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,567	454.260	8,888,505.420	
WELLS FARGO & CO	512,918	42.130	21,609,235.340	
NUCOR CORP	34,996	145.550	5,093,667.800	
CHENIERE ENERGY INC	33,619	147.140	4,946,699.660	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	52,546	111.490	5,858,353.540	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,019	59.320	5,873,807.080	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13,006	306.190	3,982,307.140	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,516	906.990	7,723,926.840	

ORACLE CORP	222,372	109.850	24,427,564.200	
PACCAR INC	71,053	76.830	5,459,001.990	
PTC INC	15,968	138.570	2,212,685.760	
EXELON CORP	134,582	40.080	5,394,046.560	
PARKER HANNIFIN CORP	17,462	356.130	6,218,742.060	
PAYCHEX INC	44,228	111.690	4,939,825.320	
ALIGN TECHNOLOGY INC	9,713	304.440	2,957,025.720	
PPL CORPORATION	102,363	26.820	2,745,375.660	
PEPSICO INC	189,524	182.350	34,559,701.400	
PENTAIR PLC	25,821	59.170	1,527,828.570	
PFIZER INC	778,289	38.970	30,329,922.330	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	41.610	1,364,641.560	
CONOCOPHILLIPS	167,119	103.890	17,361,992.910	
PG&E CORP	245,527	16.880	4,144,495.760	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	32,591	204.800	6,674,636.800	
ALTRIA GROUP INC	243,422	45.220	11,007,542.840	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	55,104	128.930	7,104,558.720	
BROWN & BROWN INC	30,650	64.030	1,962,519.500	
GARMIN LTD	19,911	105.340	2,097,424.740	
PPG INDUSTRIES INC	31,297	139.670	4,371,251.990	
COSTCO WHOLESALE CORP	61,090	517.280	31,600,635.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	31,190	114.470	3,570,319.300	
QUEST DIAGNOSTICS	14,536	134.550	1,955,818.800	
PROCTER & GAMBLE CO	324,485	146.560	47,556,521.600	
PROGRESSIVE CORP	81,255	130.900	10,636,279.500	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68,538	62.070	4,254,153.660	
PULTE GROUP INC	29,050	71.990	2,091,309.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,196	100.090	3,722,947.640	
QUALCOMM INC	153,782	119.110	18,316,974.020	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,105	95.680	2,784,766.400	
EXACT SCIENCES CORP	23,386	87.810	2,053,524.660	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	7,931	246.620	1,955,943.220	
REGENERON PHARMACEUTICALS	14,886	746.520	11,112,696.720	
REPLIGEN CORP	6,730	162.190	1,091,538.700	
RESMED INC	20,171	213.530	4,307,113.630	
US BANCORP	213,414	32.860	7,012,784.040	
SEAGEN INC	18,653	196.600	3,667,179.800	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	51,936	71.440	3,710,307.840	
ROSS STORES INC	47,578	103.290	4,914,331.620	
ROLLINS INC	36,205	40.800	1,477,164.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	14,373	451.800	6,493,721.400	
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,768	305.500	4,817,124.000	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	31,833	91.220	2,903,806.260	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	82.930	1,365,608.310	
ACCENTURE PLC-CL A	86,958	308.720	26,845,673.760	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	187,880	72.970	13,709,603.600	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,340	225.700	3,236,538.000	
AXON ENTERPRISE INC	9,177	194.820	1,787,863.140	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	31,733	175.600	5,572,314.800	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	82,528	54.660	4,510,980.480	
BOOKING HOLDINGS INC	5,209	2,606.130	13,575,331.170	
SCHLUMBERGER LTD	193,046	47.530	9,175,476.380	
SCHWAB (CHARLES) CORP	207,590	55.000	11,417,450.000	
POOL CORP	5,406	326.420	1,764,626.520	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	28,920	136.010	3,933,409.200	
BUNGE LTD	21,715	93.620	2,032,958.300	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	58.840	851,826.680	
ELEVANCE HEALTH INC	32,178	470.170	15,129,130.260	
AMERISOURCEBERGEN CORP	23,804	178.220	4,242,348.880	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31,921	71.390	2,278,840.190	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	33,603	240.760	8,090,258.280	
CENTENE CORP	78,244	69.000	5,398,836.000	
SMITH (A.O.) CORP	19,467	68.790	1,339,134.930	
SNAP-ON INC	7,068	267.580	1,891,255.440	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	50,944	84.550	4,307,315.200	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	63.580	455,550.700	
EDISON INTERNATIONAL	52,609	67.720	3,562,681.480	
SOUTHERN CO	146,824	71.260	10,462,678.240	
TRUIST FINANCIAL CORP	182,655	32.630	5,960,032.650	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	30.620	603,214.000	
AT&T INC	980,199	15.950	15,634,174.050	
CHEVRON CORP	248,161	158.860	39,422,856.460	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	84.600	1,630,242.000	
STATE STREET CORP	50,667	73.910	3,744,797.970	
STARBUCKS CORP	158,134	97.960	15,490,806.640	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	99.220	2,275,809.140	
STRYKER CORP	47,233	280.640	13,255,469.120	
NETFLIX INC	61,222	420.020	25,714,464.440	
GEN DIGITAL INC	89,004	17.820	1,586,051.280	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,318	55.740	1,132,525.320	
SYNOPSYS INC	20,823	438.780	9,136,715.940	
SYSCO CORP	67,797	72.540	4,917,994.380	

INTUITIVE SURGICAL INC	48,538	312.760	15,180,744.880	
TELEFLEX INC	6,985	237.060	1,655,864.100	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	134,781	7.330	987,944.730	
TERADYNE INC	22,066	105.020	2,317,371.320	
TEXAS INSTRUMENTS INC	125,384	170.590	21,389,256.560	
TEXTRON INC	25,824	65.290	1,686,048.960	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	52,868	518.180	27,395,140.240	
GLOBE LIFE INC	12,153	107.930	1,311,673.290	
TORO CO	14,644	96.740	1,416,660.560	
DAVITA INC	6,813	97.480	664,131.240	
TRACTOR SUPPLY CO	15,260	217.220	3,314,777.200	
BIO-TECHNE CORP	20,652	78.430	1,619,736.360	
TRIMBLE INC	36,251	50.110	1,816,537.610	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,996	388.670	2,330,465.320	
TYSON FOODS INC	41,316	50.370	2,081,086.920	
UGI CORP	33,476	29.380	983,524.880	
MARATHON OIL CORP	84,059	23.550	1,979,589.450	
UNION PACIFIC CORP	84,314	199.670	16,834,976.380	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	200,910	99.340	19,958,399.400	
UNITEDHEALTH GROUP INC	128,462	493.620	63,411,412.440	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	136.380	1,104,132.480	
VF CORP	51,762	19.110	989,171.820	
PARAMOUNT GLOBAL	78,663	16.100	1,266,474.300	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	34,956	334.110	11,679,149.160	
VULCAN MATERIALS CO	18,430	206.640	3,808,375.200	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	98,551	31.420	3,096,472.420	
WALMART INC	203,949	153.090	31,222,552.410	
WASTE MANAGEMENT INC	55,635	162.680	9,050,701.800	
WATERS CORP	8,441	249.280	2,104,172.480	
WATSCO INC	4,889	351.830	1,720,096.870	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	38.750	863,543.750	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,639	348.280	3,705,350.920	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,386	153.570	2,362,828.020	
VAIL RESORTS INC	5,235	239.660	1,254,620.100	
WESTERN DIGITAL CORP	40,723	39.780	1,619,960.940	
WABTEC CORP	24,118	99.050	2,388,887.900	
WHIRLPOOL CORP	6,832	142.060	970,553.920	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	104.490	2,323,335.150	
WYNN RESORTS LTD	15,379	102.210	1,571,887.590	
NASDAQ INC	47,600	57.830	2,752,708.000	
CME GROUP INC	48,821	184.840	9,024,073.640	
WILLIAMS COS INC	166,525	30.390	5,060,694.750	

DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	135.720	1,160,541.720	
LKQ CORP	37,072	54.300	2,013,009.600	
ALLIANT ENERGY CORP	33,966	53.230	1,808,010.180	
WEC ENERGY GROUP INC	43,488	89.930	3,910,875.840	
CARMAX INC	22,414	78.810	1,766,447.340	
TJX COMPANIES INC	155,600	79.360	12,348,416.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	6,730	274.660	1,848,461.800	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	4.180	652,284.820	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	50.170	1,180,399.760	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,146	190.830	3,271,971.180	
CBRE GROUP INC	41,089	78.940	3,243,565.660	
LIBERTY GLOBAL PLC	35,049	16.760	587,421.240	
REGIONS FINANCIAL CORP	122,025	18.470	2,253,801.750	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	298.070	1,531,185.590	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,003	501.870	3,012,725.610	
WESTLAKE CORP	4,187	111.400	466,431.800	
T-MOBILE US INC	83,642	131.360	10,987,213.120	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	58.480	2,796,513.600	
MOSAIC CO/THE	48,502	35.080	1,701,450.160	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	276.650	1,347,562.150	
CELANESE CORP	13,613	113.630	1,546,845.190	
DEXCOM INC	52,999	124.340	6,589,895.660	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,428	122.080	2,371,770.240	
EXPEDIA GROUP INC	19,389	110.480	2,142,096.720	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	25,070	67.970	1,704,007.900	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,506	314.350	4,559,961.100	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	36,034	17.740	639,243.160	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	75,703	109.960	8,324,301.880	
LIVE NATION	25,515	84.150	2,147,087.250	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,784	2,040.550	7,721,441.200	
TRANSDIGM GROUP INC	7,625	800.010	6,100,076.250	
MASTERCARD INC	117,138	369.220	43,249,692.360	
OWENS CORNING	13,227	118.150	1,562,770.050	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	82.910	1,497,437.510	
AERCAP HOLDINGS NV	24,379	59.590	1,452,744.610	
FIRST SOLAR INC	13,287	192.000	2,551,104.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	15,300	153.840	2,353,752.000	
AECOM TECHNOLOGY CORP	17,000	83.570	1,420,690.000	
DELTA AIR LINES INC	21,592	39.280	848,133.760	

INSULET CORP	9,083	283.090	2,571,306.470	
DISCOVER FINANCIAL	35,918	114.140	4,099,680.520	
TE CONNECTIVITY LTD	43,069	128.000	5,512,832.000	
MASIMO CORP	7,328	156.340	1,145,659.520	
LULULEMON ATHLETICA INC	15,887	360.400	5,725,674.800	
VMWARE INC	32,329	135.380	4,376,700.020	
MERCADOLIBRE INC	6,180	1,208.550	7,468,839.000	
ULTA BEAUTY INC	6,797	423.620	2,879,345.140	
INVESCO LTD	57,267	16.140	924,289.380	
MSCI INC	10,921	473.850	5,174,915.850	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	214,505	92.590	19,861,017.950	
VISA INC	223,475	223.560	49,960,071.000	
KEURIG DR PEPPER INC	130,795	31.310	4,095,191.450	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,549	146.660	3,893,676.340	
MARATHON PETROLEUM CORP	61,386	113.010	6,937,231.860	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	65.760	1,064,128.320	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	279,350	17.030	4,757,330.500	
XYLEM INC	33,760	109.710	3,703,809.600	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,537	89.020	3,341,543.740	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,330	215.310	1,362,912.300	
SPLUNK INC	20,626	98.890	2,039,705.140	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	211.330	1,724,875.460	
HCA HEALTHCARE INC	28,857	271.790	7,843,044.030	
VERISK ANALYTICS INC	20,276	219.360	4,447,743.360	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,792	127.100	990,363.200	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,881	239.370	2,125,844.970	
NXP SEMICONDUCTOR NV	35,214	185.000	6,514,590.000	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,741	103.510	2,043,390.910	
TARGA RESOURCES CORP	26,950	70.810	1,908,329.500	
LEAR CORP	9,620	138.110	1,328,618.200	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,261	138.430	2,112,580.230	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	28,639	56.500	1,618,103.500	
DOLLAR GENERAL CORP	30,721	153.050	4,701,849.050	
FORTINET INC	90,828	68.010	6,177,212.280	
HYATT HOTELS CORP	6,647	115.610	768,459.670	
HORIZON PHARMA PLC	28,293	99.250	2,808,080.250	
TESLA INC	392,650	244.400	95,963,660.000	
GENERAC HOLDINGS INC	9,111	116.770	1,063,891.470	
ENPHASE ENERGY INC	18,723	174.580	3,268,661.340	
GENERAL MOTORS CO	193,897	36.230	7,024,888.310	

ALLY FINANCIAL INC	39,230	28.000	1,098,440.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	10,655	204.520	2,179,160.600	
APTIV PLC	37,576	97.990	3,682,072.240	
PHILLIPS 66	64,680	98.760	6,387,796.800	
META PLATFORMS INC	304,705	264.950	80,731,589.750	
IQVIA HOLDINGS INC	25,473	206.590	5,262,467.070	
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,714	132.280	3,269,167.920	
SERVICENOW INC	28,127	534.030	15,020,661.810	
PALO ALTO NETWORKS INC	41,229	220.100	9,074,502.900	
WORKDAY INC	28,345	204.380	5,793,151.100	
ABBVIE INC	243,196	138.180	33,604,823.280	
ZOETIS INC	63,475	163.090	10,352,137.750	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	19.210	1,041,393.310	
CDW CORP	18,651	170.440	3,178,876.440	
HOWMET AEROSPACE INC	55,049	45.940	2,528,951.060	
TWILIO INC	25,710	63.890	1,642,611.900	
SNAP INC	152,250	10.090	1,536,202.500	
TRADE DESK INC A	61,854	74.580	4,613,071.320	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	28,191	75.640	2,132,367.240	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	29.650	589,175.150	
OKTA INC	21,831	71.400	1,558,733.400	
BLACK KNIGHT INC	21,663	56.120	1,215,727.560	
BAKER HUGHES CO	137,839	30.010	4,136,548.390	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	18,557	113.620	2,108,446.340	
BROADCOM INC	57,386	804.620	46,173,923.320	
ARES MANAGEMENT CORP	23,111	92.220	2,131,296.420	
MONGODB INC	9,021	374.510	3,378,454.710	
BURLINGTON STORES INC	8,453	145.510	1,229,996.030	
VEEVA SYSTEMS INC	20,611	187.610	3,866,829.710	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,938	43.820	1,092,783.160	
EVERGY INC	33,192	59.400	1,971,604.800	
ALLEGION PLC	13,423	112.650	1,512,100.950	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	63.440	1,161,840.160	
STERIS PLC	14,147	206.980	2,928,146.060	
DOCUSIGN INC	26,362	57.020	1,503,161.240	
WIX.COM LTD	8,997	73.820	664,158.540	
DROPBOX INC	45,227	24.000	1,085,448.000	
KKR & CO INC	84,487	55.180	4,661,992.660	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	41.700	210,585.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	67.140	2,273,158.980	
MODERNA INC	44,693	123.260	5,508,859.180	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	37,524	141.530	5,310,771.720	
ARAMARK	31,133	40.300	1,254,659.900	
CIGNA GROUP	41,150	265.880	10,940,962.000	

DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	47.610	1,560,179.700	
DOW INC	96,707	51.740	5,003,620.180	
OVINTIV INC	31,603	37.720	1,192,065.160	
AMCOR PLC	188,789	10.010	1,889,777.890	
PINTEREST INC	79,624	23.870	1,900,624.880	
FOX CORP-A	36,501	33.540	1,224,243.540	
FOX CORP-B	28,295	31.400	888,463.000	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	8.210	349,631.060	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	31,369	149.530	4,690,606.570	
CHEWY INC	9,648	36.800	355,046.400	
AVANTOR INC	97,157	19.630	1,907,191.910	
DYNATRACE INC	32,648	50.960	1,663,742.080	
CLOUDFLARE INC	35,474	63.820	2,263,950.680	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	70.810	977,178.000	
CARRIER GLOBAL CORP	113,892	45.300	5,159,307.600	
OTIS WORLDWIDE CORP	56,437	85.660	4,834,393.420	
UBER TECHNOLOGIES INC	250,802	40.990	10,280,373.980	
CORTEVA INC	97,725	56.440	5,515,599.000	
MATCH GROUP INC	35,259	41.590	1,466,421.810	
FERGUSON PLC	27,517	144.570	3,978,132.690	
BILL HOLDINGS INC	11,988	115.260	1,381,736.880	
BLACKSTONE INC	95,741	88.190	8,443,398.790	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,322	182.440	970,945.680	
CARLYLE GROUP INC	24,530	30.050	737,126.500	
DATADOG INC	35,218	95.630	3,367,897.340	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	60.890	1,564,203.210	
INGERSOLL RAND INC	58,584	62.460	3,659,156.640	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	50,030	77.100	3,857,313.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	7,334	304.700	2,234,669.800	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	13.870	1,295,818.620	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	36.300	1,119,455.700	
AON PLC	27,982	314.320	8,795,302.240	
WARNER BROS DISCOVERY INC	320,115	13.840	4,430,391.600	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,392.940	1,262,003.640	
BENTLEY SYSTEMS INC	28,502	50.640	1,443,341.280	
COINBASE GLOBAL INC	23,696	53.280	1,262,522.880	
UIPATH INC	53,439	17.170	917,547.630	
AIRBNB INC	57,463	117.860	6,772,589.180	
CONSTELLATION ENERGY CORP	44,942	93.290	4,192,639.180	
MONDAY.COM LTD	3,043	174.720	531,672.960	
ROYALTY PHARMA PLC	48,700	32.910	1,602,717.000	
ROBLOX CORP	59,573	38.690	2,304,879.370	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	41,904	26.150	1,095,789.600	
VIATRIS INC	150,826	9.380	1,414,747.880	

CAESARS ENTERTAINMENT INC	26,734	48.500	1,296,599.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	79.900	1,266,095.400	
HF SINCLAIR CORP	20,299	45.820	930,100.180	
SNOWFLAKE INC	36,404	170.650	6,212,342.600	
DOORDASH INC	33,971	71.780	2,438,438.380	
ARISTA NETWORKS INC	36,116	162.520	5,869,572.320	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	55,400	72.980	4,043,092.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	254,570	15.020	3,823,641.400	
FNF GROUP	31,004	35.400	1,097,541.600	
JACOBS SOLUTIONS INC	16,615	116.230	1,931,161.450	
MARVELL TECHNOLOGY INC	117,157	60.010	7,030,591.570	
APA CORP	40,946	33.410	1,368,005.860	
LINDE PLC	67,449	360.760	24,332,901.240	
LUCID GROUP INC	96,289	6.210	597,954.690	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	50.510	605,160.310	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	163.690	609,090.490	
TOAST INC	45,399	21.860	992,422.140	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.440	961,531.600	
CATALENT INC	20,564	38.810	798,088.840	
SYNCHRONY FINANCIAL	65,868	33.690	2,219,092.920	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	63,378	28.340	1,796,132.520	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	150.220	786,702.140	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	25,504	161.570	4,120,681.280	
HUBSPOT INC	6,653	516.910	3,439,002.230	
QORVO INC	14,144	98.360	1,391,203.840	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	73.850	1,132,489.750	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	7,789	282.330	2,199,068.370	
GODADDY INC	19,713	72.010	1,419,533.130	
ETSY INC	18,558	91.240	1,693,231.920	
TRANSUNION	25,708	73.300	1,884,396.400	
ALCOA CORP	23,941	35.230	843,441.430	
ALBERTSONS COS INC	40,041	20.810	833,253.210	
BLOCK INC	74,347	64.940	4,828,094.180	
DUPONT DE NEMOURS INC	68,003	69.670	4,737,769.010	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	26,221	63.730	1,671,064.330	
WESTROCK CO	34,286	29.610	1,015,208.460	
KRAFT HEINZ CO	111,514	36.880	4,112,636.320	
NOVOCURE LTD	12,317	42.760	526,674.920	
FORTIVE CORP	49,865	68.150	3,398,299.750	
WASTE CONNECTIONS INC	35,315	135.830	4,796,836.450	
ALPHABET INC-CL A	817,691	122.230	99,946,370.930	

	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	173,258	15.790	2,735,743.820	
	PAYPAL HOLDINGS INC	145,052	63.490	9,209,351.480	
	SEA LTD ADR	50,316	63.380	3,189,028.080	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,768	26.560	1,507,758.080	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	44.830	1,003,026.420	
	ALPHABET INC-CL C	740,543	122.870	90,990,518.410	
	ZSCALER INC	12,304	150.840	1,855,935.360	
	ATLASSIAN CORP PLC	19,972	171.990	3,434,984.280	
	ROKU INC	15,660	69.480	1,088,056.800	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,423	328.480	4,409,187.040	
	VISTRA CORP	49,633	24.820	1,231,891.060	
アメリカ・ドル	小計	46,676,652		5,116,013,569.970 (713,325,772,057)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	14.675	674,507.020	
	ASHTED GROUP	58,565	53.680	3,143,769.200	
	SEVERN TRENT PLC	31,034	27.490	853,124.660	
	BARCLAYS PLC	2,207,571	1.563	3,450,433.470	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.629	574,903.280	
	BT GROUP PLC	904,198	1.470	1,329,171.060	
	BUNZL PLC	46,691	30.700	1,433,413.700	
	AVIVA PLC	353,288	4.009	1,416,331.590	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	52.740	1,085,020.020	
	DIAGEO PLC	306,300	33.205	10,170,691.500	
	SCHRODERS PLC	110,366	4.589	506,469.570	
	DCC PLC	16,599	47.330	785,630.670	
	NATIONAL GRID PLC	497,162	10.545	5,242,573.290	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.377	535,756.780	
	BAE SYSTEMS PLC	425,672	9.400	4,001,316.800	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	289,114	25.905	7,489,498.170	
	HALMA PLC	51,066	24.150	1,233,243.900	
	NEXT PLC	16,093	64.340	1,035,423.620	
	IMPERIAL BRANDS PLC	125,526	17.250	2,165,323.500	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	17.360	346,783.360	
	ANGLO AMERICAN PLC	176,521	24.570	4,337,120.970	
	COMPASS GROUP PLC	240,717	21.720	5,228,373.240	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,739,806	6.075	16,644,321.450	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.394	2,050,219.200	
	CENTRICA PLC	793,776	1.169	927,924.140	
	UNILEVER PLC	348,915	39.700	13,851,925.500	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.555	955,955.790	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	18.595	787,516.840	
	PEARSON PLC	84,159	8.194	689,598.840	

PERSIMMON PLC	56,474	12.130	685,029.620	
PRUDENTIAL PLC	379,082	11.140	4,222,973.480	
RIO TINTO PLC	153,140	51.250	7,848,425.000	
VODAFONE GROUP PLC	3,279,277	0.748	2,452,899.190	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	97,637	60.340	5,891,416.580	
RELX PLC	259,441	25.310	6,566,451.710	
RENTOKIL INITIAL PLC	363,315	6.434	2,337,568.710	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	1.492	1,673,910.600	
NATWEST GROUP PLC	783,143	2.610	2,044,003.230	
ST JAMES'S PLACE PLC	89,082	11.600	1,033,351.200	
SSE PLC	145,097	18.430	2,674,137.710	
BP PLC	2,434,799	4.689	11,416,772.510	
SAGE GROUP PLC(THE)	128,893	8.596	1,107,964.220	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.595	857,878.520	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	111.900	1,203,036.900	
STANDARD CHARTERED PLC	316,670	6.608	2,092,555.360	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,257,724	0.452	4,184,491.240	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.139	649,073.950	
TESCO PLC	1,032,016	2.619	2,702,849.900	
3I GROUP PLC	125,530	19.915	2,499,929.950	
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	11.940	1,503,604.200	
GSK PLC	553,801	13.780	7,631,377.780	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	55,432	86.500	4,794,868.000	
WPP PLC	142,785	8.622	1,231,092.270	
ASTRAZENECA PLC	214,234	117.120	25,091,086.080	
WHITBREAD PLC	25,470	33.720	858,848.400	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	42.870	999,256.830	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	22.250	1,162,095.250	
INTERCONTINENTAL HOTELS	26,654	54.420	1,450,510.680	
SAINSBURY (J) PLC	283,091	2.670	755,852.970	
ADMIRAL GROUP PLC	32,350	22.940	742,109.000	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	39.770	655,767.530	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	18.905	348,891.770	
ABRDN PLC	285,831	2.143	612,535.830	
EXPERIAN PLC	130,915	28.680	3,754,642.200	
MONDI PLC	58,887	12.430	731,965.410	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.616	318,292.270	
OCADO GROUP PLC	69,766	3.866	269,715.350	
INFORMA PLC	186,195	7.072	1,316,771.040	
GLENCORE PLC	1,480,027	4.350	6,438,117.450	
ENTAIN PLC	74,451	12.960	964,884.960	
COCA-COLA HBC AG	31,035	23.380	725,598.300	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,717	5.588	484,574.590	

	M&G PLC	270,401	2.017	545,398.810	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	20.240	568,238.000	
	WISE PLC	96,207	6.050	582,052.350	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.486	567,757.500	
	HALEON PLC	703,324	3.208	2,256,263.390	
	SHELL PLC	951,603	22.945	21,834,530.830	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	6.178	684,726.270	
イギリス・ポンド 小計		38,457,620		246,972,486.020 (43,299,216,249)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	187,404	32.350	6,062,519.400	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	228,914	28.150	6,443,929.100	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	746.000	2,484,180.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	141.100	1,774,191.400	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	19.390	3,159,484.160	
	ICL GROUP LTD	103,067	19.500	2,009,806.500	
	NICE LTD	9,053	780.000	7,061,340.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	130.500	2,275,920.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	211.800	989,529.600	
イスラエル・シュケル 小計		729,398		32,260,900.160 (1,255,384,538)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	57.700	1,633,256.200	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	478,692	20.250	9,693,513.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	234,609	20.790	4,877,521.110	
	TELSTRA GROUP LTD	482,855	4.310	2,081,105.050	
	ASX LTD	31,066	61.420	1,908,073.720	
	BHP GROUP LTD	702,811	44.720	31,429,707.920	
	AMPOL LTD	31,828	30.840	981,575.520	
	COMPUTERSHARE LT	72,081	22.780	1,642,005.180	
	CSL LIMITED	67,397	305.300	20,576,304.100	
	REA GROUP LTD	6,134	130.890	802,879.260	
	TRANSURBAN GROUP	450,346	14.320	6,448,954.720	
	COCHLEAR LTD	8,356	239.480	2,001,094.880	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	8.400	1,791,123.600	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	234,232	95.800	22,439,425.600	
	RIO TINTO LIMITED	49,873	114.580	5,714,448.340	
	APA GROUP	164,300	10.150	1,667,645.000	
	ARISTOCRAT LEISU	76,675	38.070	2,919,017.250	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.110	1,840,019.020	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	37.870	2,301,246.290	
	IGO LTD	91,947	14.580	1,340,587.260	
ORICA LTD	63,862	15.050	961,123.100		
	LEND LEASE CORP LTD	107,181	7.050	755,626.050	

