

【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】	2024年3月11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 <https://www.am-one.co.jp/>

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

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

(5) 【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、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:2024年3月12日から2024年9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 <https://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

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

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

(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。

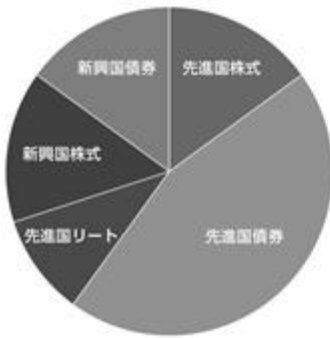
●各コース間でスイッチングが可能です。

※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。

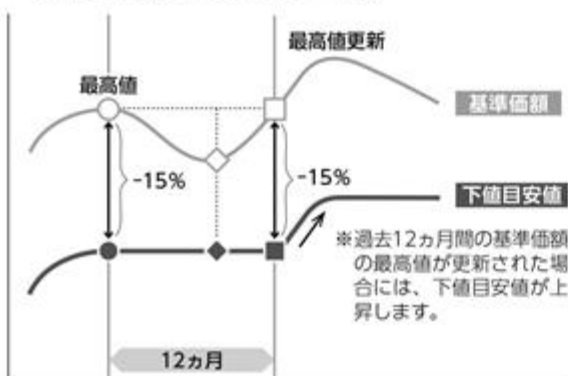
*現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(リスク抑制コース)の下値目安値について

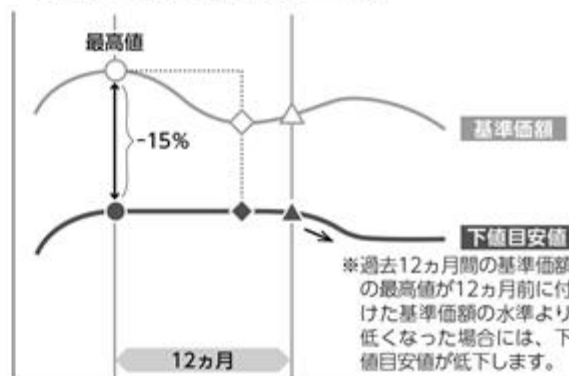
下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。

※(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。

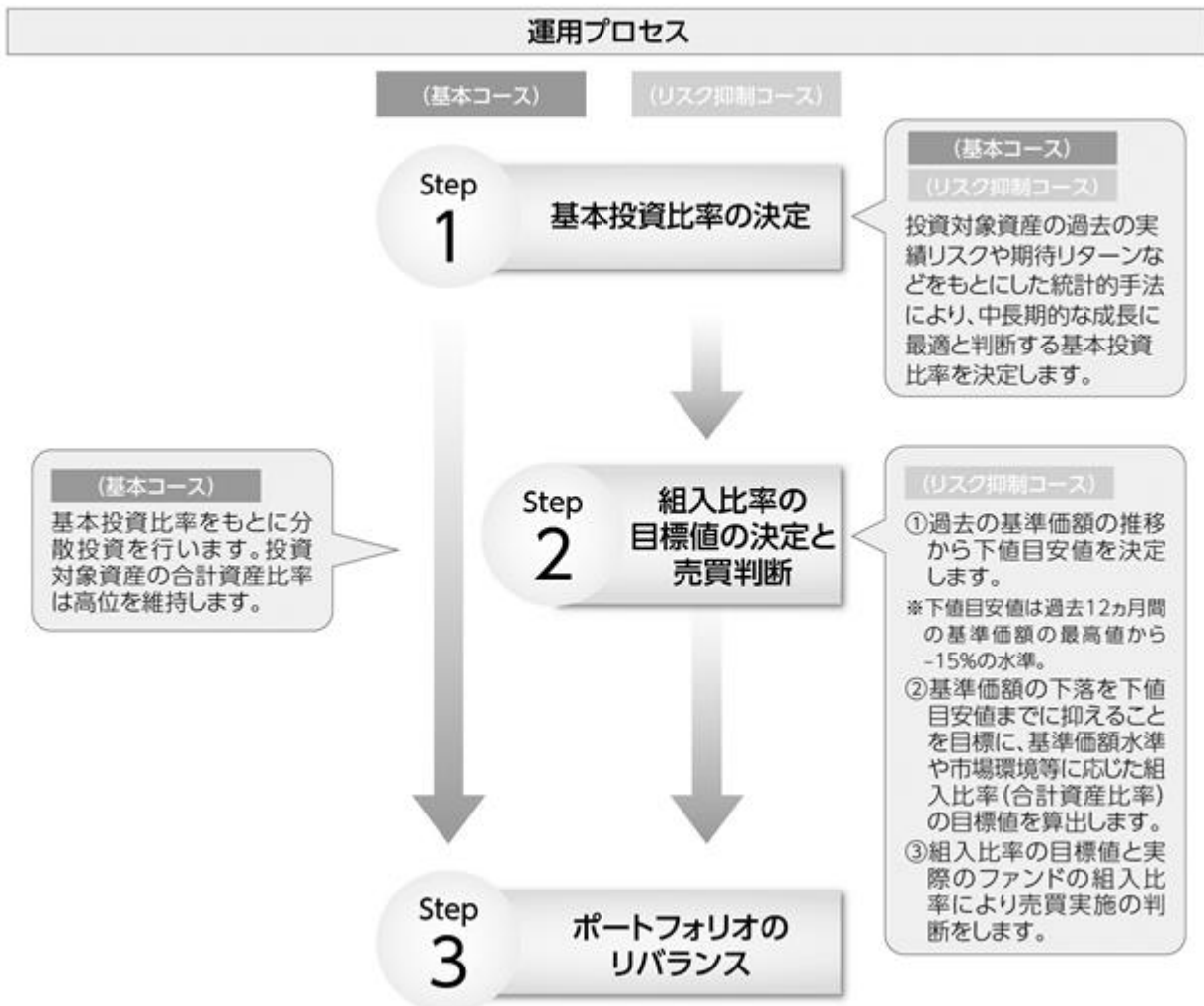
4 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

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。

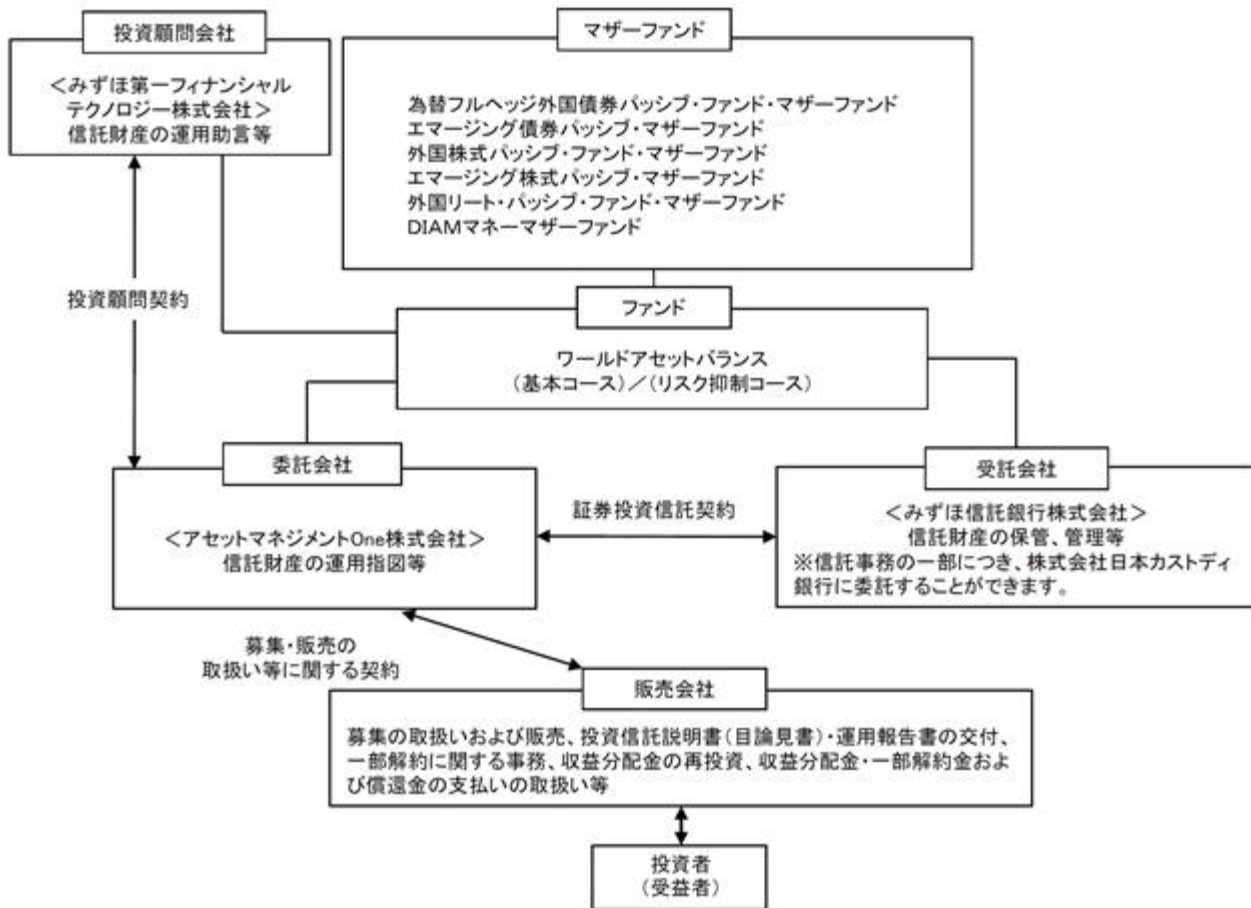
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

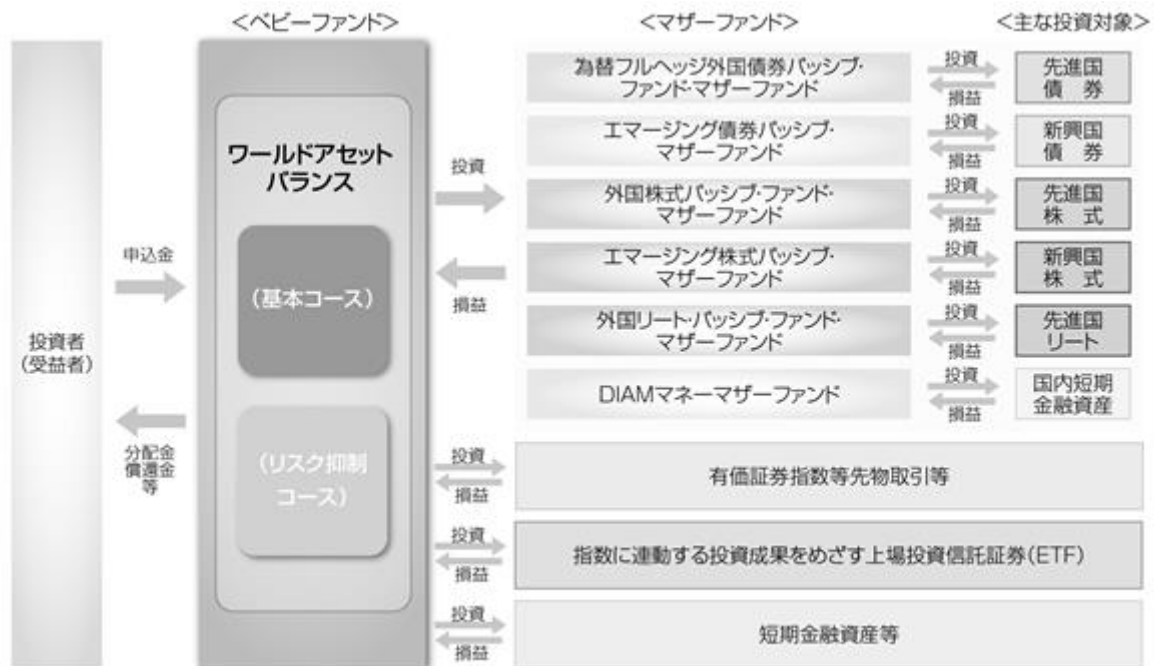
委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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12月29日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2023年12月29日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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カ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。

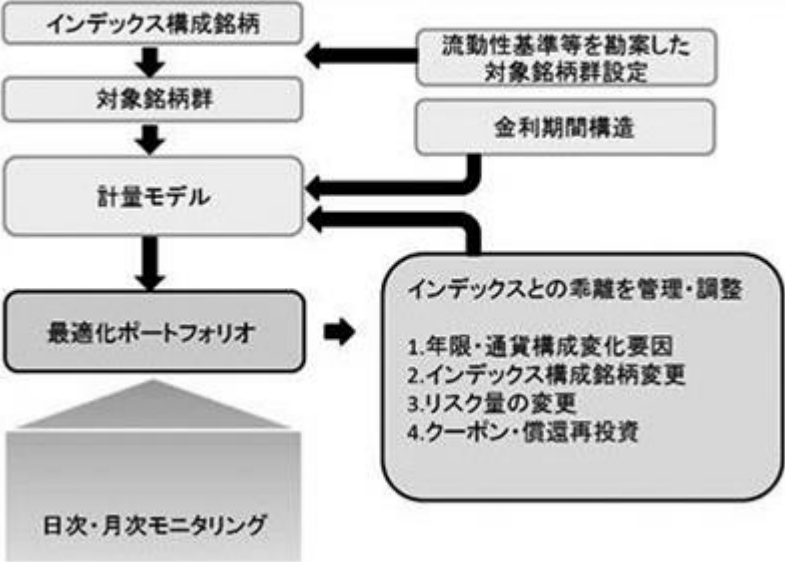
運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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: 10px; margin-top: 20px;"> <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 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>

主な投資制限	<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。
--------	---

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 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>

運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
主な投資制限	<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。

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

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

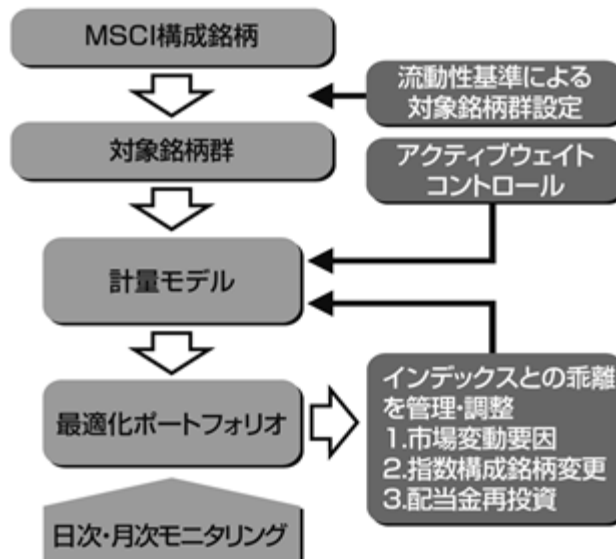
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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



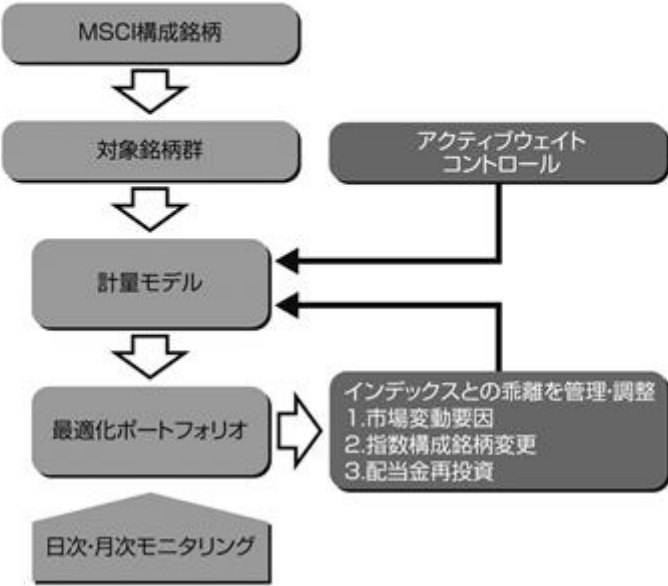
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有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限りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

	<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] --> C F --> D 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"] --> C G --> 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。

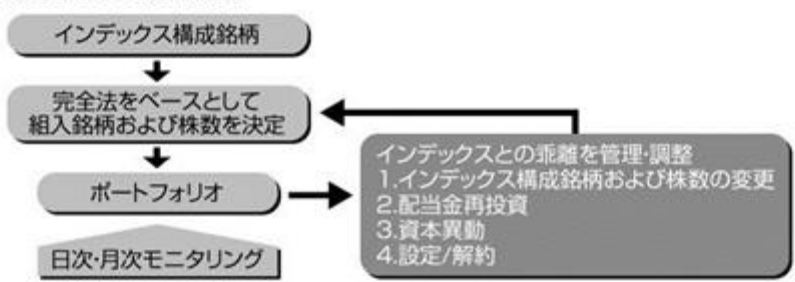
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

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

S&P DOW JONES INDICESまたは第三者ライセンサーは、S & P 先進国 R E I Tインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信に

	<p>ついて、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 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、アセットマネジメントOne、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られるべき結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、ライセンサーの商品の有価証券届出書、目論見書またはその他の募集資料を審査しておらず、いかなる部分も作成および/または証明しておらず、またS&P DOW JONES INDICESはそれらを管理していません。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESとアセットマネジメントOneとの間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</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[日々・月次モニタリング] D --> 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.資本買動 4.設定/解約] E --> 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。

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2023年12月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年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します。)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

(5) 【投資制限】

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。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。

基準価額的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。

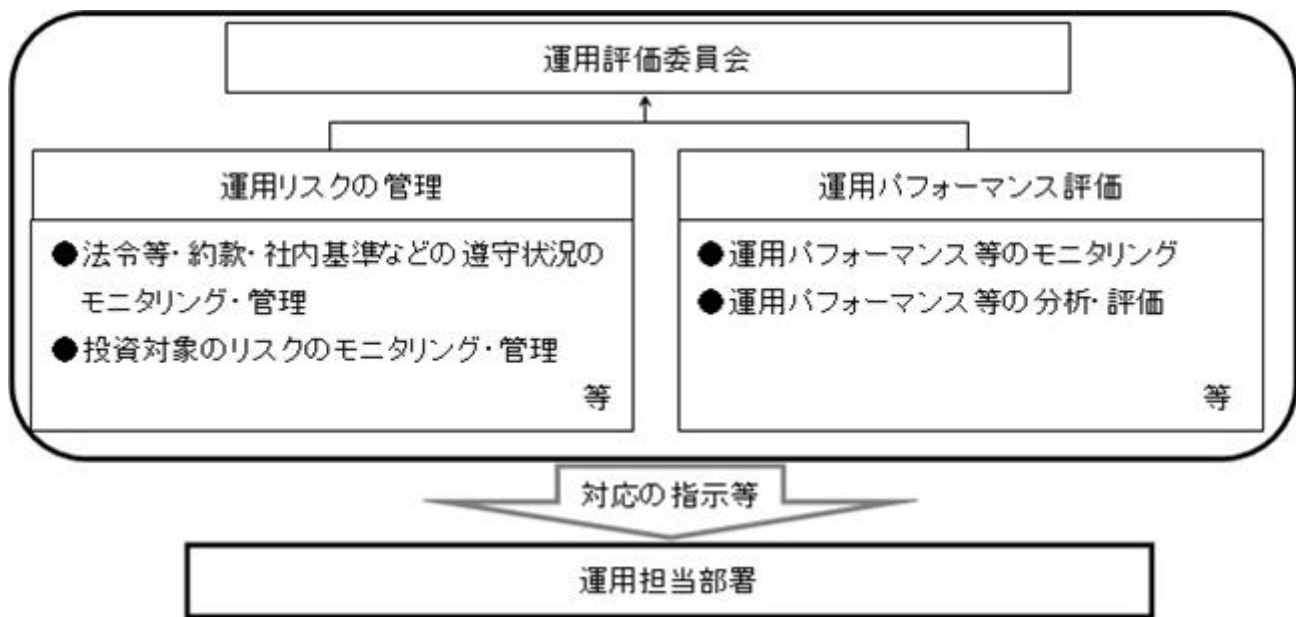
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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12月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

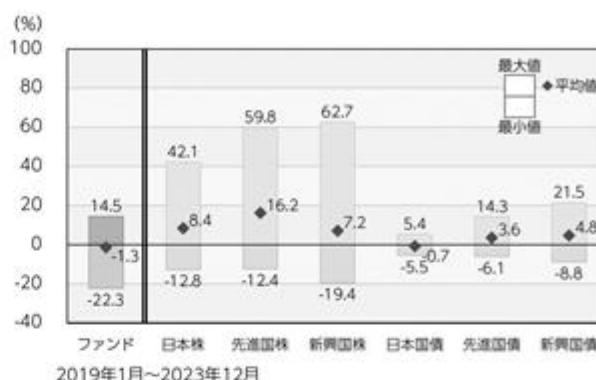
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

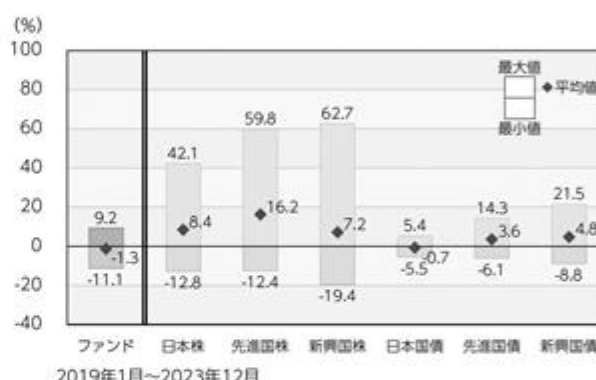
(基本コース)



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算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。

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2024年1月1日現在のものです。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「分配金自動引き落とし投資コース」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	1.35%	1.24%	0.11%
リスク抑制コース	1.31%	1.24%	0.07%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年6月13日~2023年12月11日

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

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

※なお、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12月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	5,290,565,539	97.16
内 日本	5,290,565,539	97.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	154,386,262	2.84
純資産総額	5,444,951,801	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12月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	12,073,581,309	73.59
内 日本	12,073,581,309	73.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,332,211,306	26.41
純資産総額	16,405,792,615	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12月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,182,856,342,484	96.43
内 アメリカ	847,212,019,557	69.07
内 イギリス	46,914,348,793	3.82
内 カナダ	41,691,679,038	3.40
内 スイス	38,314,285,688	3.12
内 フランス	37,776,429,358	3.08
内 ドイツ	29,377,396,974	2.39
内 オーストラリア	24,246,983,322	1.98
内 オランダ	23,345,318,013	1.90
内 アイルランド	22,103,802,673	1.80
内 デンマーク	11,538,400,198	0.94
内 スウェーデン	11,173,180,533	0.91
内 スペイン	8,937,204,615	0.73
内 イタリア	6,694,340,638	0.55
内 香港	5,708,038,659	0.47
内 ジャージー	4,045,704,324	0.33
内 シンガポール	3,765,547,036	0.31
内 フィンランド	3,704,330,278	0.30
内 ベルギー	2,639,711,099	0.22
内 イスラエル	2,330,932,822	0.19
内 ノルウェー	2,323,770,551	0.19
内 ケイマン諸島	1,679,999,629	0.14
内 オランダ領キュラソー	1,572,313,571	0.13
内 バミューダ	1,497,706,437	0.12

	内 ニュージーランド	934,271,294	0.08
	内 ルクセンブルグ	734,811,814	0.06
	内 ポルトガル	694,615,409	0.06
	内 オーストリア	690,754,261	0.06
	内 リベリア	640,974,707	0.05
	内 パナマ	392,979,352	0.03
	内 マン島	174,491,841	0.01
新株予約権証券		0	0.00
	内 カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		2,035,999,716	0.17
	内 オーストラリア	1,512,323,789	0.12
	内 シンガポール	523,675,927	0.04
投資証券		23,353,581,588	1.90
	内 アメリカ	21,908,092,506	1.79
	内 フランス	529,192,831	0.04
	内 イギリス	424,674,301	0.03
	内 香港	326,402,096	0.03
	内 ベルギー	90,908,551	0.01
	内 カナダ	74,311,303	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		18,437,138,743	1.50
純資産総額		1,226,683,062,531	100.00

その他資産の投資状況

2023年12月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	18,654,465,663	1.52
内 アメリカ	14,152,643,061	1.15
内 ドイツ	2,677,914,000	0.22
内 イギリス	783,695,886	0.06
内 カナダ	653,065,862	0.05
内 オーストラリア	387,146,854	0.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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12月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	248,360,746,275	95.77
内 アメリカ	116,369,225,204	44.87
内 フランス	21,057,646,426	8.12
内 イタリア	18,895,320,545	7.29
内 中国	18,477,316,400	7.13
内 ドイツ	16,500,052,137	6.36
内 イギリス	13,150,648,591	5.07
内 スペイン	12,318,885,811	4.75
内 カナダ	4,970,090,512	1.92
内 ベルギー	4,506,863,957	1.74
内 オランダ	3,829,477,349	1.48

内 オーストラリア	3,588,058,539	1.38
内 オーストリア	3,009,716,922	1.16
内 メキシコ	2,266,061,708	0.87
内 アイルランド	1,479,803,470	0.57
内 フィンランド	1,336,557,242	0.52
内 ポーランド	1,267,040,681	0.49
内 マレーシア	1,214,167,344	0.47
内 シンガポール	1,060,755,439	0.41
内 イスラエル	740,835,838	0.29
内 デンマーク	707,550,829	0.27
内 ニュージーランド	616,230,349	0.24
内 スウェーデン	545,188,396	0.21
内 ノルウェー	453,252,586	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,960,711,178	4.23
純資産総額	259,321,457,453	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12月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	8,845,046,154	10.21
内 オーストラリア	5,837,764,683	6.74
内 シンガポール	2,946,360,633	3.40
内 香港	60,920,838	0.07
投資証券	77,022,602,130	88.90
内 アメリカ	66,653,648,270	76.93
内 イギリス	4,146,028,120	4.79
内 フランス	1,574,539,162	1.82
内 カナダ	1,296,925,306	1.50
内 ベルギー	1,011,127,804	1.17
内 香港	968,721,631	1.12
内 スペイン	378,147,528	0.44
内 ニュージーランド	251,504,085	0.29
内 ガーンジー	251,474,511	0.29
内 韓国	154,112,705	0.18
内 オランダ	153,827,985	0.18
内 イスラエル	107,695,332	0.12
内 アイルランド	33,977,474	0.04
内 ドイツ	33,427,987	0.04
内 イタリア	7,444,230	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	772,047,318	0.89
純資産総額	86,639,695,602	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12月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	80,329,466,461	91.22

内 インド	13,690,990,561	15.55
内 台湾	12,617,501,225	14.33
内 ケイマン諸島	12,317,189,218	13.99
内 韓国	10,532,787,063	11.96
内 中国	8,320,062,711	9.45
内 ブラジル	4,502,780,569	5.11
内 サウジアラビア	3,370,290,866	3.83
内 南アフリカ	2,258,026,687	2.56
内 メキシコ	1,665,515,074	1.89
内 インドネシア	1,531,551,700	1.74
内 タイ	1,422,271,392	1.62
内 マレーシア	1,085,268,619	1.23
内 アラブ首長国連邦	1,017,311,082	1.16
内 香港	746,019,408	0.85
内 ポーランド	730,107,599	0.83
内 カタール	716,539,898	0.81
内 クエート	609,939,106	0.69
内 フィリピン	501,502,557	0.57
内 トルコ	500,638,560	0.57
内 チリ	416,148,071	0.47
内 ギリシャ	389,356,403	0.44
内 パミュダ	341,263,114	0.39
内 アメリカ	286,755,424	0.33
内 ハンガリー	209,024,632	0.24
内 チェコ	123,765,661	0.14
内 イギリス	93,716,856	0.11
内 ルクセンブルグ	92,165,816	0.10
内 コロンビア	87,306,281	0.10
内 オランダ	49,988,899	0.06
内 エジプト	45,759,172	0.05
内 ペルー	38,704,110	0.04
内 シンガポール	19,218,127	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	686,842,628	0.78
内 メキシコ	488,750,054	0.56
内 ブラジル	198,092,574	0.22
投資証券	60,095,282	0.07
内 メキシコ	60,095,282	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,985,037,550	7.93
純資産総額	88,061,441,921	100.00

その他資産の投資状況

2023年12月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	6,957,222,447	7.90
内 アメリカ	6,957,222,447	7.90

（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12月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	93,469,210,864	96.05
内 サウジアラビア	10,796,426,087	11.09
内 メキシコ	9,390,158,091	9.65
内 アラブ首長国連邦	7,908,780,902	8.13
内 カタール	7,047,102,670	7.24
内 ブラジル	6,780,163,844	6.97
内 チリ	6,516,697,044	6.70
内 ドミニカ共和国	6,314,338,437	6.49
内 ハンガリー	5,948,907,448	6.11
内 コロンビア	5,593,366,897	5.75
内 南アフリカ	4,767,127,100	4.90
内 パナマ	4,531,106,888	4.66
内 インドネシア	3,943,393,385	4.05
内 ルーマニア	3,617,728,015	3.72
内 ペルー	3,461,488,459	3.56
内 オマーン	2,350,201,389	2.41
内 フィリピン	2,169,269,746	2.23
内 ウルグアイ	1,433,526,218	1.47
内 中国	899,428,244	0.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,848,728,719	3.95
純資産総額	97,317,939,583	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12月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,843,203,229	1.1694 2,155,626,176	1.1948 2,202,259,218	- -	40.45
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	111,623,980	7.5251 839,992,774	7.6550 854,481,566	- -	15.69
3	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	535,942,539	1.5103 809,487,610	1.5506 831,032,500	- -	15.26
4	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	365,283,783	2.2284 814,034,910	2.2482 821,231,000	- -	15.08