	BLUESCOPE STEEL LTD	75,503	19.840	1,497,979.520	
	MACQUARIE GROUP LTD	50,698	172.100	8,725,125.800	
	SUNCORP GROUP LTD	161,737	13.120	2,121,989.440	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	430,429	25.200	10,846,810.800	
	NEWCREST MINING LTD	126,686	26.410	3,345,777.260	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.190	697,359.210	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	215,572	14.990	3,231,424.280	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	13.350	2,171,097.150	
	REECE LTD	31,558	18.660	588,872.280	
	SANTOS LTD	485,603	7.390	3,588,606.170	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	34.940	2,267,501.180	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	32.380	841,394.300	
	WESFARMERS LTD	158,315	47.580	7,532,627.700	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	264,886	34.730	9,199,490.780	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	169,400	37.570	6,364,358.000	
	SEEK LTD	39,064	21.600	843,782.400	
	MINERAL RESOURCES LTD	21,179	69.780	1,477,870.620	
	BRAMBLES LTD	177,669	13.540	2,405,638.260	
	PILBARA MINERALS LTD	327,947	4.750	1,557,748.250	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.570	795,570.930	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	87,104	11.490	1,000,824.960	
	XERO LTD	18,860	109.080	2,057,248.800	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	23.760	1,067,370.480	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	5.010	1,459,262.700	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	6.050	1,413,522.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	410,226	22.850	9,373,664.100	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.550	1,465,266.050	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	3.890	2,321,139.660	
	COLES GROUP LTD	171,684	17.720	3,042,240.480	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	75.880	1,617,002.800	
	オーストラリア・ドル 小計	9,630,356		220,724,818.530 (20,767,998,175)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	67,555	68.030	4,595,766.650	
	BARRICK GOLD CORP	239,565	22.670	5,430,938.550	
	BANK OF MONTREAL	97,446	116.340	11,336,867.640	
	BANK OF NOVA SCOTIA	160,517	66.130	10,614,989.210	
	NATIONAL BANK OF CANADA	46,066	96.220	4,432,470.520	
	BCE INC	14,197	61.370	871,269.890	
	BROOKFIELD CORP	194,244	42.210	8,199,039.240	
	SAPUTO INC	34,582	30.930	1,069,621.260	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	11.540	1,065,268.940	

DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	98.290	1,131,121.320	
CGI INC	27,918	138.650	3,870,830.700	
CCL INDUSTRIES INC	21,058	63.010	1,326,864.580	
CAE INC	40,808	27.830	1,135,686.640	
CAMECO CORP	54,264	41.050	2,227,537.200	
ROGERS COMM-CL B	46,626	57.510	2,681,461.260	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	123,724	57.050	7,058,454.200	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	151,940	75.270	11,436,523.800	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,465	167.460	1,082,628.900	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	36.120	589,839.600	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	77,911	152.410	11,874,415.510	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	39.510	857,880.630	
OPEN TEXT CORP	40,459	56.200	2,273,795.800	
EMPIRE CO LTD	20,608	33.910	698,817.280	
KINROSS GOLD CORP	193,561	6.470	1,252,339.670	
RB GLOBAL INC	26,641	73.760	1,965,040.160	
FORTIS INC	71,759	57.420	4,120,401.780	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	29.670	2,534,441.070	
TELUS CORP	31,890	25.300	806,817.000	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	38.070	1,302,298.560	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	67.030	1,826,299.380	
ENBRIDGE INC	278,758	50.620	14,110,729.960	
IGM FINANCIAL INC	12,478	39.860	497,373.080	
MANULIFE FINANCIAL CORP	249,587	25.720	6,419,377.640	
LOBLAW CO LTD	21,600	116.460	2,515,536.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	112,792	64.580	7,284,107.360	
MAGNA INTERNATIONAL INC	35,844	71.040	2,546,357.760	
SUN LIFE FINANCIAL INC	81,434	67.400	5,488,651.600	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,229	978.530	3,159,673.370	
METRO INC	30,428	70.160	2,134,828.480	
EMERA INC	36,998	55.330	2,047,099.340	
ONEX CORP	10,157	67.620	686,816.340	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	20.570	1,139,022.610	
POWER CORP OF CANADA	76,591	34.760	2,662,303.160	
QUEBECOR INC-B	17,195	32.680	561,932.600	
ROYAL BANK OF CANADA	191,414	123.890	23,714,280.460	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	126,848	102.040	12,943,569.920	
SUNCOR ENERGY INC	185,738	40.430	7,509,387.340	
LUNDIN MINING CORP	77,139	10.060	776,018.340	
TECK RESOURCES LTD-CL B	58,904	56.720	3,341,034.880	
THOMSON REUTERS CORP	22,378	164.110	3,672,453.580	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,698	105.310	1,442,536.380	

TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	251,252	79.120	19,879,058.240		
TC ENERGY CORP	139,293	55.250	7,695,938.250		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	101.140	819,436.280		
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	153.090	1,506,252.510		
INTACT FINANCIAL CORP	24,452	198.290	4,848,587.080		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	58,539	59.870	3,504,729.930		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,805	2,702.640	7,580,905.200		
FRANCO-NEVADA CORP NPR	26,282	194.640	5,115,528.480		
TOURMALINE OIL CORP	46,466	60.050	2,790,283.300		
KEYERA CORP	39,467	31.100	1,227,423.700		
PARKLAND CORP	15,665	34.090	534,019.850		
ALTAGAS LTD	33,833	24.740	837,028.420		
PEMBINA PIPELINE CORP	69,235	42.300	2,928,640.500		
DOLLARAMA INC	41,354	83.030	3,433,622.620		
CENOVUS ENERGY INC W/I	202,950	23.210	4,710,469.500		
ARC RESOURCES LTD	78,639	17.380	1,366,745.820		
NORTHLAND POWER INC	34,152	28.560	975,381.120		
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	19.960	1,022,810.280		
TMX GROUP LTD	7,040	147.060	1,035,302.400		
BRP INC	4,307	100.820	434,231.740		
IVANHOE MINES LTD	98,820	11.130	1,099,866.600		
NUTRIEN LTD	71,801	78.450	5,632,788.450		
TFI INTERNATIONAL INC	11,591	140.150	1,624,478.650		
WSP GLOBAL INC	17,782	172.520	3,067,750.640		
IA FINANCIAL CORP INC	12,516	88.750	1,110,795.000		
GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	49.690	1,772,293.230		
NUVEI CORP	7,929	39.750	315,177.750		
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	46.630	750,882.890		
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	42.500	2,220,582.500		
AIR CANADA	41,444	22.370	927,102.280		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	41,208	100.300	4,133,162.400		
SHOPIFY INC	165,568	81.880	13,556,707.840		
FIRSTSERVICE CORP	5,237	194.780	1,020,062.860		
HYDRO ONE LTD	46,225	37.540	1,735,286.500		
カナダ・ドル 小計	5,546,179		325,536,149.950 (34,015,272,308)		
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	314,100	3.660	1,149,606.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	244,510	30.910	7,557,804.100	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	6.880	271,072.000	
	SEATRUM LTD	7,235,222	0.122	882,697.080	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	33.070	512,585.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.600	958,080.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.945	719,327.380	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.450	1,192,605.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	459,198	12.390	5,689,463.220	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,092,930	2.430	2,655,819.900	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	7.250	1,179,575.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	169,266	28.160	4,766,530.560	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.560	286,016.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	14.700	643,860.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.970	1,026,245.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	431,290	3.330	1,436,195.700	
	シンガポール・ドル 小計	11,555,909		30,927,481.940 (3,209,344,801)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	57.000	1,352,838.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	378,536	107.160	40,563,917.760	
	CIE FINANC RICHEMONT	70,991	141.900	10,073,622.900	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	96,839	282.100	27,318,281.900	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	196.450	1,043,345.950	
	SIKA INHABER	20,139	247.600	4,986,416.400	
	SGS SA-REG	23,250	84.200	1,957,650.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	282,648	90.170	25,486,370.160	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	141.700	826,111.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,756.000	807,760.000	
	CLARIANT AG-REG	44,162	12.780	564,390.360	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	557.200	1,911,753.200	
	ABB LTD	212,002	34.500	7,314,069.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	28.640	568,274.880	
	GEBERIT AG	4,577	486.600	2,227,168.200	
	LONZA GROUP AG-REG	10,240	562.800	5,763,072.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	11,190.000	1,533,030.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	112,800.000	1,804,800.000	
	GIVAUDAN-REG	1,279	2,860.000	3,657,940.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	20,856	426.800	8,901,340.800	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	306.400	1,473,784.000	
	HOLCIM LTD	75,608	58.060	4,389,800.480	
	TEMENOS GROUP	7,082	77.700	550,271.400	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	88.100	411,691.300	
	SONOVA HOLDING AG	6,984	240.000	1,676,160.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,887	244.500	1,683,871.500	
	STRAUMANN HOLDING AG	14,531	133.300	1,936,982.300	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,215	264.100	849,081.500	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	49.750	460,635.250	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	124.100	608,834.600	
	SCHINDLER NAMEN	4,276	189.300	809,446.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,978	534.200	2,125,047.600	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	94.950	465,539.850	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	696.000	563,760.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,636	78.000	1,063,608.000	
	DUFREY GROUP	12,933	40.340	521,717.220	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,369	838.000	2,823,222.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,865	56.620	1,521,096.300	
	SWISS RE LTD	41,653	88.140	3,671,295.420	
	BKW AG	3,194	145.400	464,407.600	
	SIG GROUP AG	38,322	25.240	967,247.280	
	ALCON INC	68,865	71.240	4,905,942.600	
	UBS GROUP AG	447,218	18.200	8,139,367.600	
	VAT GROUP AG	3,325	368.800	1,226,260.000	
スイス・フラン	小計	2,035,582		191,971,223.110 (29,615,400,589)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	361,234	159.050	57,454,267.700	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	231,547	137.900	31,930,331.300	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	56.610	23,662,980.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	247.200	6,366,636.000	
	INVESTOR AB-A SHS	62,097	217.500	13,506,097.500	
	LUNDBERGS B	7,859	465.000	3,654,435.000	
	SKF AB-B SHS	46,594	190.800	8,890,135.200	
	SANDVIK AB	150,884	207.000	31,232,988.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	119.250	26,514,999.000	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	148.300	6,515,857.100	
	SWEDBANK AB	130,971	179.300	23,483,100.300	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,465	149.150	13,791,154.750	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	184,499	92.480	17,062,467.520	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	220.200	5,328,399.600	
	VOLVO AB-B SHS	209,640	213.000	44,653,320.000	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	417.600	4,235,299.200	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	94.320	6,381,125.280	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	294.000	4,495,848.000	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	292.800	6,243,960.000	
	SAAB AB-B	11,789	584.400	6,889,491.600	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	86.660	6,593,526.100	
	INVESTOR AB-B SHS	230,372	217.200	50,036,798.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	110,008	143.220	15,755,345.760	
	ASSA ABLOY AB-B	140,043	255.900	35,837,003.700	
	TELIA CO AB	344,810	24.600	8,482,326.000	
	BOLIDEN AB	36,260	361.800	13,118,868.000	

	ALFA LAVAL AB	35,313	395.300	13,959,228.900	
	KINNEVIK AB-B	36,278	158.700	5,757,318.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	43.120	3,145,259.040	
	INDUTRADE AB	39,178	261.300	10,237,211.400	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	84.280	4,025,971.320	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	105.950	22,549,550.400	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	221.400	4,069,332.000	
	HEXAGON AB-B SHS	275,826	127.550	35,181,606.300	
	SAGAX AB	28,022	232.500	6,515,115.000	
	EPIROC AB-A	84,563	198.750	16,806,896.250	
	EPIROC AB-B	61,487	170.000	10,452,790.000	
	ESSITY AB-B	86,900	283.500	24,636,150.000	
	EQT AB	55,194	222.200	12,264,106.800	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	25.555	2,039,059.000	
	VOLVO CAR AB	63,710	42.250	2,691,747.500	
	BEIJER REF AB	50,493	158.800	8,018,288.400	
	LIFCO AB	26,835	229.500	6,158,632.500	
	EVOLUTION AB	25,280	1,415.200	35,776,256.000	
	NORDEA BANK ABP	457,613	113.220	51,810,943.860	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	221.900	6,132,872.200	
スウェーデン・クローナ 小計		5,061,852		754,345,096.480 (9,700,877,941)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	12,549	1,051.500	13,195,273.500	
	A P MOLLER A/S	663	12,315.000	8,164,845.000	
	AP MOLLER MAERSK A	520	12,190.000	6,338,800.000	
	DANSKE BANK A/S	88,591	160.650	14,232,144.150	
	GENMAB A/S	9,624	2,676.000	25,753,824.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	331.500	9,877,042.500	
	ROCKWOOL AS	873	1,780.500	1,554,376.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	228,298	1,091.600	249,210,096.800	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	140,190	198.660	27,850,145.400	
	COLOPLAST-B	15,343	860.400	13,201,117.200	
	DSV A/S	26,166	1,338.500	35,023,191.000	
	DEMANT A/S	11,367	282.400	3,210,040.800	
	TRYG A/S	44,887	156.350	7,018,082.450	
	PANDORA A/S	12,473	552.000	6,885,096.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	502.200	6,296,583.600	
ORSTED A/S	26,911	659.400	17,745,113.400		
デンマーク・クローネ 小計		660,788		445,555,772.300 (8,960,126,581)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.750	1,437,983.750	
	EBOS GROUP LTD	25,631	35.850	918,871.350	
	FISHER & PAYKEL	78,460	23.620	1,853,225.200	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.130	1,123,664.940	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.220	390,827.480	

	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.360	1,282,690.880	
ニュージーランド・ドル 小計		789,612		7,007,263.600 (598,210,094)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	182.700	10,299,712.500	
	NORSK HYDRO ASA	210,898	69.600	14,678,500.800	
	TELENOR ASA	85,954	109.700	9,429,153.800	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	462.000	5,167,470.000	
	ORKLA ASA	116,068	77.800	9,030,090.400	
	EQUINOR ASA	132,805	313.650	41,654,288.250	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	427.200	8,473,084.800	
	AKER BP ASA	38,723	262.300	10,157,042.900	
	SALMAR ASA	7,248	454.000	3,290,592.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	179.900	4,627,207.900	
	ADEVINTA ASA	24,382	77.500	1,889,605.000	
	DNB BANK ASA	139,232	194.200	27,038,854.400	
ノルウェー・クローネ 小計		868,425		145,735,602.750 (1,885,818,700)	
ユーロ	CRH PLC	102,020	45.260	4,617,425.200	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	25,007	178.000	4,451,246.000	
	KERRY GROUP PLC-A	20,761	89.600	1,860,185.600	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	62.320	1,362,315.200	
	UMICORE	24,290	27.460	667,003.400	
	AIR LIQUIDE	72,237	156.600	11,312,314.200	
	AIRBUS SE	80,311	128.420	10,313,538.620	
	AXA SA	250,734	26.520	6,649,465.680	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	99,848	28.800	2,875,622.400	
	ADIDAS AG	22,590	160.000	3,614,400.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	18.300	2,646,417.900	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	166.200	518,544.000	
	DANONE	88,043	53.620	4,720,865.660	
	SAFRAN SA	46,683	136.640	6,378,765.120	
	INTESA SANPAOLO	2,233,744	2.309	5,157,714.890	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	45,234	108.080	4,888,890.720	
	ACCOR SA	20,392	32.700	666,818.400	
	BOUYGUES	29,123	30.330	883,300.590	
	BNP PARIBAS	152,126	56.070	8,529,704.820	
	THALES SA	15,023	130.450	1,959,750.350	
	CAPGEMINI SA	22,531	168.400	3,794,220.400	
	UNICREDIT SPA	266,042	18.350	4,881,870.700	
	D' IETEREN TRDG	2,736	170.200	465,667.200	
	COMMERZBANK AG	141,036	9.824	1,385,537.660	
	EIFFAGE	11,784	98.760	1,163,787.840	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	25.830	1,519,165.620	
	PUBLICIS GROUPE	29,383	71.760	2,108,524.080	
IBERDROLA SA	805,663	11.495	9,261,096.180		

ENI SPA	313,870	12.984	4,075,288.080	
JERONIMO MARTINS	34,644	24.160	836,999.040	
KESKO OYJ-B	35,252	18.135	639,295.020	
KBC GROUPE	35,962	62.440	2,245,467.280	
HANNOVER RUECK SE	8,405	189.350	1,591,486.750	
WARTSILA OYJ	50,956	11.120	566,630.720	
L'OREAL	33,329	402.200	13,404,923.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	38,083	820.000	31,228,060.000	
GEA GROUP AG	24,987	39.240	980,489.880	
BOLLORE	114,808	5.700	654,405.600	
MEDIOBANCA SPA	86,792	10.945	949,938.440	
MICHELIN(CGDE)-B	88,698	27.520	2,440,968.960	
CONTINENTAL AG	17,450	68.880	1,201,956.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	136,158	41.800	5,691,404.400	
OMV AG	17,258	39.520	682,036.160	
VERBUND AG	10,663	71.500	762,404.500	
PERNOD-RICARD	28,172	198.900	5,603,410.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	56.460	1,316,139.060	
RENAULT SA	27,902	33.085	923,137.670	
REPSOL SA	179,874	13.490	2,426,500.260	
REMY COINTREAU	2,866	142.400	408,118.400	
MERCK KGAA	18,389	168.550	3,099,465.950	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	69,513	55.820	3,880,215.660	
RWE AG	85,480	39.830	3,404,668.400	
SEB SA	2,596	86.000	223,256.000	
SOCIETE GENERALE-A	104,069	23.325	2,427,409.420	
VINCI S.A.	72,410	106.700	7,726,147.000	
SODEXO	12,910	101.900	1,315,529.000	
SOFINA	2,281	204.000	465,324.000	
SOLVAY SA	9,070	104.650	949,175.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	73,488	163.940	12,047,622.720	
VIVENDI SE	98,944	8.140	805,404.160	
SAP SE	143,986	123.200	17,739,075.200	
TELEFONICA S.A	750,387	3.886	2,916,003.880	
TOTALENERGIES SE	322,816	54.950	17,738,739.200	
VALEO	26,570	20.680	549,467.600	
E.ON SE	308,720	11.400	3,519,408.000	
VOEST-ALPINE AG	18,032	32.440	584,958.080	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	66.380	887,898.880	
SIEMENS AG-REG	105,259	158.140	16,645,658.260	
UPM-KYMMENE OYJ	77,752	29.850	2,320,897.200	
ING GROEP NV-CVA	514,463	12.084	6,216,770.890	
PUMA AG	12,194	49.250	600,554.500	
BAYER AG	133,908	51.150	6,849,394.200	
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	12.400	929,504.000	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	74.760	1,808,519.160	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	117,481	72.600	8,529,120.600	
BASF SE	126,695	46.025	5,831,137.370	
BEIERSDORF AG	12,940	117.200	1,516,568.000	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	71.900	1,552,033.400	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	25,398	42.340	1,075,351.320	
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	389.300	2,589,234.300	
ORANGE	280,606	10.528	2,954,219.960	
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	43.110	2,762,488.800	
RANDSTAD NV	15,584	48.990	763,460.160	
ALLIANZ SE	55,612	207.950	11,564,515.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	377,252	4.645	1,752,335.540	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	135,085	29.160	3,939,078.600	
HERMES INTL	4,325	1,916.400	8,288,430.000	
ENDESA S.A.	37,701	21.060	793,983.060	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	9.184	664,388.920	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	31.470	1,437,738.420	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	19,069	323.400	6,166,914.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	64,774	25.460	1,649,146.040	
DASSAULT SYSTEMES SA	92,308	40.175	3,708,473.900	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	25,380	31.480	798,962.400	
RHEINMETALL STAMM	5,596	240.500	1,345,838.000	
HEINEKEN NV	34,576	93.100	3,219,025.600	
AKZO NOBEL	23,353	70.940	1,656,661.820	
ASML HOLDING NV	55,636	666.600	37,086,957.600	
AEGON NV	232,433	4.530	1,052,921.490	
VOLKSWAGEN AG	3,315	155.900	516,808.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	28,721	126.280	3,626,887.880	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	835,535	6.510	5,439,332.850	
KERING	10,209	504.700	5,152,482.300	
ACCIONA S.A.	2,642	159.400	421,134.800	
FORTUM OYJ	54,194	12.405	672,276.570	
AGEAS	24,086	37.630	906,356.180	
UCB SA	16,732	85.660	1,433,263.120	
NEMETSCHEK SE	9,878	72.080	712,006.240	
CARREFOUR SA	76,528	16.450	1,258,885.600	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.620	470,561.740	
NOKIA OYJ	745,504	3.780	2,818,005.120	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	120,670	18.242	2,201,262.140	
WOLTERS KLUWER-CVA	35,602	113.350	4,035,486.700	
SANOFI	156,670	95.400	14,946,318.000	
STMICROELECTRONICS NV	93,810	44.100	4,137,021.000	
ELISA OYJ	20,242	50.880	1,029,912.960	

BANCO SANTANDER SA	2,306,214	3.201	7,382,191.010	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	16.150	791,527.650	
QIAGEN N.V.	34,306	42.170	1,446,684.020	
DEUTSCHE BANK AG-REG	276,499	9.843	2,721,579.650	
BMW VORZUG	7,821	101.600	794,613.600	
ENEL SPA	1,105,481	6.073	6,713,586.110	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	436,835	19.046	8,319,959.410	
SARTORIUS AG	3,651	328.400	1,198,988.400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	178,950	36.830	6,590,728.500	
RATIONAL AG	516	630.000	325,080.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	109.700	533,800.200	
BECHTLE AG	14,521	37.540	545,118.340	
KONINKLIJKE KPN NV	504,342	3.132	1,579,599.140	
EUROFINS SCIENTIFIC	17,824	59.820	1,066,231.680	
TELEPERFORMANCE	7,845	145.300	1,139,878.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	25,951	164.800	4,276,724.800	
EURAZEO	5,673	65.550	371,865.150	
GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	72.440	935,779.920	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	79.000	1,397,510.000	
INDITEX	150,465	33.250	5,002,961.250	
ESSILORLUXOTTICA	39,632	167.820	6,651,042.240	
SNAM SPA	256,415	4.974	1,275,408.210	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	10.832	1,808,088.270	
ENAGAS	38,270	18.240	698,044.800	
WENDEL	5,449	100.800	549,259.200	
TENARIS SA	55,855	12.825	716,340.370	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.250	227,071.500	
TERNA SPA	207,655	7.958	1,652,518.490	
BIOMERIEUX	4,870	91.160	443,949.200	
GRIFOLS SA	31,982	11.390	364,274.980	
FERROVIAL SA	75,279	28.750	2,164,271.250	
NESTE OYJ	56,226	38.910	2,187,753.660	
RECORDATI SPA	17,680	44.390	784,815.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	87,314	12.645	1,104,085.530	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	225.100	1,641,879.400	
KONE OYJ	49,300	50.240	2,476,832.000	
ELIA GROUP	4,078	117.300	478,349.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	265.600	1,023,888.000	
ENGIE	241,494	14.228	3,435,976.630	
ALSTOM	47,494	27.580	1,309,884.520	
IPSEN SA	3,873	110.900	429,515.700	
ARKEMA SA	10,961	83.320	913,270.520	
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	116.850	349,498.350	
LEGRAND SA	38,836	89.480	3,475,045.280	
AMPLIFON SPA	20,249	34.970	708,107.530	
ADP	3,975	137.400	546,165.000	

ORION OYJ	13,559	39.960	541,817.640	
METSO CORPORATION	79,058	10.845	857,384.010	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.690	635,050.140	
SYMRISE AG	17,265	92.120	1,590,451.800	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	33.930	1,100,078.460	
PRYSMIAN SPA	31,596	35.700	1,127,977.200	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	96.720	234,932.880	
CAIXABANK	565,553	3.598	2,034,859.690	
BUREAU VERITAS SA	39,729	24.110	957,866.190	
GETLINK	63,509	15.890	1,009,158.010	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	19.495	773,717.560	
AMADEUS IT GROUP SA	62,816	66.820	4,197,365.120	
BRENTAG SE	21,559	72.540	1,563,889.860	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	17.990	444,119.130	
EDENRED	35,618	61.340	2,184,808.120	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	137,436	2.623	360,494.620	
TALANX AG	11,451	52.600	602,322.600	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	54.400	446,569.600	
VONOVIA SE	92,440	18.680	1,726,779.200	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	134,537	9.198	1,237,471.320	
KNORR-BREMSE AG	10,342	64.760	669,747.920	
OCI NV	12,329	21.630	266,676.270	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	39,737	52.340	2,079,834.580	
FERRARI NV	16,685	276.400	4,611,734.000	
CNH INDUSTRIAL NV	143,842	12.710	1,828,231.820	
AIB GROUP PLC	147,578	3.806	561,681.860	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	36.360	628,773.480	
MONCLER SPA	29,763	63.320	1,884,593.160	
NEXI SPA	83,576	7.262	606,928.910	
PROSUS NV	109,400	66.180	7,240,092.000	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	116.700	1,770,805.800	
JDE PEET'S BV	14,385	27.320	392,998.200	
EXOR NV	14,142	80.120	1,133,057.040	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	23.720	1,776,438.240	
EURONEXT NV	14,089	63.300	891,833.700	
IMCD NV	8,848	135.100	1,195,364.800	
WORLDLINE SA	29,916	35.850	1,072,488.600	
NN GROUP NV	36,289	33.350	1,210,238.150	
FINECOBANK SPA	75,180	12.500	939,750.000	
ARGENX SE	7,482	364.500	2,727,189.000	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	114,291	19.420	2,219,531.220	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	64,874	30.580	1,983,846.920	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	32.240	316,661.280	
DSM-FIRMENICH AG	24,977	95.890	2,395,044.530	

	ZALANDO SE	31,321	24.340	762,353.140	
	STELLANTIS NV	309,373	15.052	4,656,682.390	
	AENA SME SA	9,989	142.400	1,422,433.600	
	CELLNEX TELECOM SAU	76,430	37.010	2,828,674.300	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	12.916	292,805.720	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	13.645	720,933.570	
	SCOUT24 SE	10,048	58.700	589,817.600	
	COVESTRO AG	27,558	39.050	1,076,139.900	
	HELLOFRESH SE	17,856	18.155	324,175.680	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	117,633	51.170	6,019,280.610	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.904	583,236.650	
	AMUNDI SA	12,553	53.850	675,979.050	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	11.660	488,309.140	
	ADYEN NV	2,995	1,577.800	4,725,511.000	
	DELIVERY HERO SE	22,564	35.750	806,663.000	
ユーロ 小計		24,375,195		645,964,665.650 (96,778,426,208)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	13.200	3,392,400.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	56.950	13,770,282.200	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	42.550	3,970,510.700	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	166,391	308.800	51,381,540.800	
	MTR CORP	192,441	37.050	7,129,939.050	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	112.800	10,726,828.800	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	23.950	4,094,779.400	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	42.200	8,981,004.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	6.970	10,708,749.820	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	322,904	50.600	16,338,942.400	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	498,995	24.450	12,200,427.750	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	20.000	3,461,320.000	
	SINO LAND CO	411,200	10.160	4,177,792.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	102.700	21,008,825.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	54.000	2,863,080.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	180,156	74.450	13,412,614.200	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	12.320	2,192,960.000	
	AIA GROUP LTD	1,625,716	80.750	131,276,567.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	9.590	4,441,474.240	
	SANDS CHINA LTD	335,800	27.300	9,167,340.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	14.260	1,996,400.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	19.920	4,015,872.000	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	42.200	10,808,897.000	
	ESR GROUP LTD	216,400	14.260	3,085,864.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	21.050	5,578,250.000	
	WH GROUP LTD	931,500	4.100	3,819,150.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	49.300	18,213,638.500	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	45.150	12,018,704.250	
香港・ドル	小計	10,059,069		394,234,153.610 (7,013,425,593)	
合計		156,446,637		970,425,273.834 (970,425,273,834)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年6月12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	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,334,870.460	
		GOODMAN GROUP	221,417.000	4,341,987.370	
		GPT GROUP	219,223.000	879,084.230	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	1,063,733.440	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,689,184.170	
		STOCKLAND	369,843.000	1,516,356.300	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,017,627.920	
	オーストラリア・ドル	小計	2,642,195.000	11,842,843.890 (1,114,293,183)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,535,100.450	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,158,983.140	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	772,783.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	652,855.000	
	シンガポール・ドル	小計	2,107,509.000	4,119,721.590 (427,503,509)	
投資信託受益証券	合計	4,749,704	1,541,796,692 (1,541,796,692)		
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,059.000	2,901,274.810	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,482,099.780	
		AMERICAN TOWER CORP	64,424.000	12,066,615.200	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58,993.000	1,179,860.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,496.000	3,671,291.760	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,257.000	1,312,546.270	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,271.000	1,502,808.040	
		CROWN CASTLE INC	58,995.000	6,723,070.200	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	39,801.000	4,149,254.250	

EQUINIX INC	12,944.000	9,626,323.360	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22,301.000	1,450,903.060	
EQUITY RESIDENTIAL	52,518.000	3,475,641.240	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,270.000	1,937,661.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	18,024.000	2,604,468.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,732,542.630	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	64,831.000	1,277,819.010	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68,971.000	1,427,009.990	
HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,627,206.210	
INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,967,147.990	
IRON MOUNTAIN INC	39,185.000	2,197,102.950	
KIMCO REALTY	79,991.000	1,551,825.400	
MID AMERICA	17,377.000	2,680,749.790	
PROLOGIS INC	127,204.000	15,431,117.240	
PUBLIC STORAGE	22,068.000	6,330,205.800	
REALTY INCOME CORP	93,882.000	5,718,352.620	
REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,170,439.710	
SBA COMMUNICATIONS CORP	14,868.000	3,332,216.160	
SIMON PROPERTY GROUP INC	44,425.000	4,917,847.500	
SUN COMMUNITIES INC	18,505.000	2,413,792.200	
UDR INC	41,516.000	1,766,505.800	
VENTAS INC	53,843.000	2,461,701.960	
VICI PROPERTIES INC	140,502.000	4,538,214.600	
WELLTOWER INC	70,141.000	5,688,435.100	
WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,034,662.900	
WP CAREY INC	27,925.000	1,978,765.500	
アメリカ・ドル 小計	1,719,495.000	128,327,478.030 (17,892,700,260)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	413,315.170
	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,945.000	785,070.520
	SEGRO PLC	165,081.000	1,321,638.480
イギリス・ポンド 小計	412,137.000	2,520,024.170 (441,810,637)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	432,262.320
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	291,364.800
カナダ・ドル 小計	23,146.000	723,627.120 (75,611,798)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	238,203.320
	GECINA SA	9,166.000	906,517.400
	KLEPIERRE	25,279.000	572,316.560
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,535.000	634,385.450

	WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	539,509.880	
ユーロ 小計		73,192.000	2,890,932.610 (433,119,524)	
香港・ドル	LINK REIT	349,516.000	16,532,106.800	
香港・ドル 小計		349,516.000	16,532,106.800 (294,106,180)	
投資証券 合計		2,577,486	19,137,348,399 (19,137,348,399)	
合計			20,679,145,091 (20,679,145,091)	

(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 604銘柄	70.73	-	-	73.78
	投資証券 35銘柄	-	-	1.77	
イギリス・ポンド	株式 79銘柄	4.29	-	-	4.41
	投資証券 3銘柄	-	-	0.04	
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	0.12	-	-	0.13
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	2.06	-	-	2.21
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.11	-	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.37	-	-	3.44
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	0.32	-	-	0.37
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 44銘柄	2.94	-	-	2.99
スウェーデン・クローナ	株式 46銘柄	0.96	-	-	0.98
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.89	-	-	0.90
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.06	-	-	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.19	-	-	0.19
ユーロ	株式 221銘柄	9.60	-	-	9.81
	投資証券 5銘柄	-	-	0.04	
香港・ドル	株式 28銘柄	0.70	-	-	0.74
	投資証券 1銘柄	-	-	0.03	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	653,159,843
コール・ローン	403,472,889
国債証券	211,571,601,418
派生商品評価勘定	110,766,170
未収利息	898,910,191
前払費用	495,654,100
流動資産合計	214,133,564,611
資産合計	214,133,564,611
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	963,525,883
未払金	169,268
未払解約金	2,147,000
流動負債合計	965,842,151
負債合計	965,842,151
純資産の部	
元本等	
元本	179,063,387,400
剰余金	
剰余金又は欠損金()	34,104,335,060
元本等合計	213,167,722,460
純資産合計	213,167,722,460
負債純資産合計	214,133,564,611

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年6月12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	203,149,904,502円
同期中追加設定元本額	223,723,498,848円
同期中一部解約元本額	247,810,015,950円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	10,671,991,168円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,338,518,025円
たわらノーロード バランス(標準型)	3,624,135,007円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,764,783,381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)	40,804,995円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	1,315,088,441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)	1,242,405,359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)	124,658,258円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	173,393円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	3,973,081円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	16,249,950円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	150,293,970円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,963,576円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	91,804円
投資のソムリエ	63,035,542,601円
投資のソムリエ<DC年金>	5,021,455,655円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	5,238,649,101円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	20,454,109,270円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,987,838,573円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	5,003,436,058円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	453,066,003円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	223,460,795円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	37,883,585円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,796,654,910円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	15,430,132,229円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,005,979,731円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	544,225,803円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	245,935,254円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	151,205,170円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	35,742,796円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	19,680,892円
外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）	21,380,417,319円
先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	7,175,986,765円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	1,703,633,451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）	25,564,753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）	511,444,937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）	46,691,521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）	302,883,581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）	572,689,963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）	813,903,658円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1306）（適格機関投資家限定）	420,633,129円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1309）（適格機関投資家限定）	126,409,489円
計	179,063,387,400円
2. 受益権の総数	179,063,387,400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 2022年12月13日 至 2023年6月12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	2023年6月12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	2023年6月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,529,017,926
合計	2,529,017,926

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年6月23日から2023年6月12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	2023年6月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建					
	213,044,778,489	-	213,897,538,202		852,759,713
アメリカ・ドル	105,901,964,852	-	105,844,990,824		56,974,028
イギリス・ポンド	10,066,995,017	-	10,205,224,344		138,229,327
イスラエル・シェケル	615,814,040	-	640,994,835		25,180,795
オーストラリア・ドル	3,231,375,387	-	3,365,897,166		134,521,779
オフショア・人民元	11,847,652,260	-	11,793,926,493		53,725,767
カナダ・ドル	4,303,031,165	-	4,379,339,300		76,308,135
シンガポール・ドル	948,680,845	-	955,774,550		7,093,705
スウェーデン・クローナ	426,496,367	-	427,659,864		1,163,497
デンマーク・クローネ	663,643,162	-	667,643,298		4,000,136
ニュージーランド・ドル	450,968,239	-	460,502,430		9,534,191
ノルウェー・クローネ	334,469,734	-	345,585,884		11,116,150
ポーランド・ズロチ	1,004,716,657	-	1,033,479,006		28,762,349

マレーシア・リングgit	1,125,114,380	-	1,125,458,792	344,412
メキシコ・ペソ	2,071,035,644	-	2,130,640,696	59,605,052
ユーロ	70,052,820,740	-	70,520,420,720	467,599,980
合計	213,044,778,489	-	213,897,538,202	852,759,713

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1905円 (11,905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

2023年6月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 06/30/25	5,000,000.000	4,584,765.600	
		US T N/B 0.25 07/31/25	6,000,000.000	5,484,375.000	
		US T N/B 0.25 08/31/25	6,500,000.000	5,925,664.030	
		US T N/B 0.25 10/31/25	6,000,000.000	5,441,367.180	
		US T N/B 0.375 01/31/26	13,000,000.000	11,736,562.500	
		US T N/B 0.375 04/30/25	5,070,000.000	4,682,026.150	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,000,000.000	2,583,339.840	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,000,000.000	2,570,097.660	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,500,000.000	4,078,388.650	
		US T N/B 0.5 02/28/26	6,000,000.000	5,420,507.820	
		US T N/B 0.5 06/30/27	5,000,000.000	4,340,332.050	
		US T N/B 0.5 08/31/27	6,520,000.000	5,631,267.990	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,578,535.160	
		US T N/B 0.625 03/31/27	5,000,000.000	4,395,214.850	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,150,000.000	4,151,986.340	

US T N/B 0.625 07/31/26	3,000,000.000	2,688,808.590	
US T N/B 0.625 08/15/30	5,300,000.000	4,249,730.480	
US T N/B 0.625 11/30/27	3,000,000.000	2,587,500.000	
US T N/B 0.625 12/31/27	3,160,000.000	2,719,636.710	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,070,000.000	3,516,336.890	
US T N/B 0.75 03/31/26	4,140,000.000	3,763,357.040	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,050,000.000	5,479,267.560	
US T N/B 0.75 05/31/26	6,000,000.000	5,421,210.960	
US T N/B 0.75 08/31/26	6,400,000.000	5,745,124.980	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,250,000.000	2,946,074.230	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,680,000.000	4,212,091.400	
US T N/B 0.875 11/15/30	11,690,000.000	9,522,326.900	
US T N/B 1.0 07/31/28	4,670,000.000	4,033,530.080	
US T N/B 1.125 01/15/25	11,000,000.000	10,373,085.910	
US T N/B 1.125 02/15/31	12,000,000.000	9,932,343.720	
US T N/B 1.125 02/28/25	4,820,000.000	4,532,588.650	
US T N/B 1.125 02/29/28	5,200,000.000	4,564,523.440	
US T N/B 1.125 05/15/40	4,230,000.000	2,743,468.940	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,760,000.000	2,417,782.790	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,370,000.000	3,790,975.000	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,000,000.000	3,620,781.240	
US T N/B 1.25 05/15/50	6,700,000.000	3,725,173.800	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,000,000.000	3,513,593.760	
US T N/B 1.25 06/30/28	5,000,000.000	4,385,156.250	
US T N/B 1.25 08/15/31	3,800,000.000	3,132,031.250	
US T N/B 1.25 09/30/28	10,120,000.000	8,822,189.030	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,000,000.000	3,629,218.760	
US T N/B 1.25 12/31/26	6,000,000.000	5,436,562.500	
US T N/B 1.375 01/31/25	4,000,000.000	3,784,296.880	
US T N/B 1.375 08/15/50	7,870,000.000	4,518,332.970	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,750,000.000	2,518,774.410	
US T N/B 1.375 10/31/28	6,000,000.000	5,257,500.000	
US T N/B 1.375 11/15/40	5,330,000.000	3,565,062.120	
US T N/B 1.375 12/31/28	3,900,000.000	3,407,625.000	
US T N/B 1.5 01/31/27	4,590,000.000	4,186,402.720	
US T N/B 1.5 02/15/25	8,000,000.000	7,576,093.760	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,730,000.000	4,084,244.120	
US T N/B 1.5 08/15/26	6,000,000.000	5,522,812.500	
US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,524,609.360	
US T N/B 1.625 02/15/26	12,200,000.000	11,376,023.460	
US T N/B 1.625 05/15/26	4,300,000.000	3,991,105.450	
US T N/B 1.625 05/15/31	2,400,000.000	2,050,500.000	
US T N/B 1.625 08/15/29	6,000,000.000	5,271,093.720	
US T N/B 1.625 11/15/50	8,000,000.000	4,910,468.720	
US T N/B 1.625 11/30/26	8,000,000.000	7,356,406.240	
US T N/B 1.75 01/31/29	3,000,000.000	2,671,933.590	
US T N/B 1.75 03/15/25	6,000,000.000	5,697,187.500	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,500,000.000	3,863,750.000	
US T N/B 1.75 11/15/29	5,000,000.000	4,417,773.450	

US T N/B 1.75 12/31/24	10,000,000.000	9,534,960.900	
US T N/B 1.75 12/31/26	3,000,000.000	2,767,792.980	
US T N/B 1.875 02/15/32	10,000,000.000	8,607,812.500	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,000,000.000	3,633,300.800	
US T N/B 1.875 02/28/27	5,000,000.000	4,617,480.450	
US T N/B 1.875 02/28/29	6,000,000.000	5,375,156.280	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,920,000.000	2,727,576.550	
US T N/B 1.875 07/31/26	6,000,000.000	5,594,179.680	
US T N/B 1.875 11/15/51	3,030,000.000	1,976,897.470	
US T N/B 2.0 02/15/25	6,000,000.000	5,731,757.820	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,000,000.000	2,037,246.090	
US T N/B 2.0 11/15/26	3,700,000.000	3,446,925.770	
US T N/B 2.0 11/15/41	5,000,000.000	3,657,226.550	
US T N/B 2.125 05/31/26	4,500,000.000	4,237,207.020	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,000,000.000	2,810,742.180	
US T N/B 2.25 02/15/52	8,520,000.000	6,094,961.680	
US T N/B 2.25 03/31/26	2,000,000.000	1,894,531.240	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,800,000.000	3,698,156.250	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,030,000.000	2,185,209.970	
US T N/B 2.25 11/15/25	8,000,000.000	7,605,000.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	4,840,000.000	4,494,204.690	
US T N/B 2.375 02/15/42	6,000,000.000	4,669,570.320	
US T N/B 2.375 03/31/29	2,500,000.000	2,300,000.000	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,080,000.000	1,974,700.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	6,000,000.000	5,631,562.500	
US T N/B 2.375 05/15/29	5,650,000.000	5,191,820.310	
US T N/B 2.375 11/15/49	3,000,000.000	2,224,042.980	
US T N/B 2.5 01/31/25	6,000,000.000	5,780,625.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,210,000.000	3,248,031.460	
US T N/B 2.5 02/28/26	1,720,000.000	1,641,323.420	
US T N/B 2.5 03/31/27	6,000,000.000	5,665,664.040	
US T N/B 2.5 05/15/46	3,600,000.000	2,759,695.300	
US T N/B 2.625 01/31/26	5,280,000.000	5,058,281.230	
US T N/B 2.625 02/15/29	7,530,000.000	7,030,402.110	
US T N/B 2.625 03/31/25	6,000,000.000	5,784,257.820	
US T N/B 2.625 04/15/25	6,000,000.000	5,780,976.540	
US T N/B 2.625 05/31/27	3,000,000.000	2,841,386.730	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,000,000.000	1,917,187.500	
US T N/B 2.75 02/15/28	6,000,000.000	5,683,359.360	
US T N/B 2.75 02/28/25	4,310,000.000	4,167,483.760	
US T N/B 2.75 04/30/27	2,740,000.000	2,608,565.620	
US T N/B 2.75 05/15/25	6,000,000.000	5,791,523.460	
US T N/B 2.75 05/31/29	1,800,000.000	1,689,187.500	
US T N/B 2.75 08/15/32	9,480,000.000	8,733,450.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,480,000.000	1,219,121.090	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,200,000.000	961,500.000	
US T N/B 2.75 08/31/25	3,000,000.000	2,890,195.320	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,030,000.000	846,712.300	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,160,000.000	1,731,079.680	

US T N/B 2.875 04/30/25	3,920,000.000	3,792,829.660	
US T N/B 2.875 05/15/28	5,740,000.000	5,460,623.400	
US T N/B 2.875 05/15/32	10,000,000.000	9,318,750.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,790,000.000	1,496,293.160	
US T N/B 2.875 05/15/49	6,850,000.000	5,628,907.210	
US T N/B 2.875 05/15/52	5,200,000.000	4,272,328.110	
US T N/B 2.875 06/15/25	6,500,000.000	6,285,195.280	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,270,000.000	3,160,531.640	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,000,000.000	3,293,046.880	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,020,000.000	837,774.610	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,140,000.000	3,028,996.100	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,940,000.000	1,628,273.830	
US T N/B 3.0 02/15/48	4,080,000.000	3,424,092.180	
US T N/B 3.0 02/15/49	6,500,000.000	5,465,966.800	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,000,000.000	859,453.120	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,000,000.000	839,394.530	
US T N/B 3.0 07/15/25	5,000,000.000	4,845,214.850	
US T N/B 3.0 08/15/48	4,510,000.000	3,786,021.690	
US T N/B 3.0 08/15/52	4,340,000.000	3,659,162.500	
US T N/B 3.0 09/30/25	2,000,000.000	1,936,484.380	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,320,000.000	1,114,910.160	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,570,000.000	3,002,634.960	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,000,000.000	1,756,328.120	
US T N/B 3.125 02/15/43	760,000.000	662,610.150	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,620,000.000	2,250,283.200	
US T N/B 3.125 08/15/25	6,000,000.000	5,829,140.640	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,650,000.000	1,425,541.980	
US T N/B 3.125 08/31/27	4,000,000.000	3,857,343.760	
US T N/B 3.125 08/31/29	6,000,000.000	5,745,703.140	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,080,000.000	951,728.900	
US T N/B 3.25 05/15/42	1,950,000.000	1,740,451.160	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,000,000.000	2,909,003.910	
US T N/B 3.25 06/30/29	6,000,000.000	5,786,250.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	900,000.000	810,861.320	
US T N/B 3.375 11/15/48	1,910,000.000	1,717,470.500	
US T N/B 3.5 01/31/28	4,000,000.000	3,917,734.360	
US T N/B 3.5 01/31/30	5,000,000.000	4,891,601.550	
US T N/B 3.5 02/15/33	7,000,000.000	6,852,343.750	
US T N/B 3.5 02/15/39	890,000.000	854,695.500	
US T N/B 3.5 09/15/25	5,000,000.000	4,896,289.050	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,700,000.000	1,593,650.390	
US T N/B 3.625 02/15/53	3,000,000.000	2,857,968.750	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,000,000.000	940,058.590	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	967,324.220	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,300,000.000	1,243,759.760	
US T N/B 3.875 01/15/26	6,000,000.000	5,930,039.040	
US T N/B 3.875 02/15/43	2,500,000.000	2,435,937.500	
US T N/B 3.875 03/31/25	5,000,000.000	4,925,878.900	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,500,000.000	1,491,181.630	

US T N/B 3.875 09/30/29	3,000,000.000	2,995,546.860	
US T N/B 4.0 02/15/26	6,000,000.000	5,950,781.280	
US T N/B 4.0 02/29/28	6,000,000.000	6,009,257.820	
US T N/B 4.0 10/31/29	4,030,000.000	4,053,455.840	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,920,000.000	5,018,400.000	
US T N/B 4.0 12/15/25	6,000,000.000	5,948,906.280	
US T N/B 4.125 01/31/25	6,000,000.000	5,930,507.820	
US T N/B 4.125 10/31/27	2,800,000.000	2,810,007.810	
US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,808,406.280	
US T N/B 4.25 10/15/25	3,670,000.000	3,653,728.720	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,500,000.000	1,599,990.240	
US T N/B 4.375 05/15/40	3,300,000.000	3,495,615.220	
US T N/B 4.375 05/15/41	870,000.000	916,575.580	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,273,031.250	
US T N/B 4.5 02/15/36	400,000.000	433,367.180	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,030,000.000	1,110,388.280	
US T N/B 4.5 11/15/25	6,000,000.000	6,011,484.360	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,500,000.000	2,730,468.750	
US T N/B 4.625 02/28/25	6,300,000.000	6,281,789.090	
US T N/B 4.625 03/15/26	3,500,000.000	3,530,898.420	
US T N/B 4.75 02/15/41	20,000.000	22,105.070	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	1,803,726.550	
US T N/B 5.375 02/15/31	5,790,000.000	6,395,688.310	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	1,886,076.550	
US T N/B 6.25 05/15/30	2,800,000.000	3,205,562.500	
アメリカ・ドル 小計	836,020,000.000 (116,566,268,600)	750,464,760.750 (104,637,301,592)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,910,000.000	1,707,635.500
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	730,000.000	603,197.780
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,070,000.000	1,803,487.500
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,400,000.000	1,067,388.000
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,400,000.000	1,136,184.000
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	3,140,000.000	941,686.000
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	2,010,000.000	1,863,370.500
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	3,500,000.000	2,286,387.980
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,500,000.000	602,488.800
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,750,000.000	856,450.000
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,860,000.000	1,348,965.000
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	2,100,000.000	1,717,759.680

UK TREASURY 1.0 01/31/32	3,170,000.000	2,445,179.500	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,050,000.000	659,820.000	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	570,000.000	211,670.640	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	480,000.000	424,744.320	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	2,270,000.000	1,115,554.720	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	980,000.000	589,155.320	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,640,000.000	1,501,328.160	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,090,000.000	614,188.840	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,500,000.000	773,850.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,820,000.000	1,594,975.200	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,010,000.000	479,010.880	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	300,253.320	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,410,000.000	765,460.800	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,310,000.000	1,237,289.680	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,850,000.000	1,542,979.920	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,200,000.000	2,031,700.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	670,000.000	578,014.360	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	370,000.000	312,368.800	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,000,000.000	968,774.640	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	670,000.000	593,418.330	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	2,000,000.000	1,762,220.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,340,000.000	1,255,905.620	
UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,070,000.000	2,034,830.700	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,600,000.000	1,587,457.920	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	920,000.000	928,326.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,500,000.000	1,464,750.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,050,000.000	1,045,254.630	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,500,000.000	1,461,544.200	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,630,000.000	1,572,086.100	

	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,550,000.000	1,493,533.500	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	930,000.000	903,612.180	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	800,000.000	816,273.600	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	620,000.000	622,223.560	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,000,000.000	2,078,359.200	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,760,000.000	1,822,823.200	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,080,000.000	2,087,479.050	
イギリス・ボンド 小計		72,290,000.000 (12,673,882,800)	57,611,417.630 (10,100,433,739)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	2,500,000.000	2,265,130.000	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	680,000.000	633,071.160	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,810,000.000	1,504,133.530	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,090,000.000	883,851.570	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	870,000.000	637,654.320	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	1,430,000.000	1,353,563.640	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	700,000.000	528,101.700	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,510,000.000	2,312,259.690	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,900,000.000	1,767,944.300	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,200,000.000	1,414,882.800	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,900,000.000	2,029,528.700	
イスラエル・シュケル 小計		16,590,000.000 (645,574,965)	15,330,121.410 (596,548,679)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,730,000.000	1,555,123.170	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	3,270,000.000	2,587,744.840	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,410,000.000	1,145,992.020	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,230,000.000	982,491.300	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	3,020,000.000	2,521,819.590	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,210,000.000	709,786.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,700,000.000	2,236,072.010	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,000,000.000	1,861,300.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,840,000.000	1,687,904.230	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	450,000.000	364,741.670	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	2,660,000.000	2,337,801.750	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	920,000.000	880,624.000	