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	306,471,994	1.7941 549,872,051	1.8976 581,561,255	- -	10.68
---	-----------------------------------	-------------------	-------------	-----------------------	-----------------------	--------	-------

（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12月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.16
合計	97.16

（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12月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,568,497,830	1.1717 5,353,237,378	1.1948 5,458,441,207	- -	33.27
2	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	1,165,334,694	1.5129 1,763,129,365	1.5506 1,806,967,976	- -	11.01
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	234,010,049	7.5389 1,764,200,989	7.6550 1,791,346,925	- -	10.92
4	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	790,241,150	2.2302 1,762,426,016	2.2482 1,776,620,153	- -	10.83
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	653,565,055	1.8017 1,177,584,058	1.8976 1,240,205,048	- -	7.56

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	73.59
合計	73.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年12月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,350,542	22,707.38 53,374,668,921	27,455.45 64,535,191,644	- -	5.26
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,060,970	40,851.72 43,342,457,421	53,225.96 56,471,149,327	- -	4.60
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,396,226	15,305.41 21,369,816,916	21,753.88 30,373,340,396	- -	2.48
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	371,467	40,578.17 15,073,452,232	70,237.05 26,090,747,218	- -	2.13
5	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	894,177	14,804.28 13,237,652,785	19,888.82 17,784,126,205	- -	1.45
6	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	334,116	30,113.27 10,061,325,953	50,820.52 16,979,950,731	- -	1.38
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	783,554	14,670.76 11,495,337,353	20,037.74 15,700,653,208	- -	1.28
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	429,981	30,442.99 13,089,907,783	35,908.51 15,439,981,080	- -	1.26
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	66,816	99,520.03 6,649,530,647	159,191.41 10,636,533,270	- -	0.87
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	435,612	20,253.26 8,822,564,637	24,153.64 10,521,619,348	- -	0.86

11	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 ア・サー ビス	139,147	70,636.48 9,828,855,250	74,446.56 10,359,016,458	- -	0.84
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	197,086	45,245.65 8,917,284,396	50,714.15 9,995,049,577	- -	0.81
13	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	121,042	56,424.28 6,829,708,033	82,381.95 9,971,676,657	- -	0.81
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	241,677	32,786.08 7,923,643,038	36,932.53 8,925,743,536	- -	0.73
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	600,687	16,214.92 9,740,096,364	14,209.94 8,535,730,854	- -	0.70
16	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	361,496	22,777.59 8,234,010,166	22,207.74 8,028,009,685	- -	0.65
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	126,146	53,072.71 6,694,910,645	60,464.96 7,627,413,550	- -	0.62
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	150,144	44,237.54 6,642,002,132	49,266.06 7,397,004,633	- -	0.60
19	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	353,784	20,179.85 7,139,309,440	20,668.88 7,312,321,129	- -	0.60
20	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	489,820	11,367.17 5,567,867,725	14,718.05 7,209,198,189	- -	0.59
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	60,741	96,575.25 5,866,077,299	107,768.60 6,545,973,018	- -	0.53
22	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	401,274	18,379.45 7,375,197,816	16,283.94 6,534,325,591	- -	0.53
23	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	66,410	72,983.23 4,846,816,598	94,047.47 6,245,692,681	- -	0.51
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	380,439	15,311.87 5,825,234,562	15,426.84 5,868,975,044	- -	0.48
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノー ジー	264,718	21,472.09 5,684,049,324	21,948.19 5,810,081,622	- -	0.47

26	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	272,487	23,867.95 6,503,707,683	21,241.87 5,788,135,910	- -	0.47
27	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	68,332	58,762.33 4,015,347,714	84,462.60 5,771,498,492	- -	0.47
28	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	146,338	25,686.55 3,758,918,379	37,667.21 5,512,144,381	- -	0.45
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,077,648	4,715.85 5,082,028,990	4,805.20 5,178,314,600	- -	0.42
30	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	617,137	8,397.51 5,182,415,347	8,332.51 5,142,301,766	- -	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12月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.43
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.17
投資証券	1.90
合計	98.50

(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12月29日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	8.57
半導体・半導体製造装置		6.56
コンピュータ・周辺機器		5.52
銀行		5.42
医薬品		4.84
石油・ガス・消耗燃料		4.36
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.27
資本市場		3.27
金融サービス		3.03
保険		3.00
大規模小売り		2.88
ヘルスケア機器・用品		2.20
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.06
ホテル・レストラン・レジャー		2.06
自動車		1.89
化学		1.88
機械		1.87
バイオテクノロジー		1.80
航空宇宙・防衛		1.72
生活必需品流通・小売り		1.69
電力		1.62
専門小売り		1.60

飲料	1.56
金属・鉱業	1.51
情報技術サービス	1.41
食品	1.40
繊維・アパレル・贅沢品	1.21
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.20
陸上運輸	1.10
娯楽	1.00
家庭用品	0.99
専門サービス	0.99
各種電気通信サービス	0.94
コングロマリット	0.93
電気設備	0.90
総合公益事業	0.72
メディア	0.66
通信機器	0.65
建設関連製品	0.64
パーソナルケア用品	0.62
商業サービス・用品	0.58
タバコ	0.52
航空貨物・物流サービス	0.50
電子装置・機器・部品	0.49
商社・流通業	0.46
消費者金融	0.39
不動産管理・開発	0.35
建設・土木	0.32
建設資材	0.31
家庭用耐久財	0.31
エネルギー設備・サービス	0.26
無線通信サービス	0.22
容器・包装	0.21
自動車用部品	0.16
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.13
運送インフラ	0.11
紙製品・林産品	0.10
ガス	0.10
水道	0.09
販売	0.09
海上運輸	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
旅客航空輸送	0.05
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.01
合計	96.43

(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12月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	1,876,916,160	102.05 1,915,453,851	101.59 1,906,871,741	3.03 2026/3/11	0.74
2	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,389,934,000	94.90 1,319,099,133	100.23 1,393,191,656	3.875 2033/8/15	0.54
3	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,177,189,000	99.72 1,173,959,247	101.97 1,200,410,888	4.125 2032/11/15	0.46
4	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,446,666,000	80.75 1,168,198,679	82.97 1,200,393,709	1.25 2031/8/15	0.46
5	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,262,287,000	89.88 1,134,556,745	92.94 1,173,261,253	2.875 2032/5/15	0.45
6	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,416,881,700	80.29 1,137,741,441	82.31 1,166,353,763	0.875 2030/11/15	0.45
7	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,389,934,000	80.74 1,122,354,685	83.27 1,157,418,668	1.375 2031/11/15	0.45
8	US T N/B 5.0 10/31/25 アメリカ	国債証券	1,134,640,000	100.30 1,138,146,037	101.10 1,147,138,763	5 2025/10/31	0.44
9	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 10/22/25 中国	国債証券	1,105,826,400	101.53 1,122,781,010	101.51 1,122,560,760	3.02 2025/10/22	0.43
10	CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32 中国	国債証券	1,095,864,000	100.56 1,102,009,764	101.29 1,110,003,494	2.76 2032/5/15	0.43
11	FRANCE OAT 6.0 10/25/25 フランス	国債証券	1,016,566,400	105.89 1,076,482,933	106.18 1,079,476,712	6 2025/10/25	0.42
12	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,248,104,000	83.38 1,040,680,177	85.96 1,072,979,407	1.625 2031/5/15	0.41
13	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,205,555,000	83.91 1,011,619,415	86.22 1,039,508,628	1.875 2032/2/15	0.40
14	CHINA GOVERNMENT BOND 2.46 02/15/26 中国	国債証券	976,315,200	100.53 981,574,809	100.17 978,007,056	2.46 2026/2/15	0.38
15	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50 中国	国債証券	836,841,600	113.86 952,875,784	116.71 976,736,493	3.81 2050/9/14	0.38
16	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,147,404,700	78.62 902,189,097	81.23 932,109,443	0.625 2030/8/15	0.36
17	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証券	992,810,000	90.61 899,609,252	92.31 916,545,899	0.375 2026/1/31	0.35
18	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	921,895,000	97.85 902,115,294	97.29 896,957,019	3.5 2033/2/15	0.35
19	US T N/B 4.625 02/28/25 アメリカ	国債証券	893,529,000	99.56 889,672,161	99.95 893,110,157	4.625 2025/2/28	0.34
20	US T N/B 4.375 08/15/26 アメリカ	国債証券	879,346,000	99.36 873,739,460	100.66 885,219,757	4.375 2026/8/15	0.34
21	CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28 中国	国債証券	866,728,800	99.47 862,143,107	100.10 867,668,334	2.4 2028/7/15	0.33

22	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	846,804,000	100.13 847,962,826	100.75 853,164,598	2.68 2030/5/21	0.33
23	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	850,980,000	93.86 798,730,758	96.29 819,467,146	3.375 2033/5/15	0.32
24	US T N/B 2.25 03/31/26 アメリカ	国債証券	850,980,000	94.46 803,910,877	95.89 816,010,040	2.25 2026/3/31	0.31
25	US T N/B 0.75 08/31/26 アメリカ	国債証券	879,346,000	89.80 789,699,981	91.64 805,855,343	0.75 2026/8/31	0.31
26	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	863,744,700	90.45 781,265,392	92.74 801,106,337	1.5 2027/1/31	0.31
27	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証券	859,773,460	90.67 779,614,199	92.41 794,585,168	0.75 2026/4/30	0.31
28	CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29 中国	国債証券	777,067,200	100.79 783,248,805	101.35 787,610,991	2.79 2029/12/15	0.30
29	US T N/B 1.25 11/30/26 アメリカ	国債証券	850,980,000	90.66 771,580,729	92.41 786,408,565	1.25 2026/11/30	0.30
30	US T N/B 1.25 12/31/26 アメリカ	国債証券	850,980,000	90.31 768,532,802	92.25 785,029,050	1.25 2026/12/31	0.30

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	95.77
合計	95.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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12月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	400,944	16,473.26 6,604,858,198	19,173.99 7,687,699,333	- -	8.87
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	40,746	107,992.74 4,400,272,219	115,462.38 4,704,630,326	- -	5.43
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	240,268	11,623.30 2,792,708,692	12,929.22 3,106,478,503	- -	3.59
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	68,702	39,257.47 2,697,066,897	43,655.27 2,999,204,634	- -	3.46
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	141,632	15,833.45 2,242,524,279	20,463.23 2,898,248,531	- -	3.35
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	314,309	7,988.64 2,510,903,265	8,308.40 2,611,405,335	- -	3.01
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	131,492	16,071.35 2,113,254,955	19,305.89 2,538,571,350	- -	2.93

8	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	91,749	19,011.18 1,744,257,356	22,999.15 2,110,149,270	- -	2.44
9	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	449,269	4,305.73 1,934,433,460	4,564.08 2,050,503,880	- -	2.37
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	746,930	2,037.51 1,521,881,713	2,443.85 1,825,390,407	- -	2.11
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	61,688	25,983.53 1,602,872,515	26,890.96 1,658,850,033	- -	1.91
12	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	150,148	8,881.31 1,333,512,416	8,864.37 1,330,968,177	- -	1.54
13	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	126,884	8,161.90 1,035,615,123	10,013.19 1,270,514,615	- -	1.47
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	174,856	6,320.27 1,105,137,258	7,226.23 1,263,551,159	- -	1.46
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	67,964	15,469.32 1,051,356,872	18,281.88 1,242,510,168	- -	1.43
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	249,986	4,742.55 1,185,572,948	4,921.50 1,230,306,348	- -	1.42
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	53,923	17,699.81 954,427,121	19,165.48 1,033,460,604	- -	1.19
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	27,713	32,201.12 892,389,744	35,847.53 993,442,668	- -	1.15
19	MID AMERICA アメリカ	投資証券	50,381	20,268.38 1,021,141,599	19,366.88 975,723,108	- -	1.13
20	LINK REIT 香港	投資証券	1,105,820	781.10 863,766,033	795.87 880,097,257	- -	1.02
21	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	94,396	8,895.64 839,713,250	9,315.39 879,335,969	- -	1.01
22	SEGRO PLC イギリス	投資証券	533,855	1,333.50 711,897,587	1,621.06 865,411,498	- -	1.00
23	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	304,500	2,348.77 715,202,301	2,789.79 849,492,912	- -	0.98
24	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	267,554	2,646.39 708,052,822	3,091.89 827,248,607	- -	0.95
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	80,447	9,515.27 765,475,482	10,157.86 817,169,733	- -	0.94
26	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	115,237	6,761.24 779,145,897	7,044.69 811,809,644	- -	0.94
27	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC アメリカ	投資証券	91,837	7,213.31 662,449,133	8,081.47 742,178,272	- -	0.86
28	UDR INC アメリカ	投資証券	131,633	5,606.23 737,965,496	5,498.74 723,816,840	- -	0.84
29	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	138,352	4,951.53 685,054,677	5,148.42 712,295,449	- -	0.82
30	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	71,449	8,509.75 608,013,358	9,594.79 685,538,829	- -	0.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	10.21
投資証券	88.90
合計	99.11

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年12月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,992,751	2,450.79 4,883,816,317	2,745.23 5,470,568,197	- -	6.21
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	386,689	7,347.62 2,841,244,542	8,674.24 3,354,237,058	- -	3.81
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	539,400	6,513.69 3,513,487,866	5,317.95 2,868,502,230	- -	3.26
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,316,768	1,659.61 2,185,330,709	1,376.67 1,812,764,878	- -	2.06
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	246,652	3,709.68 915,002,084	4,481.54 1,105,382,283	- -	1.26
6	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	48,415	10,718.78 518,949,872	20,614.99 998,074,765	- -	1.13
7	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	268,711	2,198.52 590,766,938	2,687.75 722,230,139	- -	0.82
8	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	416,924	1,567.31 653,451,226	1,730.14 721,340,224	- -	0.82

9	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	44,244	10,477.12 463,550,120	15,635.75 691,788,123	- -	0.79
10	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	227,205	2,784.47 632,647,733	2,933.02 666,399,081	- -	0.76
11	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,770,530	94.95 737,861,145	84.03 652,992,603	- -	0.74
12	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	275,689	2,208.49 608,858,823	2,252.72 621,052,020	- -	0.71
13	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・ レストラ ン・レ ジャー	410,510	2,393.67 982,627,582	1,494.65 613,569,797	- -	0.70
14	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	123,366	3,320.25 409,606,003	4,745.13 585,388,324	- -	0.66
15	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	158,494	2,864.06 453,937,855	3,295.55 522,326,486	- -	0.59
16	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部 品	1,009,392	481.18 485,705,098	481.45 485,979,449	- -	0.55
17	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	74,066	5,465.03 404,773,602	6,535.82 484,082,636	- -	0.55
18	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周 辺機 器	65,955	6,225.94 410,632,242	6,884.14 454,044,113	- -	0.52
19	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消 耗燃 料	389,112	803.29 312,571,474	1,086.67 422,839,487	- -	0.48
20	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	156,800	2,710.90 425,069,299	2,560.96 401,559,312	- -	0.46
21	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	395,847	771.50 305,398,528	991.25 392,386,579	- -	0.45
22	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	4,499,300	83.11 373,945,046	86.48 389,099,464	- -	0.44
23	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	189,535	2,594.55 491,759,084	2,043.68 387,350,784	- -	0.44

24	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	182,250	2,348.60 428,032,831	2,085.43 380,070,528	- -	0.43
25	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	1,239,000	231.28 286,560,879	295.48 366,102,198	- -	0.42
26	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,278,235	75.55 398,787,018	68.60 362,123,868	- -	0.41
27	AXIS BANK LTD インド	株式 銀行	184,524	1,532.04 282,698,482	1,905.50 351,610,851	- -	0.40
28	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	239,164	1,417.52 339,021,304	1,465.95 350,603,900	- -	0.40
29	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小売り	15,109	25,314.97 382,483,958	23,083.57 348,769,671	- -	0.40
30	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	541,500	948.49 513,612,235	639.78 346,444,931	- -	0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	91.22
投資信託受益証券	0.78
投資証券	0.07
合計	92.07

(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12月29日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	15.45
半導体・半導体製造装置		9.30
コンピュータ・周辺機器		6.14
石油・ガス・消耗燃料		4.68
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.53
大規模小売り		4.41
金属・鉱業		3.67
自動車		2.91
化学		2.54
保険		2.35
電子装置・機器・部品		2.32
情報技術サービス		2.23

ホテル・レストラン・レジャー	1.78
食品	1.49
不動産管理・開発	1.42
生活必需品流通・小売り	1.41
電気設備	1.40
無線通信サービス	1.36
医薬品	1.23
各種電気通信サービス	1.22
コングロマリット	1.17
飲料	1.15
金融サービス	1.10
電力	1.04
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.94
娯楽	0.91
資本市場	0.88
繊維・アパレル・贅沢品	0.83
バイオテクノロジー	0.78
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.76
建設資材	0.71
パーソナルケア用品	0.67
専門小売り	0.67
運送インフラ	0.66
建設・土木	0.65
消費者金融	0.61
機械	0.60
自動車用部品	0.60
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.52
航空宇宙・防衛	0.34
ガス	0.33
陸上運輸	0.33
タバコ	0.33
旅客航空輸送	0.32
家庭用耐久財	0.29
海上運輸	0.28
ソフトウェア	0.25
航空貨物・物流サービス	0.24
各種消費者サービス	0.23
通信機器	0.22
紙製品・林産品	0.18
ヘルスケア機器・用品	0.16
商社・流通業	0.14
水道	0.11
家庭用品	0.08
メディア	0.07
商業サービス・用品	0.06
エネルギー設備・サービス	0.05
建設関連製品	0.05
総合公益事業	0.05
容器・包装	0.02
合計	91.22

（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12月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	2,269,280,000	88.07 1,998,725,092	97.51 2,212,808,967	4.817 2049/3/14	2.27
2	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,985,620,000	103.66 2,058,404,319	108.13 2,147,050,906	7.125 2033/1/17	2.21
3	BRAZIL 3.75 09/12/31 ブラジル	国債証券	2,127,450,000	85.51 1,819,282,887	89.50 1,904,143,083	3.75 2031/9/12	1.96
4	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	1,701,960,000	97.56 1,660,569,751	99.76 1,697,994,433	4.375 2029/4/16	1.74
5	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,701,960,000	95.20 1,620,385,057	99.33 1,690,667,495	4 2029/3/14	1.74
6	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	1,701,960,000	94.49 1,608,227,378	98.10 1,669,670,210	5.5 2029/2/22	1.72
7	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 サウジアラビア	国債証券	1,730,326,000	87.43 1,512,855,224	92.89 1,607,317,124	3.25 2030/10/22	1.65
8	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,701,960,000	86.62 1,474,334,196	94.08 1,601,238,007	4.85 2029/9/30	1.65
9	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,843,790,000	74.74 1,378,184,802	80.90 1,491,782,832	2.125 2031/9/22	1.53
10	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	1,843,790,000	68.30 1,259,369,556	80.26 1,479,921,731	5.75 2049/9/30	1.52
11	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証券	1,276,470,000	100.93 1,288,346,844	107.02 1,366,078,194	6.25 2032/9/22	1.40
12	ROMANIA 4.0 02/14/51 ルーマニア	国債証券	1,843,790,000	68.07 1,255,201,882	73.19 1,349,506,776	4 2051/2/14	1.39
13	DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49 ドミニカ共和国	国債証券	1,418,300,000	81.99 1,162,984,725	94.63 1,342,256,611	6.4 2049/6/5	1.38
14	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証券	1,560,130,000	77.28 1,205,793,841	84.78 1,322,755,128	3 2034/1/15	1.36
15	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33 サウジアラビア	国債証券	1,560,130,000	77.16 1,203,796,308	83.05 1,295,703,566	2.25 2033/2/2	1.33
16	INDONESIA 3.85 10/15/30 インドネシア	国債証券	1,333,202,000	90.72 1,209,509,220	95.66 1,275,447,181	3.85 2030/10/15	1.31
17	COLOMBIA 3.25 04/22/32 コロンビア	国債証券	1,560,130,000	72.50 1,131,249,775	79.71 1,243,627,565	3.25 2032/4/22	1.28

18	BRAZIL 2.875 06/06/25 ブラジル	国債証券	1,276,470,000	95.75 1,222,326,269	96.81 1,235,837,266	2.875 2025/6/6	1.27
19	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証券	1,276,470,000	85.13 1,086,709,402	95.06 1,213,448,123	7.3 2052/4/20	1.25
20	PANAMA 3.16 01/23/30 パナマ	国債証券	1,418,300,000	83.81 1,188,818,492	85.51 1,212,919,111	3.16 2030/1/23	1.25
21	COLOMBIA 7.5 02/02/34 コロンビア	国債証券	1,134,640,000	95.89 1,088,118,174	105.62 1,198,498,219	7.5 2034/2/2	1.23
22	REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41 チリ	国債証券	1,560,130,000	69.55 1,085,087,746	76.29 1,190,229,916	3.1 2041/5/7	1.22
23	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証券	1,134,640,000	96.05 1,089,921,001	100.81 1,143,937,240	5.25 2029/6/16	1.18
24	BRAZIL 6.0 10/20/33 ブラジル	国債証券	1,134,640,000	95.44 1,082,942,965	100.18 1,136,709,345	6 2033/10/20	1.17
25	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	1,134,640,000	96.41 1,093,965,425	99.21 1,125,676,389	4.375 2031/1/23	1.16
26	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証券	1,134,640,000	96.35 1,093,292,583	97.49 1,106,203,652	2.125 2024/9/30	1.14
27	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,134,640,000	96.41 1,094,002,868	96.93 1,099,892,784	2.5 2025/4/16	1.13
28	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証券	992,810,000	99.76 990,427,256	106.66 1,058,936,110	5.5 2032/10/25	1.09
29	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 カタール	国債証券	992,810,000	97.70 970,032,102	98.01 973,053,081	3.4 2025/4/16	1.00
30	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証券	992,810,000	92.99 923,225,365	97.74 970,436,033	3.75 2030/4/16	1.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.05
合計	96.05

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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12月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Mar24	買建	413	13,757,635,874	14,152,643,061	1.15
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar24	買建	375	2,692,329,367	2,677,914,000	0.22
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar24	買建	56	767,854,767	783,695,886	0.06
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar24	買建	24	638,702,136	653,065,862	0.05
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Mar24	買建	21	369,288,083	387,146,854	0.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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12月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Mar24	買建	950	6,670,205,863	6,957,222,447	7.90

(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12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
第14計算期間末 (2023年12月11日)	5,315	5,315	0.9319	0.9319
2022年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	-
7月末日	5,704	-	0.9606	-
8月末日	5,534	-	0.9398	-
9月末日	5,254	-	0.9001	-
10月末日	5,072	-	0.8787	-
11月末日	5,288	-	0.9246	-
12月末日	5,444	-	0.9622	-

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12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
第14計算期間末 (2023年12月11日)	16,231	16,231	0.9411	0.9411
2022年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	-
7月末日	18,217	-	0.9736	-
8月末日	17,740	-	0.9554	-
9月末日	16,997	-	0.9255	-
10月末日	16,364	-	0.9118	-
11月末日	16,219	-	0.9366	-
12月末日	16,405	-	0.9614	-

【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
第14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
第14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
第14計算期間	1.8

（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
第14計算期間	2.7

（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
第14計算期間	20,220,258	389,917,952

（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
第14計算期間	36,750,716	1,888,596,359

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

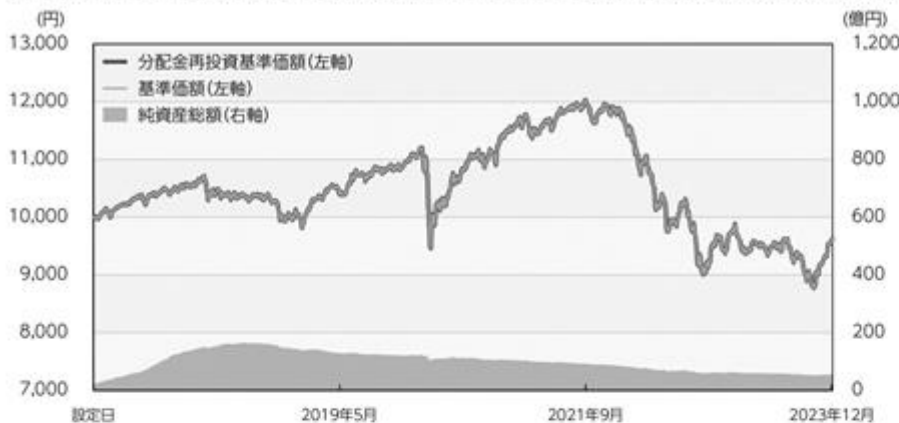
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2023年12月29日

(基本コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2023年12月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

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

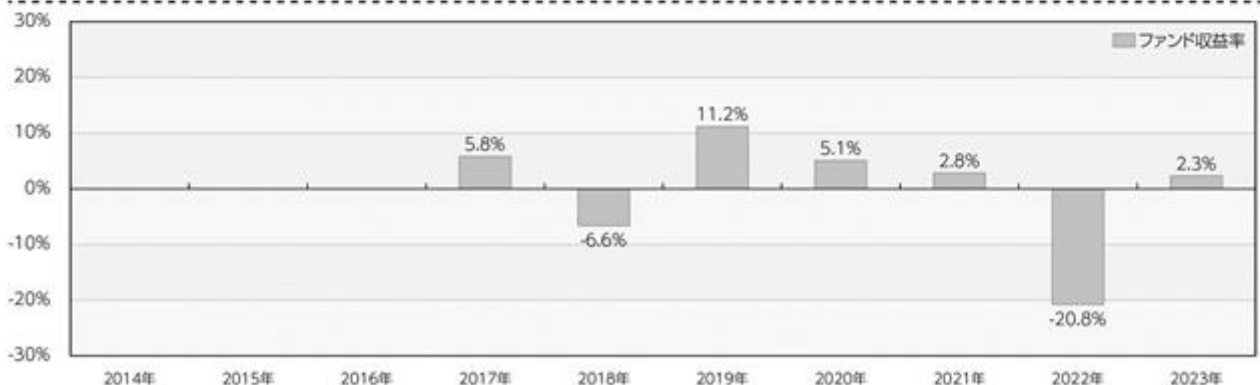
※分配金は1万口当たりです。

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	40.45
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	15.69
3	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	15.26
4	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	15.08
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	10.68

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12月29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12月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

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

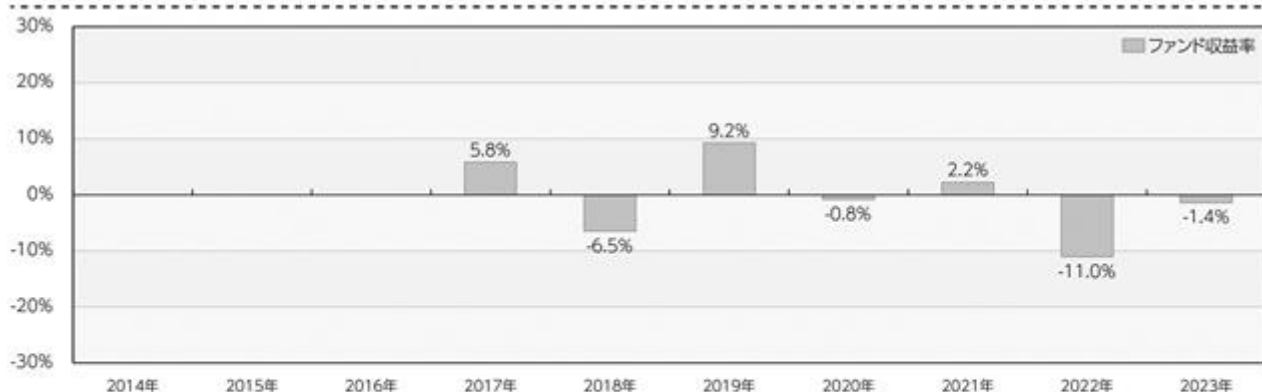
※分配金は1万口当たりです。

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	33.27
2	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	11.01
3	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	10.92
4	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	10.83
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	7.56

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12月29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	5.26
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.60
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.48
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.13
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.45

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	中国	3.03	2026/3/11	0.74
2	US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	アメリカ	3.875	2033/8/15	0.54
3	US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	アメリカ	4.125	2032/11/15	0.46
4	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.46
5	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	0.45

■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	8.87
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.43
3	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	3.59
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.46
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.35

■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	6.21
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.81
3	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	3.26
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.06
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.26

○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12月29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	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	2.27
2	ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	ルーマニア	7.125	2033/1/17	2.21
3	BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	ブラジル	3.75	2031/9/12	1.96
4	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	サウジアラビア	4.375	2029/4/16	1.74
5	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	国債証券	カタール	4	2029/3/14	1.74

○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 <https://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、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ます。

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

信託期間は、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たと
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。イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- 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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、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 <https://www.am-one.co.jp/>)