	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,460,000.000	1,369,772.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,010,000.000	815,765.920	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	650,000.000	596,696.430	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,610,000.000	3,562,386.830	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,600,000.000	1,552,446.360	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,200,000.000	1,065,959.170	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	700,000.000	667,517.530	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	530,000.000	509,119.100	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,100,000.000	1,077,842.870	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,880,000.000	2,912,637.020	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	670,000.000	699,906.320	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,100,000.000	1,137,169.330	
	オーストラリア・ドル 小計	38,950,000.000 (3,664,805,500)	34,838,619.460 (3,277,965,705)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 04/09/25	22,000,000.000	21,939,737.380	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	93,800,000.000	94,049,836.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	22,500,000.000	22,549,830.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	5,000,000.000	4,999,395.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	4,400,000.000	4,415,900.720	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	24,000,000.000	24,073,543.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.64 01/15/28	88,000,000.000	88,798,450.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	5,500,000.000	5,505,243.150	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	25,000,000.000	24,923,427.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	3,800,000.000	3,830,408.740	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	57,300,000.000	57,789,313.350	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	5,000,000.000	5,047,780.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	52,500,000.000	52,862,097.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	15,000,000.000	15,263,256.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	13,500,000.000	13,772,047.950	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	10,000,000.000	10,241,064.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	53,000,000.000	54,204,965.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	10,000,000.000	10,071,579.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	22,000,000.000	22,710,388.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	10,000,000.000	10,307,610.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	20,400,000.000	21,204,459.720	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	3,500,000.000	3,663,588.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	12,950,000.000	14,386,489.110	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	10,000,000.000	11,255,089.000	
オフショア・人民元 小計		589,150,000.000 (11,493,550,605)	597,865,502.270 (11,663,578,724)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	3,400,000.000	3,067,062.100	
	CANADA 0.75 10/01/24	10,000.000	9,497.740	
	CANADA 1.0 06/01/27	310,000.000	279,659.950	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,360,000.000	1,241,422.230	
	CANADA 1.25 03/01/25	1,100,000.000	1,041,381.960	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,650,000.000	1,503,864.450	
	CANADA 1.25 06/01/30	8,040,000.000	6,959,979.560	
	CANADA 1.5 04/01/25	2,000,000.000	1,896,143.540	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	745,600.550	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,500,000.000	1,290,688.870	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,820,000.000	2,005,026.200	
	CANADA 2.0 06/01/32	2,800,000.000	2,499,035.800	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,050,000.000	2,333,501.560	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,560,000.000	1,498,032.340	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,700,000.000	1,582,093.100	
	CANADA 2.5 12/01/32	200,000.000	185,712.000	
	CANADA 2.75 06/01/33	960,000.000	909,541.990	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,900,000.000	1,825,611.200	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,080,000.000	979,676.150	
	CANADA 2.75 12/01/64	130,000.000	114,837.450	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,300,000.000	1,263,028.460	
	CANADA 3.0 10/01/25	400,000.000	388,669.840	
	CANADA 3.0 11/01/24	2,060,000.000	2,011,516.320	
	CANADA 3.25 09/01/28	700,000.000	687,474.990	
CANADA 3.5 12/01/45	890,000.000	912,702.490		
CANADA 3.75 02/01/25	2,000,000.000	1,971,992.920		
CANADA 4.0 06/01/41	560,000.000	606,807.380		
CANADA 5.0 06/01/37	40,000.000	47,141.140		
CANADA 5.75 06/01/33	1,120,000.000	1,340,942.190		
カナダ・ドル 小計		45,440,000.000 (4,748,025,600)	41,198,644.470 (4,304,846,361)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	1,240,000.000	1,161,260.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	600,000.000	562,560.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	430,000.000	388,720.000	

	SINGAPORE 1.875 03/01/50	570,000.000	503,253.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	400,000.000	359,532.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	990,000.000	958,320.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	350,000.000	327,075.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	240,000.000	235,350.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	140,000.000	133,223.300	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	540,000.000	531,454.500	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	630,000.000	612,952.200	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	435,036.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	560,964.250	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	160,000.000	158,880.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	100,000.000	99,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	750,000.000	744,750.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	130,000.000	153,335.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	130,000.000	128,986.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	780,000.000	810,030.000	
シンガポール・ドル 小計		9,150,000.000 (949,495,500)	8,865,081.250 (919,929,481)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	700,000.000	586,707.800	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	5,280,000.000	4,857,547.200	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	6,550,000.000	5,908,279.990	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,050,000.000	3,825,711.680	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,250,000.000	3,058,575.000	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,400,000.000	4,353,707.180	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,640,000.000	5,584,225.240	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,280,000.000	3,686,129.600	
スウェーデン・クローナ 小計		33,150,000.000 (426,309,000)	31,860,883.690 (409,730,964)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	1,830,000.000	1,750,212.060	
	DENMARK 0.0 11/15/31	6,760,000.000	5,452,634.920	
	DENMARK 0.25 11/15/52	5,200,000.000	2,715,518.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,230,000.000	5,684,916.110	
	DENMARK 0.5 11/15/29	70,000.000	61,487.930	
	DENMARK 1.75 11/15/25	6,720,000.000	6,540,003.450	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,720,000.000	9,522,379.900	
デンマーク・クローネ 小計		34,530,000.000 (694,398,300)	31,727,152.370 (638,033,034)	
ニュージーラン ド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	1,300,000.000	1,061,827.880	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	460,000.000	408,858.170	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	500,000.000	322,081.470	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	500,000.000	409,119.760	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	770,000.000	739,645.960	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	530,000.000	428,505.900	

	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	430,000.000	305,657.590	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	300,000.000	277,853.460	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	750,000.000	690,006.970	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	170,000.000	165,274.000	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	200,000.000	200,622.220	
ニュージーランド・ドル 小計		5,910,000.000 (504,536,700)	5,009,453.380 (427,657,035)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,340,000.000	1,120,286.900	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,310,000.000	2,854,347.380	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,500,000.000	4,251,348.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	4,040,000.000	3,900,397.800	
	NORWAY 1.75 09/06/29	1,970,000.000	1,774,467.650	
	NORWAY 2.0 04/26/28	4,660,000.000	4,340,324.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	4,660,000.000	4,147,912.600	
	NORWAY 3.0 08/15/33	2,800,000.000	2,663,640.000	
ノルウェー・クローネ 小計		27,280,000.000 (353,003,200)	25,052,724.330 (324,182,253)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,400,000.000	2,004,600.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	3,750,000.000	3,418,875.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	1,310,000.000	961,068.400	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,050,000.000	2,198,440.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	1,310,000.000	1,246,596.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,350,000.000	3,046,490.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	5,010,000.000	4,394,772.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	1,160,000.000	979,562.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	4,600,000.000	4,366,232.600	
	POLAND 3.75 05/25/27	2,500,000.000	2,328,450.000	
	POLAND 6.0 10/25/33	1,500,000.000	1,515,750.000	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,450,000.000	3,713,580.690	
ポーランド・ズロチ 小計		33,390,000.000 (1,126,057,716)	30,174,416.690 (1,017,614,098)	
マレーシア・リ ンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,600,000.000	1,474,697.900	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	200,000.000	199,522.150	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	800,000.000	790,615.340	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,500,000.000	2,514,535.250	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,250,000.000	2,234,580.990	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	2,010,000.000	2,015,297.750	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	500,000.000	504,770.000	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	910,000.000	921,608.410	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	370,000.000	374,115.320	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	2,800,000.000	2,837,689.400	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,990,000.000	2,016,157.750	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	870,000.000	881,390.730	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	3,800,000.000	3,841,500.560	

	MALAYSIA 4.059 09/30/24	200,000.000	201,845.700	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,710,000.000	1,685,923.250	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	670,000.000	675,618.480	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	1,000,000.000	1,032,348.400	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	200,000.000	205,374.980	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	2,150,000.000	2,206,020.400	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,200,000.000	1,262,605.680	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,500,000.000	1,568,325.000	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,840,000.000	1,971,695.970	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	3,800,000.000	4,105,538.240	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	380,000.000	410,583.420	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	230,000.000	252,985.480	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,880,000.000	2,085,130.740	
マレーシア・リングgit 小計		37,360,000.000 (1,127,868,512)	38,270,477.290 (1,155,355,093)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	25,500,000.000	22,583,055.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	67,640,000.000	62,211,213.600	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	4,330,000.000	3,949,782.700	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	8,000,000.000	7,105,440.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	6,500,000.000	6,450,824.830	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	12,000,000.000	10,937,229.960	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	20,000,000.000	18,929,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	29,870,000.000	28,036,579.400	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	26,028,000.000	22,835,665.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	11,091,000.000	10,211,594.610	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	2,250,000.000	2,176,622.460	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	19,046,000.000	17,079,310.040	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	26,001,000.000	25,605,784.800	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,500,000.000	16,696,575.000	
メキシコ・ペソ 小計		275,756,000.000 (2,224,661,530)	254,808,878.200 (2,055,670,625)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,250,000.000	1,032,615.000	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,500,000.000	1,201,257.000	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	1,630,000.000	1,542,865.090	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	510,000.000	439,046.250	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	400,000.000	230,320.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	650,000.000	443,820.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,000,000.000	877,792.000	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,100,000.000	1,008,043.300	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	2,500,000.000	1,090,327.500	

AUSTRIA 0.75 02/20/28	470,000.000	427,542.550	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	2,420,000.000	2,260,998.740	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,480,000.000	1,423,275.300	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	360,000.000	260,584.560	
AUSTRIA 2.0 07/15/26	600,000.000	585,061.800	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	71,046.900	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	860,000.000	807,333.600	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	800,000.000	790,880.000	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	820,000.000	811,600.740	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	350,000.000	398,811.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	600,000.000	659,040.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,200,000.000	1,260,831.600	
BELGIUM 0.0 10/22/27	1,000,000.000	888,210.500	
BELGIUM 0.0 10/22/31	500,000.000	393,290.000	
BELGIUM 0.1 06/22/30	2,200,000.000	1,818,960.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	1,260,000.000	778,393.980	
BELGIUM 0.65 06/22/71	370,000.000	146,563.660	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,850,000.000	2,730,217.350	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,800,000.000	1,665,057.600	
BELGIUM 0.8 06/22/28	800,000.000	725,360.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,800,000.000	1,617,437.390	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,810,000.000	1,569,298.960	
BELGIUM 1.25 04/22/33	600,000.000	515,316.000	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,080,000.000	672,396.120	
BELGIUM 1.45 06/22/37	500,000.000	399,564.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,020,000.000	717,177.300	
BELGIUM 1.7 06/22/50	930,000.000	647,935.650	
BELGIUM 1.9 06/22/38	500,000.000	417,582.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	50,000.000	38,446.750	
BELGIUM 2.75 04/22/39	500,000.000	463,890.000	
BELGIUM 3.0 06/22/33	500,000.000	498,018.240	
BELGIUM 3.0 06/22/34	540,000.000	535,211.280	
BELGIUM 3.3 06/22/54	1,050,000.000	1,005,339.300	
BELGIUM 3.75 06/22/45	500,000.000	525,910.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	650,000.000	702,302.900	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,080,000.000	1,203,901.920	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,450,000.000	1,512,318.100	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,030,000.000	2,393,361.880	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,000,000.000	2,247,138.000	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	2,280,000.000	2,116,296.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,670,000.000	1,584,768.210	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	3,640,000.000	3,311,308.000	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	2,000,000.000	1,837,620.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,000,000.000	937,860.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,000,000.000	1,878,360.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,410,000.000	1,344,392.700	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	500,000.000	477,320.000	
BUNDESOBL 10/18/24	20,000.000	19,198.020	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,000,000.000	1,980,240.000	

BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	1,000,000.000	987,730.000	
BUNDESSCHAT 2.5 03/13/25	4,000,000.000	3,967,920.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,790,000.000	2,393,066.700	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	4,000,000.000	3,355,640.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,380,000.000	1,952,145.020	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,900,000.000	1,420,915.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,030,000.000	1,473,658.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,250,000.000	1,909,867.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,320,000.000	1,121,551.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,670,000.000	2,215,699.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,400,000.000	1,163,465.240	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,420,000.000	1,262,567.240	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	770,000.000	402,363.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,510,000.000	746,317.500	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	2,700,000.000	2,429,325.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	770,000.000	678,874.350	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,700,000.000	2,488,590.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	700,000.000	622,966.860	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	4,340,000.000	3,896,538.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,050,000.000	1,968,553.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,180,000.000	3,946,965.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,060,000.000	972,433.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	4,700,000.000	4,343,359.300	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,430,000.000	2,107,947.240	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,150,000.000	930,097.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	820,000.000	800,382.320	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,220,000.000	3,097,640.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,610,000.000	2,029,087.080	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,000,000.000	1,895,680.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,070,000.000	909,874.500	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	3,500,000.000	3,445,085.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	860,000.000	854,341.200	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	3,350,000.000	3,332,010.500	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,100,000.000	1,102,809.400	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,950,000.000	2,148,295.500	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,550,000.000	2,983,002.750	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,430,000.000	2,962,874.700	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	980,000.000	1,199,696.400	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	440,000.000	534,837.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	70,000.000	79,635.500	

DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	400,000.000	493,812.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	370,000.000	426,302.900	
FINLAND 0.0 09/15/30	880,000.000	717,192.080	
FINLAND 0.125 04/15/36	470,000.000	319,791.760	
FINLAND 0.125 04/15/52	510,000.000	231,066.210	
FINLAND 0.125 09/15/31	180,000.000	143,815.680	
FINLAND 0.25 09/15/40	500,000.000	307,340.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	1,500,000.000	1,406,332.500	
FINLAND 0.5 09/15/27	460,000.000	418,234.300	
FINLAND 0.5 09/15/28	690,000.000	613,627.350	
FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	834,957.060	
FINLAND 1.125 04/15/34	720,000.000	594,192.380	
FINLAND 1.375 04/15/27	300,000.000	284,566.500	
FINLAND 1.375 04/15/47	200,000.000	143,606.200	
FINLAND 1.5 09/15/32	100,000.000	88,489.700	
FINLAND 2.625 07/04/42	270,000.000	250,037.060	
FINLAND 2.75 04/15/38	100,000.000	94,523.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	600,000.000	600,051.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	70,000.000	66,451.750	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	1,700,000.000	1,534,922.770	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	4,060,000.000	3,412,265.570	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,400,000.000	2,692,715.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,490,000.000	4,115,920.140	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	8,200,000.000	7,811,566.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	4,600,000.000	4,294,753.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	1,200,000.000	1,054,706.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,110,000.000	1,360,462.590	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	430,000.000	161,018.890	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	2,270,000.000	1,323,242.020	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	2,000,000.000	1,824,500.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,220,000.000	4,743,675.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	4,720,000.000	2,506,933.600	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	4,130,000.000	2,138,650.290	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,020,000.000	2,718,607.020	
FRANCE OAT 03/25/25	7,530,000.000	7,135,604.950	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,870,000.000	3,615,706.170	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	5,140,000.000	4,910,100.650	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	4,360,000.000	3,656,657.880	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,040,000.000	1,624,656.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	4,100,000.000	3,146,750.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,910,000.000	5,389,624.500	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,160,000.000	1,471,122.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	60,000.000	39,814.800	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,310,000.000	1,898,947.050	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	3,470,000.000	2,701,589.320	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,920,000.000	4,848,850.340	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	2,500,000.000	2,469,752.500	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,000,000.000	1,999,416.000	

FRANCE OAT 3.0 05/25/33	1,500,000.000	1,510,857.000	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	2,550,000.000	2,357,643.300	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	700,000.000	693,537.600	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	820,000.000	832,956.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	40,000.000	45,484.040	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,900,000.000	2,084,672.400	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,010,000.000	3,513,067.320	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	5,800,000.000	6,647,681.600	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	7,990,000.000	9,861,753.380	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,170,000.000	1,250,645.760	
IRISH 0.0 10/18/31	530,000.000	424,125.080	
IRISH 0.2 05/15/27	730,000.000	662,176.060	
IRISH 0.35 10/18/32	1,000,000.000	804,374.000	
IRISH 0.4 05/15/35	700,000.000	524,117.300	
IRISH 0.55 04/22/41	330,000.000	212,890.310	
IRISH 0.9 05/15/28	400,000.000	367,228.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,270,000.000	1,207,585.340	
IRISH 1.1 05/15/29	300,000.000	274,275.000	
IRISH 1.3 05/15/33	580,000.000	503,492.200	
IRISH 1.35 03/18/31	720,000.000	656,121.600	
IRISH 1.5 05/15/50	690,000.000	474,809.700	
IRISH 1.7 05/15/37	180,000.000	152,033.400	
IRISH 2.4 05/15/30	810,000.000	795,752.100	
IRISH 3.0 10/18/43	800,000.000	781,725.600	
IRISH 5.4 03/13/25	550,000.000	573,339.140	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,500,000.000	1,364,250.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,750,000.000	1,574,125.000	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	2,000,000.000	1,901,240.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	5,130,000.000	4,410,774.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	7,750,000.000	7,377,922.260	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	2,000,000.000	1,679,500.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,200,000.000	1,032,360.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	3,000,000.000	2,334,199.500	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	2,130,000.000	1,946,820.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,750,000.000	1,413,681.340	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	940,000.000	627,168.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,830,000.000	1,428,498.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,750,000.000	1,446,900.000	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,000,000.000	917,450.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	2,000,000.000	1,907,500.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,910,000.000	1,776,968.500	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	2,800,000.000	2,408,770.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,130,000.000	1,089,833.020	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	840,000.000	499,464.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,000,000.000	1,928,367.300	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,940,000.000	1,841,642.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,700,000.000	1,427,932.000	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,810,000.000	2,427,011.050	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	800,000.000	466,932.000	

ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,020,000.000	706,452.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,260,000.000	1,222,452.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	3,000,000.000	2,812,824.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,860,000.000	1,761,085.200	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	400,000.000	228,480.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	680,000.000	433,704.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,250,000.000	1,193,875.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,205,400.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,700,000.000	1,480,405.900	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	580,000.000	404,492.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	2,500,000.000	2,449,795.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	850,000.000	755,225.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	800,000.000	773,040.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,280,000.000	973,568.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	830,000.000	576,020.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	2,700,000.000	2,578,230.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	880,000.000	740,520.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,000,000.000	966,747.000	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	3,410,000.000	2,912,787.900	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	530,000.000	468,679.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,540,000.000	1,292,897.760	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,830,000.000	1,691,985.970	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	750,000.000	746,775.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,160,000.000	999,036.080	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	2,000,000.000	2,003,600.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,360,000.000	2,338,807.200	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,200,000.000	1,204,842.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,010,000.000	920,964.460	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,600,000.000	1,612,800.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,880,000.000	1,835,820.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,600,000.000	1,572,160.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	4,000,000.000	4,047,200.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	1,500,000.000	1,536,450.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	2,000,000.000	2,067,600.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,200,000.000	2,262,260.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	600,000.000	596,400.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,030,000.000	2,118,032.980	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,620,000.000	1,662,489.360	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	330,000.000	354,750.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,360,000.000	1,462,816.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	290,000.000	312,359.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,690,000.000	2,939,632.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	320,000.000	365,024.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	770,000.000	864,787.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	1,900,000.000	1,767,744.800	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,400,000.000	1,271,792.200	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,000,000.000	864,318.100	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,500,000.000	997,599.040	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,760,000.000	829,666.500	

NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,500,000.000	1,248,816.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	380,000.000	308,105.210	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,950,000.000	1,846,854.750	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	2,000,000.000	1,737,328.000	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	670,000.000	465,536.770	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,500,000.000	1,400,175.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,000,000.000	827,243.020	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	900,000.000	820,758.780	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,120,000.000	1,102,212.160	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	500,000.000	492,050.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,390,000.000	1,387,907.350	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,650,000.000	1,869,352.650	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,000,000.000	1,128,700.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,670,000.000	1,869,064.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	2,880,000.000	2,659,978.080	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,600,000.000	1,433,280.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	3,300,000.000	2,868,360.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	4,000,000.000	3,762,336.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,990,000.000	1,563,145.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,030,000.000	995,408.480	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,990,000.000	2,513,675.060	
SPAIN 0.6 10/31/29	2,330,000.000	2,000,305.000	
SPAIN 0.7 04/30/32	2,010,000.000	1,617,648.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	560,000.000	387,944.370	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,010,000.000	628,725.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,430,000.000	748,780.890	
SPAIN 1.2 10/31/40	2,090,000.000	1,413,326.970	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,270,000.000	1,984,661.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,540,000.000	1,455,867.850	
SPAIN 1.4 04/30/28	3,500,000.000	3,244,990.000	
SPAIN 1.4 07/30/28	4,000,000.000	3,681,600.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	2,230,000.000	2,039,685.110	
SPAIN 1.45 10/31/71	550,000.000	258,905.280	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,040,000.000	982,280.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	500,000.000	486,353.880	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,550,000.000	1,299,716.850	
SPAIN 1.9 10/31/52	1,180,000.000	763,789.220	
SPAIN 1.95 04/30/26	300,000.000	290,919.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,160,000.000	1,999,132.830	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,700,000.000	1,665,857.200	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,840,000.000	1,675,320.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	960,000.000	902,546.880	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,860,000.000	1,510,570.060	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,010,000.000	2,002,094.670	

	SPAIN 2.8 05/31/26	2,000,000.000	1,982,100.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	950,000.000	813,867.850	
	SPAIN 3.15 04/30/33	2,000,000.000	1,955,800.000	
	SPAIN 3.45 07/30/43	2,000,000.000	1,883,680.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	540,000.000	480,124.800	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,330,000.000	1,415,060.150	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,500,000.000	3,609,823.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,440,000.000	1,613,056.320	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,430,000.000	1,632,345.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	600,000.000	659,880.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	580,000.000	689,905.360	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,000,000.000	2,392,228.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	2,707,705.000	
	ユーロ 小計	515,350,000.000 (77,209,737,000)	467,512,708.820 (70,042,754,035)	
国債証券 合計		234,408,175,528 (234,408,175,528)	211,571,601,418 (211,571,601,418)	
合計			211,571,601,418 (211,571,601,418)	

(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 187銘柄	49.09	49.46
イギリス・ポンド	国債証券 48銘柄	4.74	4.77
イスラエル・シケル	国債証券 11銘柄	0.28	0.28
オーストラリア・ドル	国債証券 24銘柄	1.54	1.55
オフショア・人民元	国債証券 24銘柄	5.47	5.51
カナダ・ドル	国債証券 29銘柄	2.02	2.03
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.43	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.19	0.19
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.30	0.30
ニュージーランド・ドル	国債証券 11銘柄	0.20	0.20
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.15	0.15
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.48	0.48
マレーシア・リングギット	国債証券 26銘柄	0.54	0.55
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.96	0.97
ユーロ	国債証券 301銘柄	32.86	33.11

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	114,818,439
コール・ローン	91,492,156
投資信託受益証券	8,097,904,131
投資証券	70,501,552,797
派生商品評価勘定	1,193
未収入金	11,196,467
未収配当金	120,907,133
流動資産合計	78,937,872,316
資産合計	78,937,872,316
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,290
未払解約金	61,208,000
流動負債合計	61,249,290
負債合計	61,249,290
純資産の部	
元本等	
元本	46,753,862,319
剰余金	
剰余金又は欠損金()	32,122,760,707
元本等合計	78,876,623,026
純資産合計	78,876,623,026
負債純資産合計	78,937,872,316

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年6月12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	38,893,824,604円
同期中追加設定元本額	27,811,679,394円
同期中一部解約元本額	19,951,641,679円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	1,672,700,227円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	35,334,695円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,799,837円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	17,667,298円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	42,801,843円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	51,273,650円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	38,314,421円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	41,138,898円
たわらノーロード 先進国リート	15,103,272,711円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,591,116,906円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	326,793,761円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,468,042,762円
たわらノーロード バランス(堅実型)	28,774,229円

たわらノーロード バランス(標準型)	563,881,175円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,185,796,579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)	47,985,232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)	494,497,663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)	500,423,171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)	873,683,734円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	622,675円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	33,752,631円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,522,007円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	25,275,694円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,678,191,840円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,491,200円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	690,947,972円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	57,534,103円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	214,120,117円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	312,458,906円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	567,875,975円
投資のソムリエ	9,045,210,186円
投資のソムリエ<DC年金>	720,615,046円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	240,510,446円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	670,367,293円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,618,196,372円
ワールドアセットバランス(基本コース)	347,351,219円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	847,154,047円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	42,415,971円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	20,915,842円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,844,141円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	100,031,740円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	176,001,936円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	50,035,961円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	23,020,391円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,147,630円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,342,049円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	87,448,568円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	284,697,856円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	326,058,688円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	217,802円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	647,540円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	125,270円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	285,547円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	711,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	506,310円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	244,380,951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)	1,243,561円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	572,716円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,700,623円
D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）	55,194,911円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	186,373,336円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	944,444,517円
計	46,753,862,319円
2. 受益権の総数	46,753,862,319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 2022年12月13日 至 2023年6月12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	2023年6月12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	2023年6月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
投資信託受益証券	281,614,660	
投資証券	1,978,190,330	
合計	2,259,804,990	

（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（2022年6月23日から2023年6月12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	2023年6月12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	59,752,178	-	59,792,275	40,097
アメリカ・ドル	27,877,600	-	27,877,200	400
オーストラリア・ドル	11,247,482	-	11,288,520	41,038
シンガポール・ドル	4,149,800	-	4,149,732	68
ユーロ	16,477,296	-	16,476,823	473
合計	59,752,178	-	59,792,275	40,097

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6871円 (16,871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

2023年6月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	144,600.000	69,408.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	391,900.000	123,448.500		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	144,308.000		
		PRIME US REIT	317,600.000	69,872.000		
		アメリカ・ドル	小計	1,765,800.000	407,036.500 (56,753,099)	
		オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	195,539.000	504,490.620	
	ARENA REIT		165,205.000	614,562.600		
	BWP TRUST		209,056.000	769,326.080		
	CENTURIA CAPITAL GROUP		302,227.000	482,052.060		
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT		240,142.000	737,235.940		
	CENTURIA OFFICE REIT		210,931.000	298,467.360		
	CHARTER HALL GROUP		212,890.000	2,339,661.100		
	CHARTER HALL LONG WALE REIT		284,748.000	1,178,856.720		
	CHARTER HALL RETAIL REIT		230,204.000	847,150.720		
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT		160,446.000	470,106.780		
	CROMWELL PROPERTY GROUP		632,521.000	335,236.130		
	DEXUS		476,074.000	3,875,242.360		
	DEXUS INDUSTRIA REIT		91,184.000	252,579.680		
	GDI PROPERTY GROUP		222,442.000	154,597.190		
GOODMAN GROUP	762,331.000		14,949,310.910			
GPT GROUP	847,586.000	3,398,819.860				
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	126,146.000	370,869.240				
HEALTHCO REIT	182,619.000	254,753.500				
HMC CAPITAL LTD	88,028.000	387,323.200				
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	674,070.000	771,810.150				
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	289,338.090				
INGENIA COMMUNITIES GROUP	162,299.000	652,441.980				