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

ホ．運用報告書

- ・委託会社は、毎年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 <https://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14期計算期間(2023年6月13日から2023年12月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【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13期 2023年6月12日現在	第14期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	6,126,982	208,257
コール・ローン	110,970,928	141,926,295
投資信託受益証券	42,447,651	-
親投資信託受益証券	5,670,521,762	5,169,013,521
派生商品評価勘定	-	48,261,937
流動資産合計	5,830,067,323	5,359,410,010
資産合計	5,830,067,323	5,359,410,010
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,301,543	-
未払解約金	9,618,415	9,771,157
未払受託者報酬	978,944	893,715
未払委託者報酬	35,896,426	32,771,572
その他未払費用	116,087	105,970
流動負債合計	63,911,415	43,542,414
負債合計	63,911,415	43,542,414
純資産の部		
元本等		
元本	6,073,969,649	5,704,271,955
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	307,813,741	388,404,359
（分配準備積立金）	1,007,472,097	988,370,880
元本等合計	5,766,155,908	5,315,867,596
純資産合計	5,766,155,908	5,315,867,596
負債純資産合計	5,830,067,323	5,359,410,010

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日	第14期 自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
営業収益		
受取配当金	492,599	523,540
受取利息	107,090	163,031
有価証券売買等損益	105,552,895	160,499,069
為替差損益	155,726,318	233,068,217
営業収益合計	49,573,734	71,882,577
営業費用		
支払利息	25,509	28,785
受託者報酬	978,944	893,715
委託者報酬	35,896,426	32,771,572
その他費用	1,198,000	1,287,231
営業費用合計	38,098,879	34,981,303
営業利益又は営業損失（ ）	87,672,613	106,863,880
経常利益又は経常損失（ ）	87,672,613	106,863,880
当期純利益又は当期純損失（ ）	87,672,613	106,863,880
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（ ）	4,101,212	7,958,175
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	233,500,264	307,813,741
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,456,487	19,766,767
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	19,766,767
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	2,198,563	1,451,680
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,198,563	1,451,680
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	307,813,741	388,404,359

(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14期	
	自 2023年6月13日	至 2023年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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13期	第14期
	2023年6月12日現在	2023年12月11日現在
1. 期首元本額	6,338,064,924円	6,073,969,649円
期中追加設定元本額	46,465,749円	20,220,258円
期中一部解約元本額	310,561,024円	389,917,952円
2. 受益権の総数	6,073,969,649口	5,704,271,955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307,813,741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388,404,359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13期	第14期
	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日

1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（45,464,598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（213,367,392円）及び分配準備積立金（942,906,282円）より分配対象収益は1,201,738,272円（1万口当たり2,106.73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13期 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日	第14期 自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 2023年6月12日現在	第14期 2023年12月11日現在
	1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	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13期 2023年6月12日現在	第14期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	1,249,878	-
親投資信託受益証券	108,968,744	144,769,117
合計	110,218,622	144,769,117

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

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)
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

種類	第14期			
	2023年12月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	3,009,404,853	-	2,961,142,916	48,261,937
アメリカ・ドル	2,469,167,108	-	2,431,734,600	37,432,508
イギリス・ポンド	63,155,714	-	61,747,400	1,408,314
イスラエル・シケル	1,577,470	-	1,562,696	14,774
オーストラリア・ドル	52,523,640	-	51,402,600	1,121,040
カナダ・ドル	35,810,742	-	35,151,600	659,142
シンガポール・ドル	20,922,990	-	20,510,500	412,490
スイス・フラン	23,626,148	-	23,108,400	517,748
スウェーデン・クローナ	7,721,560	-	7,612,000	109,560
デンマーク・クローネ	7,963,251	-	7,744,100	219,151
ニュージーランド・ドル	1,813,120	-	1,771,800	41,320
ノルウェー・クローネ	1,634,880	-	1,594,800	40,080
メキシコ・ペソ	19,659,510	-	19,370,520	288,990
ユーロ	104,272,350	-	101,387,000	2,885,350
香港・ドル	175,487,970	-	172,884,900	2,603,070
南アフリカ・ランド	24,068,400	-	23,560,000	508,400
合計	3,009,404,853	-	2,961,142,916	48,261,937

（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13期 2023年6月12日現在	第14期 2023年12月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9493円 (9,493円)	0.9319円 (9,319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12月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	111,623,980	839,992,774	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	306,471,994	549,872,051	
	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	1,843,203,229	2,155,626,176	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	535,942,539	809,487,610	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	365,283,783	814,034,910	
親投資信託受益証券 合計		3,162,525,525	5,169,013,521	
合計			5,169,013,521	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

【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13期 2023年6月12日現在	第14期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	9,017,722	240,080
コール・ローン	4,758,266,754	6,470,073,288
投資信託受益証券	65,426,830	-
親投資信託受益証券	13,810,885,612	9,799,977,806
派生商品評価勘定	-	85,694,974
流動資産合計	18,643,596,918	16,355,986,148
資産合計	18,643,596,918	16,355,986,148
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	41,097,621	47,082
未払解約金	3,255,956	16,535,093
未払受託者報酬	3,168,447	2,850,918
未払委託者報酬	116,178,104	104,535,410
その他未払費用	375,869	338,218
流動負債合計	164,075,997	124,306,721
負債合計	164,075,997	124,306,721
純資産の部		
元本等		
元本	19,098,928,495	17,247,082,852
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	619,407,574	1,015,403,425
(分配準備積立金)	1,251,015,034	1,192,655,935
元本等合計	18,479,520,921	16,231,679,427
純資産合計	18,479,520,921	16,231,679,427
負債純資産合計	18,643,596,918	16,355,986,148

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日	第14期 自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
営業収益		
受取配当金	759,269	806,963
受取利息	184,351	272,255
有価証券売買等損益	324,749,303	204,745,387
為替差損益	455,950,673	603,351,555
営業収益合計	130,257,750	397,526,950
営業費用		
支払利息	958,088	1,056,670
受託者報酬	3,168,447	2,850,918
委託者報酬	116,178,104	104,535,410
その他費用	1,654,069	2,169,931
営業費用合計	121,958,708	110,612,929
営業利益又は営業損失（ ）	252,216,458	508,139,879
経常利益又は経常損失（ ）	252,216,458	508,139,879
当期純利益又は当期純損失（ ）	252,216,458	508,139,879
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（ ）	12,388,674	52,889,463
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	408,629,522	619,407,574
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,703,111	61,282,286
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	61,282,286
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	653,379	2,027,721
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	653,379	2,027,721
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	619,407,574	1,015,403,425

(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14期	
	自 2023年6月13日	至 2023年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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13期	第14期
	2023年6月12日現在	2023年12月11日現在
1. 期首元本額	20,570,943,228円	19,098,928,495円
期中追加設定元本額	23,048,616円	36,750,716円
期中一部解約元本額	1,495,063,349円	1,888,596,359円
2. 受益権の総数	19,098,928,495口	17,247,082,852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619,407,574円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,015,403,425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13期	第14期
	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日

1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(65,217,740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(498,210,338円)及び分配準備積立金(1,127,438,195円)より分配対象収益は1,690,866,273円(1万口当たり980.37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13期 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日	第14期 自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク)、為替変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期	第14期
	2023年6月12日現在	2023年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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13期	第14期
	2023年6月12日現在	2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	1,926,504	-
親投資信託受益証券	321,753,977	189,122,793
合計	323,680,481	189,122,793

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第13期		
	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	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

種類	第14期			
	2023年12月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	5,753,421,430	-	5,667,773,538	85,647,892
アメリカ・ドル	4,747,698,424	-	4,681,197,600	66,500,824
イギリス・ポンド	120,530,985	-	118,046,500	2,484,485
イスラエル・シケル	2,760,572	-	2,734,718	25,854
オーストラリア・ドル	95,320,680	-	93,286,200	2,034,480
カナダ・ドル	64,025,266	-	62,846,800	1,178,466
シンガポール・ドル	38,542,350	-	37,782,500	759,850
スイス・フラン	40,501,968	-	39,614,400	887,568
スウェーデン・クローナ	13,477,632	-	13,286,400	191,232
デンマーク・クローネ	13,989,495	-	13,604,500	384,995
ニュージーランド・ドル	3,626,240	-	3,543,600	82,640
ノルウェー・クローネ	2,861,040	-	2,790,900	70,140
メキシコ・ペソ	34,362,135	-	33,857,020	505,115
ユーロ	198,519,303	-	193,415,200	5,104,103
香港・ドル	335,124,460	-	330,575,200	4,549,260
南アフリカ・ランド	42,080,880	-	41,192,000	888,880
合計	5,753,421,430	-	5,667,773,538	85,647,892

(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13期 2023年6月12日現在	第14期 2023年12月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9676円 (9,676円)	0.9411円 (9,411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12月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	195,968,345	1,474,700,989	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	558,178,608	1,001,484,058	
	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	3,803,024,693	4,447,637,378	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	937,254,612	1,415,629,365	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	655,385,244	1,460,526,016	
親投資信託受益証券 合計		6,149,811,502	9,799,977,806	
合計			9,799,977,806	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

「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12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,708,003,942
コール・ローン	645,899,030
株式	1,165,088,295,630
投資信託受益証券	1,887,675,586
投資証券	22,306,187,603
派生商品評価勘定	847,946,314
未収入金	398,254
未収配当金	1,669,434,609
差入委託証拠金	7,648,395,482
流動資産合計	1,205,802,236,450
資産合計	1,205,802,236,450
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	959,463
未払解約金	42,897,000
流動負債合計	43,856,463
負債合計	43,856,463
純資産の部	
元本等	
元本	160,230,183,976
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,045,528,196,011
元本等合計	1,205,758,379,987
純資産合計	1,205,758,379,987
負債純資産合計	1,205,802,236,450

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	149,259,481,190円
同期中追加設定元本額	43,828,403,034円
同期中一部解約元本額	32,857,700,248円

元本の内訳

ファンド名

DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,865,260,680円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,865,878円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,563,940円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	19,425,677円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,037,325円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	23,163,510円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,877,852円
たわらノーロード 先進国株式	54,873,424,149円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	277,368,618円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,891,156,826円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	909,648,205円
たわらノーロード バランス(堅実型)	86,800,206円
たわらノーロード バランス(標準型)	781,464,399円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,026,881,933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)	34,546,844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)	228,561,449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)	241,640,906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)	412,687,046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)	268,181円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	14,118,233円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,787,031円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,855,872円
たわらノーロード 全世界株式	1,289,686,571円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	56,457,635,798円
One DC 先進国株式インデックスファンド	3,204,893,071円
Oneグローバルバランス	19,423,553円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	138,393,197円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	763,428,702円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,025,283,560円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	82,026,002円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	234,061,384円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	239,402,103円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,709,590円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	665,830,785円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	122,359,348円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	159,456,447円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	185,759,016円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	311,191,791円
投資のソムリエ	10,208,366,400円
クルーズコントロール	96,915,313円
投資のソムリエ<DC年金>	953,157,430円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,541,841円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	280,614,963円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,070,945,281円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,657,261,756円
ワールドアセットバランス(基本コース)	111,623,980円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	195,968,345円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	55,856,014円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	28,120,917円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	9,074,557円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	189,946,126円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	138,798,742円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	828,608,436円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	131,705,858円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	61,380,309円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	30,493,959円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	18,648,442円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	133,468,734円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,286,594円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	33,757,547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)	209,356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)	228,308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)	92,290円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	236,047円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	446,629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)	192,676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)	333,656,994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)	35,016,216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)	1,106,583,540円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	197,683,563円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,234,444,714円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	310,584,205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)	768,989円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	5,603,250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)	351,579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)	4,530,408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)	21,033,062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)	38,173,655円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,491,031円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,445,909円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	978,249円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	30,352円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	769,261円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	15,799,258円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	111,917,771円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	203,679,087円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	705,783,737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)	30,683,582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)	26,285,267円

D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	177,500,803円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	5,622,945円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	136,121円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	65,244,901円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	5,408,552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)	22,172,375円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	38,922,432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)	78,054,057円
動的パッケージファンド<DC年金>	14,184,867円
コア資産形成ファンド	7,935,446円
たわらノーロード 先進国株式(為替ヘッジなし)<ラップ専用>	2,584,574,052円
MHAM外国株式インデックスファンド	135,597,136円
たわらノーロード 先進国株式(為替ヘッジあり)<ラップ専用>	9,084,506円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,672,117,081円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,925,439,713円
計	160,230,183,976円
2. 受益権の総数	160,230,183,976口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	87,461,148,353	
投資信託受益証券	54,405,428	
投資証券	549,306,468	
合計	86,966,247,313	

(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12月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年12月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	57,727,152	-	57,728,066	914
カナダ・ドル	43,605,000	-	43,605,690	690
ユーロ	14,122,152	-	14,122,376	224
買建	463,725,527	-	470,328,139	6,602,612
アメリカ・ドル	350,742,000	-	356,171,445	5,429,445
イギリス・ポンド	20,191,584	-	20,435,699	244,115
カナダ・ドル	6,110,822	-	6,206,226	95,404
ユーロ	86,681,121	-	87,514,769	833,648
合計	521,452,679	-	528,056,205	6,601,698

(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12月11日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	15,523,229,055	-	16,363,614,208	840,385,153
合計	15,523,229,055	-	16,363,614,208	840,385,153

(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12月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	7.5252円 (75,252円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年12月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,396,226	147.420	205,831,636.920	
	ABBOTT LABORATORIES	261,414	104.510	27,320,377.140	
	AES CORP	109,122	18.220	1,988,202.840	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	136,698	161.960	22,139,608.080	
	ADVANCED MICRO DEVICES	242,950	128.920	31,321,114.000	
	ADOBE INC	68,332	610.010	41,683,203.320	
	CHUBB LTD	61,414	222.910	13,689,794.740	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	32,968	263.270	8,679,485.360	
	ALLSTATE CORP	39,652	139.320	5,524,316.640	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	100,009	194.610	19,462,751.490	
AMGEN INC	80,312	269.120	21,613,565.440	
HESS CORP	41,496	134.500	5,581,212.000	
AMERICAN EXPRESS CO	93,688	168.430	15,779,869.840	
AMERICAN ELECTRIC POWER	77,342	79.640	6,159,516.880	
AFLAC INC	84,730	82.550	6,994,461.500	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	65.530	7,087,069.500	
ANALOG DEVICES	74,327	184.880	13,741,575.760	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	102,432	56.080	5,744,386.560	
VALERO ENERGY CORP	54,042	122.740	6,633,115.080	
ANSYS INC	13,252	287.200	3,805,974.400	
APPLE INC	2,350,542	195.710	460,024,574.820	
APPLIED MATERIALS INC	124,811	147.720	18,437,080.920	
ALBEMARLE CORP	16,936	127.990	2,167,638.640	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	73.750	6,010,920.000	
AMEREN CORP	40,644	78.020	3,171,044.880	
AUTODESK INC	32,074	224.010	7,184,896.740	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	61,235	229.270	14,039,348.450	
AUTOZONE INC	2,716	2,620.490	7,117,250.840	
AVERY DENNISON CORP	11,542	191.710	2,212,716.820	
BALL CORP	46,288	57.510	2,662,022.880	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	197,086	353.080	69,587,124.880	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	116,387	49.060	5,709,946.220	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	36.150	2,578,832.550	
BECTON DICKINSON & CO	43,938	232.300	10,206,797.400	
AMETEK INC	34,476	157.160	5,418,248.160	
VERIZON COMM INC	635,060	38.250	24,291,045.000	
WR BERKLEY CORP	31,607	71.330	2,254,527.310	
BEST BUY CO INC	30,568	73.990	2,261,726.320	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	304.130	918,776.730	
YUM! BRANDS INC	42,053	124.340	5,228,870.020	
FIRSTENERGY CORP	83,697	37.080	3,103,484.760	
BOEING CO	86,601	244.700	21,191,264.700	
ROBERT HALF INC	14,456	83.090	1,201,149.040	
BORGWARNER INC	37,010	32.900	1,217,629.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	221,959	54.950	12,196,647.050	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	84.500	1,456,188.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	26,064	155.320	4,048,260.480	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,090.520	3,719,763.720	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	312,164	50.310	15,704,970.840	
ONEOK INC	86,702	68.240	5,916,544.480	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	115.820	1,124,496.380	
UNITED RENTALS INC	10,788	495.060	5,340,707.280	
SEMPRA	93,163	72.380	6,743,137.940	
FEDEX CORP	35,569	272.210	9,682,237.490	
VERISIGN INC	13,302	212.970	2,832,926.940	
AMPHENOL CORP	88,014	93.230	8,205,545.220	
BROWN-FORMAN CORP	48,308	55.080	2,660,804.640	
QUANTA SERVICES INC	23,271	199.250	4,636,746.750	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.640	472,189.600	
CSX CORP	304,211	32.960	10,026,794.560	
COTERRA ENERGY INC	114,711	24.700	2,833,361.700	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	42.910	1,157,625.980	
CONSTELLATION BRANDS INC	24,629	234.440	5,774,022.760	
CARDINAL HEALTH INC	38,298	106.830	4,091,375.340	
CARLISLE COS INC	7,520	295.100	2,219,152.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	18.110	2,687,668.880	
CATERPILLAR INC	76,504	259.500	19,852,788.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	145.720	1,840,589.320	
JPMORGAN CHASE & CO	435,612	158.520	69,053,214.240	
CHURCH & DWIGHT CO INC	35,778	92.940	3,325,207.320	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,876	102.800	2,351,652.800	
CINTAS CORP	13,507	553.330	7,473,828.310	
CISCO SYSTEMS INC	609,273	48.380	29,476,627.740	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	17.380	1,205,667.980	
CLOROX COMPANY	18,305	141.550	2,591,072.750	
COCA-COLA CO/THE	617,137	58.610	36,170,399.570	
COPART INC	128,373	47.390	6,083,596.470	
COLGATE-PALMOLIVE CO	117,230	77.170	9,046,639.100	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	38,376	209.400	8,035,934.400	
MOLINA HEALTHCARE INC	8,928	367.720	3,283,004.160	
NRG ENERGY, INC.	34,874	47.810	1,667,325.940	
COMCAST CORP-CL A	616,451	42.100	25,952,587.100	
CONAGRA BRANDS INC	73,639	29.520	2,173,823.280	
CONSOLIDATED EDISON INC	51,736	91.550	4,736,430.800	
CMS ENERGY CORP	44,128	58.150	2,566,043.200	
COOPER COS INC	7,240	335.000	2,425,400.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	62.310	1,896,467.160	
CORNING INC	116,325	29.110	3,386,220.750	
HEICO CORP-CL A	11,614	143.830	1,670,441.620	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	221.740	2,093,669.080	
CUMMINS INC	21,250	230.580	4,899,825.000	

DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	47.590	1,132,927.540	
DR HORTON INC	45,784	138.460	6,339,252.640	
DANAHER CORP	105,610	217.490	22,969,118.900	
MOODY'S CORP	24,521	374.610	9,185,811.810	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,997	70.330	5,344,869.010	
TARGET CORP	69,096	135.190	9,341,088.240	
DEERE & CO	41,361	363.670	15,041,754.870	
MORGAN STANLEY	185,673	82.280	15,277,174.440	
REPUBLIC SERVICES INC	33,574	161.790	5,431,937.460	
COSTAR GROUP INC	61,975	82.390	5,106,120.250	
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	695.380	2,591,681.260	
THE WALT DISNEY CO	275,728	92.820	25,593,072.960	
DOLLAR TREE INC	31,756	124.410	3,950,763.960	
DOVER CORP	20,350	143.620	2,922,667.000	
OMNICOM GROUP	30,586	81.940	2,506,216.840	
DTE ENERGY CO	30,044	108.610	3,263,078.840	
DUKE ENERGY CORP	118,123	94.390	11,149,629.970	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,701	158.950	2,813,573.950	
EBAY INC	75,181	41.290	3,104,223.490	
BANK OF AMERICA CORP	1,077,648	30.960	33,363,982.080	
CITIGROUP INC	288,199	48.890	14,090,049.110	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	84.850	1,424,631.500	
EATON CORP PLC	59,302	232.310	13,776,447.620	
CADENCE DESIGN SYS INC	40,689	259.930	10,576,291.770	
ECOLAB INC	38,151	192.120	7,329,570.120	
REVVITY INC	17,972	91.020	1,635,811.440	
ELECTRONIC ARTS INC	38,801	137.140	5,321,169.140	
SALESFORCE INC	146,338	250.810	36,703,033.780	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	305.750	1,030,989.000	
EMERSON ELECTRIC CO	84,776	89.550	7,591,690.800	
ATMOS ENERGY CORP	21,199	113.460	2,405,238.540	
ENTERGY CORP	30,736	102.010	3,135,379.360	
EOG RESOURCES INC	86,645	118.960	10,307,289.200	
EQUIFAX INC	18,730	228.380	4,277,557.400	
EQT CORP	59,729	37.130	2,217,737.770	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	35,846	133.730	4,793,685.580	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	120.370	2,698,093.550	
EXXON MOBIL CORP	600,687	99.550	59,798,390.850	
FMC CORP	17,711	55.880	989,690.680	
NEXTERA ENERGY INC	309,921	59.700	18,502,283.700	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	443.890	2,402,332.680	
FAIR ISAAC CORP	3,775	1,134.390	4,282,322.250	
ASSURANT INC	8,766	167.680	1,469,882.880	
FASTENAL CO	85,603	62.290	5,332,210.870	
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	31.250	3,294,062.500	
M&T BANK CORP	24,958	132.650	3,310,678.700	

FISERV INC	91,718	132.360	12,139,794.480	
FORD MOTOR CO	585,908	11.010	6,450,847.080	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	25.570	1,213,986.890	
FREEPORT-MCMORAN INC	214,628	38.150	8,188,058.200	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,446.470	2,291,208.480	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	31,707	240.960	7,640,118.720	
GENERAL DYNAMICS CORP	34,634	252.290	8,737,811.860	
GENERAL MILLS INC	88,517	65.470	5,795,207.990	
GENUINE PARTS CO	20,769	132.980	2,761,861.620	
GILEAD SCIENCES INC	185,219	79.020	14,636,005.380	
GARTNER INC	11,988	452.000	5,418,576.000	
MCKESSON CORP	20,139	457.890	9,221,446.710	
NVIDIA CORP	371,467	475.060	176,469,113.020	
GRACO INC	23,985	82.630	1,981,880.550	
GENERAL ELECTRIC CO	164,658	120.590	19,856,108.220	
WW GRAINGER INC	6,777	804.050	5,449,046.850	
HALLIBURTON CO	139,251	34.930	4,864,037.430	
MONSTER BEVERAGE CORP	117,637	53.920	6,342,987.040	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	49,219	350.830	17,267,501.770	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28,728	195.810	5,625,229.680	
HASBRO INC	16,359	48.700	796,683.300	
HENRY SCHEIN INC	17,431	71.910	1,253,463.210	
HEICO CORP	6,878	178.910	1,230,542.980	
HERSHEY FOODS CORP	22,500	185.740	4,179,150.000	
HP INC	134,136	29.460	3,951,646.560	
F5 INC	8,981	170.820	1,534,134.420	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	88.530	1,604,606.250	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	241.650	1,840,164.750	
JUNIPER NETWORKS INC	57,881	28.990	1,677,970.190	
HOLOGIC INC	38,399	68.370	2,625,339.630	
HOME DEPOT INC	150,144	326.470	49,017,511.680	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	92.940	2,446,087.860	
HORMEL FOODS CORP	49,054	31.380	1,539,314.520	
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	28.770	2,813,015.520	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	420.620	2,068,188.540	
HUBBELL INC	7,820	308.170	2,409,889.400	
HUMANA INC	18,641	481.620	8,977,878.420	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	186.620	2,290,947.120	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	215,385	11.990	2,582,466.150	
BIOGEN INC	21,910	239.290	5,242,843.900	
IDEX CORP	11,045	204.840	2,262,457.800	
ILLINOIS TOOL WORKS	44,869	249.610	11,199,751.090	
INTUIT INC	42,167	573.900	24,199,641.300	
IDEXX LABORATORIES INC	12,500	531.350	6,641,875.000	

TRANE TECHNOLOGIES PLC	33,856	234.000	7,922,304.000	
INTEL CORP	629,190	42.700	26,866,413.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	76.820	3,149,082.260	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	36.840	1,626,596.520	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	31.220	1,687,846.860	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	164.690	1,952,729.330	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	119.000	2,330,734.000	
INCYTE CORP	31,654	54.700	1,731,473.800	
JOHNSON & JOHNSON	361,496	154.420	55,822,212.320	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,659	78.280	3,574,186.520	
KLA CORPORATION	20,432	534.430	10,919,473.760	
DEVON ENERGY CORP	96,985	44.090	4,276,068.650	
KELLANOVA	42,451	53.700	2,279,618.700	
KEYCORP	144,072	13.260	1,910,394.720	
KIMBERLY-CLARK CORP	50,460	119.940	6,052,172.400	
BLACKROCK INC/NEW YORK	22,139	744.730	16,487,577.470	
KROGER CO	103,385	44.580	4,608,903.300	
LAM RESEARCH CORP	20,026	703.170	14,081,682.420	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	411.490	2,699,785.890	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,451	163.880	2,204,349.880	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	61.710	1,250,244.600	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,313	114.410	2,667,240.330	
LENNAR CORP	37,667	139.580	5,257,559.860	
ELI LILLY & CO	121,042	598.050	72,389,168.100	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	37.570	1,057,820.920	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	110,884	156.300	17,331,169.200	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,825	127.200	5,701,740.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	33,842	448.020	15,161,892.840	
LOEWS CORP	30,289	68.840	2,085,094.760	
LOWE'S COS INC	86,951	207.830	18,071,026.330	
DOMINION ENERGY INC	126,501	47.490	6,007,532.490	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	41.420	1,673,409.420	
MCCORMICK & CO INC	35,510	67.090	2,382,365.900	
MCDONALD'S CORPORATION	109,514	285.530	31,269,532.420	
S&P GLOBAL INC	48,610	415.380	20,191,621.800	
EVEREST GROUP LTD	6,670	384.780	2,566,482.600	
MARKEL GROUP INC	2,013	1,374.000	2,765,862.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	91,510	69.180	6,330,661.800	
MARSH & MCLENNAN COS	74,055	195.670	14,490,341.850	

MASCO CORP	34,561	64.000	2,211,904.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,365	469.390	4,395,837.350	
METLIFE INC	97,405	64.090	6,242,686.450	
MEDTRONIC PLC	202,117	79.350	16,037,983.950	
CVS HEALTH CORP	197,356	75.100	14,821,435.600	
MERCK & CO. INC.	380,439	103.750	39,470,546.250	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	65,250	76.140	4,968,135.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,876	216.600	2,788,941.600	
MICROSOFT CORP	1,060,970	374.230	397,046,803.100	
MICRON TECH INC	163,017	74.960	12,219,754.320	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	81,668	86.080	7,029,981.440	
3M CO	82,577	103.370	8,535,984.490	
ENTEGRIS INC	20,987	106.990	2,245,399.130	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	204.460	1,569,026.040	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,847	324.520	8,063,348.440	
ILLUMINA INC	24,379	112.940	2,753,364.260	
XCEL ENERGY INC	82,777	60.910	5,041,947.070	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	117.280	1,713,812.640	
NETAPP INC	32,785	89.390	2,930,651.150	
NEWMONT CORP	173,608	39.080	6,784,600.640	
NVR INC	483	6,535.890	3,156,834.870	
NIKE INC-CL B	182,817	115.910	21,190,318.470	
NORDSON CORP	7,548	239.160	1,805,179.680	
NORFOLK SOUTHERN CORP	34,140	221.000	7,544,940.000	
EVERSOURCE ENERGY	51,861	59.650	3,093,508.650	
NISOURCE INC	64,543	26.300	1,697,480.900	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	80.390	2,642,258.520	
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,526	476.250	10,251,757.500	
WELLS FARGO & CO	549,951	46.100	25,352,741.100	
NUCOR CORP	37,496	162.090	6,077,726.640	
CHENIERE ENERGY INC	36,422	176.210	6,417,920.620	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,630	118.090	6,805,526.700	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,774	56.470	5,634,237.780	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,854	369.450	5,487,810.300	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,084	945.880	8,592,373.920	
ORACLE CORP	246,970	113.610	28,058,261.700	
PACCAR INC	77,744	95.380	7,415,222.720	
PTC INC	18,085	166.610	3,013,141.850	
EXELON CORP	147,025	39.210	5,764,850.250	
PARKER HANNIFIN CORP	19,211	438.630	8,426,520.930	
PAYCHEX INC	49,152	124.020	6,095,831.040	

ALIGN TECHNOLOGY INC	10,491	221.230	2,320,923.930	
PPL CORPORATION	113,687	26.060	2,962,683.220	
PEPSICO INC	206,840	165.680	34,269,251.200	
PENTAIR PLC	25,545	67.410	1,721,988.450	
PFIZER INC	849,236	28.780	24,441,012.080	
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	36.000	1,451,484.000	
CONOCOPHILLIPS	179,242	112.070	20,087,650.940	
PG&E CORP	306,139	17.610	5,391,107.790	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34,773	223.050	7,756,117.650	
ALTRIA GROUP INC	263,679	41.300	10,889,942.700	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	59,805	140.670	8,412,769.350	
BROWN & BROWN INC	36,907	74.150	2,736,654.050	
GARMIN LTD	23,281	124.590	2,900,579.790	
PPG INDUSTRIES INC	35,748	143.980	5,146,997.040	
COSTCO WHOLESALE CORP	66,410	610.780	40,561,899.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,293	98.440	3,375,802.920	
QUEST DIAGNOSTICS	16,574	135.910	2,252,572.340	
PROCTER & GAMBLE CO	353,784	145.150	51,351,747.600	
PROGRESSIVE CORP	87,083	161.170	14,035,167.110	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	74,243	62.570	4,645,384.510	
PULTE GROUP INC	33,950	96.310	3,269,724.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,240	120.160	4,474,758.400	
QUALCOMM INC	167,820	132.970	22,315,025.400	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,141	107.050	3,119,544.050	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	64.720	1,685,632.400	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	8,747	264.640	2,314,806.080	
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,052	840.140	13,485,927.280	
REPLIGEN CORP	8,576	159.270	1,365,899.520	
RESMED INC	22,899	162.870	3,729,560.130	
US BANCORP	229,227	40.430	9,267,647.610	
SEAGEN INC	21,236	218.980	4,650,259.280	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,309	79.300	4,465,303.700	
ROSS STORES INC	50,878	132.080	6,719,966.240	
ROLLINS INC	45,708	41.430	1,893,682.440	
ROPER TECHNOLOGIES INC	15,771	536.600	8,462,718.600	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,327	278.530	4,826,089.310	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	34,772	120.470	4,188,982.840	
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	107.020	2,060,991.160	
ACCENTURE PLC-CL A	94,821	337.230	31,976,485.830	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	202,099	71.090	14,367,217.910	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	242.660	3,935,217.220	

AXON ENTERPRISE INC	11,039	236.380	2,609,398.820	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	34,835	181.260	6,314,192.100	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	89,354	58.940	5,266,524.760	
BOOKING HOLDINGS INC	5,368	3,275.000	17,580,200.000	
SCHLUMBERGER LTD	212,211	48.800	10,355,896.800	
SCHWAB (CHARLES) CORP	224,033	64.070	14,353,794.310	
POOL CORP	5,406	354.120	1,914,372.720	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	117.300	3,766,972.200	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	60.240	872,094.480	
ELEVANCE HEALTH INC	35,171	477.970	16,810,682.870	
CENCORA INC	25,701	201.750	5,185,176.750	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,591	75.150	2,674,663.650	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	36,435	289.820	10,559,591.700	
CENTENE CORP	82,487	73.770	6,085,065.990	
SMITH (A.O.) CORP	19,563	77.990	1,525,718.370	
SNAP-ON INC	8,204	278.220	2,282,516.880	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,392	100.870	5,486,521.040	
EDISON INTERNATIONAL	57,612	67.450	3,885,929.400	
SOUTHERN CO	166,722	71.500	11,920,623.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	198,729	34.330	6,822,366.570	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	29.070	572,679.000	
AT&T INC	1,063,626	16.920	17,996,551.920	
CHEVRON CORP	272,487	144.310	39,322,598.970	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,592	92.850	2,097,667.200	
STATE STREET CORP	50,416	73.970	3,729,271.520	
STARBUCKS CORP	170,073	96.610	16,430,752.530	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	113.160	2,595,550.920	
STRYKER CORP	51,849	289.100	14,989,545.900	
NETFLIX INC	66,811	453.760	30,316,159.360	
GEN DIGITAL INC	92,583	22.150	2,050,713.450	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	55.690	1,525,906.000	
SYNOPSIS INC	22,666	535.930	12,147,389.380	
SYSCO CORP	76,419	73.830	5,642,014.770	
INTUITIVE SURGICAL INC	53,463	310.420	16,595,984.460	
TELEFLEX INC	6,985	231.080	1,614,093.800	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	9.820	1,662,035.000	
TERADYNE INC	22,066	92.290	2,036,471.140	
TEXAS INSTRUMENTS INC	137,188	157.030	21,542,631.640	
TEXTRON INC	29,841	75.930	2,265,827.130	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	58,046	489.770	28,429,189.420	

GLOBE LIFE INC	12,153	122.360	1,487,041.080	
TORO CO	14,644	84.230	1,233,464.120	
DAVITA INC	6,813	107.580	732,942.540	
TRACTOR SUPPLY CO	16,808	212.070	3,564,472.560	
BIO-TECHNE CORP	25,934	68.310	1,771,551.540	
TRIMBLE INC	37,504	46.900	1,758,937.600	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,175	403.070	2,488,957.250	
TYSON FOODS INC	41,316	51.380	2,122,816.080	
MARATHON OIL CORP	92,952	24.090	2,239,213.680	
UNION PACIFIC CORP	91,691	229.770	21,067,841.070	
RTX CORP	217,454	81.320	17,683,359.280	
UNITEDHEALTH GROUP INC	139,147	549.770	76,498,846.190	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	137.450	1,112,795.200	
VF CORP	51,762	18.140	938,962.680	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	16.850	1,370,343.100	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	38,348	350.150	13,427,552.200	
VULCAN MATERIALS CO	20,095	216.030	4,341,122.850	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	23.160	2,480,991.840	
WALMART INC	222,066	150.860	33,500,876.760	
WASTE MANAGEMENT INC	60,476	172.500	10,432,110.000	
WATERS CORP	8,786	292.140	2,566,742.040	
WATSCO INC	4,889	411.850	2,013,534.650	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,626	342.240	3,636,642.240	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,604	119.330	1,862,025.320	
VAIL RESORTS INC	6,523	225.870	1,473,350.010	
WESTERN DIGITAL CORP	49,451	47.860	2,366,724.860	
WABTEC CORP	25,714	118.400	3,044,537.600	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	103.780	2,307,548.300	
WYNN RESORTS LTD	15,379	84.190	1,294,758.010	
NASDAQ INC	52,969	53.970	2,858,736.930	
CME GROUP INC	54,132	211.620	11,455,413.840	
WILLIAMS COS INC	180,781	35.520	6,421,341.120	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	138.090	1,180,807.590	
LKQ CORP	37,072	45.400	1,683,068.800	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	51.380	2,082,123.120	
WEC ENERGY GROUP INC	47,882	84.070	4,025,439.740	
CARMAX INC	22,414	67.220	1,506,669.080	
TJX COMPANIES INC	172,469	89.130	15,372,161.970	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	236.130	1,838,272.050	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.280	511,840.720	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	40.450	951,707.600	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,271	170.040	3,276,840.840	
CBRE GROUP INC	44,502	82.690	3,679,870.380	
REGIONS FINANCIAL CORP	133,681	17.440	2,331,396.640	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	394.900	2,028,601.300	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,127	575.730	4,103,227.710	
WESTLAKE CORP	6,030	129.250	779,377.500	
T-MOBILE US INC	80,697	156.400	12,621,010.800	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	46.390	2,218,369.800	
MOSAIC CO/THE	48,502	35.680	1,730,551.360	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	261.680	1,603,051.680	
CELANESE CORP	16,273	141.350	2,300,188.550	
DEXCOM INC	58,553	116.970	6,848,944.410	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	147.700	2,888,125.800	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	145.500	3,197,799.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	76.560	2,370,986.640	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,536	357.580	5,555,362.880	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	84,672	113.340	9,596,724.480	
LIVE NATION	23,597	85.190	2,010,228.430	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,117	2,242.950	9,234,225.150	
TRANSDIGM GROUP INC	8,166	983.920	8,034,690.720	
MASTERCARD INC	126,146	412.160	51,992,335.360	
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	50.900	1,202,410.700	
OWENS CORNING	13,227	143.360	1,896,222.720	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	108.490	1,959,437.890	
AERCAP HOLDINGS NV	30,064	72.150	2,169,117.600	
FIRST SOLAR INC	15,579	145.380	2,264,875.020	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17,070	191.360	3,266,515.200	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,263	272.650	1,980,256.950	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	91.230	1,924,405.620	
DELTA AIR LINES INC	21,592	40.350	871,237.200	
INSULET CORP	10,158	194.660	1,977,356.280	
DISCOVER FINANCIAL	39,188	103.300	4,048,120.400	
TE CONNECTIVITY LTD	47,054	133.320	6,273,239.280	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,255	489.640	8,448,738.200	
MERCADOLIBRE INC	6,748	1,577.980	10,648,209.040	
ULTA BEAUTY INC	7,263	482.160	3,501,928.080	
MSCI INC	11,948	506.680	6,053,812.640	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	233,121	91.310	21,286,278.510	
VISA INC	241,677	255.740	61,806,475.980	
KEURIG DR PEPPER INC	160,760	32.110	5,162,003.600	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	27,995	131.350	3,677,143.250	

MARATHON PETROLEUM CORP	58,920	143.020	8,426,738.400	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	73.430	1,573,604.900	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	298,312	17.700	5,280,122.400	
XYLEM INC	36,891	106.380	3,924,464.580	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,272	92.580	3,450,641.760	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	246.890	1,600,094.090	
SPLUNK INC	22,702	150.950	3,426,866.900	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	268.500	2,191,497.000	
HCA HEALTHCARE INC	30,702	257.530	7,906,686.060	
VERISK ANALYTICS INC	21,663	232.920	5,045,745.960	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,706	120.420	1,289,216.520	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,295	256.090	2,636,446.550	
NXP SEMICONDUCTOR NV	38,938	215.550	8,393,085.900	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,242	125.290	2,410,830.180	
TARGA RESOURCES CORP	33,263	86.560	2,879,245.280	
LEAR CORP	9,398	133.080	1,250,685.840	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,608	178.720	2,789,461.760	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	57.110	1,958,587.450	
DOLLAR GENERAL CORP	33,444	127.220	4,254,745.680	
FORTINET INC	100,599	52.160	5,247,243.840	
HYATT HOTELS CORP	6,647	122.640	815,188.080	
TESLA INC	429,981	243.840	104,846,567.040	
ENPHASE ENERGY INC	18,600	103.010	1,915,986.000	
GENERAL MOTORS CO	208,056	33.750	7,021,890.000	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	30.080	1,180,038.400	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	224.110	2,665,788.450	
APTIV PLC	43,097	79.830	3,440,433.510	
PHILLIPS 66	68,358	125.320	8,566,624.560	
META PLATFORMS INC	334,116	332.750	111,177,099.000	
IQVIA HOLDINGS INC	27,848	215.280	5,995,117.440	
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,850	148.730	3,695,940.500	
SERVICENOW INC	30,797	699.080	21,529,566.760	
PALO ALTO NETWORKS INC	46,854	298.420	13,982,170.680	
WORKDAY INC	31,060	273.410	8,492,114.600	
ABBVIE INC	264,718	149.280	39,517,103.040	
ZOETIS INC	68,687	184.600	12,679,620.200	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	21.940	1,189,389.340	
CDW CORP	20,262	213.190	4,319,655.780	
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	53.260	3,361,238.600	
TWILIO INC	25,710	70.610	1,815,383.100	
SNAP INC	152,250	15.090	2,297,452.500	

TRADE DESK INC A	66,855	70.630	4,721,968.650	
OKTA INC	21,831	72.010	1,572,050.310	
BAKER HUGHES CO	152,160	32.240	4,905,638.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	100.960	2,199,413.600	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	11.110	1,799,397.820	
BROADCOM INC	66,816	944.300	63,094,348.800	
ARES MANAGEMENT CORP	23,161	110.640	2,562,533.040	
MONGODB INC	10,906	381.790	4,163,801.740	
BURLINGTON STORES INC	10,565	176.280	1,862,398.200	
VEEVA SYSTEMS INC	23,273	172.710	4,019,479.830	
EVERGY INC	33,192	51.560	1,711,379.520	
ALLEGION PLC	13,423	110.340	1,481,093.820	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	22,002	67.170	1,477,874.340	
STERIS PLC	14,158	200.500	2,838,679.000	
DOCUSIGN INC	26,362	49.730	1,310,982.260	
WIX.COM LTD	8,997	103.180	928,310.460	
DROPBOX INC	41,801	27.590	1,153,289.590	
KKR & CO INC	90,373	76.950	6,954,202.350	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	52.060	262,903.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	73.060	2,473,592.420	
MODERNA INC	50,006	80.320	4,016,481.920	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40,232	171.330	6,892,948.560	
CIGNA GROUP	45,163	258.800	11,688,184.400	
DELL TECHNOLOGIES INC	38,669	68.700	2,656,560.300	
DOW INC	106,037	50.920	5,399,404.040	
OVINTIV INC	39,160	41.630	1,630,230.800	
AMCOR PLC	223,348	9.650	2,155,308.200	
PINTEREST INC	90,936	34.910	3,174,575.760	
FOX CORP-A	36,501	29.940	1,092,839.940	
FOX CORP-B	27,507	28.010	770,471.070	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	33,813	242.550	8,201,343.150	
AVANTOR INC	97,157	20.980	2,038,353.860	
DYNATRACE INC	39,362	54.130	2,130,665.060	
CLOUDFLARE INC	39,310	77.520	3,047,311.200	
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	90.350	1,528,541.300	
CARRIER GLOBAL CORP	124,379	55.270	6,874,427.330	
OTIS WORLDWIDE CORP	62,600	87.500	5,477,500.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	276,804	61.700	17,078,806.800	
CORTEVA INC	108,001	45.150	4,876,245.150	
MATCH GROUP INC	44,764	32.100	1,436,924.400	
FERGUSON PLC	30,868	180.650	5,576,304.200	
BILL HOLDINGS INC	16,243	70.980	1,152,928.140	
BLACKSTONE INC	105,031	112.570	11,823,339.670	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,809	152.350	885,001.150	
CARLYLE GROUP INC	34,847	36.930	1,286,899.710	
DATADOG INC	38,635	113.830	4,397,822.050	

SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	80.590	2,489,425.100	
VERTIV HOLDINGS CO	53,234	47.140	2,509,450.760	
INGERSOLL RAND INC	61,976	73.310	4,543,460.560	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	62,373	68.520	4,273,797.960	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	186.570	1,668,122.370	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	19.040	1,778,831.040	
DRAFTKINGS INC	63,900	35.900	2,294,010.000	
UNITY SOFTWARE INC	40,967	32.700	1,339,620.900	
AON PLC	30,296	324.100	9,818,933.600	
WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	11.470	4,030,798.870	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,546.120	1,400,784.720	
BENTLEY SYSTEMS INC	33,634	50.590	1,701,544.060	
COINBASE GLOBAL INC	26,305	146.620	3,856,839.100	
UIPATH INC	53,439	24.630	1,316,202.570	
AIRBNB INC	64,456	140.680	9,067,670.080	
CONSTELLATION ENERGY CORP	48,214	111.210	5,361,878.940	
MONDAY.COM LTD	3,043	175.030	532,616.290	
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	28.570	1,776,282.610	
ROBLOX CORP	59,573	40.830	2,432,365.590	
VIATRIS INC	184,148	9.830	1,810,174.840	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	44.190	1,529,150.760	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	75.050	1,189,242.300	
HF SINCLAIR CORP	20,299	52.670	1,069,148.330	
SNOWFLAKE INC	42,608	190.670	8,124,067.360	
DOORDASH INC	39,376	100.000	3,937,600.000	
ARISTA NETWORKS INC	39,238	224.030	8,790,489.140	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	59,548	92.090	5,483,775.320	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	34.150	542,745.950	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	273,108	17.770	4,853,129.160	
FNF GROUP	38,907	46.720	1,817,735.040	
JACOBS SOLUTIONS INC	18,723	127.290	2,383,250.670	
MARVELL TECHNOLOGY INC	129,101	52.880	6,826,860.880	
APA CORP	49,146	34.470	1,694,062.620	
CONFLUENT INC	27,524	22.680	624,244.320	
LINDE PLC	73,237	401.270	29,387,810.990	
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	11.730	862,929.180	
LUCID GROUP INC	143,927	4.730	680,774.710	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	56.410	675,848.210	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	198.990	740,441.790	
TOAST INC	45,399	15.350	696,874.650	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.150	880,472.250	
CATALENT INC	27,357	37.180	1,017,133.260	

SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	35.290	2,424,458.290	
VERALTO CORP	32,610	75.430	2,459,772.300	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM	19,871	26.640	529,363.440	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	28,191	62.920	1,773,777.720	
BUNGE GLOBAL SA	21,715	104.500	2,269,217.500	
KENVUE INC	264,038	20.610	5,441,823.180	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	29.610	2,161,914.930	
CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	201.060	1,367,006.940	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	144.330	3,999,817.290	
HUBSPOT INC	6,836	502.040	3,431,945.440	
QORVO INC	14,144	103.970	1,470,551.680	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,444	75.600	1,394,366.400	
LIBERTY GLOBAL LTD	36,034	17.080	615,460.720	
GODADDY INC	19,713	104.310	2,056,263.030	
ETSY INC	18,558	80.080	1,486,124.640	
TRANSUNION	31,262	62.630	1,957,939.060	
ALBERTSONS COS INC	54,086	22.190	1,200,168.340	
BLOCK INC	84,306	69.170	5,831,446.020	
DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	70.890	4,837,179.150	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	63.410	1,966,470.920	
WESTROCK CO	34,286	41.160	1,411,211.760	
KRAFT HEINZ CO	129,447	36.230	4,689,864.810	
FORTIVE CORP	50,061	68.890	3,448,702.290	
WASTE CONNECTIONS INC	38,848	138.330	5,373,843.840	
ALPHABET INC-CL A	894,177	134.990	120,704,953.230	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	186,711	16.220	3,028,452.420	
PAYPAL HOLDINGS INC	158,507	58.940	9,342,402.580	
SEA LTD ADR	58,070	40.000	2,322,800.000	
EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	32.120	1,809,287.480	
ZILLOW GROUP INC-C	22,374	46.410	1,038,377.340	
ALPHABET INC-CL C	783,554	136.640	107,064,818.560	
ZSCALER INC	14,051	198.800	2,793,338.800	
ATLISSIAN CORP PLC	23,713	192.360	4,561,432.680	
ROKU INC	19,331	103.360	1,998,052.160	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,042	367.550	5,161,137.100	
VISTRA CORP	49,633	36.960	1,834,435.680	
アメリカ・ドル	小計	51,029,705	5,976,802,360.730 (869,027,063,248)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	15.140	928,006.300
	ASHTREAD GROUP	66,851	50.320	3,363,942.320

SEVERN TRENT PLC	45,548	27.140	1,236,172.720	
BARCLAYS PLC	2,229,023	1.432	3,191,960.930	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	5.366	666,435.730	
BT GROUP PLC	904,198	1.321	1,194,445.550	
BUNZL PLC	46,691	30.790	1,437,615.890	
CRH PLC	108,593	51.400	5,581,680.200	
AVIVA PLC	429,205	4.291	1,841,718.650	
CRODA INTERNATIONAL	20,573	47.670	980,714.910	
DIAGEO PLC	333,830	28.290	9,444,050.700	
SCHRODERS PLC	110,366	4.214	465,082.320	
DCC PLC	17,471	55.200	964,399.200	
NATIONAL GRID PLC	547,462	10.600	5,803,097.200	
KINGFISHER PLC	336,026	2.321	779,916.340	
BAE SYSTEMS PLC	457,388	10.425	4,768,269.900	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	314,741	23.165	7,290,975.260	
HALMA PLC	51,066	22.050	1,126,005.300	
NEXT PLC	18,588	80.020	1,487,411.760	
IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	18.200	2,296,457.800	
ANGLO AMERICAN PLC	193,117	18.026	3,481,127.040	
COMPASS GROUP PLC	259,074	20.620	5,342,105.880	
HSBC HOLDINGS PLC	2,924,664	6.192	18,109,519.480	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.409	2,063,065.190	
CENTRICA PLC	793,776	1.494	1,185,901.340	
UNILEVER PLC	382,437	37.865	14,480,977.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	11.095	1,004,863.050	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	24.220	1,333,141.460	
PEARSON PLC	84,159	9.604	808,263.030	
PERSIMMON PLC	56,989	13.095	746,270.950	
PRUDENTIAL PLC	418,146	8.896	3,719,826.810	
RIO TINTO PLC	167,240	55.830	9,337,009.200	
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.692	2,479,368.870	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	107,096	53.940	5,776,758.240	
RELX PLC	280,647	31.070	8,719,702.290	
RENTOKIL INITIAL PLC	374,845	4.191	1,570,975.390	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,221,103	2.893	3,532,650.970	
NATWEST GROUP PLC	896,355	2.205	1,976,462.770	
ST JAMES'S PLACE PLC	89,082	6.996	623,217.670	
SSE PLC	168,922	18.825	3,179,956.650	
BP PLC	2,571,529	4.682	12,039,898.770	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	11.745	1,787,542.020	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.750	865,891.250	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	94.780	1,018,979.780	
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	6.600	2,392,684.800	

	LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,179,291	0.463	4,250,011.730	
	TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.375	783,561.620	
	TESCO PLC	1,030,735	2.879	2,967,486.060	
	3I GROUP PLC	139,893	23.440	3,279,091.920	
	SMITH & NEPHEW PLC	125,930	10.485	1,320,376.050	
	GSK PLC	626,067	14.344	8,980,305.040	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	63,356	91.000	5,765,396.000	
	WPP PLC	142,785	7.226	1,031,764.410	
	ASTRAZENECA PLC	232,839	101.220	23,567,963.580	
	WHITBREAD PLC	31,475	33.430	1,052,209.250	
	INTERTEK GROUP PLC	23,309	40.520	944,480.680	
	BURBERRY GROUP PLC	52,229	15.185	793,097.360	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	68.300	1,835,494.200	
	SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.948	783,599.030	
	ADMIRAL GROUP PLC	40,084	28.010	1,122,752.840	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	47.400	781,578.600	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	17.515	323,239.320	
	ABRDN PLC	285,831	1.790	511,637.490	
	EXPERIAN PLC	140,133	30.810	4,317,497.730	
	MONDI PLC	74,310	14.630	1,087,155.300	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.484	276,473.920	
	OCADO GROUP PLC	69,766	6.274	437,711.880	
	INFORMA PLC	223,961	7.744	1,734,353.980	
	GLENCORE PLC	1,570,188	4.574	7,182,039.910	
	ENTAIN PLC	96,924	8.030	778,299.720	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	22.730	705,425.550	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	4.976	675,880.120	
	M&G PLC	270,401	2.129	575,683.720	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	17.600	494,120.000	
	WISE PLC	96,207	8.088	778,122.210	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.669	637,676.490	
	HALEON PLC	836,729	3.248	2,717,695.790	
	SHELL PLC	993,556	25.205	25,042,578.980	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	7.380	1,056,727.440	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	5.594	1,208,997.650	
	イギリス・ポンド 小計	40,717,305		272,225,004.450 (49,678,341,062)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	187,404	31.380	5,880,737.520	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	28.200	6,742,140.600	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	770.600	2,566,098.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	17.990	2,931,362.560	
	ICL GROUP LTD	103,067	18.700	1,927,352.900	
	NICE LTD	9,053	756.900	6,852,215.700	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	134.000	3,945,496.000	

	AZRIELI GROUP	4,672	216.100	1,009,619.200	
イスラエル・シュケル 小計		738,997		31,855,022.480 (1,250,701,449)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	48.530	1,373,690.180	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	520,190	21.920	11,402,564.800	
	FORTESCUE LTD	253,090	25.750	6,517,067.500	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.840	2,303,435.520	
	ASX LTD	31,215	59.210	1,848,240.150	
	BHP GROUP LTD	757,775	47.740	36,176,178.500	
	AMPOL LTD	31,828	34.490	1,097,747.720	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	23.610	2,163,242.640	
	CSL LIMITED	72,171	266.920	19,263,883.320	
	REA GROUP LTD	9,317	161.790	1,507,397.430	
	TRANSURBAN GROUP	476,258	13.160	6,267,555.280	
	COCHLEAR LTD	10,446	283.320	2,959,560.720	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	7.840	2,020,305.280	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	246,769	106.440	26,266,092.360	
	RIO TINTO LIMITED	56,991	128.890	7,345,569.990	
	APA GROUP	164,300	8.700	1,429,410.000	
	ARISTOCRAT LEISU	86,829	39.240	3,407,169.960	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.940	2,138,887.080	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	49.500	3,007,966.500	
	IGO LTD	91,947	8.180	752,126.460	
	ORICA LTD	63,862	15.580	994,969.960	
	BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	21.160	1,620,580.920	
	MACQUARIE GROUP LTD	56,701	169.350	9,602,314.350	
	SUNCORP GROUP LTD	199,628	13.900	2,774,829.200	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	465,095	29.200	13,580,774.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.560	626,384.040	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	219,807	14.520	3,191,597.640	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	12.600	2,049,125.400	
	REECE LTD	31,558	20.010	631,475.580	
	SANTOS LTD	478,809	7.250	3,471,365.250	
SONIC HEALTHCARE	64,897	31.100	2,018,296.700		
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	32.880	1,296,129.600		
WESFARMERS LTD	172,824	53.700	9,280,648.800		
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	282,153	29.810	8,410,980.930		
WOOLWORTHS GROUP LTD	183,840	35.770	6,575,956.800		
SEEK LTD	58,513	24.830	1,452,877.790		

	MINERAL RESOURCES LTD	28,865	62.490	1,803,773.850	
	BRAMBLES LTD	220,767	12.980	2,865,555.660	
	PILBARA MINERALS LTD	404,496	3.710	1,500,680.160	
	CAR GROUP LTD	58,310	28.640	1,669,998.400	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.640	811,170.360	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	10.450	1,409,809.500	
	XERO LTD	23,149	105.000	2,430,645.000	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	23.210	1,042,662.830	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	4.610	1,342,754.700	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.050	1,179,882.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	443,450	24.610	10,913,304.500	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.500	1,444,628.500	
	SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.130	2,136,969.940	
	COLES GROUP LTD	197,589	15.670	3,096,219.630	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	67.260	1,433,310.600	
	オーストラリア・ドル 小計	10,297,449		241,907,763.980 (23,123,963,159)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	75,291	69.640	5,243,265.240	
	BARRICK GOLD CORP	267,495	22.830	6,106,910.850	
	BANK OF MONTREAL	109,727	118.500	13,002,649.500	
	BANK OF NOVA SCOTIA	183,639	60.900	11,183,615.100	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,706	94.550	4,888,802.300	
	BCE INC	14,197	55.200	783,674.400	
	BROOKFIELD CORP	211,045	48.770	10,292,664.650	
	SAPUTO INC	34,582	26.400	912,964.800	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	8.230	759,719.530	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	112.630	1,296,146.040	
	CGI INC	31,091	141.550	4,400,931.050	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	59.610	1,255,267.380	
	CAE INC	40,808	27.950	1,140,583.600	
	CAMECO CORP	66,084	61.270	4,048,966.680	
	ROGERS COMM-CL B	53,375	61.750	3,295,906.250	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	136,114	58.450	7,955,863.300	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	164,344	84.800	13,936,371.200	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	144.530	1,287,906.830	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	31.580	515,701.400	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,693	160.060	13,395,901.580	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	49.610	1,495,344.620	
	OPEN TEXT CORP	40,459	54.260	2,195,305.340	
	EMPIRE CO LTD	20,608	38.110	785,370.880	
	KINROSS GOLD CORP	192,737	7.800	1,503,348.600	
	RB GLOBAL INC	26,641	85.320	2,273,010.120	
	FORTIS INC	72,078	55.330	3,988,075.740	

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	10.390	887,524.190	
TELUS CORP	31,890	25.060	799,163.400	
GREAT WEST LIFECO INC	43,551	43.910	1,912,324.410	
IMPERIAL OIL LTD	27,434	75.320	2,066,328.880	
ENBRIDGE INC	314,754	47.460	14,938,224.840	
IGM FINANCIAL INC	12,478	34.510	430,615.780	
MANULIFE FINANCIAL CORP	271,363	27.080	7,348,510.040	
LOBLAW CO LTD	24,803	124.050	3,076,812.150	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	116,251	76.560	8,900,176.560	
MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	74.630	3,155,281.770	
SUN LIFE FINANCIAL INC	84,814	69.900	5,928,498.600	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,133	1,237.260	3,876,335.580	
METRO INC	35,059	68.480	2,400,840.320	
EMERA INC	44,643	49.100	2,191,971.300	
ONEX CORP	10,157	91.320	927,537.240	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	20.200	1,118,534.600	
POWER CORP OF CANADA	89,864	38.170	3,430,108.880	
QUEBECOR INC-B	30,598	30.900	945,478.200	
ROYAL BANK OF CANADA	208,784	125.240	26,148,108.160	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	138,820	99.060	13,751,509.200	
STANTEC INC	18,358	105.030	1,928,140.740	
SUNCOR ENERGY INC	198,439	41.770	8,288,797.030	
LUNDIN MINING CORP	77,139	9.890	762,904.710	
TECK RESOURCES LTD-CL B	65,896	52.620	3,467,447.520	
THOMSON REUTERS CORP	24,837	192.200	4,773,671.400	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	113.600	1,487,819.200	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	270,486	81.010	21,912,070.860	
TC ENERGY CORP	157,154	51.650	8,117,004.100	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	102.250	828,429.500	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	161.520	1,589,195.280	
INTACT FINANCIAL CORP	26,758	210.250	5,625,869.500	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	66,562	64.290	4,279,270.980	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,041	3,291.950	10,010,819.950	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,420	147.380	4,335,919.600	
TOURMALINE OIL CORP	49,085	62.220	3,054,068.700	
KEYERA CORP	39,997	33.570	1,342,699.290	
PARKLAND CORP	15,665	44.770	701,322.050	
ALTAGAS LTD	47,249	27.890	1,317,774.610	
PEMBINA PIPELINE CORP	82,164	45.440	3,733,532.160	
DOLLARAMA INC	41,508	99.650	4,136,272.200	
MEG ENERGY CORP	47,181	23.830	1,124,323.230	

	CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	22.120	5,016,086.040	
	ARC RESOURCES LTD	96,301	20.450	1,969,355.450	
	NORTHLAND POWER INC	34,152	22.660	773,884.320	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	22.160	1,135,544.880	
	TMX GROUP LTD	46,884	30.160	1,414,021.440	
	BRP INC	4,307	83.060	357,739.420	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	12.640	1,249,084.800	
	NUTRIEN LTD	77,339	73.960	5,719,992.440	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	156.740	1,816,773.340	
	WSP GLOBAL INC	17,782	189.440	3,368,622.080	
	IA FINANCIAL CORP INC	16,448	92.230	1,516,999.040	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	38.650	1,378,529.550	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	36.760	591,946.280	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	48.810	2,550,273.690	
	AIR CANADA	41,858	18.490	773,954.420	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,113	97.700	4,407,540.100	
	SHOPIFY INC	179,237	98.590	17,670,975.830	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	222.040	1,162,823.480	
	HYDRO ONE LTD	46,225	38.990	1,802,312.750	
カナダ・ドル	小計	6,122,743		369,671,963.040 (39,562,293,485)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.770	647,686.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	4.950	802,890.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	268,710	31.600	8,491,236.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	101,000	6.290	635,290.000	
	SEATRUM LTD	7,235,222	0.109	788,639.190	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	29.600	458,800.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.600	1,343,040.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.980	745,969.140	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.770	1,251,773.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	502,098	12.650	6,351,539.700	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	2.340	3,137,542.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.380	1,556,720.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	27.580	5,283,390.280	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.020	262,472.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.630	938,355.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	3.100	1,256,399.000	
シンガポール・ドル	小計	12,026,309		33,951,741.510 (3,680,029,262)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	78.180	1,855,524.120	

NESTLE SA-REGISTERED	401,274	99.380	39,878,610.120	
CIE FINANC RICHEMONT	77,733	115.750	8,997,594.750	
ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	105,427	253.300	26,704,659.100	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	202.700	1,076,539.700	
SIKA INHABER	23,397	245.700	5,748,642.900	
SGS SA-REG	22,978	73.160	1,681,070.480	
NOVARTIS AG-REG SHS	307,129	84.720	26,019,968.880	
BALOISE HOLDING AG -R	5,830	133.000	775,390.000	
BARRY CALLEBAUT AG	460	1,429.000	657,340.000	
CLARIANT AG-REG	22,909	12.790	293,006.110	
SWISSCOM AG-REG	4,457	508.600	2,266,830.200	
ABB LTD	238,635	35.970	8,583,700.950	
ADECCO GROUP AG-REG	26,454	41.510	1,098,105.540	
GEBERIT AG	5,105	507.200	2,589,256.000	
LONZA GROUP AG-REG	10,855	329.200	3,573,466.000	
LINDT & SPRUENGLI PART	137	10,880.000	1,490,560.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	107,200.000	1,715,200.000	
GIVAUDAN-REG	1,392	3,392.000	4,721,664.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	22,160	450.600	9,985,296.000	
ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	272.000	1,308,320.000	
HOLCIM LTD	77,519	65.420	5,071,292.980	
TEMENOS GROUP	10,930	76.820	839,642.600	
BACHEM HOLDING AG	4,673	64.900	303,277.700	
SONOVA HOLDING AG	8,100	257.000	2,081,700.000	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	262.000	2,067,180.000	
STRAUMANN HOLDING AG	16,475	119.850	1,974,528.750	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	228.500	982,550.000	
THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	43.950	406,933.050	
HELVETIA HOLDING AG	4,906	117.000	574,002.000	
SCHINDLER NAMEN	4,209	193.200	813,178.800	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	571.800	2,574,815.400	
BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	102.500	502,557.500	
EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	654.500	814,852.500	
SWISS PRIME SITE AG	13,356	88.500	1,182,006.000	
AVOLTA AG	12,933	31.270	404,414.910	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,433	1,172.500	4,025,192.500	
JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	45.760	1,469,536.640	
SWISS RE LTD	45,502	98.880	4,499,237.760	
BKW AG	3,194	152.100	485,807.400	
SIG GROUP AG	50,969	19.920	1,015,302.480	
ALCON INC	74,922	63.100	4,727,578.200	
SANDOZ GROUP AG	57,347	27.040	1,550,662.880	
UBS GROUP AG	487,869	25.010	12,201,603.690	
VAT GROUP AG	4,131	395.900	1,635,462.900	
スイス・フラン 小計	2,254,885		203,224,061.490	

				(33,605,130,808)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	396,072	165.150	65,411,290.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	241,869	141.050	34,115,622.450	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	59.300	24,787,400.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	232.000	5,975,160.000	
	LUNDBERGS B	14,872	532.000	7,911,904.000	
	SKF AB-B SHS	46,594	203.000	9,458,582.000	
	SANDVIK AB	169,218	211.100	35,721,919.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	132.450	29,449,992.600	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	173.250	7,612,085.250	
	SWEDBANK AB	132,581	198.550	26,323,957.550	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,795	156.800	14,550,256.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	102.350	22,398,888.100	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	257.800	6,238,244.400	
	VOLVO AB-B SHS	237,569	252.700	60,033,686.300	
	HOLMEN AB-B SHS	17,320	443.800	7,686,616.000	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	85.900	5,811,478.600	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	322.900	4,937,786.800	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	323.400	6,896,505.000	
	SAAB AB-B	11,789	544.000	6,413,216.000	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	94.480	7,188,510.800	
	INVESTOR AB-B SHS	271,548	224.600	60,989,680.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	172.540	18,059,589.260	
	ASSA ABLOY AB-B	153,368	274.800	42,145,526.400	
	TELIA CO AB	344,810	26.100	8,999,541.000	
	BOLIDEN AB	36,260	295.950	10,731,147.000	
	ALFA LAVAL AB	44,407	385.200	17,105,576.400	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	65.100	4,748,524.200	
	INDUTRADE AB	39,178	253.100	9,915,951.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	86.040	4,110,044.760	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	69.100	14,706,691.200	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	239.400	8,709,611.400	
	HEXAGON AB-B SHS	307,116	115.700	35,533,321.200	
	SAGAX AB	28,022	252.500	7,075,555.000	
EPIROC AB-A	103,115	199.000	20,519,885.000		
EPIROC AB-B	61,487	171.200	10,526,574.400		
ESSITY AB-B	86,900	263.300	22,880,770.000		
EQT AB	55,194	239.700	13,230,001.800		
VOLVO CAR AB	63,710	34.130	2,174,422.300		
BEIJER REF AB	50,493	128.700	6,498,449.100		
LIFCO AB	39,631	240.100	9,515,403.100		
EVOLUTION AB	28,266	1,148.600	32,466,327.600		
INVESTMENT AB LATOUR	27,638	249.800	6,903,972.400		
スウェーデン・クローナ 小計	4,709,855		756,469,668.570		

				(10,507,363,696)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	15,167	833.200	12,637,144.400	
	A P MOLLER A/S	663	10,500.000	6,961,500.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	10,430.000	5,663,490.000	
	DANSKE BANK A/S	102,303	179.100	18,322,467.300	
	GENMAB A/S	9,783	2,252.000	22,031,316.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	360.300	10,735,138.500	
	ROCKWOOL AS	873	1,918.000	1,674,414.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	489,820	668.600	327,493,652.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	188.920	29,192,107.320	
	COLOPLAST-B	21,291	767.400	16,338,713.400	
	DSV A/S	28,190	1,080.000	30,445,200.000	
	DEMANT A/S	11,367	293.200	3,332,804.400	
	TRYG A/S	58,222	151.050	8,794,433.100	
	PANDORA A/S	12,473	937.600	11,694,684.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	16,295	550.400	8,968,768.000	
ORSTED A/S	26,911	342.500	9,217,017.500		
デンマーク・クローネ 小計	978,217		523,502,850.720 (10,993,559,865)		
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.250	1,355,813.250	
	EBOS GROUP LTD	25,631	37.530	961,931.430	
	FISHER & PAYKEL	78,460	24.000	1,883,040.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	5.170	1,616,777.910	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.320	397,110.880	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.250	1,256,367.000	
ニュージーランド・ドル 小計	883,297		7,471,040.470 (665,146,733)		
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	183.650	13,428,120.700	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	62.280	13,775,214.960	
	TELENOR ASA	119,576	123.200	14,731,763.200	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	445.600	4,984,036.000	
	ORKLA ASA	116,068	80.900	9,389,901.200	
	EQUINOR ASA	129,895	334.750	43,482,351.250	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	361.800	7,175,941.200	
	AKER BP ASA	40,933	300.000	12,279,900.000	
	SALMAR ASA	12,897	580.400	7,485,418.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	184.700	4,750,668.700	
	ADEVINTA ASA	54,715	112.000	6,128,080.000	
	DNB BANK ASA	143,909	208.800	30,048,199.200	
ノルウェー・クローネ 小計	969,033		167,659,595.210 (2,236,579,000)		
ユーロ	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	27,104	153.700	4,165,884.800	
	KERRY GROUP PLC-A	25,025	74.280	1,858,857.000	

KINGSPAN GROUP PLC	21,860	74.080	1,619,388.800	
UMICORE	33,545	24.100	808,434.500	
AIR LIQUIDE	77,642	175.320	13,612,195.440	
AIRBUS SE	88,164	141.820	12,503,418.480	
AXA SA	271,713	29.995	8,150,031.430	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	98,192	29.550	2,901,573.600	
ADIDAS AG	24,550	193.360	4,746,988.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	19.140	2,767,892.820	
DASSAULT AVIATION SA	3,120	182.400	569,088.000	
DANONE	96,532	59.220	5,716,625.040	
SAFRAN SA	51,062	164.600	8,404,805.200	
INTESA SANPAOLO	2,330,103	2.700	6,291,278.100	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	49,783	100.920	5,024,100.360	
ACCOR SA	31,427	34.810	1,093,973.870	
BOUYGUES	29,123	36.010	1,048,719.230	
BNP PARIBAS	155,810	61.850	9,636,848.500	
THALES SA	15,023	138.950	2,087,445.850	
CAPGEMINI SA	25,063	192.150	4,815,855.450	
LOTUS BAKERIES NV	77	8,060.000	620,620.000	
UNICREDIT SPA	244,666	25.300	6,190,049.800	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	133.200	1,652,079.600	
D' IETEREN TRDG	2,736	161.500	441,864.000	
COMMERZBANK AG	158,792	11.020	1,749,887.840	
EIFFAGE	12,706	96.280	1,223,333.680	
FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	28.530	1,677,963.420	
PUBLICIS GROUPE	33,467	79.260	2,652,594.420	
IBERDROLA SA	899,504	11.795	10,609,649.680	
ENI SPA	353,207	15.010	5,301,637.070	
JERONIMO MARTINS	45,606	23.500	1,071,741.000	
KESKO OYJ-B	35,252	17.935	632,244.620	
KBC GROUPE	35,962	56.960	2,048,395.520	
HANNOVER RUECK SE	8,405	218.600	1,837,333.000	
WARTSILA OYJ	77,148	13.050	1,006,781.400	
L'OREAL	36,699	441.950	16,219,123.050	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	41,589	739.100	30,738,429.900	
GEA GROUP AG	25,513	34.450	878,922.850	
BOLLORE	114,808	5.385	618,241.080	
MEDIOBANCA SPA	86,792	11.130	965,994.960	
MICHELIN(CGDE) -B	98,359	31.920	3,139,619.280	
CONTINENTAL AG	17,635	73.600	1,297,936.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	151,735	45.895	6,963,877.820	
OMV AG	23,354	38.830	906,835.820	
VERBUND AG	10,663	87.250	930,346.750	
PERNOD-RICARD	30,948	159.250	4,928,469.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	47.150	1,099,113.650	

RENAULT SA	27,902	37.980	1,059,717.960	
REPSOL SA	195,049	13.940	2,718,983.060	
REMY COINTREAU	2,866	107.050	306,805.300	
MERCK KGAA	18,505	142.000	2,627,710.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	69,501	61.860	4,299,331.860	
RWE AG	98,751	40.450	3,994,477.950	
SEB SA	2,596	110.700	287,377.200	
SOCIETE GENERALE-A	104,069	24.040	2,501,818.760	
VINCI S.A.	76,313	115.840	8,840,097.920	
SODEXO	12,910	100.050	1,291,645.500	
SOFINA	2,281	208.000	474,448.000	
SOLVAY SA	11,217	112.350	1,260,229.950	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	81,059	174.940	14,180,461.460	
VIVENDI SE	98,944	8.890	879,612.160	
SAP SE	157,400	148.180	23,323,532.000	
TELEFONICA S.A	755,720	4.003	3,025,147.160	
TOTALENERGIES SE	341,670	61.900	21,149,373.000	
E.ON SE	339,366	12.485	4,236,984.510	
VOEST-ALPINE AG	18,032	26.580	479,290.560	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	64.000	1,144,704.000	
SIEMENS AG-REG	113,016	162.420	18,356,058.720	
UPM-KYMMENE OYJ	77,973	33.540	2,615,214.420	
ING GROEP NV-CVA	540,815	13.510	7,306,410.650	
PUMA AG	17,210	56.000	963,760.000	
BAYER AG	147,329	31.895	4,699,058.450	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	12.005	1,152,239.900	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	72.740	1,759,653.340	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	119,618	62.870	7,520,383.660	
BASF SE	135,442	45.190	6,120,623.980	
BEIERSDORF AG	15,743	132.500	2,085,947.500	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	78.200	1,688,025.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	38.150	1,283,060.800	
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	458.700	3,050,813.700	
ORANGE	286,957	11.094	3,183,500.950	
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	41.040	2,629,843.200	
RANDSTAD NV	15,584	56.020	873,015.680	
ALLIANZ SE	61,413	243.800	14,972,489.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	4.514	2,281,560.670	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	27.275	4,000,342.420	
HERMES INTL	4,712	1,982.400	9,341,068.800	
ENDESA S.A.	50,946	19.740	1,005,674.040	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	8.364	605,068.480	
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	36.860	2,085,317.640	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	20,381	391.300	7,975,085.300	

ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	23.735	1,925,596.810	
DASSAULT SYSTEMES SA	101,597	44.220	4,492,619.340	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	37.450	1,304,608.200	
RHEINMETALL STAMM	6,662	284.700	1,896,671.400	
HEINEKEN NV	43,759	87.480	3,828,037.320	
AKZO NOBEL	26,032	72.280	1,881,592.960	
ASML HOLDING NV	60,741	649.600	39,457,353.600	
AEGON LTD	232,433	5.202	1,209,116.460	
VOLKSWAGEN AG	3,315	124.600	413,049.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	30,425	114.860	3,494,615.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	885,310	8.506	7,530,446.860	
KERING	11,443	413.800	4,735,113.400	
ACCIONA S.A.	5,005	135.850	679,929.250	
FORTUM OYJ	54,194	13.540	733,786.760	
AGEAS	24,086	40.520	975,964.720	
UCB SA	16,732	76.600	1,281,671.200	
NEMETSCHEK SE	10,222	78.660	804,062.520	
CARREFOUR SA	90,642	17.190	1,558,135.980	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	28.120	497,077.240	
NOKIA OYJ	827,068	2.985	2,468,797.980	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	121,772	18.808	2,290,287.770	
WOLTERS KLUWER-CVA	38,724	129.800	5,026,375.200	
SANOFI	174,457	86.130	15,025,981.410	
STMICROELECTRONICS NV	104,058	44.385	4,618,614.330	
ELISA OYJ	20,242	41.970	849,556.740	
BANCO SANTANDER SA	2,412,875	3.940	9,506,727.500	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	15.565	1,020,892.780	
QIAGEN N.V.	35,613	38.570	1,373,593.410	
DEUTSCHE BANK AG-REG	282,637	11.824	3,341,899.880	
BMW VORZUG	7,821	91.600	716,403.600	
ENEL SPA	1,202,825	6.566	7,897,748.950	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	482,293	22.615	10,907,056.190	
SARTORIUS AG	3,651	305.800	1,116,475.800	
LEONARDO SPA	64,915	13.850	899,072.750	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	197,936	37.160	7,355,301.760	
RATIONAL AG	542	631.500	342,273.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	86.920	422,952.720	
BECHTLE AG	14,521	43.140	626,435.940	
KONINKLIJKE KPN NV	496,095	3.138	1,556,746.110	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	55.000	1,267,090.000	
TELEPERFORMANCE	7,845	118.050	926,102.250	
DEUTSCHE BOERSE AG	28,751	180.500	5,189,555.500	
EURAZEO	5,673	70.350	399,095.550	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	73.560	950,248.080	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	73.600	1,301,984.000	

INDITEX	162,141	37.880	6,141,901.080	
ESSILORLUXOTTICA	43,937	182.700	8,027,289.900	
SNAM SPA	317,518	4.696	1,491,064.520	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	12.612	2,105,207.650	
ENAGAS	38,270	16.860	645,232.200	
TENARIS SA	76,002	15.745	1,196,651.490	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.265	240,695.790	
TERNA SPA	207,655	7.672	1,593,129.160	
BIOMERIEUX	4,870	97.880	476,675.600	
GRIFOLS SA	31,982	14.185	453,664.670	
NESTE OYJ	66,248	35.220	2,333,254.560	
RECORDATI SPA	18,197	46.700	849,799.900	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	10.060	844,436.400	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	190.000	1,651,480.000	
KONE OYJ	49,300	40.920	2,017,356.000	
ELIA GROUP	4,078	107.200	437,161.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	204.800	789,504.000	
ENGIE	277,054	16.234	4,497,694.630	
ALSTOM	47,494	11.690	555,204.860	
IPSEN SA	5,964	103.100	614,888.400	
ARKEMA SA	10,489	91.640	961,211.960	
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	110.500	330,505.500	
LEGRAND SA	41,105	93.880	3,858,937.400	
AMPLIFON SPA	20,249	28.170	570,414.330	
ADP	3,975	117.000	465,075.000	
ORION OYJ	13,559	36.600	496,259.400	
METSO CORPORATION	102,831	9.016	927,124.290	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	13.435	1,069,224.470	
SYMRISE AG	19,547	105.350	2,059,276.450	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39,869	35.270	1,406,179.630	
PRYSMIAN SPA	38,343	38.520	1,476,972.360	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	90.240	219,192.960	
CAIXABANK	630,095	3.913	2,465,561.730	
BUREAU VERITAS SA	39,729	21.650	860,132.850	
GETLINK	63,968	17.190	1,099,609.920	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	17.425	691,563.400	
AMADEUS IT GROUP SA	68,848	65.560	4,513,674.880	
BRENNTAG SE	21,559	79.180	1,707,041.620	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	17.485	748,987.460	
EDENRED	35,618	53.200	1,894,877.600	
TALANX AG	10,349	67.500	698,557.500	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	72.180	860,024.700	
VONOVIA SE	107,478	26.520	2,850,316.560	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	8.108	1,330,976.840	
KNORR-BREMSE AG	10,342	57.280	592,389.760	
OCI NV	12,329	18.375	226,545.370	

SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	52.740	2,371,295.880		
FERRARI NV	18,850	340.700	6,422,195.000		
ASR NEDERLAND NV	27,365	44.120	1,207,343.800		
AIB GROUP PLC	226,914	3.930	891,772.020		
NORDEA BANK ABP	492,403	10.782	5,309,089.140		
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	34.100	589,691.300		
MONCLER SPA	29,763	53.660	1,597,082.580		
NEXI SPA	83,576	7.424	620,468.220		
PROSUS NV	220,842	30.080	6,642,927.360		
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	83.560	1,535,080.760		
JDE PEET'S BV	14,385	24.700	355,309.500		
EXOR NV	14,142	92.420	1,307,003.640		
SIEMENS ENERGY AG	74,892	11.365	851,147.580		
EURONEXT NV	14,077	77.700	1,093,782.900		
IMCD NV	9,332	147.900	1,380,202.800		
WORLDDLINE SA	36,232	15.550	563,407.600		
NN GROUP NV	36,289	35.550	1,290,073.950		
FINECOBANK SPA	96,393	12.930	1,246,361.490		
ARGENX SE	9,078	424.000	3,849,072.000		
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	125,611	25.000	3,140,275.000		
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,616	32.250	2,438,616.000		
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	28.220	277,176.840		
DSM-FIRMENICH AG	28,846	87.030	2,510,467.380		
ZALANDO SE	31,321	22.280	697,831.880		
STELLANTIS NV	327,741	21.025	6,890,754.520		
FERROVIAL SE	73,817	32.480	2,397,576.160		
AENA SME SA	11,603	163.500	1,897,090.500		
CELLNEX TELECOM SAU	81,974	35.770	2,932,209.980		
BANCO BPM SPA	202,727	4.989	1,011,405.000		
ABN AMRO BANK NV	75,982	13.130	997,643.660		
SCOUT24 SE	10,048	65.140	654,526.720		
COVESTRO AG	27,558	51.140	1,409,316.120		
HELLOFRESH SE	17,856	16.015	285,963.840		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	129,506	58.710	7,603,297.260		
POSTE ITALIANE SPA	61,361	10.035	615,757.630		
AMUNDI SA	11,288	57.800	652,446.400		
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	11.545	483,493.050		
ADYEN NV	3,176	1,186.800	3,769,276.800		
DELIVERY HERO SE	22,564	31.510	710,991.640		
ユーロ 小計	26,708,321		728,801,522.860 (114,115,742,449)		
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	10.420	2,677,940.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	61.200	14,797,915.200	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	39.800	3,713,897.200	

HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	183,491	248.400	45,579,164.400	
MTR CORP	207,441	27.900	5,787,603.900	
HANG SENG BANK LTD	122,096	85.850	10,481,941.600	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	21.250	6,331,905.000	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	41.600	8,853,312.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	23.250	4,696,500.000	
HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	5.350	8,219,772.100	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	41.900	14,116,277.600	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	20.450	13,916,122.750	
NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	11.020	1,907,187.320	
SINO LAND CO	659,200	8.000	5,273,600.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	77.200	15,792,418.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	57.750	3,061,905.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	77.550	16,685,347.800	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	8.490	1,511,220.000	
AIA GROUP LTD	1,729,116	63.850	110,404,056.600	
HKT TRUST / HKT LTD	797,136	8.770	6,990,882.720	
SANDS CHINA LTD	335,800	21.050	7,068,590.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	11.420	1,598,800.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	15.360	3,096,576.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	25.250	6,467,408.750	
ESR GROUP LTD	465,200	9.950	4,628,740.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	12.940	3,429,100.000	
WH GROUP LTD	1,001,000	4.820	4,824,820.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	40.200	14,851,689.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	37.450	9,969,002.750	
香港・ドル 小計	11,681,369		356,733,695.690 (6,642,381,414)	
合計	169,117,485		1,165,088,295.630 (1,165,088,295,630)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル 小計		2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券	合計		2,968	0 (0)	

投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,195,479.810		
		GOODMAN GROUP	255,895.000	5,936,764.000		
		GPT GROUP	349,447.000	1,513,105.510		
		MIRVAC GROUP	474,881.000	1,001,998.910		
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,303,016.660		
		STOCKLAND	369,843.000	1,549,642.170		
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,047,638.400		
	オーストラリア・ドル 小計		2,985,154.000	14,547,645.460	(1,390,609,430)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,495,738.900		
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,741,572.300		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	772,783.000		
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	575,810.000		
	シンガポール・ドル 小計		2,277,909.000	4,585,904.200	(497,066,156)	
	投資信託受益証券 合計		5,263,063	1,887,675,586	(1,887,675,586)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,234.000	2,894,508.960		
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,788,904.600		
		AMERICAN TOWER CORP	69,325.000	14,312,146.250		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,468,700.030		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,518.000	3,781,788.500		
		BOSTON PROPERTIES INC	24,473.000	1,568,229.840		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,578,096.150		
		CROWN CASTLE INC	65,066.000	7,552,210.620		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	45,607.000	6,148,279.670		
		EQUINIX INC	13,861.000	11,113,333.970		
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,932,404.900		
		EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	3,182,397.280		
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,236,906.230		
		EXTRA SPACE STORAGE INC	34,180.000	4,740,082.400		
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,603,445.760		
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,133.000	1,689,993.750		
		HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	1,986,365.850		
		INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,862,445.480		
		IRON MOUNTAIN INC	43,616.000	2,854,667.200		
		KIMCO REALTY	95,524.000	1,933,405.760		
MID AMERICA	17,537.000	2,229,478.810				
PROLOGIS INC	139,674.000	16,739,928.900				

	PUBLIC STORAGE	23,534.000	6,443,844.540	
	REALTY INCOME CORP	109,733.000	5,910,219.380	
	REGENCY CENTERS CORP	21,907.000	1,401,171.720	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	16,539.000	4,038,493.020	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	48,901.000	6,497,964.880	
	SUN COMMUNITIES INC	18,509.000	2,362,488.760	
	UDR INC	50,449.000	1,784,381.130	
	VENTAS INC	60,757.000	2,838,567.040	
	VICI PROPERTIES INC	152,711.000	4,659,212.610	
	WELLTOWER INC	77,707.000	6,816,458.040	
	WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,158,464.050	
	WP CAREY INC	32,996.000	2,064,229.760	
アメリカ・ドル 小計		1,871,895.000	144,173,215.840 (20,962,785,584)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	781,219.110	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,373,143.750	
イギリス・ポンド 小計		286,426.000	2,154,362.860 (393,149,678)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	440,635.440	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	258,478.080	
カナダ・ドル 小計		23,146.000	699,113.520 (74,819,129)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	236,176.920	
	GECINA SA	8,697.000	931,448.700	
	KLEPIERRE	36,407.000	858,477.060	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,477.000	1,168,115.940	
	WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	548,374.120	
ユーロ 小計		88,793.000	3,742,592.740 (586,015,171)	
香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	15,543,396.400	
香港・ドル 小計		410,116.000	15,543,396.400 (289,418,041)	
投資証券 合計		2,680,376	22,306,187,603 (22,306,187,603)	
合計			24,193,863,189 (24,193,863,189)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証 券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証 券 時価比 率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式	589銘柄 72.07	-	-	-	74.83
	投資証券	34銘柄 -	-	-	1.74	
イギリス・ポンド	株式	80銘柄 4.12	-	-	-	4.21
	投資証券	2銘柄 -	-	-	0.03	
イスラエル・シケル	株式	8銘柄 0.10	-	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式	51銘柄 1.92	-	-	-	2.06
	投資信託受益証 券	7銘柄 -	-	0.12	-	
カナダ・ドル	株式	86銘柄 3.28	-	-	-	3.33
	新株予約権証券	1銘柄 -	0.00	-	-	
	投資証券	2銘柄 -	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式	16銘柄 0.31	-	-	-	0.35
	投資信託受益証 券	4銘柄 -	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式	45銘柄 2.79	-	-	-	2.83
スウェーデン・クロー ナ	株式	42銘柄 0.87	-	-	-	0.88
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄 0.91	-	-	-	0.92
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 9.46	-	-	-	9.64
	投資証券	5銘柄 -	-	-	0.05	
香港・ドル	株式	29銘柄 0.55	-	-	-	0.58
	投資証券	1銘柄 -	-	-	0.02	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	579,023,904
コール・ローン	607,761,621
国債証券	247,790,573,642
派生商品評価勘定	5,299,404,550
未収入金	34,255
未収利息	1,057,988,101
前払費用	722,905,757
流動資産合計	256,057,691,830
資産合計	
256,057,691,830	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,412
未払金	450,494,888
未払解約金	54,631,000
流動負債合計	505,162,300
負債合計	
505,162,300	
純資産の部	
元本等	
元本	218,509,951,433
剰余金	
剰余金又は欠損金()	37,042,578,097
元本等合計	255,552,529,530
純資産合計	
255,552,529,530	
負債純資産合計	
256,057,691,830	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	179,063,387,400円
同期中追加設定元本額	443,695,940,888円
同期中一部解約元本額	404,249,376,855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>	12,326,694,193円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,494,290,105円
たわらノーロード バランス(標準型)	4,285,990,623円
たわらノーロード バランス(積極型)	2,144,546,100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)	39,796,612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)	1,421,491,003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)	1,342,972,405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)	77,475,614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)	5,023,841円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	14,832,751円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	156,623,679円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,379,970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	91,895,791,908円
投資のソムリエ<DC年金>	8,568,803,995円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	8,470,820,134円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	28,927,516,459円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,843,203,229円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,803,024,693円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	443,048,838円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	222,391,383円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	71,789,922円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,557,019,713円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,935,108,760円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,444,850,084円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	560,079,661円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	241,871,042円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	147,488,767円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	33,930,891円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	22,241,915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)	21,356,875,241円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	6,601,371,188円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,794,621,890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)	40,833,839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)	421,742,614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)	34,994,814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)	286,896,031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)	629,169,762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)	841,082,567円
計	218,509,951,433円
2. 受益権の総数	218,509,951,433口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年12月11日現在
----	---------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	2,155,511,752	
合計	2,155,511,752	