	MIRVAC GROUP	1,747,076.000	3,913,450.240	
	NATIONAL STORAGE REIT	538,807.000	1,341,629.430	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	140,343.000	91,924.660	
	REGION RE LTD	515,147.000	1,256,958.680	
	RURAL FUNDS GROUP	173,970.000	306,187.200	
	SCENTRE GROUP	2,325,996.000	6,070,849.560	
	STOCKLAND	1,067,321.000	4,376,016.100	
	VICINITY CENTRES	1,710,911.000	3,190,849.010	
	WAYPOINT REIT LTD	300,308.000	813,834.680	
	オーストラリア・ドル 小計	15,082,424.000	55,295,931.830 (5,202,794,226)	
シンガポール・ ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	228,595.000	276,599.950	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	995,816.000	1,045,606.800	
	CAPITALAND CHINA TRUST	503,380.000	500,863.100	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,243,009.000	4,373,867.550	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,500,260.000	3,945,683.800	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	358,800.000	426,972.000	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	226,700.000	133,753.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	37,092.000	
	ESR LOGOS REIT	2,683,040.000	845,157.600	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	481,400.000	286,433.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100.000	139,906.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	480,700.000	1,052,733.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,304,864.000	1,591,934.080	
	KEPPEL DC REIT	594,400.000	1,212,576.000	
	KEPPEL REIT	890,700.000	761,548.500	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	847,200.000	546,444.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	882,520.000	1,923,893.600	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,424,920.000	2,322,619.600	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,038,800.000	1,672,468.000	
	QUE COMMERCIAL REIT	1,039,155.000	348,116.920	
	PARAGON REIT	455,900.000	423,987.000	
	PARKWAY LIFE REIT	173,200.000	646,036.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	259,900.000	183,229.500	
	STARHILL GLOBAL REIT	614,900.000	310,524.500	

		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,005,290.000	1,296,824.100	
	シンガポール・ドル 小計		20,883,949.000	26,304,869.600 (2,729,656,318)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	162,640.000	258,597.600	
	ユーロ 小計		162,640.000	258,597.600 (38,743,092)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	678,000.000	3,932,400.000	
	香港・ドル 小計		678,000.000	3,932,400.000 (69,957,396)	
投資信託受益証券 合計			38,572,813	8,097,904,131 (8,097,904,131)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	44,351.000	639,097.910	
		AGREE REALTY CORP	39,205.000	2,563,614.950	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	33,832.000	635,703.280	
		ALEXANDER'S INC.	1,021.000	188,874.790	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	70,080.000	8,450,947.200	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	6,752.000	109,382.400	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	23,022.000	456,756.480	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	136,200.000	4,786,068.000	
		AMERICOLD REALTY TRUST	119,422.000	3,557,581.380	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	65,794.000	2,417,929.500	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	65,982.000	564,805.920	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	95,647.000	1,482,528.500	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	29,672.000	350,426.320	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	49,953.180	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	62,272.000	11,726,440.320	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,188.000	19,079.280	
		BOSTON PROPERTIES INC	63,205.000	3,420,022.550	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	94,814.940	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	81,948.000	363,029.640	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	132,782.000	2,850,829.540	
		BROADSTONE NET LEASE INC	77,706.000	1,265,830.740	
		BRT APARTMENTS CORP	6,159.000	120,593.220	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	48,882.000	5,535,397.680	
		CARETRUST REIT INC	44,457.000	876,247.470	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	11,835.000	275,755.500	

CENTERSPACE	6,622.000	414,537.200	
CHATHAM LODGING TRUST	22,868.000	227,536.600	
CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	92,875.090	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	28,074.720	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10,321.000	357,725.860	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	50,428.000	1,211,784.840	
COUSINS PROPERTIES INC	68,071.000	1,467,610.760	
CTO REALTY GROUTH INC	9,356.000	156,993.680	
CUBESMART	99,640.000	4,414,052.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	91,448.000	759,018.400	
DIGITAL REALTY TRUST INC	128,130.000	13,357,552.500	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	101,192.000	269,170.720	
DOUGLAS EMMETT INC	77,068.000	969,515.440	
EAST GROUP	19,310.000	3,280,769.000	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	42,482.000	616,838.640	
ELME COMMUNITIES	40,732.000	651,304.680	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	62,501.000	434,381.950	
EPR PROPERTIES	33,842.000	1,535,411.540	
EQUINIX INC	41,263.000	30,686,880.470	
EQUITY COMMONWEALTH	49,039.000	1,021,482.370	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	77,644.000	5,051,518.640	
EQUITY RESIDENTIAL	151,573.000	10,031,101.140	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	64,303.000	1,585,068.950	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	28,918.000	6,775,487.400	
EXTRA SPACE STORAGE INC	59,588.000	8,610,466.000	
FARMLAND PARTNERS INC	23,717.000	289,584.570	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	32,428.000	3,117,627.920	
FIRST INDUSTRIAL RT	58,543.000	3,008,524.770	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	37,398.000	984,689.340	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	53,550.000	76,041.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	115,268.000	5,739,193.720	
GETTY REALTY CORP	18,523.000	646,452.700	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16,720.000	213,347.200	
GLADSTONE LAND CORP	15,596.000	267,627.360	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,422.000	244,139.280	
GLOBAL NET LEASE INC	48,468.000	503,097.840	

HEALTHCARE REALTY TRUST INC	168,622.000	3,323,539.620	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	242,648.000	5,020,387.120	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,525.000	83,314.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	46,166.000	1,041,504.960	
HOST HOTELS & RESORTS INC	317,384.000	5,627,218.320	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,059.000	316,896.210	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	101,147.000	1,854,024.510	
INDUS REALTY TRUST INC	2,103.000	140,585.550	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	49,461.040	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	12,243.000	864,478.230	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	29,365.000	689,196.550	
INVITATION HOMES INC	258,457.000	8,862,490.530	
IRON MOUNTAIN INC	130,099.000	7,294,650.930	
JBG SMITH PROPERTIES	43,096.000	660,230.720	
KILROY REALTY CORP	47,193.000	1,412,958.420	
KIMCO REALTY	274,490.000	5,325,106.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	96,800.000	2,031,832.000	
LIFE STORAGE INC	37,721.000	4,816,971.700	
LTC PROPERTIES INC	18,900.000	633,150.000	
LXP INDUSTRIAL TRUST	123,739.000	1,260,900.410	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	264,892.000	2,434,357.480	
MID AMERICA	51,374.000	7,925,466.980	
NATIONAL HEALTH INVS INC	19,429.000	1,025,462.620	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	37,988.000	1,389,601.040	
NETSTREIT CORP	24,197.000	447,402.530	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	14,638.000	167,312.340	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10,016.000	461,336.960	
NNN REIT INC	80,432.000	3,481,096.960	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	186,708.960	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	103,771.000	3,228,315.810	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,132.000	168,657.680	
ORION OFFICE REIT INC	28,112.000	181,884.640	
PARAMOUNT GROUP INC	78,702.000	368,325.360	
PARK HOTELS & RESORTS INC	101,322.000	1,409,389.020	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	59,690.000	848,791.800	
PHILLIPS EDISON & CO INC	52,693.000	1,711,995.570	
PHYSICIANS REALTY TRUST	102,634.000	1,469,718.880	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	58,595.000	403,719.550	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,079.000	383,081.970	
POSTAL REALTY TRUST INC	7,309.000	109,708.090	
PROLOGIS INC	411,286.000	49,893,104.660	
PUBLIC STORAGE	70,467.000	20,213,458.950	
REALTY INCOME CORP	279,540.000	17,026,781.400	
REGENCY CENTERS CORP	68,294.000	4,139,299.340	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	55,617.000	750,273.330	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	83,912.000	4,311,398.560	
RLJ LODGING TRUST	70,804.000	767,515.360	
RPT REALTY	40,594.000	420,553.840	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24,400.000	2,335,080.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	103,588.000	1,214,051.360	
SAFEHOLD INC	17,782.000	452,907.540	
SAUL CENTERS INC	5,447.000	206,495.770	
SERVICE PROPERTIES TRUST	76,925.000	686,940.250	
SIMON PROPERTY GROUP INC	145,719.000	16,131,093.300	
SITE CENTERS CORP	81,813.000	1,081,567.860	
SL GREEN	28,057.000	754,733.300	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	61,803.000	2,474,592.120	
STAG INDUSTRIAL INC	79,360.000	2,861,721.600	
STAR HOLDINGS	5,322.000	81,054.060	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	50,883.000	349,057.380	
SUN COMMUNITIES INC	55,175.000	7,197,027.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	94,114.000	1,003,255.240	
TANGER FACTORY OUTLET	46,487.000	1,020,854.520	
TERRENO REALTY CORP	32,893.000	1,927,529.800	
THE MACERICH COMPANY	95,956.000	1,075,666.760	
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	63,796.000	432,536.880	
UDR INC	137,278.000	5,841,178.900	
UMH PROPERTIES INC	23,551.000	383,881.300	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,151.000	305,028.090	
URBAN EDGE PROPERTIES	52,509.000	780,808.830	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	14,046.000	292,156.800	

	VENTAS INC	177,959.000	8,136,285.480	
	VERIS RESIDENTIAL INC	35,212.000	601,773.080	
	VICI PROPERTIES INC	447,307.000	14,448,016.100	
	VORNADO REALTY TRUST	71,874.000	1,109,015.820	
	WELLTOWER INC	210,608.000	17,080,308.800	
	WHITESTONE REIT	19,598.000	188,336.780	
	WP CAREY INC	94,268.000	6,679,830.480	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	49,736.000	631,149.840	
	アメリカ・ドル 小計	9,787,746.000	436,296,746.520 (60,832,855,366)	
イギリス・ポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	184,841.000	96,117.320	
	AEW UK REIT PLC	78,980.000	79,927.760	
	ASSURA PLC	1,318,883.000	642,296.020	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	351,056.000	280,142.680	
	BIG YELLOW GROUP PLC	78,821.000	915,900.020	
	BRITISH LAND CO PLC	414,225.000	1,437,360.750	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	293,773.000	234,430.850	
	CLS HOLDINGS PLC	83,611.000	110,032.070	
	CUSTODIAN REIT PLC	190,248.000	176,550.140	
	DERWENT LONDON PLC	49,463.000	1,071,368.580	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	103,977.000	65,297.550	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	288,036.000	251,167.390	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	114,090.000	552,195.600	
	HAMMERSON PLC	1,737,565.000	462,192.290	
	HOME REIT PLC	286,621.000	108,915.980	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	185,316.000	180,312.460	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	337,396.000	2,070,261.850	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	441,765.000	823,008.190	
	LXI REIT PLC	767,460.000	785,111.580	
	NEWRIVER REIT PLC	148,157.000	133,637.610	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	248,473.000	194,802.830	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	600,827.000	610,440.230	
	PRS REIT PLC/THE	249,964.000	212,219.430	
	REGIONAL REIT LTD	180,491.000	91,869.910	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	95,638.000	916,212.040	

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	256,281.000	115,839.010	
	SEGRO PLC	537,887.000	4,306,323.320	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	814,673.000	980,866.290	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	552,980.000	456,208.500	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	153,569.000	87,073.620	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	844,097.000	1,189,332.670	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	362,893.000	205,397.430	
	UNITE GROUP PLC	179,276.000	1,654,717.480	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	201,966.000	263,767.590	
	WAREHOUSE REIT PLC	184,359.000	164,816.940	
	WORKSPACE GROUP PLC	60,495.000	315,481.420	
イギリス・ボンド 小計		13,209,193.000	22,241,595.400 (3,899,396,506)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314,331.000	523,046.780	
	REIT 1 LTD	87,414.000	1,423,099.920	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	92,361.000	724,110.240	
イスラエル・シュケル 小計		494,106.000	2,670,256.940 (103,909,043)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	28,626.000	648,378.900	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,568.000	177,626.640	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,337.000	97,459.530	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,738.000	586,811.880	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,104.000	135,336.800	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	49,970.520	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	36,677.000	1,817,712.120	
	CHOICE PROPERTIES REIT	72,055.000	969,860.300	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	21,716.000	315,316.320	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,237.000	333,999.740	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	56,937.000	793,132.410	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	11,617.000	173,441.810	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,876.000	51,840.400	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	46,831.000	711,831.200		

	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,984.000	1,158,854.080	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	58,204.000	597,173.040	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	15,554.050	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	32,303.000	415,739.610	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,983.000	442,448.930	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,341.000	139,274.310	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,705.000	145,373.500	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	122,144.750	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	49,976.000	389,313.040	
	PRIMARIS REIT	21,998.000	282,894.280	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,769.000	83,575.700	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	66,005.000	1,333,301.000	
	SLATE GROCERY REIT	12,066.000	156,375.360	
	SLATE OFFICE REIT	17,818.000	35,992.360	
	SMARTCENTRES REIT	31,367.000	790,448.400	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	21,434.000	54,871.040	
	カナダ・ドル 小計	783,793.000	13,026,052.020 (1,361,092,176)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	376,442.000	414,086.200	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	476,422.000	1,029,071.520	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	674,616.000	610,527.480	
	PRECINCT PROPERTIES	610,508.000	763,135.000	
	STRIDE STAPLED GROUP	256,569.000	343,802.460	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	209,563.000	484,090.530	
	ニュージーランド・ドル 小計	2,604,120.000	3,644,713.190 (311,149,165)	
ユーロ	AEDIFICA	17,538.000	1,165,400.100	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3,939.000	20,522.190	
	ALTAREA	2,083.000	250,793.200	
	CARE PROPERTY INVEST NV	16,012.000	211,358.400	
	CARMILA SA	26,256.000	388,063.680	
	COFINIMMO SA	13,780.000	1,045,213.000	
	COVIVIO	20,812.000	978,580.240	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	19,196.000	439,204.480	
	GECINA SA	24,206.000	2,393,973.400	

	HAMBORNER REIT AG	32,393.000	222,863.840	
	ICADE	14,462.000	595,545.160	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	52,518.020	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	133,768.000	781,205.120	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	12,613.000	201,555.740	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	198,163.000	206,089.520	
	KLEPIERRE	86,398.000	1,956,050.720	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	26,318.000	139,485.400	
	MERCIALYS	35,663.000	277,101.510	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	147,060.000	1,191,921.300	
	MONTEA SCA	6,010.000	466,977.000	
	NSI NV	7,741.000	158,303.450	
	RETAIL ESTATES	5,130.000	327,807.000	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	47,260.000	2,215,076.200	
	VASTNED RETAIL	7,975.000	160,297.500	
	WAREHOUSES DE PAUW	69,267.000	1,854,970.260	
	WERELDHAVE NV	18,149.000	259,167.720	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,247.000	303,311.200	
	ユーロ 小計	1,022,994.000	18,263,355.350 (2,736,215,899)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	26,101.000	88,482,390.000	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	11,135.000	60,574,400.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	67,653.000	287,863,515.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	18,354.000	87,548,580.000	
	JR REIT XXVII	66,386.000	306,371,390.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,530.000	114,146,800.000	
	LOTTE REIT CO LTD	55,954.000	223,816,000.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	39,353.000	170,595,255.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	20,887.000	77,699,640.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	29,807.000	186,591,820.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9,851.000	36,744,230.000	
SK REITS CO LTD	31,791.000	164,995,290.000		
	韓国・ウォン 小計	397,802.000	1,805,429,310.000 (195,166,908)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	896,070.000	2,517,956.700	
	LINK REIT	1,123,220.000	53,128,306.000	
	PROSPERITY REIT	538,000.000	930,740.000	

	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	445,000.000	1,303,850.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	985,000.000	1,802,550.000	
	香港・ドル 小計	3,987,290.000	59,683,402.700 (1,061,767,734)	
投資証券 合計		32,287,044	70,501,552,797 (70,501,552,797)	
合計			78,599,456,928 (78,599,456,928)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 5銘柄 投資証券 140銘柄	0.07 -	- 77.12	77.47
イギリス・ポンド	投資証券 37銘柄	-	4.94	4.96
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-	0.13	0.13
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	6.60	-	6.62
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	-	1.73	1.73
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	3.46	-	3.47
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-	0.39	0.40
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 27銘柄	0.05 -	- 3.47	3.53
韓国・ウォン	投資証券 12銘柄	-	0.25	0.25
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 5銘柄	0.09 -	- 1.35	1.44

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,128,645,695
コール・ローン	218,126,114
株式	97,334,549,112
投資信託受益証券	769,891,909
投資証券	93,623,618
派生商品評価勘定	210,608,570
未収入金	3,068,605
未収配当金	206,003,466
差入委託証拠金	2,413,644,526
流動資産合計	104,378,161,615
資産合計	104,378,161,615
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	427,703
未払金	1,459,729,340
未払解約金	212,234,000
流動負債合計	1,672,391,043
負債合計	1,672,391,043
純資産の部	
元本等	
元本	69,472,541,639
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	33,233,228,933
元本等合計	102,705,770,572
純資産合計	102,705,770,572
負債純資産合計	104,378,161,615

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年6月12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	74,225,058,256円
同期中追加設定元本額	22,843,520,898円
同期中一部解約元本額	27,596,037,515円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	9,298,264,223円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	5,522,531,617円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,845,664円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	12,857,485円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	32,142,376円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	38,371,854円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	28,705,330円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	30,959,601円
たわらノーロード 新興国株式	11,733,651,821円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,953,707,976円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,983,022,594円
たわらノーロード バランス(堅実型)	33,140,857円
たわらノーロード バランス(標準型)	129,944,218円
たわらノーロード バランス(積極型)	228,430,983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)	54,672,522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)	187,350,123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)	155,484,919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)	292,244,470円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	708,280円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,576,432円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,476,316円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	7,630,008円
たわらノーロード 全世界株式	472,184,070円
One DC 新興国株式インデックスファンド	883,401,511円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	373,154,066円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	401,972,605円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	596,408,352円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,085,718,469円
投資のソムリエ	15,233,842,002円
クルーズコントロール	670,209,941円
投資のソムリエ<DC年金>	1,217,497,328円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	458,074,216円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,359,455,282円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,292,682,506円
ワールドアセットバランス(基本コース)	594,531,654円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,442,572,294円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	67,779,250円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	33,407,657円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	9,829,040円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	225,156,849円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,064,138,216円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	336,196,103円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	88,621,924円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	36,741,899円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	22,860,433円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	5,429,454円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	26,560,756円
エマージング株式パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	11,056,834円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	410,405,623円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	6,237,770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)	212,458,887円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	95,143,888円
計	69,472,541,639円

2. 受益権の総数

(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 2022年12月13日 至 2023年6月12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	2023年6月12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	2023年6月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	179,858,384	
投資信託受益証券	68,540,445	
投資証券	1,182,692	
合計	249,581,521	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年4月19日から2023年6月12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	2023年6月12日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	166,340,016	-	166,630,464	290,448	
アメリカ・ドル	165,410,439	-	165,690,071	279,632	
ブラジル・レアル	929,577	-	940,393	10,816	
買建	20,883,256	-	20,841,763	41,493	
アメリカ・ドル	929,577	-	940,963	11,386	
フィリピン・ペソ	19,953,679	-	19,900,800	52,879	
合計	187,223,272	-	187,472,227	331,941	

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2023年6月12日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	4,245,973,949	-	4,456,486,757	210,512,808	
合計	4,245,973,949	-	4,456,486,757	210,512,808	

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4784円 (14,784円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年6月12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	24,381	7.060	172,129.860	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	7,056	140.500	991,368.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,815	71.280	628,333.200	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	264,673	1.144	302,785.910	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	118,900	1.360	161,704.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,488	0.652	56,390.170	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	54,168	2.684	145,386.910	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	50,259	0.805	40,458.490	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	71,084	0.000	0.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	16,003	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC GDR	7,413	0.000	0.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,953	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC	7,574	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	107,951	0.000	0.000	
SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000		

	TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000	
	VTB BANK PJSC	304,000,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	37,340	17.480	652,703.200	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	46,195	6.190	285,947.050	
	VK CO LTD GDR	9,858	0.000	0.000	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	897,112	0.000	0.000	
	YANDEX NV	25,601	0.000	0.000	
	PHOSAGRO PJSC GDR	18,163	0.000	0.000	
	H WORLD GROUP LTD ADR	20,210	43.070	870,444.700	
	JOYY INC-ADR	4,368	28.930	126,366.240	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,996	41.580	249,313.680	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	QIFU TECHNOLOGY INC ADR	12,687	16.250	206,163.750	
	NIO INC ADR	143,897	7.730	1,112,323.810	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	70,412	7.780	547,805.360	
	AUTOHOME INC ADR	7,801	30.080	234,654.080	
	MINISO GROUP HOLDING LTD ADR	8,323	17.140	142,656.220	
	WEIBO CORP ADR	6,261	14.380	90,033.180	
	KANZHUN LTD ADR	16,973	15.300	259,686.900	
	KE HOLDINGS INC ADR	68,733	16.700	1,147,841.100	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	6,123	67.620	414,037.260	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	1.580	95,492.040	
	PDD HOLDINGS INC ADR	52,633	76.100	4,005,371.300	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	43,488	59.720	2,597,103.360	
	IQIYI INC ADR	40,457	4.920	199,048.440	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	44,005	27.100	1,192,535.500	
アメリカ・ドル	小計	307,665,762		16,928,083.710 (2,360,282,712)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	153,458	10.280	1,577,548.240	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	279,091	5.380	1,501,509.580	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	362,185	22.260	8,062,238.100	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	307,381	8.050	2,474,417.050	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	461,907	12.920	5,967,838.440	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	690,893	6.050	4,179,902.650	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	405,864	5.070	2,057,730.480	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	196,535	14.150	2,780,970.250	
	MULTIPLY GROUP	412,002	3.230	1,330,766.460	

	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	265,941	3.900	1,037,169.900	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	311,988	4.110	1,282,270.680	
	アラブ首長国連邦・ディルハム 小計	3,847,245		32,252,361.830 (1,226,234,797)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	316,531	2,481.950	785,614,115.450	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	74,292	359.450	26,704,259.400	
	ASIAN PAINTS LTD	39,882	3,180.550	126,846,695.100	
	BANK OF BARODA	94,220	184.850	17,416,567.000	
	EICHER MOTORS LTD	14,349	3,581.300	51,388,073.700	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,533	1,715.750	47,239,744.750	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	97,265	1,370.650	133,316,272.250	
	SHREE CEMENT LTD	882	25,447.800	22,444,959.600	
	ICICI BANK LTD	535,856	938.050	502,659,720.800	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	59,693	262.200	15,651,504.600	
	STATE BANK OF INDIA LTD	184,956	578.700	107,034,037.200	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	28,293	673.450	19,053,920.850	
	TATA STEEL LTD	766,093	108.900	83,427,527.700	
	TATA MOTORS LTD	173,112	562.300	97,340,877.600	
	JSW STEEL LTD	63,016	748.500	47,167,476.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	58,975	801.000	47,238,975.000	
	BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,686	6,752.950	18,138,423.700	
	TATA POWER CO LTD	145,241	221.200	32,127,309.200	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,684	4,878.750	52,124,565.000	
	NESTLE INDIA LTD	3,503	22,073.450	77,323,295.350	
	GAIL INDIA LTD	246,273	104.900	25,834,037.700	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	113,393	1,872.000	212,271,696.000	
	VEDANTA LTD	74,877	276.750	20,722,209.750	
	AXIS BANK LTD	236,659	974.750	230,683,360.250	
	TITAN COMPANY LTD	36,961	2,876.250	106,309,076.250	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	329,755	154.250	50,864,708.750	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	13,391	1,596.550	21,379,401.050	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	384,309	120.350	46,251,588.150	
	LUPIN LTD	22,429	806.400	18,086,745.600	
	MPHASIS LTD	7,098	1,853.250	13,154,368.500	
	ACC LTD	7,500	1,837.300	13,779,750.000	
	BAJAJ FINANCE LTD	28,355	7,037.150	199,538,388.250	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	180,705	2,652.900	479,392,294.500	
	INFOSYS LTD	345,402	1,265.950	437,261,661.900	
	WIPRO LTD	144,383	397.300	57,363,365.900	

TATA ELXSI LTD	3,406	7,817.600	26,626,745.600	
MRF LTD	208	98,390.950	20,465,317.600	
INDIAN OIL CORP LTD	302,373	90.300	27,304,281.900	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	85,321	2,636.200	224,923,220.200	
TRENT LTD	18,269	1,598.400	29,201,169.600	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	10,567	4,926.700	52,060,438.900	
HCL TECHNOLOGIES LTD	98,779	1,109.750	109,619,995.250	
DABUR INDIA LTD	65,862	549.950	36,220,806.900	
HERO MOTOCORP LTD	11,725	2,899.300	33,994,292.500	
SRF LTD	15,568	2,429.700	37,825,569.600	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,426	2,265.100	19,085,732.600	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	11,416	4,666.800	53,276,188.800	
BHARTI AIRTEL LTD	232,050	833.500	193,413,675.000	
UNITED SPIRITS LTD	31,096	888.200	27,619,467.200	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	100,140	983.950	98,532,753.000	
DIVI'S LABORATORIES LTD	12,642	3,428.750	43,346,257.500	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	14,119	9,627.800	135,934,908.200	
AUROBINDO PHARMA LTD	28,484	669.400	19,067,189.600	
HAVELLS INDIA LTD	26,438	1,345.850	35,581,582.300	
TVS MOTOR COMPANY LTD	25,167	1,336.000	33,623,112.000	
INDRAPRASTHA GAS LTD	30,576	463.050	14,158,216.800	
JINDAL STEEL & POWER LTD	32,770	523.950	17,169,841.500	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	255,944	81.750	20,923,422.000	
SHRIRAM FINANCE LTD	23,798	1,417.200	33,726,525.600	
PETRONET LNG LTD	84,155	222.800	18,749,734.000	
CIPLA LTD/INDIA	55,665	969.250	53,953,301.250	
LARSEN & TOUBRO LTD	71,409	2,363.000	168,739,467.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	11,951	8,153.250	97,439,490.750	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	94,948	3,209.300	304,716,616.400	
ADANI ENTERPRISES LTD	18,069	2,451.150	44,289,829.350	
NTPC LTD	456,652	182.800	83,475,985.600	
YES BANK LTD	1,230,792	16.600	20,431,147.200	
AMBUJA CEMENTS LTD	63,176	455.700	28,789,303.200	
BHARAT FORGE LTD	26,609	815.600	21,702,300.400	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	129,392	415.050	53,704,149.600	
ITC LTD	308,974	438.450	135,469,650.300	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	15,113	2,614.950	39,519,739.350	
UNITED PHOSPHORUS LTD	49,294	680.250	33,532,243.500	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	9,851	1,805.950	17,790,413.450	
SIEMENS INDIA LTD	9,327	3,658.550	34,123,295.850	
INFO EDGE INDIA LTD	7,593	4,143.100	31,458,558.300	

CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	65,008	379.950	24,699,789.600	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	42,939	1,035.350	44,456,893.650	
TECH MAHINDRA LTD	56,369	1,063.050	59,923,065.450	
INDIAN HOTELS CO LTD	90,065	381.950	34,400,326.750	
MARICO LTD	53,087	533.200	28,305,988.400	
PAGE INDUSTRIES LTD	589	38,363.200	22,595,924.800	
ABB LTD/INDIA	5,625	4,151.200	23,350,500.000	
DLF LTD	64,955	485.200	31,516,166.000	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	364,579	244.900	89,285,397.100	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	55,683	734.950	40,924,220.850	
BAJAJ FINSERV LTD	40,041	1,466.500	58,720,126.500	
BAJAJ AUTO LTD	6,864	4,743.400	32,558,697.600	
JUBILANT FOODWORKS LTD	40,548	479.550	19,444,793.400	
ADANI POWER LTD	77,437	276.200	21,388,099.400	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,565	1,116.800	12,915,792.000	
COAL INDIA LTD	162,207	227.650	36,926,423.550	
PI INDUSTRIES LTD	7,418	3,619.900	26,852,418.200	
VARUN BEVERAGES LTD	23,961	1,591.400	38,131,535.400	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	11,290	2,848.450	32,159,000.500	
LTIMINDTREE LTD	9,351	4,823.050	45,100,340.550	
ADANI GREEN ENERGY LTD	33,577	963.650	32,356,476.050	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	101,503	581.700	59,044,295.100	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	762.250	12,042,787.750	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	8,797	3,732.900	32,838,321.300	
BANDHAN BANK LTD	78,230	256.550	20,069,906.500	
GODREJ PROPERTIES LTD	12,688	1,429.900	18,142,571.200	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	43,239	1,065.700	46,079,802.300	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	30,158	925.800	27,920,276.400	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	23,163	640.150	14,827,794.450	
ZOMATO LTD	451,476	77.600	35,034,537.600	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	81,877	569.700	46,645,326.900	
SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	43,809	535.350	23,453,148.150	
BERGER PAINTS INDIA LTD	26,332	647.700	17,055,236.400	
AVENUE SUPERMARTS LTD	16,927	3,632.100	61,480,556.700	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	23,926	1,215.500	29,082,053.000	

	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	36,667	495.050	18,151,998.350	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	14,070	2,462.750	34,650,892.500	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	47,341	1,232.400	58,343,048.400	
インド・ルピー	小計	11,235,826		8,085,611,437.200 (13,745,539,443)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	902,200	1,975.000	1,781,845,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,885,085	710.000	2,048,410,350.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	144,501	23,075.000	3,334,360,575.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	476,900	7,425.000	3,540,982,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	822,500	4,550.000	3,742,375,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,109,800	6,800.000	14,346,640,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,161,800	4,150.000	21,421,470,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	752,600	5,025.000	3,781,815,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	292,400	7,400.000	2,163,760,000.000	
	BANK MANDIRI	3,878,100	5,125.000	19,875,262,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	7,062,200	5,425.000	38,312,435,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	784,000	9,225.000	7,232,400,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,270,600	2,050.000	4,654,730,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	375,332	5,925.000	2,223,842,100.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,735,500	9,100.000	52,193,050,000.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	287,700	6,350.000	1,826,895,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,380,900	2,190.000	3,024,171,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	259,300	11,375.000	2,949,537,500.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,697,900	2,700.000	4,584,330,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	2,218,600	1,015.000	2,251,879,000.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	86,918,700	127.000	11,038,674,900.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,232,482	3,100.000	3,820,694,200.000	
インドネシア・ルピア	小計	127,649,100		210,149,559,625.000 (1,975,405,860)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	58.620	763,935.840	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	46.740	271,092.000	

LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	10.500	238,350.000	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	21.810	129,551.400	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	83.470	250,410.000	
HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	15,000	16.820	252,300.000	
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	7,140	19.360	138,230.400	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD	48,300	6.830	329,889.000	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	9.290	111,480.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,080	63.910	772,032.800	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	12.900	157,380.000	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	14.480	253,400.000	
UNISPLENDOR CORP LTD	21,240	32.990	700,707.600	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	11.810	124,005.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	10.480	200,168.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	71.540	85,848.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	15.670	253,854.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	137.040	287,784.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	24.200	285,560.000	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	17.200	153,080.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	31.850	257,985.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	13,600	21.890	297,704.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	23.770	330,403.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	12.450	297,555.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	7.760	244,440.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	3.980	245,964.000	

GEM CO LTD	29,100	6.930	201,663.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	97.270	252,902.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	27.160	187,404.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	7.570	439,817.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	13.470	227,643.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	9,800	103.720	1,016,456.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	11,995	9.600	115,152.000	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	24.530	144,825.120	
ZHEJIANG NHU CO LTD	27,312	15.550	424,701.600	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	9.000	266,400.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	26.850	358,716.000	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	19.160	126,456.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	24.410	124,491.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	47.040	437,472.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	25.610	266,344.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	11,500	32.840	377,660.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	33,300	40.790	1,358,307.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	11,300	66.640	753,032.000	
CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD	5,700	29.320	167,124.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	10.310	185,580.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	11.660	209,880.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	74.980	757,298.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	14.140	158,368.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	11.980	297,104.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	9.350	94,435.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	11.590	64,904.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	22.640	319,224.000	
DAAN GENE CO LTD	13,900	12.370	171,943.000	

SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	30.100	361,200.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	21.800	170,040.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	71,750	11.530	827,277.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	61.690	370,140.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	6,139	87.060	534,461.340	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	11,470	45.670	523,834.900	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	12.500	158,750.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	3.940	144,598.000	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD	32,000	7.970	255,040.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	60,929	19.780	1,205,175.620	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	28.770	310,716.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	3,584	33.180	118,917.120	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	11,100	33.420	370,962.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	23.180	159,942.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	87,100	6.150	535,665.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	51.480	252,252.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	9.460	144,738.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	39.900	299,250.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	24.260	121,300.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	99,100	2.910	288,381.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	34.210	543,939.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	22.500	220,500.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	9,400	205.940	1,935,836.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	9,800	57.040	558,992.000	

BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	6.540	97,773.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	22,300	36.390	811,497.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	8,740	12.960	113,270.400	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,448	18.990	141,437.520	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	54.570	496,587.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	165.740	596,664.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.650	242,592.000	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	9.100	130,130.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	45,054	27.180	1,224,567.720	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	19.380	579,462.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.720	157,300.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.760	481,988.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	11.840	235,616.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	18.750	358,125.000	
IFLYTEK CO LTD	15,900	66.350	1,054,965.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.280	212,952.000	
GOERTEK INC	25,100	18.180	456,318.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.670	142,071.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	44,000	26.760	1,177,440.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	39,600	11.530	456,588.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	148,720	3.900	580,008.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	6.020	170,366.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	4.760	178,976.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	12.070	488,690.160	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.460	146,642.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	27,400	24.740	677,876.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	52.550	552,826.000	

EAST MONEY INFORMATION CO LTD	101,218	14.230	1,440,332.140	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	9,800	136.260	1,335,348.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	24,500	164.590	4,032,455.000	
WANDA FILM HOLDING CO LTD	21,700	12.490	271,033.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	66,200	7.080	468,696.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	4.000	872,400.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	13.330	611,847.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	18,700	35.200	658,240.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.140	386,622.000	
PING AN BANK CO LTD	107,000	11.880	1,271,160.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	44,580	16.970	756,522.600	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	146,300	4.580	670,054.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	14.670	808,317.000	
ZTE CORP	31,100	36.400	1,132,040.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	6.470	184,395.000	
WEICHAO POWER CO LTD	48,100	11.820	568,542.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	38.750	162,750.000	
GF SECURITIES CO LTD	38,700	14.940	578,178.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	10.730	226,403.000	
BYD CO LTD	11,500	258.000	2,967,000.000	
YOUNGY CO LTD	2,100	73.500	154,350.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	7.030	212,306.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	6.370	217,217.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	40.030	386,689.800	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	47.000	245,340.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	15.950	175,450.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	44,500	11.180	497,510.000	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	8,400	18.810	158,004.000	

YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	41.950	88,095.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	23.500	225,600.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	19.220	224,874.000	
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	6,400	38.360	245,504.000	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU CO LTD	15,200	15.580	236,816.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	17.920	143,360.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	21.330	270,891.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,500	307.000	1,074,500.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	6.600	198,660.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	25.600	327,680.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	6.850	234,270.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	57,300	4.910	281,343.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	18.330	101,731.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	2,800	245.870	688,436.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	6.650	103,740.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	64.780	427,548.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	46.840	28,104.000	
NINESTAR CORP	4,500	35.810	161,145.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	10.040	255,216.800	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	21,400	19.790	423,506.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	51.690	82,704.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	14.050	237,445.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	23.750	254,125.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	134.800	245,336.000	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	87.230	157,014.000	

MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	6.970	105,247.000	
SF HOLDING CO LTD	32,000	48.080	1,538,560.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	66.460	119,628.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.770	136,172.000	
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	47.750	191,000.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	88.160	220,400.000	
GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD	4,700	46.130	216,811.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	100,190	6.290	630,195.100	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	14.300	556,270.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	6.230	454,790.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	68.630	157,849.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	24.030	627,183.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	16,161	33.940	548,504.340	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	12.400	112,840.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	49,400	14.100	696,540.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	57.820	179,242.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.030	225,675.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,446	26.840	334,050.640	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	7.240	280,912.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	34.650	128,205.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	23.730	123,396.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	14.340	219,086.520	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	2,200	119.200	262,240.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	35.650	157,216.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,900	92.380	360,282.000	

GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	64.000	172,800.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	36.620	113,522.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	95.810	201,201.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	47.130	429,637.080	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	13.590	129,105.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	5,400	115.200	622,080.000	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	10,300	14.250	146,775.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	4,700	68.880	323,736.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	34.880	240,672.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	76.300	346,402.000	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	114.200	342,600.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO- PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	33.740	91,098.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	8,030	24.760	198,822.800	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	55.870	72,631.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	28.390	136,272.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	29.770	92,287.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	25.610	81,952.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.440	94,488.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	68.950	165,480.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	12.880	274,344.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	12.690	167,508.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	4,200	67.450	283,290.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	73.200	139,080.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	36,700	8.240	302,408.000	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	23.990	283,082.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	56,100	19.640	1,101,804.000	

SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,400	302.000	2,234,800.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	60,800	4.830	293,664.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	8.220	127,410.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,600	123.450	197,520.000	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	2,700	96.250	259,875.000	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	16.250	138,125.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	29.580	120,094.800	
SG MICRO CORP	3,150	103.660	326,529.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	27,640	212.040	5,860,785.600	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	103.250	311,402.000	
WUXI APTEC CO LTD	19,572	67.440	1,319,935.680	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	30.460	313,738.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	92,100	4.040	372,084.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	4.210	347,325.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	49.490	361,277.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	104.710	268,057.600	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	52,300	12.590	658,457.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	4,950	45.970	227,551.500	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	960	103.490	99,350.400	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	189.280	208,208.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	90.580	99,638.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,900	53.760	209,664.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	1,800	80.700	145,260.000	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	152.290	456,870.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	58.190	314,226.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	75,000	5.950	446,250.000	

NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	54.420	146,934.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	29.660	243,212.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	26,300	12.960	340,848.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	8,730	96.010	838,167.300	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	2,380	72.070	171,526.600	
JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD	3,220	45.300	145,866.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	17.120	219,136.000	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	43,700	8.490	371,013.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.880	329,184.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	3.960	279,972.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	25.090	268,463.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.480	210,304.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	91.480	201,256.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	50.730	147,117.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	166,100	5.640	936,804.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	76.920	246,144.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	211.000	168,800.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	140.000	215,040.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	185,000	5.510	1,019,350.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.490	220,290.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	42.240	97,152.000	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	900	104.370	93,933.000	
HOYMILES POWER ELECTRONICS INC	400	526.900	210,760.000	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	4,000	85.860	343,440.000	

TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	6.330	275,355.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	5,070	37.960	192,457.200	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	95.250	133,350.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	40.450	246,745.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	28.600	45,760.000	
SHENZHEN SED INDUSTRY CO LTD	7,600	34.010	258,476.000	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD	6,300	44.560	280,728.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	50.990	305,940.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,860	65.490	187,301.400	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	22,872	37.000	846,264.000	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.870	244,572.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	7,077	66.450	470,266.650	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	57.900	167,910.000	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	3,800	37.880	143,944.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	151.200	393,120.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	17,100	39.160	669,636.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	43.800	201,480.000	
ASR MICROELECTRONICS CO LTD	4,000	82.920	331,680.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	12.710	510,942.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,800	226.780	634,984.000	
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP INC	5,600	59.870	335,272.000	
GALAXYCORE INC	18,400	16.360	301,024.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,060	57.750	234,465.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,600	426.500	682,400.000	

SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	5,200	134.550	699,660.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	3,247	494.500	1,605,641.500	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	21.230	403,370.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	600	334.240	200,544.000	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	44.530	382,958.000	
HUNAN CHANGYUAN LICO CO LTD	22,400	11.910	266,784.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.400	445,440.000	
WINTIME ENERGY GROUP CO LTD	249,900	1.420	354,858.000	
PETROCHINA CO LTD	122,100	7.860	959,706.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	373,700	5.070	1,894,659.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	511,200	3.680	1,881,216.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	4.130	809,480.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	214,700	6.780	1,455,666.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	37.880	522,744.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	42,800	29.450	1,260,460.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	129,200	33.740	4,359,208.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	67,800	49.480	3,354,744.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	129,900	17.100	2,221,290.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	188,500	7.560	1,425,060.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	217,700	4.010	872,977.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	13.800	586,500.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	7,800	1,666.000	12,994,800.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	225,700	6.050	1,365,485.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	70,300	20.180	1,418,654.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,700	29.810	1,213,267.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.400	206,820.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	147,300	22.860	3,367,278.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	7.740	639,324.000	

CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	341,400	3.290	1,123,206.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	271,500	6.180	1,677,870.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	9.550	530,025.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.970	422,079.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	42,800	29.840	1,277,152.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	148,400	4.890	725,676.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	191,200	5.310	1,015,272.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	151,400	5.910	894,774.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	26.210	608,072.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	54,400	13.880	755,072.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	9.570	564,630.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	23.230	271,791.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	76,700	13.390	1,027,013.000	
CRRC CORP LTD	141,700	6.530	925,301.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	40,952	45.790	1,875,192.080	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	23.900	415,860.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	49,500	13.760	681,120.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	155,700	8.150	1,268,955.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	16,300	37.650	613,695.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	32,100	22.800	731,880.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	15.490	746,618.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	3.900	395,070.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	6.580	369,796.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	17,400	29.950	521,130.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	7.350	194,040.000	
GEMDALE CORP	39,700	7.630	302,911.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	33,300	18.220	606,726.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	20,000	87.350	1,747,000.000	

SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.570	359,659.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	113,500	11.710	1,329,085.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	6.690	368,619.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	12.760	487,432.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	43,844	26.680	1,169,757.920	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	6.140	182,972.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	13,300	116.800	1,553,440.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	10.330	319,197.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.820	404,950.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	98.820	434,808.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.890	97,250.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	102,000	5.580	569,160.000	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL SHANGHAI CO LTD	19,300	14.100	272,130.000	
AIR CHINA LTD	60,700	8.220	498,954.000	
TBEA CO LTD	18,600	22.990	427,614.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	8.290	360,615.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	63,600	4.090	260,124.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	117,300	5.750	674,475.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	32,200	27.800	895,160.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	46.970	488,488.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	33.610	231,909.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	18.990	282,951.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.730	127,939.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	28,500	17.710	504,735.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	39,100	8.800	344,080.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	9.400	310,200.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	15.370	364,269.000	

SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	23.200	264,480.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	18,600	40.190	747,534.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	8.720	499,656.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	15.650	118,940.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	89,670	10.660	955,882.200	
CMOC GROUP LIMITED	119,700	5.400	646,380.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	48,300	11.200	540,960.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	6.170	208,546.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	56.280	506,520.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	25.400	511,048.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	26.280	204,984.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	10.870	301,099.000	
BBMG CORP	54,200	2.280	123,576.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	84,500	3.220	272,090.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.680	450,744.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	14,000	28.220	395,080.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	6.770	290,433.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	30,600	4.790	146,574.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	18.270	274,397.130	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	6.850	397,300.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	26,400	16.770	442,728.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	41.800	429,035.200	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	20.440	332,150.000	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD	127,500	2.540	323,850.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	18.650	61,545.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	36,400	5.930	215,852.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.770	163,430.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	32.990	336,498.000	

XIAMEN C & D INC	18,900	11.030	208,467.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	7.030	179,968.000	
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO LTD	29,800	9.020	268,796.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	39.000	179,400.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	7.160	120,288.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	15,100	27.250	411,475.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	49,500	9.690	479,655.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	14,900	12.670	188,783.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.110	161,934.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	6.300	123,480.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	10.570	246,281.000	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,900	285.150	1,112,085.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	6.990	238,359.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,480	204.200	1,527,416.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	10.770	135,702.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	6.030	342,504.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	7.380	184,500.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	8,450	48.490	409,740.500	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	13.340	270,802.000	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	19,400	7.640	148,216.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	3.110	90,812.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	14,400	25.900	372,960.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	11.110	354,409.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	15.480	195,048.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	12.110	316,071.000	

JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	35.560	149,352.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.580	273,656.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	33,900	14.940	506,466.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	17.010	216,027.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	18.010	104,998.300	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	14.000	273,000.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	13.310	157,058.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	12.170	272,608.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	22,500	14.830	333,675.000	
TONGWEI CO LTD	29,000	31.820	922,780.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	10,654	45.500	484,757.000	
JCET GROUP CO LTD	10,900	31.800	346,620.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	30.120	204,816.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	90.490	226,225.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	48.070	254,771.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	13.170	73,752.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	29.700	311,553.000	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	130.890	222,513.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	13.930	282,026.780	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	2.400	149,760.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	14.340	189,288.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	9,624	55.500	534,132.000	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	9.220	180,712.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	13.900	272,440.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	10.560	208,032.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	12.830	201,431.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	83.570	142,069.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	36.630	179,487.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	22.210	124,376.000	

SHEDE SPIRITS CO LTD	2,100	130.460	273,966.000	
BTG HOTELS GROUP CO LTD	14,800	19.930	294,964.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	53.970	226,674.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,500	63.670	95,505.000	
YUNNAN BOTANEE BIO- TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	86.500	77,850.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	1,440	123.820	178,300.800	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	38.470	100,022.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	88.970	142,352.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	156.420	218,988.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	53.920	382,832.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	37.750	419,025.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	181,700	5.450	990,265.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	23.980	278,168.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	78,900	5.910	466,299.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	191.850	191,850.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	840	289.040	242,793.600	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	1,600	154.530	247,248.000	
3PEAK INC	1,200	226.970	272,364.000	
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	4,800	95.000	456,000.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	46,968	27.600	1,296,316.800	
HUAIIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	12.010	152,527.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	106.580	191,844.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	5.180	379,694.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	29.550	301,410.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	63,251	17.750	1,122,705.250	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	28,819	48.750	1,404,926.250	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	54.260	271,300.000	

HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	28.710	200,970.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	8.130	107,316.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	63.980	447,860.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	22,300	15.580	347,434.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	14.880	605,616.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	6.880	722,400.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	52.530	178,602.000	
SERES GROUP CO LTD	11,700	25.400	297,180.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	55.650	294,945.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,000	95.600	191,200.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.600	632,320.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	45,400	12.210	554,334.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	21.720	247,608.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	54.280	75,992.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	21.320	42,640.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	28,300	14.950	423,085.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	8,850	38.310	339,043.500	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	11.400	346,560.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	55,200	7.380	407,376.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	3,200	96.720	309,504.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	21,300	19.230	409,599.000	
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	14,812	28.950	428,807.400	
TOLY BREAD CO LTD	8,467	10.430	88,310.810	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,004	34.800	139,339.200	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	500	525.000	262,500.000	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	47.030	138,268.200	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	16.810	190,121.100	
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	9.940	490,042.000	
SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	55.310	365,046.000	
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	16.030	256,480.000	

	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	42.300	190,350.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	103,500	2.940	304,290.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	14.590	156,113.000	
オフショア・人民元 小計		16,778,568		243,762,924.110 (4,755,497,758)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	480,177	16.000	7,682,832.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	342,736	5.998	2,055,730.520	
	OOREDOO QSC	79,416	10.550	837,838.800	
	QATAR FUEL QSC	65,374	16.200	1,059,058.800	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	47,654	17.250	822,031.500	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	107,400	9.889	1,062,078.600	
	INDUSTRIES QATAR QSC	157,045	11.650	1,829,574.250	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	174,049	17.820	3,101,553.180	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	249,488	3.971	990,716.840	
	MASRAF AL RAYAN	554,259	2.612	1,447,724.500	
	BARWA REAL ESTATE CO	203,813	2.605	530,932.860	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	451,662	1.993	900,162.360	
	DUKHAN BANK	202,475	3.858	781,148.550	
カタール・リアル 小計		3,115,548		23,101,382.760 (884,551,946)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	838,983	0.733	614,974.530	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	199,700	0.512	102,246.400	
	GULF BANK KSCP	210,518	0.257	54,103.120	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	778,864	0.936	729,016.700	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	171,911	0.615	105,725.260	
	MABANEE CO KPSC	72,704	0.777	56,491.000	
	BOUBYAN BANK KSCP	144,441	0.623	89,986.740	
クウェート・ディナール 小計		2,417,121		1,752,543.750 (796,986,796)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	48,542	17,200.000	834,922,400.000	
	BANCOLOMBIA SA	27,434	33,190.000	910,534,460.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	45,692	29,950.000	1,368,475,400.000	
コロンビア・ペソ 小計		121,668		3,113,932,260.000 (103,669,033)	

サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	29,425	46.550	1,369,733.750	
	JARIR MARKETING CO	61,270	16.760	1,026,885.200	
	ETIHAD ETISALAT CO	36,691	46.150	1,693,289.650	
	SAUDI BRITISH BANK	105,304	37.850	3,985,756.400	
	AL RAJHI BANK	203,464	73.500	14,954,604.000	
	ARAB NATIONAL BANK	71,659	26.500	1,898,963.500	
	BANK ALBILAD	47,980	38.850	1,864,023.000	
	BANK AL-JAZIRA	41,743	18.480	771,410.640	
	BANQUE SAUDI FRANSI	62,234	41.200	2,564,040.800	
	RIYAD BANK	153,398	33.800	5,184,852.400	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,554	17.200	903,928.800	
	SAUDI TELECOM CO	207,251	43.100	8,932,518.100	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	24,297	129.200	3,139,172.400	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	93,109	88.900	8,277,390.100	
	SAUDI ELECTRICITY CO	87,717	22.420	1,966,615.140	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	38,856	25.900	1,006,370.400	
	SAVOLA GROUP	28,334	39.000	1,105,026.000	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	37,325	14.940	557,635.500	
	ALMARAI CO JSC	23,932	57.900	1,385,662.800	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,987	188.200	750,353.400	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,972	9.530	447,643.160	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	38,197	36.550	1,396,100.350	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	14,397	45.250	651,464.250	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	75,912	13.440	1,020,257.280	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	47,334	15.980	756,397.320	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	47,684	11.220	535,014.480	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	38,524	14.120	543,958.880	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	7,946	185.800	1,476,366.800	
	ALINMA BANK	102,823	34.050	3,501,123.150	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	134,367	43.300	5,818,091.100	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	5,036	241.000	1,213,676.000		
DALLAH HEALTHCARE CO	3,751	165.400	620,415.400		
SAUDI ARABIAN OIL CO	276,342	32.350	8,939,663.700		

	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	9,127	269.200	2,456,988.400	
	ACWA POWER CO	7,940	153.600	1,219,584.000	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	5,202	142.000	738,684.000	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,627	334.000	877,418.000	
	NAHDI MEDICAL CO	4,279	172.200	736,843.800	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	5,202	169.800	883,299.600	
	ELM CO	2,420	557.000	1,347,940.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	306,025	37.450	11,460,636.250	
	サウジアラビア・リアル 小計	2,592,637		109,979,797.900 (4,094,547,876)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	94,700	36.250	3,432,875.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	308,500	19.500	6,015,750.000	
	SIAM MAKRO PCL NVDR	222,800	38.250	8,522,100.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	124,300	37.500	4,661,250.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	57,000	132.500	7,552,500.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	864,300	8.750	7,562,625.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	29,400	143.500	4,218,900.000	
	SHIN CORP PCL	97,200	74.750	7,265,700.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	392,200	21.500	8,432,300.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	123,500	219.000	27,046,500.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	642,820	13.800	8,870,916.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	325,700	98.000	31,918,600.000	
	PTT PCL	1,046,400	31.750	33,223,200.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	116,200	53.000	6,158,600.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	826,100	8.600	7,104,460.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	81,350	333.000	27,089,550.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	436,200	72.250	31,515,450.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	193,400	67.750	13,102,850.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,160,500	28.750	33,364,375.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	62,800	235.000	14,758,000.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	328,110	33.750	11,073,712.500	
	THAI OIL PCL NVDR	124,700	46.000	5,736,200.000	
	CP ALL PCL NVDR	604,400	63.250	38,228,300.000	