(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6月23日から2023年12月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年12月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	252,016,116,907	-	-	246,716,776,630	5,299,340,277
アメリカ・ドル	119,279,781,415	-	-	117,452,004,704	1,827,776,711
イギリス・ポンド	13,021,452,458	-	-	12,710,680,995	310,771,463
イスラエル・シケル	773,052,753	-	-	764,561,120	8,491,633
オーストラリア・ドル	3,521,428,200	-	-	3,436,814,301	84,613,899
オフショア・人民元	19,473,465,131	-	-	19,016,171,856	457,293,275
カナダ・ドル	4,996,147,504	-	-	4,908,225,147	87,922,357
シンガポール・ドル	1,088,004,132	-	-	1,065,098,937	22,905,195
スウェーデン・クローナ	531,466,102	-	-	523,591,353	7,874,749
デンマーク・クローネ	693,082,414	-	-	673,274,454	19,807,960
ニュージーランド・ドル	607,989,154	-	-	593,477,424	14,511,730
ノルウェー・クローネ	449,717,136	-	-	437,984,353	11,732,783
ポーランド・ズロチ	1,324,340,770	-	-	1,291,467,344	32,873,426
マレーシア・リンギット	1,211,967,792	-	-	1,194,187,776	17,780,016
メキシコ・ペソ	2,339,499,579	-	-	2,304,286,928	35,212,651

ユーロ	82,704,722,367	-	80,344,949,938	2,359,772,429
買建	520,447,370	-	520,475,231	27,861
アメリカ・ドル	260,612,550	-	260,616,673	4,123
ユーロ	259,834,820	-	259,858,558	23,738
合計	252,536,564,277	-	247,237,251,861	5,299,368,138

(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12月11日現在
1口当たり純資産額	1.1695円
(1万口当たり純資産額)	(11,695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12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/31/25	3,500,000.000	3,269,833.980	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,000,000.000	2,793,632.820	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,000,000.000	2,784,492.180	
		US T N/B 0.25 08/31/25	2,000,000.000	1,850,351.560	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,300,000.000	3,044,314.440	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,500,000.000	4,138,154.280	
		US T N/B 0.375 01/31/26	7,000,000.000	6,397,480.460	
		US T N/B 0.375 04/30/25	3,970,000.000	3,727,923.050	
		US T N/B 0.375 07/31/27	5,100,000.000	4,422,357.440	
		US T N/B 0.375 09/30/27	4,200,000.000	3,621,023.440	
		US T N/B 0.375 11/30/25	4,500,000.000	4,136,308.600	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,400,000.000	4,035,023.430	
		US T N/B 0.5 02/28/26	3,900,000.000	3,564,158.200	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,500,000.000	2,359,277.350	

US T N/B 0.5 04/30/27	2,200,000.000	1,933,464.850	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,600,000.000	1,402,281.240	
US T N/B 0.5 06/30/27	3,500,000.000	3,058,261.710	
US T N/B 0.5 08/31/27	3,900,000.000	3,388,962.870	
US T N/B 0.5 10/31/27	4,600,000.000	3,973,429.670	
US T N/B 0.625 03/31/27	1,200,000.000	1,062,257.800	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,990,000.000	4,773,866.230	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,800,000.000	3,438,109.350	
US T N/B 0.625 08/15/30	8,090,000.000	6,391,731.980	
US T N/B 0.625 11/30/27	4,000,000.000	3,464,062.480	
US T N/B 0.625 12/31/27	4,660,000.000	4,024,164.850	
US T N/B 0.75 01/31/28	5,070,000.000	4,389,609.950	
US T N/B 0.75 03/31/26	3,140,000.000	2,881,931.250	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,062,000.000	5,544,125.210	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,800,000.000	3,466,460.920	
US T N/B 0.75 08/31/26	6,200,000.000	5,614,148.410	
US T N/B 0.875 06/30/26	5,216,000.000	4,767,953.730	
US T N/B 0.875 09/30/26	3,680,000.000	3,338,881.250	
US T N/B 0.875 11/15/30	9,990,000.000	7,996,292.600	
US T N/B 1.0 07/31/28	5,070,000.000	4,373,172.050	
US T N/B 1.125 02/15/31	6,300,000.000	5,119,365.250	
US T N/B 1.125 02/28/25	4,820,000.000	4,598,957.780	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,000,000.000	903,085.940	
US T N/B 1.125 02/29/28	5,420,000.000	4,758,061.300	
US T N/B 1.125 05/15/40	5,000,000.000	3,057,421.900	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,760,000.000	2,885,750.000	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,770,000.000	3,263,627.120	
US T N/B 1.125 10/31/26	5,300,000.000	4,827,554.700	
US T N/B 1.25 03/31/28	4,800,000.000	4,226,812.510	
US T N/B 1.25 04/30/28	4,200,000.000	3,690,585.930	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,600,000.000	2,353,187.500	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,640,000.000	4,067,884.370	
US T N/B 1.25 06/30/28	4,870,000.000	4,260,774.390	
US T N/B 1.25 08/15/31	10,200,000.000	8,220,164.080	
US T N/B 1.25 09/30/28	5,200,000.000	4,518,921.880	
US T N/B 1.25 11/30/26	6,000,000.000	5,472,304.680	
US T N/B 1.25 12/31/26	6,000,000.000	5,466,562.500	
US T N/B 1.375 08/15/50	3,500,000.000	1,851,035.160	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,250,000.000	1,151,513.670	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,600,000.000	4,014,218.750	
US T N/B 1.375 11/15/31	9,800,000.000	7,923,070.280	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,330,000.000	2,730,690.810	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,900,000.000	4,256,779.300	
US T N/B 1.5 01/31/27	6,090,000.000	5,575,442.540	
US T N/B 1.5 02/15/30	5,100,000.000	4,339,980.450	
US T N/B 1.5 08/15/26	5,900,000.000	5,457,500.000	
US T N/B 1.5 11/30/28	2,840,000.000	2,488,494.530	
US T N/B 1.625 02/15/26	3,300,000.000	3,095,748.050	
US T N/B 1.625 05/15/26	4,922,000.000	4,593,994.860	

US T N/B 1.625 05/15/31	10,300,000.000	8,607,138.650	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,800,000.000	3,307,484.350	
US T N/B 1.625 09/30/26	800,000.000	741,062.490	
US T N/B 1.625 10/31/26	3,000,000.000	2,771,250.000	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,200,000.000	2,943,789.050	
US T N/B 1.625 11/30/26	2,100,000.000	1,937,126.960	
US T N/B 1.75 01/31/29	3,600,000.000	3,183,468.760	
US T N/B 1.75 08/15/41	4,400,000.000	2,916,031.270	
US T N/B 1.75 11/15/29	3,500,000.000	3,054,091.810	
US T N/B 1.75 12/31/26	3,500,000.000	3,237,636.710	
US T N/B 1.875 02/15/32	8,500,000.000	7,117,421.870	
US T N/B 1.875 02/15/41	3,800,000.000	2,603,593.740	
US T N/B 1.875 02/15/51	4,950,000.000	2,987,499.040	
US T N/B 1.875 02/28/27	4,800,000.000	4,438,218.760	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,600,000.000	4,086,542.980	
US T N/B 1.875 06/30/26	1,000,000.000	937,402.340	
US T N/B 1.875 07/31/26	1,000,000.000	935,195.310	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,700,000.000	3,430,242.210	
US T N/B 2.0 02/15/50	2,300,000.000	1,441,902.330	
US T N/B 2.0 08/15/25	3,800,000.000	3,627,664.070	
US T N/B 2.0 08/15/51	3,900,000.000	2,425,083.990	
US T N/B 2.0 11/15/26	5,700,000.000	5,321,484.370	
US T N/B 2.0 11/15/41	5,500,000.000	3,794,785.170	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,600,000.000	3,460,429.690	
US T N/B 2.125 05/31/26	4,700,000.000	4,437,644.540	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,200,000.000	2,997,812.510	
US T N/B 2.25 02/15/52	5,020,000.000	3,317,906.250	
US T N/B 2.25 03/31/26	6,000,000.000	5,697,890.640	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,900,000.000	3,562,835.960	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,100,000.000	3,807,875.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	3,100,000.000	2,102,490.240	
US T N/B 2.25 08/15/49	6,440,000.000	4,288,385.950	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,500,000.000	5,250,459.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	2,840,000.000	2,627,277.350	
US T N/B 2.375 02/15/42	4,100,000.000	3,006,132.790	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,300,000.000	3,913,251.930	
US T N/B 2.375 04/30/26	3,002,000.000	2,855,417.980	
US T N/B 2.375 05/15/27	5,100,000.000	4,775,970.680	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,520,000.000	3,198,868.740	
US T N/B 2.375 05/15/51	6,800,000.000	4,627,851.580	
US T N/B 2.375 11/15/49	4,600,000.000	3,149,562.500	
US T N/B 2.5 02/15/45	3,110,000.000	2,252,381.040	
US T N/B 2.5 02/15/46	2,000,000.000	1,433,125.000	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,420,000.000	2,312,801.550	
US T N/B 2.5 03/31/27	5,500,000.000	5,186,005.880	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,300,000.000	929,474.610	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,280,000.000	2,187,107.800	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,000,000.000	4,614,746.090	
US T N/B 2.625 03/31/25	200,000.000	194,015.620	

US T N/B 2.625 04/15/25	3,900,000.000	3,781,171.870	
US T N/B 2.625 05/31/27	5,100,000.000	4,814,021.470	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,900,000.000	3,578,402.330	
US T N/B 2.625 12/31/25	1,400,000.000	1,344,191.400	
US T N/B 2.75 02/15/28	3,900,000.000	3,666,837.860	
US T N/B 2.75 02/28/25	3,010,000.000	2,928,577.150	
US T N/B 2.75 04/30/27	4,740,000.000	4,498,278.520	
US T N/B 2.75 05/15/25	5,500,000.000	5,334,355.450	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,900,000.000	3,610,089.820	
US T N/B 2.75 06/30/25	4,000,000.000	3,874,609.360	
US T N/B 2.75 07/31/27	3,150,000.000	2,979,580.080	
US T N/B 2.75 08/15/32	5,580,000.000	4,974,700.780	
US T N/B 2.75 08/15/42	480,000.000	373,275.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	3,000,000.000	2,232,304.680	
US T N/B 2.75 08/31/25	3,000,000.000	2,898,632.820	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,130,000.000	875,087.880	
US T N/B 2.75 11/15/47	1,900,000.000	1,413,087.880	
US T N/B 2.875 04/30/25	3,920,000.000	3,810,285.930	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,200,000.000	2,984,249.970	
US T N/B 2.875 05/15/28	2,340,000.000	2,205,221.470	
US T N/B 2.875 05/15/32	8,900,000.000	8,037,117.220	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,790,000.000	1,408,890.810	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,300,000.000	2,507,419.920	
US T N/B 2.875 05/15/52	3,900,000.000	2,966,208.990	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,300,000.000	2,234,279.290	
US T N/B 2.875 06/15/25	2,000,000.000	1,941,093.760	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,270,000.000	3,169,409.170	
US T N/B 2.875 08/15/28	4,400,000.000	4,136,257.790	
US T N/B 2.875 08/15/45	2,000,000.000	1,543,476.560	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,000,000.000	765,546.880	
US T N/B 2.875 11/30/25	2,640,000.000	2,550,126.550	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,590,000.000	2,024,853.910	
US T N/B 3.0 02/15/48	3,100,000.000	2,415,275.360	
US T N/B 3.0 02/15/49	6,500,000.000	5,056,289.020	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,000,000.000	811,074.220	
US T N/B 3.0 05/15/45	2,600,000.000	2,054,863.270	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,300,000.000	1,015,066.400	
US T N/B 3.0 07/15/25	3,000,000.000	2,914,804.680	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,410,000.000	2,653,406.250	
US T N/B 3.0 08/15/52	4,140,000.000	3,232,030.060	
US T N/B 3.0 09/30/25	2,000,000.000	1,939,062.500	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,000,000.000	1,937,695.320	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,500,000.000	1,189,599.610	
US T N/B 3.0 11/15/45	870,000.000	685,243.940	
US T N/B 3.125 02/15/42	500,000.000	414,892.580	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,260,000.000	1,033,396.870	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,520,000.000	2,008,075.770	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,000,000.000	2,917,851.570	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,500,000.000	2,028,417.970	

US T N/B 3.125 08/31/27	4,100,000.000	3,926,951.170	
US T N/B 3.125 08/31/29	2,500,000.000	2,353,613.270	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,900,000.000	4,647,630.840	
US T N/B 3.125 11/15/41	580,000.000	482,714.050	
US T N/B 3.25 05/15/42	2,650,000.000	2,227,449.230	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,890,000.000	3,748,683.600	
US T N/B 3.25 06/30/29	2,500,000.000	2,372,656.250	
US T N/B 3.375 05/15/33	6,000,000.000	5,600,625.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,400,000.000	1,184,558.590	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,300,000.000	1,964,433.580	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,450,000.000	2,042,878.890	
US T N/B 3.5 01/31/28	2,900,000.000	2,810,281.250	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,300,000.000	2,203,013.660	
US T N/B 3.5 02/15/33	5,500,000.000	5,189,121.070	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,640,000.000	1,485,801.550	
US T N/B 3.5 04/30/28	3,300,000.000	3,195,585.940	
US T N/B 3.5 04/30/30	2,500,000.000	2,391,796.870	
US T N/B 3.5 09/15/25	2,500,000.000	2,445,166.020	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,700,000.000	1,496,166.020	
US T N/B 3.625 02/15/53	4,700,000.000	4,148,209.000	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,407,031.250	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,500,000.000	2,409,570.300	
US T N/B 3.625 05/15/26	4,800,000.000	4,699,500.000	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,950,000.000	3,490,195.310	
US T N/B 3.625 05/31/28	3,150,000.000	3,066,266.590	
US T N/B 3.625 08/15/43	800,000.000	706,109.370	
US T N/B 3.75 04/15/26	2,600,000.000	2,552,875.000	
US T N/B 3.75 05/31/30	3,000,000.000	2,910,703.140	
US T N/B 3.75 06/30/30	3,500,000.000	3,394,726.580	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	912,363.280	
US T N/B 3.75 11/15/43	2,500,000.000	2,244,921.870	
US T N/B 3.875 01/15/26	2,600,000.000	2,559,222.660	
US T N/B 3.875 02/15/43	3,500,000.000	3,204,892.550	
US T N/B 3.875 03/31/25	2,000,000.000	1,971,640.620	
US T N/B 3.875 04/30/25	3,900,000.000	3,843,023.410	
US T N/B 3.875 05/15/43	3,200,000.000	2,929,750.010	
US T N/B 3.875 08/15/33	9,800,000.000	9,518,250.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	700,000.000	652,777.340	
US T N/B 3.875 09/30/29	4,200,000.000	4,110,585.940	
US T N/B 3.875 11/30/27	4,600,000.000	4,523,093.750	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,500,000.000	2,446,093.750	
US T N/B 3.875 12/31/27	2,600,000.000	2,556,632.800	
US T N/B 3.875 12/31/29	3,500,000.000	3,423,710.920	
US T N/B 4.0 02/15/26	6,500,000.000	6,414,941.390	
US T N/B 4.0 02/28/30	3,500,000.000	3,446,132.830	
US T N/B 4.0 02/29/28	3,700,000.000	3,655,339.850	
US T N/B 4.0 06/30/28	2,600,000.000	2,569,886.720	
US T N/B 4.0 07/31/30	1,500,000.000	1,476,093.750	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,200,000.000	2,166,914.060	

US T N/B 4.0 11/15/42	4,000,000.000	3,732,812.480	
US T N/B 4.0 11/15/52	3,770,000.000	3,560,367.370	
US T N/B 4.0 12/15/25	3,900,000.000	3,847,746.080	
US T N/B 4.125 06/15/26	5,000,000.000	4,952,734.400	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,484,179.700	
US T N/B 4.125 08/15/53	5,000,000.000	4,835,546.900	
US T N/B 4.125 08/31/30	3,000,000.000	2,972,519.520	
US T N/B 4.125 09/30/27	3,000,000.000	2,976,855.480	
US T N/B 4.125 10/31/27	4,000,000.000	3,968,046.880	
US T N/B 4.125 11/15/32	8,300,000.000	8,219,593.750	
US T N/B 4.25 05/15/39	850,000.000	838,511.710	
US T N/B 4.25 05/31/25	3,500,000.000	3,466,162.100	
US T N/B 4.25 10/15/25	4,070,000.000	4,033,354.080	
US T N/B 4.25 11/15/40	800,000.000	780,437.500	
US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	606,398.430	
US T N/B 4.375 05/15/40	800,000.000	794,687.500	
US T N/B 4.375 05/15/41	870,000.000	860,705.270	
US T N/B 4.375 08/15/26	6,200,000.000	6,180,625.000	
US T N/B 4.375 08/15/43	3,700,000.000	3,630,335.950	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,700,000.000	2,692,511.710	
US T N/B 4.5 02/15/36	750,000.000	773,818.350	
US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	612,679.680	
US T N/B 4.5 07/15/26	3,900,000.000	3,898,933.580	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,030,000.000	1,043,619.330	
US T N/B 4.5 11/15/25	4,200,000.000	4,182,281.250	
US T N/B 4.5 11/15/33	2,000,000.000	2,043,281.240	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,000,000.000	1,025,566.410	
US T N/B 4.625 02/28/25	6,300,000.000	6,268,746.070	
US T N/B 4.625 03/15/26	4,732,000.000	4,734,125.700	
US T N/B 4.625 06/30/25	3,000,000.000	2,988,164.070	
US T N/B 4.625 09/15/26	4,000,000.000	4,015,781.240	
US T N/B 4.625 10/15/26	5,000,000.000	5,020,703.100	
US T N/B 4.625 11/15/26	500,000.000	502,226.560	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,020,000.000	1,056,616.400	
US T N/B 4.75 07/31/25	2,900,000.000	2,894,789.040	
US T N/B 5.0 05/15/37	400,000.000	431,640.620	
US T N/B 5.0 09/30/25	2,500,000.000	2,508,496.100	
US T N/B 5.0 10/31/25	8,000,000.000	8,034,062.480	
US T N/B 5.25 11/15/28	800,000.000	833,500.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	500,000.000	536,367.190	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	1,861,047.630	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,000,000.000	1,063,632.810	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,000,000.000	1,109,804.690	
アメリカ・ドル 小計	912,984,000.000 (132,747,873,600)	810,454,111.210 (117,840,027,768)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,010,000.000	925,503.400
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,280,000.000	1,094,080.840

UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,000,000.000	1,518,700.000	
UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,750,000.000	2,469,500.000	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,800,000.000	1,421,892.000	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,550,000.000	1,302,620.000	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,480,000.000	449,180.000	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,400,000.000	1,322,739.040	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,250,000.000	844,250.000	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,000,000.000	406,400.000	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,810,000.000	902,104.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,200,000.000	1,648,759.200	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,650,000.000	1,391,438.400	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,900,000.000	2,307,388.480	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	2,100,000.000	1,351,660.800	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	570,000.000	213,579.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,210,000.000	1,098,256.500	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,680,000.000	829,920.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,630,000.000	998,171.250	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,790,000.000	1,671,564.650	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,700,000.000	965,934.900	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	890,000.000	460,236.800	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,520,000.000	1,367,240.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,000,000.000	529,500.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	750,000.000	355,197.600	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	760,000.000	449,802.200	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,300,000.000	700,440.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,900,000.000	1,401,193.760	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,270,000.000	2,177,497.500	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	900,000.000	582,210.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,300,000.000	1,088,100.000	

	UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,760,000.000	2,600,723.160	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,220,000.000	1,054,898.620	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,770,000.000	1,478,382.940	
	UK TREASURY 3.5 10/22/25	3,750,000.000	3,680,812.500	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,250,000.000	1,171,754.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	670,000.000	591,600.210	
	UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,900,000.000	1,668,424.200	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,040,000.000	963,551.680	
	UK TREASURY 4.0 10/22/63	1,250,000.000	1,155,000.000	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,600,000.000	2,592,720.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,650,000.000	1,660,213.500	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,550,000.000	1,584,797.500	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,270,000.000	1,251,712.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,050,000.000	1,058,876.700	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,000,000.000	981,083.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,690,000.000	1,628,298.100	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,750,000.000	1,681,449.350	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,130,000.000	1,088,077.000	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	700,000.000	712,325.600	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,000,000.000	1,033,300.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,820,000.000	1,829,837.820	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	700,000.000	730,366.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,300,000.000	1,366,359.280	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,310,000.000	1,368,234.470	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	800,000.000	872,682.400	
	イギリス・ボンド 小計	84,280,000.000 (15,380,257,200)	70,050,540.550 (12,783,523,145)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	2,100,000.000	1,954,528.800	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,830,000.000	1,749,469.020	
	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	500,000.000	497,449.000	

	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,810,000.000	1,516,284.060	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,380,000.000	1,114,917.180	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,785,000.000	1,280,873.160	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	1,730,000.000	1,671,546.760	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	850,000.000	610,614.500	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,700,000.000	1,606,777.100	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,040,000.000	968,300.320	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	2,100,000.000	1,875,696.900	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,675,000.000	1,910,545.200	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,030,000.000	2,166,777.340	
	イスラエル・シュケル 小計	20,530,000.000 (806,055,019)	18,923,779.340 (742,991,102)	
オーストラリア ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,600,000.000	1,489,035.160	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	2,320,000.000	2,114,462.560	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,770,000.000	2,176,789.110	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,210,000.000	981,438.710	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,350,000.000	1,856,773.490	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,370,000.000	1,966,079.570	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,350,000.000	747,409.970	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,800,000.000	1,466,151.230	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,600,000.000	1,491,407.300	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,140,000.000	1,951,533.910	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,550,000.000	1,212,852.750	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	800,000.000	685,531.380	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,120,000.000	1,072,962.350	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,000,000.000	946,429.430	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,010,000.000	942,175.110	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,110,000.000	850,881.790	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,650,000.000	1,478,749.510	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,940,000.000	1,917,374.300	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,800,000.000	1,736,785.710	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	630,000.000	542,089.450	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,380,000.000	1,281,426.500	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	630,000.000	588,246.270	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,600,000.000	1,526,169.420	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,030,000.000	1,037,449.060	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,210,000.000	1,230,637.270		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,770,000.000	1,816,730.120		
AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	900,000.000	919,031.850		

オーストラリア・ドル 小計		40,640,000.000 (3,884,777,600)	36,026,603.280 (3,443,783,008)	
オフショア・人 民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 04/09/25	38,500,000.000	38,248,300.860	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	7,500,000.000	7,435,517.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	4,500,000.000	4,481,729.010	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	12,500,000.000	12,453,318.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	9,000,000.000	8,960,541.660	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	47,000,000.000	46,630,407.040	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.46 02/15/26	49,000,000.000	48,965,577.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	4,400,000.000	4,392,950.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 09/25/28	8,000,000.000	7,964,052.880	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	10,500,000.000	10,479,912.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	11,000,000.000	10,924,215.170	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	34,000,000.000	33,904,237.980	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	33,000,000.000	33,086,813.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	10,000,000.000	9,982,207.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	12,000,000.000	11,995,439.760	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.64 01/15/28	19,000,000.000	19,053,973.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	42,500,000.000	42,550,970.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	21,000,000.000	21,103,517.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	11,500,000.000	11,502,174.650	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	22,000,000.000	22,110,092.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	6,100,000.000	6,139,725.030	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	55,000,000.000	55,319,000.000		
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	39,000,000.000	39,343,898.100		
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	17,000,000.000	17,156,831.800		

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	20,500,000.000	20,702,234.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	36,000,000.000	36,420,228.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	7,000,000.000	7,116,757.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	7,500,000.000	7,611,367.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	35,000,000.000	35,719,621.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	9,500,000.000	9,772,305.150	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 10/22/25	55,500,000.000	56,149,477.650	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	94,200,000.000	95,565,315.960	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	6,700,000.000	6,842,143.850	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	16,500,000.000	17,037,228.450	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	7,600,000.000	8,038,200.040	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	28,600,000.000	30,438,551.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,000,000.000	2,258,516.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	43,500,000.000	49,757,522.850	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	3,400,000.000	3,903,845.320	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	10,000,000.000	11,853,486.000	
	オフショア・人民元 小計	907,500,000.000 (18,354,550,500)	923,372,204.710 (18,675,572,189)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	2,000,000.000	1,844,288.600	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,250,000.000	1,174,535.120	
	CANADA 0.5 12/01/30	3,000,000.000	2,462,876.400	
	CANADA 1.0 06/01/27	710,000.000	651,117.250	
	CANADA 1.0 09/01/26	560,000.000	519,838.230	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	673,724.270	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,050,000.000	973,106.090	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,590,000.000	1,392,082.470	
	CANADA 1.5 04/01/25	830,000.000	799,272.610	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	755,945.760	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,650,000.000	2,320,675.270	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,850,000.000	2,475,189.990	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,090,000.000	1,516,806.280	
	CANADA 2.0 06/01/28	500,000.000	470,372.640	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,300,000.000	1,167,409.570	

CANADA 2.0 12/01/51	2,580,000.000	2,011,213.910	
CANADA 2.25 06/01/25	560,000.000	543,882.750	
CANADA 2.25 06/01/29	460,000.000	434,256.120	
CANADA 2.25 12/01/29	500,000.000	470,121.120	
CANADA 2.5 12/01/32	1,620,000.000	1,508,730.700	
CANADA 2.75 06/01/33	1,060,000.000	1,006,607.150	
CANADA 2.75 09/01/27	1,700,000.000	1,649,357.620	
CANADA 2.75 12/01/48	1,000,000.000	922,883.820	
CANADA 2.75 12/01/55	1,000,000.000	911,030.900	
CANADA 2.75 12/01/64	580,000.000	526,862.630	
CANADA 3.0 04/01/26	750,000.000	734,124.540	
CANADA 3.0 10/01/25	600,000.000	587,737.080	
CANADA 3.25 09/01/28	1,800,000.000	1,781,659.240	
CANADA 3.25 12/01/33	1,600,000.000	1,583,963.280	
CANADA 3.5 03/01/28	800,000.000	798,529.960	
CANADA 3.5 08/01/25	1,000,000.000	987,617.350	
CANADA 3.5 12/01/45	1,110,000.000	1,154,915.000	
CANADA 3.75 02/01/25	2,000,000.000	1,982,187.480	
CANADA 3.75 05/01/25	1,000,000.000	991,567.580	
CANADA 4.0 06/01/41	420,000.000	459,827.710	
CANADA 4.5 11/01/25	3,000,000.000	3,018,972.660	
CANADA 5.0 06/01/37	390,000.000	457,707.750	
CANADA 5.75 06/01/29	1,250,000.000	1,395,144.930	
CANADA 5.75 06/01/33	670,000.000	797,183.470	
カナダ・ドル 小計	49,330,000.000 (5,279,296,600)	45,913,325.300 (4,913,644,074)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	440,000.000	417,157.400
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	400,000.000	379,720.000
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	490,000.000	449,183.000
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	810,000.000	649,620.000
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	320,000.000	256,225.600
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	910,000.000	886,613.000
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	730,000.000	683,280.000
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	648,000.000	637,567.200
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	340,000.000	317,876.200
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	520,000.000	515,060.000
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	330,000.000	324,192.000
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	540,000.000	521,208.000
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	395,000.000	384,425.850
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	550,000.000	550,385.000
	SINGAPORE 2.875 08/01/28	150,000.000	150,272.250
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	200,080.000
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	700,000.000	700,630.000
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	325,000.000	332,800.000
SINGAPORE 3.375 09/01/33	650,000.000	678,219.750	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	670,000.000	679,246.000	
シンガポール・ドル 小計	10,118,000.000 (1,096,690,020)	9,713,761.250 (1,052,874,582)	

スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,100,000.000	3,492,306.200	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	7,180,000.000	6,696,166.430	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	5,300,000.000	4,847,027.910	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,700,000.000	4,491,027.980	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,220,000.000	3,050,976.140	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,600,000.000	4,568,525.650	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,550,000.000	6,492,650.950	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,430,000.000	3,849,969.200	
スウェーデン・クローナ 小計		39,080,000.000 (542,821,200)	37,488,650.460 (520,717,355)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,410,000.000	4,475,368.170	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,300,000.000	2,303,893.630	
	DENMARK 0.5 11/15/27	5,130,000.000	4,772,521.080	
	DENMARK 0.5 11/15/29	4,570,000.000	4,102,333.620	
	DENMARK 1.75 11/15/25	4,370,000.000	4,291,439.190	
	DENMARK 2.25 11/15/33	2,350,000.000	2,292,871.500	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,290,000.000	10,271,535.480	
デンマーク・クローネ 小計		34,420,000.000 (722,820,000)	32,509,962.670 (682,709,216)	
ニュージーラン ド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	920,000.000	755,377.810	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	1,280,000.000	1,151,285.500	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	560,000.000	443,408.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	570,000.000	349,747.520	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	910,000.000	732,072.060	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	120,000.000	116,171.410	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	340,000.000	264,430.590	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	500,000.000	328,377.030	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	710,000.000	651,485.430	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	590,000.000	529,611.790	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	420,000.000	397,417.230	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	550,000.000	544,413.870	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	340,000.000	334,499.520	
ニュージーランド・ドル 小計		7,810,000.000 (695,324,300)	6,598,297.760 (587,446,450)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,890,000.000	1,627,070.760	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,610,000.000	3,194,276.010	
	NORWAY 1.5 02/19/26	7,400,000.000	7,074,252.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,950,000.000	3,749,778.450	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,480,000.000	1,441,934.400	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,920,000.000	3,599,971.200	
	NORWAY 2.0 04/26/28	3,060,000.000	2,898,095.400	

	NORWAY 2.125 05/18/32	2,650,000.000	2,418,448.300	
	NORWAY 3.0 08/15/33	4,790,000.000	4,649,813.460	
	NORWAY 3.5 10/06/42	1,650,000.000	1,737,685.950	
ノルウェー・クローネ 小計		34,400,000.000 (458,896,000)	32,391,325.930 (432,100,288)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,400,000.000	2,105,820.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	2,150,000.000	2,026,916.800	
	POLAND 1.25 10/25/30	1,900,000.000	1,488,273.800	
	POLAND 1.75 04/25/32	2,350,000.000	1,802,661.500	
	POLAND 10/25/25	1,000,000.000	912,201.190	
	POLAND 2.5 07/25/26	5,980,000.000	5,623,765.420	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,900,000.000	3,588,795.600	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,810,000.000	1,655,471.250	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,500,000.000	2,220,127.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,700,000.000	1,650,781.600	
	POLAND 3.75 05/25/27	1,770,000.000	1,704,040.950	
	POLAND 5.75 04/25/29	4,050,000.000	4,173,047.100	
	POLAND 6.0 10/25/33	2,670,000.000	2,803,566.750	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,700,000.000	4,068,359.050	
ポーランド・ズロチ 小計		37,880,000.000 (1,367,543,760)	35,823,828.510 (1,293,311,857)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	923,785.880	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,200,000.000	1,195,566.540	
	MALAYSIA 3.519 04/20/28	2,100,000.000	2,094,391.530	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,100,000.000	1,076,551.090	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	1,100,000.000	1,104,309.580	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	2,300,000.000	2,211,515.450	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,300,000.000	1,290,148.910	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	2,110,000.000	2,111,394.710	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,230,000.000	1,240,879.840	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	370,000.000	373,124.420	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,400,000.000	1,416,811.760	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,390,000.000	1,404,363.980	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,570,000.000	1,585,632.960	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,000,000.000	2,016,158.200	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	2,110,000.000	2,038,648.420	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	800,000.000	820,144.640	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	950,000.000	973,627.920	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,500,000.000	1,529,661.450	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,320,000.000	1,365,467.660	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,500,000.000	2,606,034.000	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	720,000.000	748,797.980	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	740,000.000	794,809.280	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,300,000.000	1,400,954.490	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	700,000.000	750,583.050		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,288,798.920		
MALAYSIA 4.893 06/08/38	2,230,000.000	2,449,983.700		

	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,700,000.000	1,869,257.610	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	620,000.000	679,962.240	
マレーシア・リングgit 小計		38,560,000.000 (1,198,383,104)	39,361,366.210 (1,223,288,284)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	2,000,000.000	1,936,020.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	35,200,000.000	31,379,392.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	13,340,000.000	12,573,750.400	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	2,000,000.000	1,832,355.760	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	21,330,000.000	18,981,567.000	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	12,750,000.000	11,124,120.000	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	29,000,000.000	27,104,270.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	4,700,000.000	4,985,525.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	6,500,000.000	6,450,725.710	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	24,100,000.000	22,152,978.830	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	19,500,000.000	18,361,590.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,370,000.000	27,959,836.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	28,700,000.000	24,881,178.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	8,891,000.000	8,004,834.030	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	17,946,000.000	15,771,303.720	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	24,201,000.000	23,502,559.140	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,800,000.000	11,096,130.000	
メキシコ・ペソ 小計		292,328,000.000 (2,449,913,270)	268,098,136.390 (2,246,850,052)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,550,000.000	1,318,240.900	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,280,000.000	1,055,393.280	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	630,000.000	605,278.800	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	900,000.000	794,329.200	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	400,000.000	241,040.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	600,000.000	424,440.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,200,000.000	1,078,600.990	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,000,000.000	933,615.000	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	210,000.000	94,536.540	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	850,000.000	789,643.200	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	400,000.000	232,570.640	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,520,000.000	1,441,978.400	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	350,000.000	154,435.750	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	650,000.000	561,196.350	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	900,000.000	874,152.900	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	950,000.000	703,688.830	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	900,000.000	530,640.000		

AUSTRIA 1.85 05/23/49	200,000.000	157,240.800	
AUSTRIA 2.0 07/15/26	720,000.000	708,886.080	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	400,000.000	295,264.000	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	710,000.000	681,134.240	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,250,000.000	1,257,437.500	
AUSTRIA 2.9 05/23/29	100,000.000	101,747.680	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	570,000.000	577,183.710	
AUSTRIA 3.15 10/20/53	100,000.000	100,813.900	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	380,000.000	437,766.080	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,000,000.000	1,121,459.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	500,000.000	522,627.500	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,000,000.000	1,123,675.000	
BELGIUM 0.0 10/22/27	1,000,000.000	907,775.000	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,500,000.000	1,214,268.000	
BELGIUM 0.1 06/22/30	900,000.000	765,180.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	750,000.000	612,375.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	860,000.000	553,993.940	
BELGIUM 0.65 06/22/71	70,000.000	29,605.530	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,300,000.000	1,257,333.350	
BELGIUM 0.8 06/22/27	800,000.000	752,903.200	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,400,000.000	1,297,520.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,950,000.000	1,786,473.480	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,800,000.000	1,727,775.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,310,000.000	1,159,770.510	
BELGIUM 1.25 04/22/33	1,000,000.000	874,330.000	
BELGIUM 1.4 06/22/53	680,000.000	437,189.680	
BELGIUM 1.45 06/22/37	800,000.000	657,513.600	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	666,615.440	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,030,000.000	738,600.120	
BELGIUM 1.9 06/22/38	400,000.000	343,262.800	
BELGIUM 2.15 06/22/66	600,000.000	455,220.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	550,000.000	433,444.550	
BELGIUM 2.75 04/22/39	300,000.000	285,497.400	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,200,000.000	1,213,948.800	
BELGIUM 3.0 06/22/34	840,000.000	845,117.280	
BELGIUM 3.3 06/22/54	1,200,000.000	1,182,120.000	
BELGIUM 3.45 06/22/43	400,000.000	409,597.600	
BELGIUM 3.75 06/22/45	800,000.000	857,720.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	650,000.000	709,996.300	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,000,000.000	1,138,118.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	700,000.000	727,141.100	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,680,000.000	2,001,765.860	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,610,000.000	1,802,778.180	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,880,000.000	3,664,233.200	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,470,000.000	1,413,500.550	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,990,000.000	1,843,289.240	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	3,500,000.000	3,270,680.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,500,000.000	2,383,225.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	500,000.000	477,030.000	

BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,710,000.000	2,614,716.400	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	500,000.000	483,055.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,100,000.000	2,094,792.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	2,300,000.000	2,317,181.000	
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	500,000.000	494,665.000	
BUNDESSCHAT 2.8 06/12/25	1,300,000.000	1,296,711.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,210,000.000	1,937,551.200	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,000,000.000	1,715,020.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,180,000.000	1,825,776.160	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,270,000.000	972,464.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,300,000.000	1,713,155.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,800,000.000	2,428,748.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	820,000.000	711,784.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,400,000.000	2,035,008.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	600,000.000	509,092.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,320,000.000	1,229,811.120	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,070,000.000	569,443.300	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,560,000.000	787,394.400	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,800,000.000	1,648,944.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,700,000.000	1,528,912.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,500,000.000	2,341,050.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,850,000.000	1,678,775.100	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,250,000.000	2,058,502.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,050,000.000	1,018,710.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,000,000.000	3,826,440.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,660,000.000	1,547,186.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,100,000.000	1,970,658.900	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,300,000.000	2,157,271.200	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,050,000.000	1,816,660.800	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,150,000.000	948,577.500	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,000,000.000	2,912,610.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	3,200,000.000	2,501,731.200	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,600,000.000	2,494,960.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,370,000.000	1,183,419.700	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,500,000.000	1,297,875.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	2,300,000.000	2,287,879.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	3,360,000.000	3,376,934.400	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	900,000.000	904,671.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	1,000,000.000	1,011,990.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,150,000.000	2,148,968.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,250,000.000	2,258,757.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	2,000,000.000	2,057,020.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,050,000.000	1,164,135.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,650,000.000	3,117,804.230	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,690,000.000	2,071,517.500	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,000,000.000	1,107,920.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,880,000.000	2,305,350.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,800,000.000	2,346,642.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,590,000.000	1,929,814.800	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,550,000.000	1,748,911.500	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	900,000.000	1,105,317.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	970,000.000	1,104,364.400	
FINLAND 0.0 09/15/26	100,000.000	92,865.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	380,000.000	318,299.360	
FINLAND 0.125 04/15/36	390,000.000	275,764.710	
FINLAND 0.125 04/15/52	380,000.000	178,132.630	
FINLAND 0.125 09/15/31	480,000.000	393,943.680	
FINLAND 0.25 09/15/40	400,000.000	254,710.560	
FINLAND 0.5 04/15/26	900,000.000	855,523.800	
FINLAND 0.5 04/15/43	300,000.000	188,990.310	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	278,235.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	500,000.000	453,526.100	
FINLAND 0.5 09/15/29	400,000.000	355,627.280	
FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	174,699.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	850,000.000	821,633.800	
FINLAND 1.125 04/15/34	500,000.000	423,406.000	
FINLAND 1.375 04/15/27	200,000.000	192,391.800	
FINLAND 1.375 04/15/47	440,000.000	322,553.000	
FINLAND 1.5 09/15/32	390,000.000	351,951.050	
FINLAND 2.625 07/04/42	470,000.000	442,229.610	
FINLAND 2.75 04/15/38	200,000.000	192,704.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	700,000.000	706,367.900	
FINLAND 2.875 04/15/29	500,000.000	506,375.000	
FINLAND 3.0 09/15/33	500,000.000	507,671.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	70,000.000	67,446.400	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	3,500,000.000	3,299,864.150	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	3,800,000.000	3,500,400.400	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,400,000.000	2,715,580.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	4,560,000.000	3,922,628.280	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,200,000.000	2,676,384.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,400,000.000	2,759,450.200	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,300,000.000	2,146,776.300	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,600,000.000	3,474,615.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	4,030,000.000	3,823,913.860	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	4,720,000.000	4,231,763.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,110,000.000	1,407,032.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	930,000.000	361,123.410	

FRANCE OAT 0.5 06/25/44	970,000.000	582,554.130	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	4,330,000.000	4,022,717.220	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,200,000.000	4,811,487.200	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,750,000.000	954,955.750	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,700,000.000	908,782.600	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,290,000.000	3,018,127.560	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,370,000.000	2,247,743.550	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,900,000.000	2,803,485.100	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,300,000.000	2,827,776.600	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,240,000.000	2,662,308.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	950,000.000	749,075.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	2,800,000.000	2,591,240.400	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,260,000.000	2,271,062.700	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	660,000.000	448,602.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,660,000.000	2,240,345.100	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,800,000.000	1,433,010.600	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	3,100,000.000	2,921,774.800	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	3,883,250.740	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,000,000.000	899,379.440	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,300,000.000	4,280,193.120	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,200,000.000	3,225,827.200	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,790,000.000	4,821,687.280	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,300,000.000	3,361,769.400	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,150,000.000	1,087,879.300	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,300,000.000	3,331,762.500	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,320,000.000	4,397,729.760	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	2,000,000.000	2,117,454.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,300,000.000	2,620,758.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,090,000.000	2,406,948.500	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,500,000.000	2,783,740.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,210,000.000	3,802,832.430	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,350,000.000	2,767,219.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,100,000.000	3,547,023.100	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,290,000.000	4,063,119.400	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,470,000.000	6,841,536.510	
IRISH 0.0 10/18/31	1,000,000.000	821,713.660	
IRISH 0.2 05/15/27	900,000.000	832,644.000	
IRISH 0.2 10/18/30	400,000.000	341,732.930	
IRISH 0.35 10/18/32	400,000.000	330,016.000	
IRISH 0.4 05/15/35	550,000.000	424,462.500	
IRISH 0.55 04/22/41	330,000.000	222,645.060	
IRISH 0.9 05/15/28	650,000.000	607,673.300	
IRISH 1.0 05/15/26	1,850,000.000	1,779,461.720	
IRISH 1.1 05/15/29	950,000.000	883,372.700	
IRISH 1.3 05/15/33	280,000.000	249,212.040	
IRISH 1.35 03/18/31	300,000.000	276,645.000	
IRISH 1.5 05/15/50	670,000.000	480,125.350	
IRISH 1.7 05/15/37	450,000.000	389,669.850	
IRISH 2.0 02/18/45	900,000.000	750,440.700	

IRISH 2.4 05/15/30	500,000.000	496,774.000	
IRISH 3.0 10/18/43	270,000.000	270,123.190	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,250,000.000	1,162,125.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,400,000.000	2,208,720.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	2,030,000.000	1,788,430.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,700,000.000	1,461,745.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,400,000.000	1,322,217.400	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,000,000.000	881,000.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,700,000.000	1,352,588.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	900,000.000	838,890.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,300,000.000	1,896,522.500	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,000,000.000	676,400.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,200,000.000	955,920.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,200,000.000	1,013,280.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	2,400,000.000	2,208,240.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,400,000.000	1,133,431.600	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,700,000.000	1,589,500.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,600,000.000	1,546,288.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,810,000.000	1,712,468.150	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,700,000.000	1,489,310.500	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,100,000.000	818,180.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	2,830,000.000	2,759,288.870	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,040,000.000	628,160.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,400,000.000	2,338,182.670	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,190,000.000	1,146,803.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,600,000.000	2,216,380.400	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,600,000.000	1,404,134.450	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,400,000.000	817,617.060	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	900,000.000	623,970.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,260,000.000	1,232,910.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,400,000.000	1,332,048.200	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	2,834,086.530	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,100,000.000	1,056,530.200	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,800,000.000	1,752,687.000	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	400,000.000	232,760.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	680,000.000	432,140.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,950,000.000	1,886,430.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,600,000.000	1,298,240.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,580,000.000	1,395,184.240	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	780,000.000	543,972.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	4,000,000.000	3,949,861.750	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,200,000.000	1,078,680.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,100,000.000	1,075,360.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,280,000.000	968,576.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	489,440.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.000	966,600.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,100,000.000	2,046,550.800	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,380,000.000	1,183,488.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,400,000.000	1,367,214.800	

ITALY BTPS 3.1 03/01/40	800,000.000	684,219.200	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	530,000.000	471,329.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,440,000.000	1,199,852.640	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,500,000.000	1,398,217.500	
ITALY BTPS 3.4 03/28/25	1,100,000.000	1,100,000.000	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,050,000.000	1,053,255.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,660,000.000	1,423,357.040	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,300,000.000	1,307,670.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,760,000.000	2,754,700.800	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	900,000.000	903,690.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	2,400,000.000	2,432,592.000	
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	2,200,000.000	2,240,700.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,400,000.000	1,271,151.000	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	1,200,000.000	1,220,880.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,600,000.000	1,625,760.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,080,000.000	2,043,600.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,300,000.000	1,289,990.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	700,000.000	712,740.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	1,020,200.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	800,000.000	823,840.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,000,000.000	1,016,300.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	1,330,000.000	1,372,028.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,740,000.000	1,807,686.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,300,000.000	1,297,660.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,400,000.000	1,439,200.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	500,000.000	496,150.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,400,000.000	1,484,310.800	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,400,000.000	1,455,732.600	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,830,000.000	1,980,609.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,060,000.000	2,205,848.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,290,000.000	1,383,396.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,740,000.000	1,902,342.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,120,000.000	2,420,828.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,800,000.000	3,228,680.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,470,000.000	1,643,166.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,100,000.000	1,222,100.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	1,000,000.000	945,889.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,500,000.000	1,390,050.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,000,000.000	885,062.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	700,000.000	477,374.100	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,500,000.000	729,358.120	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	900,000.000	767,691.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	780,000.000	647,919.720	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,600,000.000	1,535,885.120	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	700,000.000	621,308.100	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,470,000.000	1,049,201.910	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,400,000.000	1,328,460.000	

NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,400,000.000	1,182,606.440	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,350,000.000	1,271,923.420	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,372,790.280	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	570,000.000	491,479.080	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	1,000,000.000	1,002,360.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,520,000.000	1,513,099.200	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	700,000.000	694,496.600	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,440,000.000	1,456,983.360	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	350,000.000	377,661.550	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,300,000.000	1,486,288.700	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,500,000.000	1,724,850.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	670,000.000	749,395.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	2,600,000.000	2,442,583.000	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,400,000.000	1,282,050.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	2,000,000.000	1,787,000.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	1,800,000.000	1,720,191.600	
SPAIN 0.1 04/30/31	2,490,000.000	2,005,695.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,200,000.000	1,888,407.400	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,300,000.000	1,067,380.040	
SPAIN 0.6 10/31/29	2,310,000.000	2,022,806.940	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,300,000.000	1,070,192.500	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,300,000.000	1,209,325.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	2,000,000.000	1,786,300.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,060,000.000	752,137.840	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,400,000.000	895,020.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,310,000.000	698,664.920	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,850,000.000	1,274,243.000	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,500,000.000	1,344,825.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,640,000.000	2,526,202.500	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,600,000.000	2,445,099.800	
SPAIN 1.4 07/30/28	2,400,000.000	2,258,040.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	2,230,000.000	2,070,957.400	
SPAIN 1.45 10/31/27	2,300,000.000	2,182,449.300	
SPAIN 1.45 10/31/71	550,000.000	262,873.050	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,240,000.000	2,144,464.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,500,000.000	1,468,433.370	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,400,000.000	1,192,732.800	
SPAIN 1.9 10/31/52	1,700,000.000	1,118,171.600	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,640,000.000	1,603,578.880	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,370,233.330	
SPAIN 2.15 10/31/25	3,550,000.000	3,499,169.960	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,960,000.000	1,814,960.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,400,000.000	1,332,520.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,100,000.000	904,354.000	

	SPAIN 2.8 05/31/26	1,100,000.000	1,095,930.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,750,000.000	1,514,001.770	
	SPAIN 3.15 04/30/33	2,400,000.000	2,383,404.980	
	SPAIN 3.45 07/30/43	400,000.000	381,598.400	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,340,000.000	1,199,301.910	
	SPAIN 3.5 05/31/29	1,000,000.000	1,028,329.400	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,800,000.000	1,838,880.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	500,000.000	512,808.200	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,980,000.000	2,126,633.650	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,900,000.000	1,947,093.400	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,900,000.000	2,148,439.250	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,330,000.000	1,521,520.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,100,000.000	1,217,315.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,100,000.000	1,320,099.550	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,100,000.000	2,512,992.300	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,300,000.000	1,396,122.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,500,000.000	1,720,782.000	
	ユーロ 小計	555,850,000.000 (87,034,993,000)	519,553,801.710 (81,351,734,272)	
国債証券 合計		272,020,195,172.600 (272,020,195,173)	247,790,573,642 (247,790,573,642)	
合計			247,790,573,642 (247,790,573,642)	

(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 253銘柄	46.11	47.56
イギリス・ポンド	国債証券 56銘柄	5.00	5.16
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	0.29	0.30
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.35	1.39
オフショア・人民元	国債証券 40銘柄	7.31	7.54
カナダ・ドル	国債証券 39銘柄	1.92	1.98
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	0.41	0.42
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.20	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.27	0.28
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	0.23	0.24
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.17	0.17
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.51	0.52
マレーシア・リングgit	国債証券 28銘柄	0.48	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券 17銘柄	0.88	0.91
ユーロ	国債証券 359銘柄	31.83	32.83

(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12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	107,022,573
コール・ローン	101,680,821
投資信託受益証券	8,514,203,800
投資証券	75,022,989,706
派生商品評価勘定	690
未収入金	15,048,501
未収配当金	194,738,530
流動資産合計	83,955,684,621
資産合計	83,955,684,621
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	443,220
未払解約金	86,393,000
流動負債合計	86,836,220
負債合計	86,836,220
純資産の部	
元本等	
元本	46,744,560,535
剰余金	
剰余金又は欠損金()	37,124,287,866
元本等合計	83,868,848,401
純資産合計	83,868,848,401
負債純資産合計	83,955,684,621

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	46,753,862,319円
同期中追加設定元本額	26,144,414,670円
同期中一部解約元本額	26,153,716,454円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	2,356,415,757円
たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	24,604,708円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,652,111円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	14,809,568円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	38,030,466円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	51,309,274円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	45,387,678円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	33,287,993円
たわらノーロード 先進国リート	15,038,861,899円
たわらノーロード 先進国リート＜ラップ向け＞	1,686,270,972円
たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	302,086,674円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,956,527,349円
たわらノーロード バランス（堅実型）	28,337,165円
たわらノーロード バランス（標準型）	604,552,176円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,284,315,826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)	99,075,222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)	711,855,741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)	622,428,959円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	1,059,837,504円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,148,390円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	51,817,329円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	8,203,922円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	31,959,392円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,791,193,821円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,506,812円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	694,837,158円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	76,954,907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)	320,109,119円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	600,889,449円
投資のソムリエ	7,321,138,824円
投資のソムリエ<DC年金>	683,875,667円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	236,034,852円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	763,616,720円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,605,585,985円
ワールドアセットバランス(基本コース)	306,471,994円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	558,178,608円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	39,752,683円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	20,122,556円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,470,370円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	106,993,806円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	170,585,985円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	46,475,742円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	21,725,598円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	13,340,471円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,067,856円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	91,012,957円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	275,542,143円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	348,962,327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)	223,904,467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)	1,865,358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)	3,178,434円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	48,208,886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)	139,616,863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)	934,376,799円
計	46,744,560,535円
2. 受益権の総数	46,744,560,535口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
投資信託受益証券	124,776,400	
投資証券	2,684,397,017	
合計	2,809,173,417	

（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6月23日から2023年12月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年12月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	28,632,000	-	29,075,220	443,220
アメリカ・ドル	28,632,000	-	29,075,220	443,220
買建	43,605,000	-	43,605,690	690
アメリカ・ドル	43,605,000	-	43,605,690	690
合計	72,237,000	-	72,680,910	442,530

（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12月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7942円 (17,942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12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	340,400.000	216,154.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	391,900.000	109,732.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	58,730.000		
		PRIME US REIT	317,600.000	58,438.400		
	アメリカ・ドル	小計		1,961,600.000	443,054.400 (64,420,110)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	215,615.000	238,254.570		
		ABACUS STORAGE KING	224,215.000	265,694.770		
		ARENA REIT	157,934.000	557,507.020		
		BWP TRUST	218,012.000	780,482.960		
		CENTURIA CAPITAL GROUP	338,978.000	540,669.910		
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	241,652.000	770,869.880		
		CENTURIA OFFICE REIT	185,985.000	248,289.970		
		CHARTER HALL GROUP	207,794.000	2,264,954.600		
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	298,981.000	1,070,351.980		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	222,343.000	769,306.780		
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	157,053.000	441,318.930		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	618,825.000	275,377.120		
		DEXUS	484,190.000	3,529,745.100		
		DEXUS INDUSTRIA REIT	93,159.000	260,845.200		
		GDI PROPERTY GROUP	222,442.000	139,026.250		
		GOODMAN GROUP	764,636.000	17,739,555.200		
		GPT GROUP	862,445.000	3,734,386.850		
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	119,794.000	301,880.880		
		HEALTHCO REIT	202,023.000	289,903.000		
		HMC CAPITAL LTD	115,404.000	631,259.880		
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	803,393.000	972,105.530				
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	244,692.450				
INGENIA COMMUNITIES GROUP	169,987.000	693,546.960				
MIRVAC GROUP	1,776,591.000	3,748,607.010				
NATIONAL STORAGE REIT	561,839.000	1,325,940.040				
REGION RE LTD	515,481.000	1,139,213.010				
RURAL FUNDS GROUP	152,896.000	305,792.000				
SCENTRE GROUP	2,316,022.000	6,461,701.380				
STOCKLAND	1,059,278.000	4,438,374.820				
VICINITY CENTRES	1,704,828.000	3,273,269.760				

	WAYPOINT REIT LTD	299,993.000	728,982.990	
オーストラリア・ドル 小計		15,397,645.000	58,181,906.800 (5,561,608,471)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	292,995.000	383,823.450	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,020,316.000	979,503.360	
	CAPITALAND CHINA TRUST	497,080.000	429,974.200	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,254,709.000	4,283,947.100	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,585,860.000	4,519,701.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	291,800.000	303,472.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	31,472.000	
	ESR LOGOS REIT	2,702,540.000	824,274.700	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	474,300.000	310,666.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	482,300.000	1,075,529.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,296,364.000	1,438,964.040	
	KEPPEL DC REIT	600,800.000	1,183,576.000	
	KEPPEL REIT	1,017,000.000	900,045.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	731,400.000	453,468.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	926,620.000	2,140,492.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,497,720.000	2,441,283.600	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,029,200.000	1,461,464.000	
	PARAGON REIT	530,600.000	445,704.000	
	PARKWAY LIFE REIT	166,600.000	591,430.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	242,300.000	163,552.500	
STARHILL GLOBAL REIT	621,200.000	326,130.000		
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	996,490.000	1,165,893.300		
シンガポール・ドル 小計		19,370,594.000	25,854,365.950 (2,802,354,725)	
ユーロ	CROMWELL REIT EUR	129,840.000	171,388.800	
ユーロ 小計		129,840.000	171,388.800 (26,836,058)	
香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	674,000.000	3,167,800.000	
香港・ドル 小計		674,000.000	3,167,800.000 (58,984,436)	
投資信託受益証券 合計		37,533,679	8,514,203,800 (8,514,203,800)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	41,188.000	651,182.280
		AGREE REALTY CORP	42,462.000	2,500,587.180

ALEXANDER & BALDWIN INC	31,305.000	542,515.650	
ALEXANDER'S INC.	1,048.000	198,072.000	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	69,423.000	8,291,883.120	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,384.000	73,432.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,830.000	491,073.300	
AMERICAN HOMES 4 RENT	142,705.000	5,006,091.400	
AMERICOLD REALTY TRUST	114,186.000	3,240,598.680	
APARTMENT INCOME REIT CORP	65,733.000	2,154,727.740	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	64,228.000	458,587.920	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	93,552.000	1,581,028.800	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	28,991.000	347,022.270	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	27,301.380	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	63,342.000	11,132,356.500	
BOSTON PROPERTIES INC	64,831.000	4,154,370.480	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	51,944.070	
BRANDYWINE REALTY TRUST	73,547.000	366,264.060	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	135,179.000	3,069,915.090	
BROADSTONE NET LEASE INC	83,316.000	1,364,716.080	
BRT APARTMENTS CORP	4,006.000	75,873.640	
CAMDEN PROPERTY TRUST	47,939.000	4,489,487.350	
CARETRUST REIT INC	44,396.000	1,002,461.680	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	10,705.000	250,818.150	
CENTERSPACE	7,073.000	385,407.770	
CHATHAM LODGING TRUST	23,615.000	240,164.550	
CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	94,425.880	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	28,074.720	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	103,063.000	565,815.870	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10,042.000	283,385.240	
COPT DEFENCE PROPERTIES	50,088.000	1,234,168.320	
COUSINS PROPERTIES INC	67,471.000	1,515,398.660	
CTO REALTY GROUTH INC	9,356.000	162,607.280	
CUBESMART	100,961.000	4,258,534.980	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	93,836.000	806,989.600	
DIGITAL REALTY TRUST INC	135,082.000	18,210,404.420	

DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	102,226.000	253,520.480	
DOUGLAS EMMETT INC	74,419.000	1,064,935.890	
EAST GROUP	20,399.000	3,531,882.860	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	43,727.000	553,146.550	
ELME COMMUNITIES	41,055.000	560,400.750	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	60,646.000	565,827.180	
EPR PROPERTIES	33,109.000	1,498,844.430	
EQUINIX INC	41,767.000	33,487,527.590	
EQUITY COMMONWEALTH	48,988.000	938,120.200	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	82,884.000	5,869,016.040	
EQUITY RESIDENTIAL	153,791.000	9,045,986.620	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	68,612.000	1,667,957.720	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	28,563.000	6,458,379.930	
EXTRA SPACE STORAGE INC	94,247.000	13,070,173.960	
FARMLAND PARTNERS INC	20,744.000	259,300.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	32,984.000	3,269,374.080	
FIRST INDUSTRIAL RT	59,490.000	2,942,375.400	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	40,457.000	979,868.540	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,375.000	115,473.750	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	116,842.000	5,384,079.360	
GETTY REALTY CORP	19,860.000	574,748.400	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	18,651.000	250,109.910	
GLADSTONE LAND CORP	16,125.000	229,136.250	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,662.000	280,750.860	
GLOBAL NET LEASE INC	87,053.000	792,182.300	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	171,368.000	2,721,323.840	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	245,637.000	4,605,693.750	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	47,176.000	1,015,227.520	
HOST HOTELS & RESORTS INC	316,583.000	5,695,328.170	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	52,743.000	401,374.230	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	99,750.000	1,458,345.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	109,674.480	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	12,506.000	1,099,027.280	