	BTS GROUP HOLDINGS PCL	866,900	7.350	6,371,715.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	146,445	151.500	22,186,417.500	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	189,122	33.250	6,288,306.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	234,908	38.500	9,043,958.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	167,600	64.000	10,726,400.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	832,800	8.350	6,953,880.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	98,200	37.500	3,682,500.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	309,700	47.000	14,555,900.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	142,800	30.000	4,284,000.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	817,200	5.000	4,086,000.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	196,333	40.750	8,000,569.750	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	143,300	38.500	5,517,050.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	69,000	55.000	3,795,000.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	295,300	20.800	6,142,240.000	
	SCB X PCL NVDR	79,600	107.500	8,557,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,135,228	7.050	8,003,357.400	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	32,500	65.000	2,112,500.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	87,300	41.250	3,601,125.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	74,400	58.750	4,371,000.000	
	タイ・パーツ 小計	14,181,216		485,133,632.650 (1,950,237,203)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,062	665.000	5,361,230.000	
	CEZ	16,771	1,030.000	17,274,130.000	
	MONETA MONEY BANK AS	36,549	79.200	2,894,680.800	
	チェコ・コルナ 小計	61,382		25,530,040.800 (161,385,600)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	7,247,805	37.280	270,198,170.400	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	5,709	24,000.000	137,016,000.000	
	BANCO DE CHILE	4,867,306	84.450	411,043,991.700	
	EMPRESAS CMPC SA	119,258	1,464.900	174,701,044.200	
	EMPRESAS COPEC SA	40,423	5,869.000	237,242,587.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,516	6,297.000	66,219,252.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,756,795	55.880	98,169,704.600	
	ENEL AMERICAS SA	2,133,152	111.800	238,486,393.600	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	14,993	55,800.000	836,609,400.000	

	FALABELLA SA	101,069	1,850.000	186,977,650.000	
	CENCOSUD SA	116,908	1,570.000	183,545,560.000	
	ENEL CHILE SA	2,415,702	49.250	118,973,323.500	
チリ・ペソ 小計		18,829,636		2,959,183,077.000 (522,932,037)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	336,662	18.460	6,214,780.520	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	73,827	55.600	4,104,781.200	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	154,226	37.140	5,727,953.640	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,410	692.300	5,129,943.000	
	HEKTAS TICARET TAS	121,118	32.020	3,878,198.360	
	KOC HOLDING AS	81,550	103.600	8,448,580.000	
	SASA POLYESTER SANAYI	108,067	65.550	7,083,791.850	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	144,586	44.920	6,494,803.120	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	14,011	231.500	3,243,546.500	
	TURK HAVA YOLLARI	58,741	176.900	10,391,282.900	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	133,611	37.340	4,989,034.740	
	TURKIYE IS BANKASI	315,842	13.450	4,248,074.900	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	94,878	77.500	7,353,045.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	313,727	12.380	3,883,940.260	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	92,361	43.600	4,026,939.600	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	48,633	163.600	7,956,358.800	
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	78,429	24.940	1,956,019.260		
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	5,176	580.200	3,003,115.200		
トルコ・リラ 小計		2,182,855		98,134,188.850 (585,193,795)	
ハンガリー・ フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	13,796	8,360.000	115,334,560.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	47,806	3,000.000	143,418,000.000	
	OTP BANK NYRT	24,932	11,580.000	288,712,560.000	
ハンガリー・フォロント 小計		86,534		547,465,120.000 (222,994,588)	
フィリピン・ペ ソ	AYALA LAND INC	646,300	24.850	16,060,555.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	158,120	55.000	8,696,600.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	195,973	104.300	20,439,983.900	
	AYALA CORP	33,153	679.500	22,527,463.500	

	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	108,890	198.000	21,560,220.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	249,960	48.200	12,048,072.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	46,960	235.600	11,063,776.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	206,215	56.050	11,558,350.750	
	BDO UNIBANK INC	250,632	140.000	35,088,480.000	
	PLDT INC	7,725	1,280.000	9,888,000.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,070,475	32.800	35,111,580.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,620	142.000	13,578,040.000	
	SM INVESTMENTS CORP	24,133	910.000	21,961,030.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	31,260	328.000	10,253,280.000	
	ACEN CORP	46,119	5.980	275,791.620	
	フィリピン・ペソ 小計	3,171,535		250,111,222.770 (622,176,678)	
ブラジル・リアル	VALE SA	353,689	68.360	24,178,180.040	
	RAIA DROGASIL SA	133,564	28.660	3,827,944.240	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,950	43.210	1,034,879.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	129,800	38.550	5,003,790.000	
	BANCO DO BRASIL SA	89,000	47.740	4,248,860.000	
	ITAU SA	524,926	9.230	4,845,066.980	
	GERDAU SA	121,181	25.300	3,065,879.300	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	387,310	33.750	13,071,712.500	
	VIBRA ENERGIA SA	116,600	17.530	2,043,998.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	494,812	30.280	14,982,907.360	
	CCR SA	96,920	14.250	1,381,110.000	
	WEG SA	174,344	37.800	6,590,203.200	
	BANCO BRADESCO SA PEF	558,702	16.860	9,419,715.720	
	BANCO BRADESCO SA	157,892	14.540	2,295,749.680	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	64,606	13.020	841,170.120	
	SUZANO SA	82,875	45.240	3,749,265.000	
	CPFL ENERGIA SA	23,600	31.360	740,096.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	502,647	27.800	13,973,586.600	
	ENGIE BRASIL SA	21,587	43.920	948,101.040	
	LOCALIZA RENT A CAR	76,989	68.180	5,249,110.020	
	LOJAS RENNER SA	104,320	21.830	2,277,305.600	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	77,204	18.100	1,397,392.400	
	COSAN SA	130,100	17.650	2,296,265.000	
	TOTVS SA	53,400	29.860	1,594,524.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	108,000	30.410	3,284,280.000	
	JBS SA	84,600	17.740	1,500,804.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	137,962	12.550	1,731,423.100	

	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	35,998	54.480	1,961,171.040	
	ENEVA SA	95,700	12.380	1,184,766.000	
	HYPERA SA	41,200	45.840	1,888,608.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	606,048	14.700	8,908,905.600	
	MAGAZINE LUIZA SA	322,600	3.970	1,280,722.000	
	PRIO SA	78,900	34.480	2,720,472.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	40,928	43.470	1,779,140.160	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	72,900	31.070	2,265,003.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	556,961	4.240	2,361,514.640	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	73,200	11.280	825,696.000	
	AMBEV SA	488,295	15.140	7,392,786.300	
	NATURA &CO HOLDING SA	92,700	15.950	1,478,565.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	131,100	12.960	1,699,056.000	
	TIM SA	90,300	14.620	1,320,186.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	57,700	32.240	1,860,248.000	
	RUMO SA	134,500	22.400	3,012,800.000	
	ブラジル・リアル 小計	7,749,610		177,512,959.140 (5,068,527,522)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	397.700	534,508.800	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,937	114.150	1,705,058.550	
	BANK PEKAO SA	19,439	108.700	2,113,019.300	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	60,811	65.240	3,967,309.640	
	LPP SA	112	13,810.000	1,546,720.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,784	389.200	1,472,732.800	
	CD PROJEKT RED SA	7,001	129.350	905,579.350	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	91,923	35.790	3,289,924.170	
	CYFROWY POLSAT SA	31,925	16.515	527,241.370	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	80,042	7.140	571,499.880	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	63,307	40.960	2,593,054.720	
	DINO POLSKA SA	5,109	460.300	2,351,672.700	
	ALLEGRO.EU SA	44,457	34.565	1,536,656.200	
	PEPCO GROUP NV	16,587	38.540	639,262.980	
	ポーランド・ズロチ 小計	440,778		23,754,240.460 (801,097,507)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	165,200	3.570	589,764.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	672,500	4.950	3,328,875.000	
	CELCOMDIGI BHD	372,000	4.280	1,592,160.000	

	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	83,820	6.930	580,872.600	
	RHB BANK BHD	146,380	5.290	774,350.200	
	TOP GLOVE CORP BHD	500,700	1.070	535,749.000	
	GAMUDA BHD	207,900	4.250	883,575.000	
	GENTING BHD	209,800	4.110	862,278.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,056	17.300	312,368.800	
	HONG LEONG BANK BHD	65,508	18.660	1,222,379.280	
	IOI CORP BHD	276,013	3.770	1,040,569.010	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	53,100	21.700	1,152,270.000	
	MALAYAN BANKING BHD	551,875	8.620	4,757,162.500	
	MISC BHD	139,680	7.230	1,009,886.400	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,300	132.000	831,600.000	
	PPB GROUP BHD	59,460	15.800	939,468.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	34,400	21.460	738,224.000	
	PETRONAS GAS BHD	79,500	16.620	1,321,290.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	338,300	2.530	855,899.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	132,500	4.970	658,525.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	272,150	9.180	2,498,337.000	
	QL RESOURCES BHD	115,450	5.280	609,576.000	
	DIALOG GROUP BHD	310,044	2.090	647,991.960	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	1,514,850	3.820	5,786,727.000	
	SIME DARBY BERHAD	234,000	2.000	468,000.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	315,100	2.780	875,978.000	
	MAXIS BHD	257,500	4.080	1,050,600.000	
	INARI AMERTRON BHD	234,700	2.490	584,403.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	298,500	6.400	1,910,400.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	231,900	5.730	1,328,787.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	376,100	4.650	1,748,865.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	220,800	4.230	933,984.000	
	MR DIY GROUP M BHD	403,200	1.550	624,960.000	
	マレーシア・リンギット 小計	8,897,286		43,055,874.750 (1,299,822,414)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	346,100	11.440	3,959,384.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	137,700	94.220	12,974,094.000	
	GRUMA SAB DE CV	18,270	278.370	5,085,819.900	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,060	183.630	3,683,617.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	58,100	115.620	6,717,522.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	270,000	140.870	38,034,900.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	109,425	37.670	4,122,039.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	20,975	292.160	6,128,056.000	

	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	159,700	38.430	6,137,271.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	20,135	492.160	9,909,641.600	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	323,952	85.380	27,659,021.760	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	223,300	44.040	9,834,132.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	54,000	179.120	9,672,480.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	541,200	67.470	36,514,764.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	40,195	307.220	12,348,707.900	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	148,700	16.330	2,428,271.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,280,178	19.370	63,537,047.860	
	BANCO DEL BAJIO SA	82,800	55.910	4,629,348.000	
メキシコ・ペソ	小計	5,854,790		263,376,118.570 (2,124,786,837)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	237,800	1.576	374,772.800	
	NATIONAL BANK OF GREECE	57,607	5.970	343,913.790	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,379	14.650	298,552.350	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	269,619	1.502	404,967.730	
	MYTILINEOS HOLDINGS	11,022	31.000	341,682.000	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	7,137	23.600	168,433.200	
	OPAP SA	17,833	16.080	286,754.640	
	JUMBO SA	12,011	24.420	293,308.620	
	PUBLIC POWER CORP	21,441	10.150	217,626.150	
	TERNA ENERGY SA	6,102	20.560	125,457.120	
ユーロ	小計	664,081		2,855,468.400 (427,806,276)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	110,300.000	189,716,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,498	107,900.000	377,434,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,225	235,000.000	757,875,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,937	78,900.000	389,529,300.000	
	COWAY CO LTD	5,833	48,200.000	281,150,600.000	
	KT&G CORP	10,728	83,100.000	891,496,800.000	
	CJ CORP	1,681	84,700.000	142,380,700.000	
	KAKAO CORP	32,656	56,400.000	1,841,798,400.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,228	7,560.000	236,083,680.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,509	315,000.000	475,335,000.000	
	LG UPLUS CORP	24,033	11,250.000	270,371,250.000	
	DOOSAN ENERBILITY	47,045	18,970.000	892,443,650.000	

POSCO INTERNATIONAL CORP	4,463	36,750.000	164,015,250.000	
LG H&H CO LTD	995	540,000.000	537,300,000.000	
LG CHEM LTD	5,169	752,000.000	3,887,088,000.000	
LG CHEM LTD	733	387,500.000	284,037,500.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	44,931	35,700.000	1,604,036,700.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	25,931	19,730.000	511,618,630.000	
S-OIL CORP	4,940	75,200.000	371,488,000.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,868	48,300.000	524,924,400.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,276	37,100.000	232,839,600.000	
POSCO FUTURE M CO LTD	3,237	386,500.000	1,251,100,500.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,282	172,900.000	394,557,800.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,438	76,900.000	264,382,200.000	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,383	103,700.000	454,517,100.000	
HYUNDAI MOBIS	6,391	222,500.000	1,421,997,500.000	
SK HYNIX INC	56,829	115,400.000	6,558,066,600.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	8,321	39,300.000	327,015,300.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,064	107,800.000	222,499,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	14,520	197,100.000	2,861,892,000.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,694	80,700.000	217,405,800.000	
HYUNDAI STEEL CO	9,520	33,900.000	322,728,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,033	10,360.000	290,421,880.000	
KIA CORPORATION	27,372	82,900.000	2,269,138,800.000	
KOREA ZINC CO LTD	817	496,000.000	405,232,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,465	19,080.000	524,032,200.000	
KOREAN AIR CO LTD	19,346	22,500.000	435,285,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,910	132,300.000	252,693,000.000	
KT CORP	7,359	30,200.000	222,241,800.000	
HLB INC	11,674	36,350.000	424,349,900.000	
LG ELECTRONICS INC	11,103	126,200.000	1,401,198,600.000	
LG CORP	9,855	90,400.000	890,892,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,290	9,810.000	149,994,900.000	
NAVER CORP	13,690	200,500.000	2,744,845,000.000	
L&F CO LTD	2,654	273,000.000	724,542,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,737	56,200.000	266,219,400.000	
KANGWON LAND INC	9,245	18,180.000	168,074,100.000	
POSCO HOLDINGS INC	7,490	394,000.000	2,951,060,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16,479	28,650.000	472,123,350.000	

COSMOAM&T CO LTD	2,166	218,000.000	472,188,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,723	735,000.000	4,206,405,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	5,889	147,200.000	866,860,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	496,257	72,000.000	35,730,504,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	65,848	6,470.000	426,036,560.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,750	107,100.000	401,625,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	85,363	61,200.000	5,224,215,600.000	
YUHAN CORP	5,839	60,400.000	352,675,600.000	
HANON SYSTEMS	19,141	9,360.000	179,159,760.000	
GS HOLDINGS CORP	4,259	39,400.000	167,804,600.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,742	16,200.000	384,620,400.000	
CELLTRION INC	11,438	169,000.000	1,933,022,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	31,079	42,200.000	1,311,533,800.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,928	180,900.000	348,775,200.000	
CELLTRION PHARM INC	1,764	83,000.000	146,412,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	7,704	68,000.000	523,872,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,032	107,200.000	325,030,400.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,829	200,500.000	1,168,714,500.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	890	321,500.000	286,135,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	31,293	5,250.000	164,288,250.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,436	311,000.000	446,596,000.000	
SK INC	3,619	173,100.000	626,448,900.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	40,591	49,450.000	2,007,224,950.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,426	52,900.000	392,835,400.000	
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,508	61,000.000	152,988,000.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	10,982	44,650.000	490,346,300.000	
HANMI PHARM CO LTD	610	320,000.000	195,200,000.000	
E-MART CO LTD	1,730	82,100.000	142,033,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,697	35,750.000	275,167,750.000	
HD HYUNDAI CO LTD	4,006	60,100.000	240,760,600.000	
BGF RETAIL CO LTD	715	186,100.000	133,061,500.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,527	125,100.000	316,127,700.000	
NETMARBLE CORP	2,597	55,900.000	145,172,300.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	58,047	12,180.000	707,012,460.000	
ECOPRO BM CO LTD	5,115	267,000.000	1,365,705,000.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,949	73,900.000	217,931,100.000	
KRAFTON INC	3,122	199,700.000	623,463,400.000	

	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,365	124,900.000	295,388,500.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,720	98,300.000	267,376,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	10,144	46,400.000	470,681,600.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,385	80,100.000	191,038,500.000	
	KAKAO GAMES CORP	3,264	39,800.000	129,907,200.000	
	HYBE CO LTD	1,970	280,500.000	552,585,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,646	609,000.000	2,220,414,000.000	
	KAKAOBANK CORP	17,696	25,850.000	457,441,600.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,875	131,300.000	246,187,500.000	
	KAKAOPAY CORP	2,237	55,000.000	123,035,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	4,119	126,600.000	521,465,400.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,726	110,200.000	961,605,200.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,846	801,000.000	1,478,646,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	3,427	48,800.000	167,237,600.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,600	62,000.000	285,200,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	11,195	71,900.000	804,920,500.000	
韓国・ウォン	小計	1,651,423		116,022,551,020.000 (12,542,037,765)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	119,000	12.560	1,494,640.000	
	JIANGSU EXPRESS	144,000	7.840	1,128,960.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	206,000	4.490	924,940.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	10,800	133.720	1,444,176.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	134,000	21.350	2,860,900.000	
	BEIJING ENTERPRISES	55,000	31.750	1,746,250.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	390,000	4.950	1,930,500.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	502,000	4.800	2,409,600.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	162,000	21.000	3,402,000.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	70,000	34.550	2,418,500.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	941,600	6.740	6,346,384.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	400,120	17.700	7,082,124.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	332,888	32.300	10,752,282.400	
	CITIC LTD	607,000	9.900	6,009,300.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	208,000	5.540	1,152,320.000	
	LENOVO GROUP LTD	764,000	7.600	5,806,400.000	
	PETRO CHINA CO LTD	2,210,000	5.770	12,751,700.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	163,390	8.440	1,379,011.600	

SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONIC	29,000	18.720	542,880.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,563,200	5.170	13,251,744.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	102,000	14.880	1,517,760.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	297,000	11.000	3,267,000.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	82,800	101.700	8,420,760.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	416,000	6.190	2,575,040.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	152,000	5.000	760,000.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	194,200	9.240	1,794,408.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	152,000	10.960	1,665,920.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	380,000	3.630	1,379,400.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	130,500	6.700	874,350.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	291,200	9.330	2,716,896.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	74,500	21.750	1,620,375.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	636,000	9.540	6,067,440.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	99,000	28.500	2,821,500.000	
BYD CO LTD	102,500	251.200	25,748,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	200,000	8.160	1,632,000.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	411,592	3.190	1,312,978.480	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	300,000	4.860	1,458,000.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	13,000	102.900	1,337,700.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	719,788	9.660	6,953,152.080	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.870	847,530.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	193,200	18.040	3,485,328.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	224,000	8.610	1,928,640.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	779,000	13.540	10,547,660.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	579,000	11.620	6,727,980.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	264,400	11.600	3,067,040.000	
WEICHAH POWER CO LTD	189,440	11.140	2,110,361.600	

CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	7.400	843,600.000	
TINGYI HOLDING CORP	202,000	11.860	2,395,720.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	64,000	69.300	4,435,200.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	320,000	7.110	2,275,200.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	316,000	3.790	1,197,640.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	169,333	53.000	8,974,649.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	100,000	6.050	605,000.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,100,250	3.860	4,246,965.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	332,000	30.050	9,976,600.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	646,800	336.000	217,324,800.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	658,500	53.450	35,196,825.000	
LI NING CO LTD	248,000	46.400	11,507,200.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	478,000	1.920	917,760.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	543,000	2.930	1,590,990.000	
AIR CHINA / HONG KONG	196,000	5.750	1,127,000.000	
ZTE CORP	70,688	25.450	1,799,009.600	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	350,500	26.050	9,130,525.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	326,250	7.290	2,378,362.500	
BANK OF COMMUNICATIONS	929,205	5.310	4,934,078.550	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	216,250	9.220	1,993,825.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	64,500	16.260	1,048,770.000	
BAIDU INC	235,150	132.700	31,204,405.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	9,992,530	5.140	51,361,604.200	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	87,100	68.300	5,948,930.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	244,000	3.780	922,320.000	
MINTH GROUP LTD	82,000	21.700	1,779,400.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	4.710	763,020.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	370,000	4.760	1,761,200.000	
BANK OF CHINA LTD	8,267,200	3.190	26,372,368.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	84,000	8.300	697,200.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	405,470	37.850	15,347,039.500	

IND & COMM BK OF CHINA - H	5,876,235	4.340	25,502,859.900	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	125,000	11.380	1,422,500.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	112,500	7.350	826,875.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	285,600	4.100	1,170,960.000	
CHINA COAL ENERGY CO	209,000	6.550	1,368,950.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	17.220	861,000.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	53,500	31.650	1,693,275.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	1,280,142	1.700	2,176,241.400	
CMOC GROUP LIMITED	384,000	4.310	1,655,040.000	
CHINA CITIC BANK-H	935,800	4.350	4,070,730.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	75,200	77.500	5,828,000.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	127,600	85.000	10,846,000.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	19.240	673,400.000	
FOSUN INTERNATIONAL	277,528	5.400	1,498,651.200	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	558,000	1.280	714,240.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	414,000	3.640	1,506,960.000	
KINGSOFT CORP LTD	93,400	31.050	2,900,070.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,162,000	1.490	3,221,380.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	395,000	5.330	2,105,350.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	152,000	6.920	1,051,840.000	
DONGYUE GROUP	159,000	7.100	1,128,900.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	83,500	23.900	1,995,650.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	513,000	5.050	2,590,650.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	277,800	21.100	5,861,580.000	
CRRC CORP LTD - H	465,000	4.880	2,269,200.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	159,000	8.340	1,326,060.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	143,000	12.060	1,724,580.000	
SINOPHARM GROUP CO	141,600	26.850	3,801,960.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	292,000	3.180	928,560.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	290,527	4.580	1,330,613.660	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	258,000	6.040	1,558,320.000	

CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	353,000	8.550	3,018,150.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	88,400	15.800	1,396,720.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	211,000	14.300	3,017,300.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	99,000	9.910	981,090.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	200,500	19.140	3,837,570.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	88,300	21.450	1,894,035.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	3.190	2,003,817.640	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	106,000	5.310	562,860.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.500	567,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	3,038,000	3.100	9,417,800.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	78,000	29.450	2,297,100.000	
FAR EAST HORIZON LTD	120,000	6.790	814,800.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	90,800	14.000	1,271,200.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	196,500	15.080	2,963,220.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	260,400	5.270	1,372,308.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	836,000	3.150	2,633,400.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	20.550	945,300.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	348,000	4.340	1,510,320.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	176,000	4.090	719,840.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	831,000	5.340	4,437,540.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	57,000	17.900	1,020,300.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	114,000	18.660	2,127,240.000	
EAST BUY HOLDING LTD	42,500	33.000	1,402,500.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	233,000	10.020	2,334,660.000	

PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,100	19.560	1,097,316.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	83,750	15.760	1,319,900.000	
CHINA TOWER CORP LTD	4,690,000	0.900	4,221,000.000	
XIAOMI CORP	1,597,600	10.840	17,317,984.000	
BEIGENE LTD	71,400	129.800	9,267,720.000	
WUXI APPTec CO LTD	34,412	66.900	2,302,162.800	
MEITUAN	526,010	127.100	66,855,871.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	128,000	17.800	2,278,400.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	176,000	17.360	3,055,360.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	490,000	8.400	4,116,000.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	121,000	37.650	4,555,650.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	997,000	0.870	867,390.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	52,000	9.400	488,800.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	143,500	10.940	1,569,890.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	205,000	6.800	1,394,000.000	
HANSH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	128,000	13.120	1,679,360.000	
CHINA FEIHE LTD	374,000	4.530	1,694,220.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,720,368	83.900	144,338,875.200	
PHARMARON BEIJING CO LTD	19,300	27.650	533,645.000	
JD.COM INC	244,135	145.000	35,399,575.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	184,000	7.960	1,464,640.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	121.200	921,120.000	
JIUMAQIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	84,000	13.700	1,150,800.000	
KUAI SHOU TECHNOLOGY	242,500	58.400	14,162,000.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	261,200	23.500	6,138,200.000	
BILIBILI INC	19,420	129.900	2,522,658.000	
AKESO INC	49,000	35.550	1,741,950.000	
NETEASE INC	205,200	146.300	30,020,760.000	
GDS HOLDINGS LTD	90,500	11.100	1,004,550.000	
ZAI LAB LTD	98,700	23.450	2,314,515.000	
NONGFU SPRING CO LTD	183,400	42.700	7,831,180.000	
LI AUTO INC	117,200	125.100	14,661,720.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	116,800	50.900	5,945,120.000	
HYGIEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	37,200	47.500	1,767,000.000	

	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	69,200	38.250	2,646,900.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12,600	50.700	638,820.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	241,661	11.160	2,696,936.760	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	159,900	33.950	5,428,605.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	49,600	16.800	833,280.000	
	JD LOGISTICS INC	210,400	12.680	2,667,872.000	
	TRIP.COM GROUP LTD	57,250	284.800	16,304,800.000	
	XPENG INC	109,600	34.550	3,786,680.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	64,000	26.300	1,683,200.000	
	CGN POWER CO LTD	1,043,000	1.920	2,002,560.000	
	GF SECURITIES CO LTD	106,000	11.000	1,166,000.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	61,600	30.500	1,878,800.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	115,800	9.950	1,152,210.000	
	3SBIO INC	198,500	7.640	1,516,540.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	164,000	7.580	1,243,120.000	
	CHINA LITERATURE LTD	38,600	33.100	1,277,660.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	43,000	22.200	954,600.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	261,500	2.610	682,515.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	145,000	8.630	1,251,350.000	
	BOC AVIATION LTD	23,600	62.800	1,482,080.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	77,600	21.900	1,699,440.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	17.380	2,155,120.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	144,000	14.320	2,062,080.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	397,500	44.850	17,827,875.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	648,000	1.830	1,185,840.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	37,240	54.500	2,029,580.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	18.860	1,131,600.000	
	香港・ドル 小計	88,967,778		1,271,071,400.070 (22,612,360,206)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	52,917	343.000	18,150,531.000	
	ACER INC	310,577	34.200	10,621,733.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	74,743	315.000	23,544,045.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	49,009	403.000	19,750,627.000	
	ASIA CEMENT CORP	236,105	44.600	10,530,283.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	645,437	14.250	9,197,477.250	

VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	86,179	93.400	8,049,118.600	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	71,660	185.000	13,257,100.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	143,562	171.500	24,620,883.000	
QUANTA COMPUTER INC	282,451	131.500	37,142,306.500	
EVA AIRWAYS CORP	255,000	35.850	9,141,750.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	65,760	190.500	12,527,280.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	548,588	18.400	10,094,019.200	
CHINA AIRLINES	290,000	22.700	6,583,000.000	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	207,138	38.800	8,036,954.400	
CHINA STEEL CORP	1,227,117	29.750	36,506,730.750	
ADVANTECH CO LTD	44,906	405.000	18,186,930.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	449,676	28.850	12,973,152.600	
DELTA ELECTRONICS INC	202,002	323.000	65,246,646.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	122,494	71.300	8,733,822.200	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	391,746	125.500	49,164,123.000	
AUO CORP	699,622	18.250	12,768,101.500	
TAIWAN MOBILE CO LTD	179,951	103.000	18,534,953.000	
EVERGREEN MARINE CORP	106,579	155.000	16,519,745.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	301,339	32.550	9,808,584.450	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	44,768	194.000	8,684,992.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	19,322	487.500	9,419,475.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	60,718	463.000	28,112,434.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	394,285	94.100	37,102,218.500	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	362,565	69.300	25,125,754.500	
GIANT MANUFACTURING	31,244	205.000	6,405,020.000	
MEDIATEK INC	158,223	764.000	120,882,372.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,333	61.200	47,266,779.600	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	922,607	22.250	20,528,005.750	
HOTAI MOTOR CO LTD	31,390	828.000	25,990,920.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	157,944	78.600	12,414,398.400	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,042,127	24.600	25,636,324.200	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	995,075	44.600	44,380,345.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,693,947	13.000	22,021,311.000	

E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,393,369	26.500	36,924,278.500	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,292,932	108.000	139,636,656.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,158,633	37.650	43,622,532.450	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,566	2,220.000	23,456,520.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,125,174	19.050	21,434,564.700	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,422,291	8.960	12,743,727.360	
INVENTEC CO LTD	270,005	38.650	10,435,693.250	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	211,788	97.600	20,670,508.800	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,083,479	17.400	18,852,534.600	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,831,074	25.200	46,143,064.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,095,090	27.950	30,607,765.500	
NAN YA PLASTICS CORP	490,872	79.900	39,220,672.800	
WISTRON CORP	274,017	73.000	20,003,241.000	
POU CHEN CORP	233,990	32.150	7,522,778.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	499,028	76.000	37,926,128.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,294	284.000	16,839,496.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,706	88.900	10,019,563.400	
E INK HOLDINGS INC	89,636	227.000	20,347,372.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	174,336	36.100	6,293,529.600	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	116,174	59.000	6,854,266.000	
TAIWAN CEMENT CORP	635,990	38.450	24,453,815.500	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,560,824	565.000	1,446,865,560.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,172,698	52.300	61,332,105.400	
WAN HAI LINES LTD	78,747	61.800	4,866,564.600	
WALSIN LIHWA CORP	270,176	45.300	12,238,972.800	
WINBOND ELECTRONICS CORP	323,927	28.100	9,102,348.700	
YAGEO CORP	33,192	492.500	16,347,060.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	165,608	62.900	10,416,743.200	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	193,000	32.900	6,349,700.000	
GLOBAL UNICHIP CORP	9,374	1,405.000	13,170,470.000	
INNOLUX CORPORATION	910,742	14.700	13,387,907.400	
WPG HOLDINGS CO LTD	165,203	53.600	8,854,880.800	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	24,219	284.500	6,890,305.500	

	EMEMORY TECHNOLOGY INC	7,064	2,175.000	15,364,200.000	
	PEGATRON CORP	210,159	78.100	16,413,417.900	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,712	1,000.000	14,712,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	30,470	175.500	5,347,485.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	157,030	211.500	33,211,845.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,080.000	8,640,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	62,923	107.500	6,764,222.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	1,015,791	28.350	28,797,674.850	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	403,215	46.250	18,648,693.750	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	6,993	1,900.000	13,286,700.000	
	WIWYNN CORP	9,239	1,160.000	10,717,240.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	319,107	126.000	40,207,482.000	
	SILERGY CORP	34,423	360.000	12,392,280.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	325,413	30.900	10,055,261.700	
	PHARMAESSENTIA CORP	25,128	336.500	8,455,572.000	
	MOMO.COM INC	8,206	677.000	5,555,462.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	23,344	511.000	11,928,784.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	18,912	362.500	6,855,600.000	
	台湾・ドル 小計	35,899,389		3,374,845,494.660 (15,300,874,504)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	10,000	211.910	2,119,100.000	
	BIDVEST GROUP LTD	27,847	259.620	7,229,638.140	
	CLICKS GROUP LTD	24,286	260.160	6,318,245.760	
	DISCOVERY LTD	57,120	145.760	8,325,811.200	
	GOLD FIELDS LTD	93,343	290.430	27,109,607.490	
	REMGRO LTD	50,832	142.360	7,236,443.520	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	32,991	93.000	3,068,163.000	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	55,410	86.500	4,792,965.000	
	EXXARO RESOURCES LTD	24,734	172.940	4,277,497.960	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,204	1,502.180	13,826,064.720	
	MTN GROUP LTD	177,846	136.640	24,300,877.440	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	43,996	455.150	20,024,779.400	
	FIRSTRAND LTD	525,158	68.040	35,731,750.320	
	NASPERS LTD	20,378	3,109.700	63,369,466.600	
	NEDBANK GROUP LTD	48,638	223.080	10,850,165.040	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	7,041	1,097.290	7,726,018.890	
	SASOL LTD	60,092	258.650	15,542,795.800	

SHOPRITE HOLDINGS LTD	53,051	224.280	11,898,278.280	
MR PRICE GROUP LTD	26,025	141.700	3,687,742.500	
STANDARD BANK GROUP LTD	140,127	171.950	24,094,837.650	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	90,173	67.760	6,110,122.480	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	38,563	179.300	6,914,345.900	
ABSA GROUP LTD	90,120	164.140	14,792,296.800	
SANLAM LTD	189,142	59.080	11,174,509.360	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	89,896	156.200	14,041,755.200	
KUMBA IRON ORE LTD	6,921	496.000	3,432,816.000	
OUTSURANCE GROUP LTD	92,899	33.910	3,150,205.090	
VODACOM GROUP PTY LTD	66,961	117.000	7,834,437.000	
NEPI ROCKCASTLE NV	50,449	112.000	5,650,288.000	
OLD MUTUAL LTD	479,238	11.770	5,640,631.260	
REINET INVESTMENTS SCA	14,603	410.420	5,993,363.260	
PEPKOR HOLDINGS LTD	240,457	16.300	3,919,449.100	
MULTICHOICE GROUP LTD	34,585	95.780	3,312,551.300	
SIBANYE STILLWATER LTD	280,877	33.620	9,443,084.740	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	38,211	153.280	5,856,982.080	
BID CORP LTD	35,006	415.250	14,536,241.500	
南アフリカ・ランド 小計	3,326,220		423,333,327.780 (3,149,599,959)	
合計	667,387,988		97,334,549,112 (97,334,549,112)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年6月12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	122,700.000	3,569,343.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	38,000.000	1,171,160.000	
		ENERGISA SA	23,500.000	1,067,370.000	
		KLABIN SA	78,200.000	1,663,314.000	
	ブラジル・レアル 小計		262,400.000	7,471,187.000 (213,324,802)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,577,975.000	19,030,378.500	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	54,100.000	8,301,645.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	201,500.000	37,390,340.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	246,900.000	4,266,432.000	
	メキシコ・ペソ 小計		2,080,475.000	68,988,795.500 (556,567,107)	
投資信託受益証券 合計			2,342,875	769,891,909 (769,891,909)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	306,900.000	7,896,537.000	

メキシコ・ペソ 小計		306,900.000	7,896,537.000 (63,705,312)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,040.000	22,033.200	
香港・ドル 小計		12,040.000	22,033.200 (391,971)	
南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	321,604.000	3,968,593.360	
南アフリカ・ランド 小計		321,604.000	3,968,593.360 (29,526,335)	
投資証券 合計		640,544	93,623,618 (93,623,618)	
合計			863,515,527 (863,515,527)	

(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 48銘柄	2.30	-	-	2.40
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 11銘柄	1.19	-	-	1.25
インド・ルピー	株式 114銘柄	13.38	-	-	14.00
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.92	-	-	2.01
オフショア・人民元	株式 508銘柄	4.63	-	-	4.84
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.86	-	-	0.90
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.78	-	-	0.81
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.10	-	-	0.11
サウジアラビア・リアル	株式 41銘柄	3.99	-	-	4.17
タイ・バーツ	株式 42銘柄	1.90	-	-	1.99
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.16	-	-	0.16
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.51	-	-	0.53
トルコ・リラ	株式 18銘柄	0.57	-	-	0.60
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.22	-	-	0.23
フィリピン・ペソ	株式 15銘柄	0.61	-	-	0.63
ブラジル・レアル	株式 43銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	4.93 -	- 0.21	- -	5.38
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.78	-	-	0.82
マレーシア・リンギット	株式 33銘柄	1.27	-	-	1.32
メキシコ・ペソ	株式 18銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	2.07 -	- 0.54	- -	2.80

	投資証券	1銘柄	-	-	0.06	
ユーロ	株式	11銘柄	0.42	-	-	0.44
韓国・ウォン	株式	102銘柄	12.21	-	-	12.77
香港・ドル	株式	195銘柄	22.02	-	-	23.03
	投資証券	1銘柄	-	-	0.00	
台湾・ドル	株式	90銘柄	14.90	-	-	15.58
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.07	-	-	3.24
	投資証券	1銘柄	-	-	0.03	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,853,365,961
コール・ローン	154,318,635
国債証券	126,365,035,682
未収利息	1,317,406,966
前払費用	270,458,672
流動資産合計	129,960,585,916
資産合計	129,960,585,916
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,108,000
流動負債合計	4,108,000
負債合計	4,108,000
純資産の部	
元本等	
元本	61,950,342,126
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	68,006,135,790
元本等合計	129,956,477,916
純資産合計	129,956,477,916
負債純資産合計	129,960,585,916

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	64,316,633,021円
同期中追加設定元本額	29,184,574,000円
同期中一部解約元本額	31,550,864,895円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	110,507,119円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,716,303,243円
たわらノーロード バランス（堅実型）	183,374,250円
たわらノーロード バランス（標準型）	539,995,142円
たわらノーロード バランス（積極型）	231,751,302円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	907,473円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	5,362,184円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	66,020,291円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,539,886円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	6,546,602円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	64,865,239円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	271,810,079円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	401,120,681円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	744,059,402円
投資のソムリエ	16,571,471,397円
クルーズコントロール	458,878,959円
投資のソムリエ<DC年金>	1,320,519,624円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	309,714,130円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,474,199,374円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,754,538,960円
ワールドアセットバランス（基本コース）	428,714,394円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,006,369,313円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	61,734,017円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	30,439,496円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	10,662,643円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	219,569,507円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,808,685,801円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	231,344,316円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	72,839,950円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	33,503,257円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	20,600,350円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,864,674円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	4,480,107円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	22,825,769円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	22,051,858,355円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	448,154,509円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,177,838,737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)	314,159,579円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	6,761,028円
エマージング債券パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	7,528,113円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	145,542,961円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	65,174,787円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,540,205,126円
計	61,950,342,126円
2. 受益権の総数	61,950,342,126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 2022年12月13日 至 2023年6月12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	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年6月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	1,345,672,022	
合計	1,345,672,022	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年4月19日から2023年6月12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)

2023年6月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0978円 (20,978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

2023年6月12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	5,000,000.000	4,407,500.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	5,000,000.000	4,175,515.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	6,000,000.000	5,019,936.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	10,000,000.000	9,620,500.000	

ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	10,000,000.000	9,583,000.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	9,000,000.000	8,136,477.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,411,140.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	9,000,000.000	8,405,145.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	9,000,000.000	6,548,310.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	10,000,000.000	8,324,760.000	
BRAZIL 2.875 06/06/25	13,000,000.000	12,444,578.640	
BRAZIL 3.75 09/12/31	7,000,000.000	6,066,781.840	
BRAZIL 3.875 06/12/30	13,000,000.000	11,604,949.850	
BRAZIL 4.5 05/30/29	9,000,000.000	8,569,374.120	
BRAZIL 4.75 01/14/50	15,000,000.000	11,077,801.950	
BRAZIL 6.0 10/20/33	7,000,000.000	6,918,388.750	
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,664,648.980	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,595,076.440	
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	1,000,000.000	959,630.000	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	6,000,000.000	4,717,898.220	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	9,000,000.000	6,887,237.850	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	9,000,000.000	6,717,947.850	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	6,000,000.000	3,656,503.680	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	6,000,000.000	5,768,689.080	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	7,000,000.000	6,216,780.500	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	9,000,000.000	6,278,114.610	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	9,000,000.000	8,892,990.540	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	7,000,000.000	7,210,645.190	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	6,000,000.000	5,285,470.620	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	7,000,000.000	6,039,057.360	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	17,000,000.000	16,036,041.690	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	17,000,000.000	13,300,011.370	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	11,200,000.000	10,500,168.440	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	4,000,000.000	3,420,947.920	
HUNGARY 2.125 09/22/31	11,000,000.000	8,391,746.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	11,000,000.000	6,644,693.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	7,000,000.000	6,808,319.000	
HUNGARY 5.375 03/25/24	5,380,000.000	5,375,814.360	
HUNGARY 6.125 05/22/28	7,000,000.000	7,122,360.000	

HUNGARY 6.25 09/22/32	8,000,000.000	8,133,600.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	4,200,000.000	3,405,865.720	
INDONESIA 3.05 03/12/51	9,000,000.000	6,515,208.900	
INDONESIA 3.4 09/18/29	2,200,000.000	2,049,180.430	
INDONESIA 3.5 01/11/28	4,200,000.000	3,987,847.500	
INDONESIA 3.85 10/15/30	8,400,000.000	7,914,056.800	
INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,175,841.990	
INDONESIA 4.2 10/15/50	8,000,000.000	6,783,859.280	
INDONESIA 4.35 01/08/27	3,600,000.000	3,560,437.510	
INDONESIA 4.75 01/08/26	2,000,000.000	2,004,017.180	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,500,000.000	3,134,375.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	10,000,000.000	9,914,000.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	16,000,000.000	16,091,296.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	8,000,000.000	8,136,320.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	11,000,000.000	8,386,310.680	
PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	7,012,352.880	
PANAMA 3.87 07/23/60	13,000,000.000	8,444,160.660	
PANAMA 4.5 01/19/63	6,000,000.000	4,298,560.980	
PANAMA 4.5 04/01/56	9,000,000.000	6,648,146.640	
PANAMA 6.4 02/14/35	10,000,000.000	10,387,138.700	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,053,818.900	
PERU 2.392 01/23/26	3,000,000.000	2,815,791.480	
PERU 2.78 12/01/60	9,000,000.000	5,313,234.240	
PERU 2.783 01/23/31	16,000,000.000	13,720,924.480	
PERU 3.0 01/15/34	10,000,000.000	8,203,794.000	
PERU 3.55 03/10/51	8,000,000.000	5,839,560.560	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	3,600,000.000	2,861,542.830	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	8,000,000.000	5,358,074.800	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	2,000,000.000	1,877,422.120	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	11,000,000.000	8,102,786.780	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	3,000,000.000	2,452,500.000	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	6,200,000.000	5,948,099.820	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	3,200,000.000	2,770,465.530	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	8,200,000.000	7,019,805.480	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	9,000,000.000	7,380,694.800	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	9,200,000.000	8,633,694.460	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	7,000,000.000	4,504,153.640	

REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	10,000,000.000	7,477,347.600	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	8,000,000.000	5,937,135.040	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	6,200,000.000	5,482,445.970	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	5,000,000.000	3,668,598.650	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	7,000,000.000	6,167,766.640	
REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	12,000,000.000	11,945,904.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	10,000,000.000	10,082,080.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	9,000,000.000	9,318,519.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	11,000,000.000	11,667,821.000	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	13,000,000.000	12,918,742.980	
ROMANIA 3.0 02/14/31	4,000,000.000	3,312,120.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	11,000,000.000	7,593,949.000	
ROMANIA 7.125 01/17/33	11,000,000.000	11,642,950.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	9,000,000.000	7,287,003.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	11,000,000.000	10,532,500.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	8,200,000.000	7,469,199.600	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	5,000,000.000	3,488,370.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	6,400,000.000	4,764,652.800	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	19,000,000.000	18,651,198.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,948,144.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	7,000,000.000	6,006,175.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	10,000,000.000	10,029,870.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	8,000,000.000	8,021,688.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	7,000,000.000	6,417,285.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	6,000,000.000	5,753,160.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	7,000,000.000	7,359,800.000	

SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	11,000,000.000	9,758,573.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	1,400,000.000	1,348,410.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	15,000,000.000	10,843,785.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	6,000,000.000	5,550,720.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	10,000,000.000	8,545,500.000	
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	6,000,000.000	5,906,400.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	13,000,000.000	12,645,100.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	10,000,000.000	9,711,600.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	11,000,000.000	10,845,252.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	14,000,000.000	12,583,200.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	17,000,000.000	16,166,303.000	
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	3,000,000.000	2,956,800.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	6,000,000.000	4,261,200.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	5,000,000.000	4,915,055.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	8,000,000.000	6,635,340.720	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,343,711.420	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	7,000,000.000	5,857,141.850	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,572,036.840	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	7,000,000.000	4,647,877.990	
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,558,882.090	
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	7,000,000.000	5,665,536.520	
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	5,000,000.000	3,860,350.850	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	5,000,000.000	3,992,448.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	8,000,000.000	7,774,055.840	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	7,000,000.000	6,680,406.740	

	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	7,000,000.000	6,666,726.080	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	7,000,000.000	5,960,047.870	
	UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	6,000,000.000	5,998,734.720	
	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	9,000,000.000	9,457,810.110	
	アメリカ・ドル 小計	1,034,080,000.000 (144,181,774,400)	906,297,322.540 (126,365,035,682)	
国債証券 合計		144,181,774,400 (144,181,774,400)	126,365,035,682 (126,365,035,682)	
合計			126,365,035,682 (126,365,035,682)	

(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 131銘柄	97.24	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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ワールドアセットバランス(基本コース)

2023年6月30日現在

資産総額	5,886,307,325円
負債総額	157,290,026円
純資産総額(-)	5,729,017,299円
発行済数量	6,047,260,887口
1口当たり純資産額(/)	0.9474円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2023年6月30日現在

資産総額	18,693,722,675円
負債総額	426,613,743円
純資産総額(-)	18,267,108,932円
発行済数量	18,934,760,438口
1口当たり純資産額(/)	0.9647円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	1,073,530,587,668円
負債総額	76,631,534円
純資産総額(-)	1,073,453,956,134円
発行済数量	149,945,948,681口
1口当たり純資産額(/)	7.1589円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	228,459,803,052円
負債総額	16,160,769,216円
純資産総額(-)	212,299,033,836円
発行済数量	179,305,300,521口
1口当たり純資産額(/)	1.1840円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	84,680,472,860円
負債総額	635,421,361円
純資産総額(-)	84,045,051,499円
発行済数量	47,946,122,548口
1口当たり純資産額(/)	1.7529円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	103,991,129,959円
負債総額	118,503,821円
純資産総額(-)	103,872,626,138円
発行済数量	68,362,399,215口
1口当たり純資産額(/)	1.5194円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	134,415,816,918円
負債総額	2,817,930,000円
純資産総額(-)	131,597,886,918円
発行済数量	60,167,572,112口
1口当たり純資産額(/)	2.1872円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2023年6月30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(2023年6月30日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年6月30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	1,557,024,065,347
追加型株式投資信託	787	15,326,214,559,522
単位型公社債投資信託	23	39,870,065,521
単位型株式投資信託	209	1,114,294,997,605
合計	1,045	18,037,403,687,995

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	31,421	33,770
金銭の信託	30,332	29,184
未収委託者報酬	17,567	16,279
未収運用受託報酬	4,348	3,307
未収投資助言報酬	309	283
未収収益	5	15
前払費用	1,167	1,129
その他	2,673	2,377
流動資産計	87,826	86,346
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,109	1,001
器具備品	158	118
リース資産	-	7
無形固定資産		
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	1,449	1,651
電話加入権	3	2
投資その他の資産		
投資有価証券	241	182
関係会社株式	5,349	5,810
長期差入保証金	1,102	775
繰延税金資産	3,092	2,895
その他	367	104
固定資産計	15,983	15,918
資産合計	103,810	102,265

(単位:百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
(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	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
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	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	108,563		95,739	
運用受託報酬	16,716		16,150	
投資助言報酬	1,587		2,048	
その他営業収益	12		23	
営業収益計		126,879		113,962
営業費用				
支払手数料	45,172		41,073	
広告宣伝費	391		216	
公告費	0		0	
調査費	36,488		33,177	
調査費	10,963		12,294	
委託調査費	25,525		20,882	
委託計算費	557		548	
営業雑経費	842		733	
通信費	35		36	
印刷費	606		504	
協会費	66		69	
諸会費	26		29	
支払販売手数料	106		92	
営業費用計		83,453		75,749
一般管理費				
給料	10,377		10,484	
役員報酬	168		168	
給料・手当	8,995		9,199	
賞与	1,213		1,115	
交際費	6		17	
寄付金	15		11	
旅費交通費	40		128	
租税公課	367		330	
不動産賃借料	1,674		1,006	
退職給付費用	495		437	
固定資産減価償却費	1,389		1,388	
福利厚生費	42		47	
修繕費	0		1	
賞与引当金繰入額	1,933		1,730	
役員賞与引当金繰入額	69		48	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,901		4,074	
事務用消耗品費	45		37	
器具備品費	0		1	
諸経費	217		334	
一般管理費計		20,578		20,078
営業利益		22,848		18,135

（単位：百万円）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）		第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		13		10
受取配当金	1	559	1	2,400
時効成立分配金・償還金		0		0
為替差益		7		-
雑収入		19		10
時効後支払損引当金戻入額		10		24
営業外収益計		610		2,446
営業外費用				
為替差損		-		3
金銭の信託運用損		743		1,003
早期割増退職金		20		24
雑損失		-		47
営業外費用計		764		1,079
経常利益		22,694		19,502
特別利益				
固定資産売却益		0		-
投資有価証券売却益		-		4
特別利益計		0		4
特別損失				
固定資産除却損		5		12
投資有価証券売却損		6		9
ゴルフ会員権売却損		3		-
オフィス再編費用	2	509		-
関係会社株式評価損		-		584
特別損失計		525		606
税引前当期純利益		22,169		18,900
法人税、住民税及び事業税		6,085		4,881
法人税等調整額		584		197
法人税等合計		6,669		5,078
当期純利益		15,499		13,821

（３）【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							11,280	11,280	11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	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	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			11,280
当期純利益			15,499
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	4,219
当期末残高	0	0	77,573

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			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計		その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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

重要な会計方針

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

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

（会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、（金融商品会計）注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27 - 3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
建物	415	523
器具備品	966	934
リース資産	-	1

（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37期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
受取配当金	543	2,393

2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

（株主資本等変動計算書関係）

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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
2021年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

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

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2023年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
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					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022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	30,332	30,332	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	30,334	30,334	-

第38期（2023年3月31日現在）

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

(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37期（2022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	31,421	-	-	-
(2) 金銭の信託	30,332	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	17,567	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,348	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	83,670	1	-	-

第38期（2023年3月31日現在）

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

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37期（2022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	-	6,932	-	6,932
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	6,932	-	6,932

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、投資有価証券1百万円となります。

第38期（2023年3月31日現在）

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

（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（コールローン・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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	239	180
関係会社株式		
非上場株式	5,349	5,810

(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37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円)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37期(2022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239百万円)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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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	13	-	6

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

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、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。

(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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	14	31
退職給付の支払額	185	191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

(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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	35	44
未認識過去勤務費用	33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	34	22
過去勤務費用の費用処理額	69	34
その他	3	4
確定給付制度に係る退職給付費用	398	334

(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20百万円、当事業年度において24百万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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.76%	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97百万円、当事業年度103百万円であります。

（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37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	156	121
未払事業所税	10	9
賞与引当金	592	529
未払法定福利費	92	94
運用受託報酬	845	390
資産除去債務	13	15
減価償却超過額（一括償却資産）	12	21
減価償却超過額	58	198
繰延資産償却超過額（税法上）	292	297
退職給付引当金	767	812
時効後支払損引当金	45	33
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	345
投資有価証券評価損	28	4
その他	2	13
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,092	2,895
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	3,092	2,895

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37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
法定実効税率	-	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 %
その他	-	0.06 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	26.87 %

（注）前事業年度は、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が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	76,763百万円	68,921百万円
資産合計	76,763百万円	68,921百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	4,740百万円	3,643百万円
負債合計	4,740百万円	3,643百万円
純資産	72,022百万円	65,278百万円

(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	55,263百万円	51,451百万円
顧客関連資産	25,175百万円	20,947百万円

(2) 損益計算書項目

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,429百万円	8,039百万円
経常利益	8,429百万円	8,039百万円
税引前当期純利益	8,429百万円	8,039百万円
当期純利益	7,015百万円	6,744百万円
1株当たり当期純利益	175,380円68銭	168,617円97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	4,618百万円	4,228百万円

（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37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬（注）	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（持分法損益等）

当社は2022年8月1日付で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37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

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。

(2) 子会社及び関連会社等

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

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。

(3) 兄弟会社等

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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	7,789	未払 手数料	1,592
	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	16,373	未払 手数料	2,651

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。

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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
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	15,499百万円	13,821百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2023年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(注) 資本金の額は2023年3月末日現在

(3) 投資顧問会社

名称	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社
資本金の額	200百万円（2023年3月末日現在）
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社は委託会社との投資顧問契約に基づき、各ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2023年5月25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 丘本 正彦指定有限責任社員
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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38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2023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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2023年8月10日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（基本コース）の2022年12月13日から2023年6月12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、ワールドアセットバランス（基本コース）の2023年6月12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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2023年8月10日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2022年12月13日から2023年6月12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、ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。