INVENTRUST PROPERTIES CORP	30,243.000	762,426.030	
INVITATION HOMES INC	256,473.000	8,484,126.840	
IRON MOUNTAIN INC	130,118.000	8,516,223.100	
JBG SMITH PROPERTIES	40,623.000	628,031.580	
KILROY REALTY CORP	46,855.000	1,808,134.450	
KIMCO REALTY	275,782.000	5,581,827.680	
KITE REALTY GROUP TRUST	96,640.000	2,126,080.000	
LTC PROPERTIES INC	17,897.000	592,569.670	
LXP INDUSTRIAL TRUST	130,363.000	1,198,035.970	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	265,823.000	1,246,709.870	
MID AMERICA	51,927.000	6,601,479.510	
NATIONAL HEALTH INVS INC	19,365.000	1,065,268.650	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	36,961.000	1,362,012.850	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	5,706.000	111,267.000	
NETSTREIT CORP	31,405.000	521,951.100	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	14,807.000	126,599.850	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	9,758.000	315,280.980	
NNN REIT INC	81,983.000	3,340,807.250	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	148,373.280	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	110,035.000	3,358,268.200	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,764.000	171,817.320	
ORION OFFICE REIT INC	20,368.000	113,857.120	
PARAMOUNT GROUP INC	75,433.000	406,583.870	
PARK HOTELS & RESORTS INC	95,919.000	1,456,050.420	
PEAKSTONE REALTY TRUST	16,780.000	294,656.800	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	52,194.000	700,443.480	
PHILLIPS EDISON & CO INC	51,685.000	1,841,019.700	
PHYSICIANS REALTY TRUST	106,080.000	1,333,425.600	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	52,948.000	353,163.160	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,197.000	349,379.030	
POSTAL REALTY TRUST INC	6,866.000	100,312.260	
PROLOGIS INC	411,945.000	49,371,608.250	
PUBLIC STORAGE	70,617.000	19,335,640.770	
REALTY INCOME CORP	316,273.000	17,034,463.780	
REGENCY CENTERS CORP	73,764.000	4,717,945.440	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	54,625.000	733,067.500	

	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	91,800.000	4,812,156.000	
	RLJ LODGING TRUST	68,352.000	737,518.080	
	RPT REALTY	37,596.000	459,047.160	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,862.000	2,813,794.500	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	101,334.000	1,432,862.760	
	SAFEHOLD INC	18,989.000	414,529.870	
	SAUL CENTERS INC	6,050.000	236,736.500	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	77,180.000	592,742.400	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	146,008.000	19,401,543.040	
	SITE CENTERS CORP	80,257.000	1,085,877.210	
	SL GREEN	28,726.000	1,220,567.740	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	62,349.000	2,575,637.190	
	STAG INDUSTRIAL INC	80,795.000	2,926,394.900	
	STAR HOLDINGS	5,322.000	69,771.420	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	46,872.000	299,512.080	
	SUN COMMUNITIES INC	55,385.000	7,069,341.400	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	92,547.000	939,352.050	
	TANGER INC	46,850.000	1,246,210.000	
	TERRENO REALTY CORP	36,973.000	2,178,079.430	
	THE MACERICH COMPANY	95,928.000	1,284,475.920	
	UDR INC	136,075.000	4,812,972.750	
	UMH PROPERTIES INC	27,937.000	412,350.120	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,978.000	252,929.180	
	URBAN EDGE PROPERTIES	52,560.000	915,069.600	
	VENTAS INC	179,165.000	8,370,588.800	
	VERIS RESIDENTIAL INC	37,449.000	560,611.530	
	VICI PROPERTIES INC	452,113.000	13,793,967.630	
	VORNADO REALTY TRUST	70,384.000	1,968,640.480	
	WELLTOWER INC	247,011.000	21,667,804.920	
	WHITESTONE REIT	21,086.000	243,332.440	
	WP CAREY INC	95,194.000	5,955,336.640	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	46,358.000	585,501.540	
アメリカ・ドル	小計	9,941,496.000	447,600,965.070 (65,081,180,323)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	184,841.000	90,572.090	
	AEW UK REIT PLC	78,980.000	76,057.740	
	ASSURA PLC	1,328,830.000	584,685.200	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	335,753.000	228,983.540	
	BIG YELLOW GROUP PLC	78,076.000	887,724.120	

	BRITISH LAND CO PLC	423,129.000	1,591,811.290	
	CLS HOLDINGS PLC	45,585.000	44,217.450	
	CUSTODIAN REIT PLC	191,703.000	164,481.170	
	DERWENT LONDON PLC	50,295.000	1,113,531.300	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	265,420.000	243,390.140	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	114,229.000	472,451.140	
	HAMMERSON PLC	1,738,721.000	467,715.940	
	HELICAL PLC	48,089.000	95,216.220	
	HOME REIT PLC	286,621.000	54,457.990	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	169,602.000	144,500.900	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	335,403.000	2,159,324.510	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	147,597.000	88,263.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	438,616.000	828,107.000	
	LXI REIT PLC	765,854.000	714,541.780	
	NEWRIVER REIT PLC	151,095.000	125,106.660	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	239,715.000	158,211.900	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	599,040.000	587,059.200	
	PRS REIT PLC/THE	249,183.000	197,352.930	
	REGIONAL REIT LTD	236,558.000	74,515.770	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	97,375.000	770,723.120	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	203,492.000	90,757.430	
	SEGRO PLC	545,552.000	4,537,901.530	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	857,314.000	1,071,642.500	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	561,733.000	451,071.590	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	262,409.000	216,225.010	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	173,559.000	105,870.990	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	859,113.000	1,359,116.760	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	354,973.000	203,754.500	
	UNITE GROUP PLC	175,706.000	1,721,040.270	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	199,551.000	236,667.480	
	WAREHOUSE REIT PLC	182,285.000	156,035.960	
	WORKSPACE GROUP PLC	58,577.000	311,629.640	
イギリス・ボンド	小計	13,265,614.000	22,424,715.760 (4,092,286,379)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314,331.000	525,561.430	
	REIT 1 LTD	80,666.000	1,302,755.900	

	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	103,336.000	856,655.440	
イスラエル・シュケル 小計		498,333.000	2,684,972.770 (105,418,206)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	26,739.000	506,704.050	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,895.000	139,033.250	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,117.000	728,525.170	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,104.000	121,560.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	43,955.550	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	37,122.000	1,875,403.440	
	CHOICE PROPERTIES REIT	72,061.000	964,176.180	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	23,112.000	310,163.040	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,105.000	308,364.750	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	58,271.000	769,759.910	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	8,533.000	78,162.280	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	47,026.000	680,936.480	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,014.000	1,025,124.100	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	54,790.000	513,930.200	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	31,365.000	403,040.250	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,462.000	439,092.900	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,341.000	144,972.320	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,705.000	124,916.750	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	109,135.250	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	57,391.000	257,111.680	
PRIMARIS REIT	22,168.000	295,721.120		
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,769.000	73,956.610		
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	65,670.000	1,176,806.400		
SLATE GROCERY REIT	11,264.000	121,088.000		
SMARTCENTRES REIT	31,957.000	759,617.890		
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	3,727.000	33,431.190		
カナダ・ドル 小計		715,586.000	12,004,688.760 (1,284,741,791)	

ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	358,594.000	387,281.520	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	474,291.000	1,007,868.370	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	723,771.000	600,729.930	
	PRECINCT PROPERTIES	584,851.000	690,124.180	
ニュージーランド・ドル 小計		2,141,507.000	2,686,004.000 (239,134,936)	
ユーロ	AEDIFICA	20,878.000	1,295,479.900	
	ALTAREA	2,084.000	147,338.800	
	CARE PROPERTY INVEST NV	15,092.000	202,836.480	
	CARMILA SA	24,554.000	356,524.080	
	COFINIMMO SA	15,148.000	1,049,756.400	
	COVIVIO	21,617.000	1,007,784.540	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	19,494.000	416,781.720	
	GECINA SA	22,914.000	2,454,089.400	
	HAMBORNER REIT AG	31,150.000	210,262.500	
	ICADE	14,129.000	475,582.140	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	45,323.770	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	129,450.000	822,007.500	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	12,768.000	263,659.200	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	195,526.000	195,526.000	
	KLEPIERRE	87,848.000	2,071,455.840	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	22,313.000	134,993.650	
	MERCIALYS	39,645.000	362,553.520	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	146,547.000	1,409,782.140	
	MONTEA SCA	6,867.000	570,647.700	
	NSI NV	7,519.000	134,439.720	
	RETAIL ESTATES	5,574.000	349,489.800	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	14,260.000	591,790.000	
UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	45,344.000	2,866,647.680		
VASTNED RETAIL	7,728.000	152,859.840		
WAREHOUSES DE PAUW	72,798.000	1,981,561.560		
WERELDHAVE NV	18,282.000	262,712.340		
XIOR STUDENT HOUSING NV	12,423.000	390,703.350		
ユーロ 小計		1,032,507.000	20,222,589.570 (3,166,453,075)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	26,312.000	82,488,120.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	69,322.000	259,957,500.000	
	JR REIT XXVII	76,448.000	323,375,040.000	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	22,542.000	119,247,180.000	

	LOTTE REIT CO LTD	48,275.000	155,928,250.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	20,887.000	73,522,240.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	33,139.000	220,042,960.000	
	SK REITS CO LTD	48,785.000	194,896,075.000	
	韓国・ウォン 小計	345,710.000	1,429,457,365.000 (158,097,985)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	814,070.000	2,051,456.400	
	LINK REIT	1,144,720.000	43,384,888.000	
	PROSPERITY REIT	538,000.000	710,160.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	445,000.000	912,250.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	908,000.000	1,044,200.000	
	香港・ドル 小計	3,849,790.000	48,102,954.400 (895,677,011)	
投資証券 合計		31,790,543	75,022,989,706 (75,022,989,706)	
合計			83,537,193,506 (83,537,193,506)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 5銘柄 投資証券 137銘柄	0.08 -	- 77.60	77.98
イギリス・ポンド	投資証券 38銘柄	-	4.88	4.90
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	6.63	-	6.66
カナダ・ドル	投資証券 26銘柄	-	1.53	1.54
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 22銘柄	3.34	-	3.35
ニュージーランド・ドル	投資証券 4銘柄	-	0.29	0.29
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 27銘柄	0.03 -	- 3.78	3.82
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	-	0.19	0.19
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 5銘柄	0.07 -	- 1.07	1.14

(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12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,873,633,407
コール・ローン	223,242,624
株式	78,370,789,997
投資信託受益証券	665,214,594
投資証券	57,389,240
派生商品評価勘定	87,222,384
未収配当金	96,986,794
差入委託証拠金	1,399,146,536
流動資産合計	84,773,625,576
資産合計	84,773,625,576
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,799,480
未払解約金	4,808,000
流動負債合計	22,607,480
負債合計	22,607,480
純資産の部	
元本等	
元本	56,111,784,828
剰余金	
剰余金又は欠損金()	28,639,233,268
元本等合計	84,751,018,096
純資産合計	84,751,018,096
負債純資産合計	84,773,625,576

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	69,472,541,639円
同期中追加設定元本額	16,293,206,002円
同期中一部解約元本額	29,653,962,813円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	9,787,235,340円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>	3,694,554,993円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,706,266円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	10,890,256円

MITO ラップ型ファンド(積極型)	27,585,447円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	38,306,321円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	33,202,050円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	24,057,455円
たわらノーロード 新興国株式	12,630,963,502円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,935,229,606円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,462,756,257円
たわらノーロード バランス(堅実型)	32,211,680円
たわらノーロード バランス(標準型)	134,498,459円
たわらノーロード バランス(積極型)	249,740,233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)	5,456,273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)	99,957,315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)	176,301,372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)	267,862,304円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	71,286円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,806,138円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,696,437円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,540,960円
たわらノーロード 全世界株式	793,346,019円
One DC 新興国株式インデックスファンド	1,087,485,546円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	367,966,817円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	400,914,931円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	591,176,546円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,129,537,176円
投資のソムリエ	8,313,759,069円
クルーズコントロール	467,299,434円
投資のソムリエ<DC年金>	775,136,916円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	449,449,869円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	871,158,778円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,968,234,038円
ワールドアセットバランス(基本コース)	535,942,539円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	937,254,612円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	45,829,891円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	22,624,677円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,369,263円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	147,631,525円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,615,181,499円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	320,632,006円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	52,802,077円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	24,739,658円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	15,003,437円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,481,841円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	24,362,644円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	252,378,602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)	3,719,833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)	158,877,752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)	94,764,792円
計	56,111,784,828円

2. 受益権の総数

56,111,784,828口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	1,051,077,334

投資信託受益証券	116,379,980
投資証券	8,458,694
合計	926,238,660

（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12月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年12月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	159,303,600	-	159,306,120	2,520
アメリカ・ドル	159,303,600	-	159,306,120	2,520
買建	114,957,480	-	116,737,008	1,779,528
アメリカ・ドル	114,957,480	-	116,737,008	1,779,528
合計	274,261,080	-	276,043,128	1,777,008

（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12月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引				
買建	5,420,113,604	-	5,487,759,500	67,645,896
合計	5,420,113,604	-	5,487,759,500	67,645,896

（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12月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5104円 (15,104円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2023年12月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,977	9.440	169,702.880	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	5,356	124.670	667,732.520	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,989	75.450	527,320.050	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	219,522	1.400	307,330.800	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	1.523	135,547.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	51,568	1.978	102,001.500	
	EFG HOLDING S.A.E. -GDR	62,824	0.650	40,835.600	
	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	27,140	15.270	414,427.800	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	35,410	11.140	394,467.400	
	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	16,679	34.570	576,593.030		

	JOYY INC-ADR	3,434	37.440	128,568.960	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,056	23.110	116,844.160	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	QIFU TECHNOLOGY INC ADR	10,000	14.770	147,700.000	
	NIO INC ADR	112,414	7.380	829,615.320	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	60,221	8.220	495,016.620	
	AUTOHOME INC ADR	4,983	26.450	131,800.350	
	WEIBO CORP ADR	6,261	9.570	59,917.770	
	KANZHUN LTD ADR	19,195	15.200	291,764.000	
	KE HOLDINGS INC ADR	54,478	15.100	822,617.800	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,782	59.280	342,756.960	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	0.867	52,399.740	
	PDD HOLDINGS INC ADR	48,415	138.960	6,727,748.400	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,384	39.910	1,332,355.440	
	IQIYI INC ADR	33,439	4.560	152,481.840	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	33,649	21.310	717,060.190	
アメリカ・ドル	小計	307,378,296		15,684,606.130 (2,280,541,731)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	115,717	10.020	1,159,484.340	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	234,419	5.610	1,315,090.590	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	281,634	18.700	5,266,555.800	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	233,580	8.280	1,934,042.400	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	358,966	13.260	4,759,889.160	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	550,388	7.380	4,061,863.440	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	312,686	5.360	1,675,996.960	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	152,707	17.450	2,664,737.150	
	MULTIPLY GROUP	316,386	3.250	1,028,254.500	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	188,416	3.210	604,815.360	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	257,162	3.690	948,927.780	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	3,002,061		25,419,657.480 (1,004,839,060)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	246,652	2,455.750	605,715,649.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	59,189	470.450	27,845,465.050	
	ASIAN PAINTS LTD	31,014	3,232.000	100,237,248.000	
	BANK OF BARODA	92,818	212.000	19,677,416.000	
	EICHER MOTORS LTD	11,150	4,055.000	45,213,250.000	

GRASIM INDUSTRIES LTD	21,160	2,070.050	43,802,258.000	
HDFC BANK LTD	227,205	1,653.200	375,615,306.000	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,684	1,668.550	126,282,538.200	
SHREE CEMENT LTD	788	27,670.250	21,804,157.000	
ICICI BANK LTD	416,924	1,010.850	421,447,625.400	
INDUSIND BANK LTD	21,721	1,508.950	32,775,902.950	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	42,590	377.500	16,077,725.000	
STATE BANK OF INDIA LTD	143,026	614.150	87,839,417.900	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	21,636	843.200	18,243,475.200	
TATA STEEL LTD	586,692	129.200	75,800,606.400	
TATA MOTORS LTD	135,256	714.550	96,647,174.800	
JSW STEEL LTD	49,199	839.350	41,295,180.650	
TATA COMMUNICATIONS LTD	8,325	1,694.850	14,109,626.250	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	42,645	946.600	40,367,757.000	
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,047	7,984.250	16,343,759.750	
TATA POWER CO LTD	114,167	323.550	36,938,732.850	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,830	4,942.200	43,639,626.000	
NESTLE INDIA LTD	2,715	24,789.600	67,303,764.000	
GAIL INDIA LTD	176,391	140.350	24,756,476.850	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	87,140	1,838.450	160,202,533.000	
VEDANTA LTD	67,908	244.800	16,623,878.400	
SUPREME INDUSTRIES LTD	5,274	4,522.250	23,850,346.500	
AXIS BANK LTD	184,524	1,131.200	208,733,548.800	
TITAN COMPANY LTD	29,402	3,634.650	106,865,979.300	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,604	195.950	49,497,753.800	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,435	2,293.800	26,229,603.000	
BHARAT ELECTRONICS LTD	292,960	158.750	46,507,400.000	
LUPIN LTD	17,129	1,239.350	21,228,826.150	
MPHASIS LTD	6,694	2,427.050	16,246,672.700	
BAJAJ FINANCE LTD	22,138	7,307.600	161,775,648.800	
INFOSYS LTD	268,711	1,491.150	400,688,407.650	
WIPRO LTD	106,724	422.600	45,101,562.400	
TATA ELXSI LTD	3,020	8,365.850	25,264,867.000	
MRF LTD	144	117,949.400	16,984,713.600	
INDIAN OIL CORP LTD	225,534	118.800	26,793,439.200	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	66,630	2,522.300	168,060,849.000	
TRENT LTD	15,014	2,841.300	42,659,278.200	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,120	5,555.350	45,109,442.000	
CUMMINS INDIA LTD	12,335	1,949.350	24,045,232.250	
HCL TECHNOLOGIES LTD	77,040	1,364.100	105,090,264.000	
DABUR INDIA LTD	48,446	547.500	26,524,185.000	
HERO MOTOCORP LTD	8,789	3,715.750	32,657,726.750	

SRF LTD	11,697	2,423.100	28,343,000.700	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,071	2,605.650	18,424,551.150	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	8,653	5,763.900	49,875,026.700	
BHARTI AIRTEL LTD	181,756	1,000.250	181,801,439.000	
UNITED SPIRITS LTD	22,698	1,045.250	23,725,084.500	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	77,598	1,235.800	95,895,608.400	
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,597	3,681.750	35,333,754.750	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,018	10,618.550	116,995,183.900	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,151	1,017.400	22,536,427.400	
HAVELLS INDIA LTD	19,728	1,343.000	26,494,704.000	
TVS MOTOR COMPANY LTD	19,289	1,902.700	36,701,180.300	
INDRAPRASTHA GAS LTD	27,995	401.100	11,228,794.500	
JINDAL STEEL & POWER LTD	27,284	686.250	18,723,645.000	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	214,409	95.000	20,368,855.000	
SHRIRAM FINANCE LTD	22,842	2,031.600	46,405,807.200	
PETRONET LNG LTD	64,449	210.000	13,534,290.000	
CIPLA LTD/INDIA	42,634	1,219.100	51,975,109.400	
LARSEN & TOUBRO LTD	54,438	3,378.450	183,916,061.100	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,077	9,413.550	85,446,793.350	
ASHOK LEYLAND LTD	131,250	174.900	22,955,625.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	74,066	3,626.700	268,615,162.200	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,830	2,822.150	39,030,334.500	
NTPC LTD	347,936	285.050	99,179,156.800	
YES BANK LTD	977,054	19.900	19,443,374.600	
AMBUJA CEMENTS LTD	52,658	494.350	26,031,482.300	
BHARAT FORGE LTD	20,684	1,177.150	24,348,170.600	
SUZLON ENERGY LTD	722,047	38.750	27,979,321.250	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,664	520.350	51,860,162.400	
ITC LTD	243,576	449.150	109,402,160.400	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,991	2,561.650	30,716,745.150	
UNITED PHOSPHORUS LTD	40,105	585.200	23,469,446.000	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,201	2,053.450	16,840,343.450	
SIEMENS INDIA LTD	7,072	3,827.200	27,065,958.400	
INFO EDGE INDIA LTD	5,742	4,745.650	27,249,522.300	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	50,735	454.850	23,076,814.750	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,516	1,021.550	33,216,719.800	
TECH MAHINDRA LTD	43,452	1,225.300	53,241,735.600	
INDIAN HOTELS CO LTD	67,997	435.500	29,612,693.500	
MARICO LTD	39,330	530.500	20,864,565.000	
POWER FINANCE CORP LTD	119,321	384.600	45,890,856.600	
PAGE INDUSTRIES LTD	508	37,335.500	18,966,434.000	

ABB LTD/INDIA	4,777	4,746.800	22,675,463.600	
DLF LTD	49,742	649.900	32,327,325.800	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	369,258	228.600	84,412,378.800	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	3,889	6,464.500	25,140,440.500	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,610	1,022.950	43,587,899.500	
REC LTD	107,141	405.450	43,440,318.450	
BAJAJ FINSERV LTD	30,672	1,710.150	52,453,720.800	
BAJAJ AUTO LTD	5,519	6,075.700	33,531,788.300	
JUBILANT FOODWORKS LTD	30,266	559.750	16,941,393.500	
ADANI POWER LTD	62,307	533.800	33,259,476.600	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,379	1,440.650	16,393,156.350	
COAL INDIA LTD	124,565	351.000	43,722,315.000	
TATA MOTORS LTD	33,523	479.650	16,079,306.950	
PI INDUSTRIES LTD	7,267	3,843.500	27,930,714.500	
VARUN BEVERAGES LTD	36,637	1,066.950	39,089,847.150	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	8,498	3,574.200	30,373,551.600	
LTIMINDTREE LTD	7,277	5,708.700	41,542,209.900	
ADANI GREEN ENERGY LTD	25,366	1,550.300	39,324,909.800	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	78,537	671.250	52,717,961.250	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	740.500	11,699,159.500	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	15,727	2,733.650	42,992,113.550	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,689	2,987.050	22,967,427.450	
BANDHAN BANK LTD	52,105	237.050	12,351,490.250	
GODREJ PROPERTIES LTD	9,790	1,930.150	18,896,168.500	
POLYCAB INDIA LTD	3,386	5,446.650	18,442,356.900	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	33,265	1,166.650	38,808,612.250	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	22,115	759.950	16,806,294.250	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	18,362	749.550	13,763,237.100	
ZOMATO LTD	419,610	119.950	50,332,219.500	
MACROTECH DEVELOPERS LTD	21,458	917.700	19,692,006.600	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	62,992	678.200	42,721,174.400	
APL APOLLO TUBES LTD	12,592	1,601.550	20,166,717.600	
SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	32,684	571.800	18,688,711.200	
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	17,909	651.250	11,663,236.250	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	264,027	244.250	64,488,594.750	

	ASTRAL POLYTECHNIK LTD	10,849	1,928.750	20,925,008.750	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	22,656	578.950	13,116,691.200	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	13,233	4,070.650	53,866,911.450	
	IDFC BANK LTD	285,952	88.050	25,178,073.600	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	18,897	1,449.400	27,389,311.800	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,024	543.550	17,950,195.200	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	10,946	2,897.950	31,720,960.700	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	35,977	1,465.200	52,713,500.400	
インド・ルピー	小計	10,799,932		7,665,588,748.200 (13,414,780,309)	
インドネシア・ ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	547,000	1,685.000	921,695,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,178,385	1,750.000	3,812,173,750.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	112,201	22,300.000	2,502,082,300.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	364,000	6,400.000	2,329,600,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	591,600	3,510.000	2,076,516,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,604,200	5,675.000	9,103,835,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,988,600	3,940.000	15,715,084,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	637,600	5,025.000	3,203,940,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	192,100	8,150.000	1,565,615,000.000	
	BANK MANDIRI	3,038,000	5,700.000	17,316,600,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,597,200	5,375.000	30,084,950,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,192,000	5,075.000	6,049,400,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,785,000	1,645.000	2,936,325,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	234,932	6,300.000	1,480,071,600.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,499,300	8,750.000	39,368,875,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,250,300	2,560.000	3,200,768,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	194,100	10,975.000	2,130,247,500.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,482,800	2,850.000	4,225,980,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,523,700	905.000	1,378,948,500.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	66,987,200	108.000	7,234,617,600.000	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL PT	528,400	6,450.000	3,408,180,000.000	

	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	794,082	2,470.000	1,961,382,540.000	
インドネシア・ルピア 小計		99,322,700		162,006,886,790.000 (1,522,864,736)	
オフショア・人 民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	41.590	542,000.880	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	48.660	282,228.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	9.780	222,006.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	22.420	133,174.800	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	59.200	177,600.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	15,000	13.160	197,400.000	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	7,140	14.980	106,957.200	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	8.920	107,040.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	5,180	42.150	218,337.000	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	11.800	143,960.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	13.470	235,725.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	7,040	20.940	147,417.600	
	JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	11.750	123,375.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.740	224,234.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	56.050	67,260.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	15.050	243,810.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	2,200	32.580	71,676.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	151.360	317,856.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	28.250	333,350.000	
	NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	14.300	127,270.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	30.260	245,106.000		
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	13,600	17.120	232,832.000		
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	17.710	246,169.000		

YINTAI GOLD CO LTD	23,900	14.740	352,286.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	6.810	214,515.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	3.540	218,772.000	
GEM CO LTD	29,100	5.550	161,505.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	83.450	216,970.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	22.910	158,079.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	5.700	331,170.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	14.560	246,064.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	5,900	79.020	466,218.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	7.500	116,947.500	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	22.180	130,950.720	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,812	17.120	99,501.440	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	7.610	225,256.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	24.910	332,797.600	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	17.590	116,094.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	22.190	113,169.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	42.600	396,180.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	22.500	234,000.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	1,000	33.370	33,370.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	24,000	40.100	962,400.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	14,350	62.240	893,144.000	
CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD	5,700	23.970	136,629.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	9.660	173,880.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	11.850	213,300.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	55.600	561,560.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	11.440	128,128.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	9.430	233,864.000	

TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	10.500	106,050.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	9.850	55,160.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	17.300	243,930.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	28.290	339,480.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	23.790	185,562.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	10.280	529,934.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	48.910	293,460.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,239	67.900	152,028.100	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	11,470	36.080	413,837.600	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	12.770	162,179.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	3.840	140,928.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	39,729	16.320	648,377.280	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	29.140	314,712.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	3,584	24.050	86,195.200	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	500	32.620	16,310.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	16.530	114,057.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	83,200	5.340	444,288.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	50.180	245,882.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	11.900	182,070.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	6,200	39.510	244,962.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	26.830	134,150.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	23.660	376,194.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	19.100	187,180.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,700	190.000	1,463,000.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	4,800	59.110	283,728.000	

BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	6.690	100,015.500	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	15.600	213,330.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	8,740	10.270	89,759.800	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	9,682	10.760	104,178.320	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	40.650	369,915.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	159.300	573,480.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.140	223,987.200	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	8.220	117,546.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	31,154	30.890	962,347.060	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	16.050	479,895.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.500	151,250.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.070	432,791.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	9.420	187,458.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	19.850	379,135.000	
IFLYTEK CO LTD	14,700	48.450	712,215.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.170	202,678.000	
GOERTEK INC	25,100	17.740	445,274.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.860	146,118.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	20.820	732,864.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	34,900	12.700	443,230.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	129,320	4.170	539,264.400	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.530	156,499.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	3.290	123,704.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	18.340	742,549.920	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.540	148,458.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,300	26.180	322,014.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	49.720	523,054.400	

EAST MONEY INFORMATION CO LTD	77,918	14.370	1,119,681.660	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,800	111.700	871,260.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	18,700	142.930	2,672,791.000	
WANDA FILM HOLDING CO LTD	21,700	12.450	270,165.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	6,700	8.410	56,347.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.870	844,047.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	9.580	439,722.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	32.880	397,848.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	8.940	378,162.000	
PING AN BANK CO LTD	97,200	9.300	903,960.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	24,480	19.660	481,276.800	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	133,800	4.520	604,776.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	10.780	593,978.000	
ZTE CORP	16,500	26.100	430,650.000	
ZOONLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	6.340	180,690.000	
WEICHAO POWER CO LTD	20,000	13.920	278,400.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	33.460	140,532.000	
GF SECURITIES CO LTD	15,300	14.220	217,566.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	8.340	175,974.000	
BYD CO LTD	8,400	198.550	1,667,820.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	5.570	168,214.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	6.490	221,309.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	23.330	225,367.800	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	46.610	243,304.200	
LB GROUP CO LTD	11,000	16.470	181,170.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	9.500	406,600.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	36.460	76,566.000	

ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	27.560	264,576.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	16.040	187,668.000	
RISEN ENERGY CO LTD	1,100	16.600	18,260.000	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU CO LTD	15,200	12.010	182,552.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	15.470	123,760.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	14.400	182,880.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,200	222.230	488,906.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	6.530	196,553.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	23.440	300,032.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	6.700	229,140.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	67,400	5.520	372,048.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	13.250	73,537.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	241.000	409,700.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	6.680	104,208.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	40.260	265,716.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	53.380	32,028.000	
NINESTAR CORP	1,100	25.700	28,270.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	5.520	210,864.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	8.330	211,748.600	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	57.710	92,336.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	15.010	253,669.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	25.820	276,274.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	121.030	220,274.600	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	68.920	124,056.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	6.300	95,130.000	
SF HOLDING CO LTD	24,400	41.190	1,005,036.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.990	141,364.000	

BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	38.200	152,800.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	66.350	165,875.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	36,190	5.840	211,349.600	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	9.470	368,383.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	4.920	359,160.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	39.970	91,931.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	25.450	664,245.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	21.470	138,717.670	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	15.630	142,233.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	24,800	13.400	332,320.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	57.650	178,715.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.410	234,225.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46	25.410	1,168.860	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	7.140	277,032.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	23.250	86,025.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	15.480	236,503.440	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	2,200	83.310	183,282.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	31.690	139,752.900	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,700	56.860	210,382.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	45.220	122,094.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	28.460	88,226.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	68.130	143,073.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	32.150	293,079.400	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	11.870	112,765.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,100	117.500	364,250.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	100	58.390	5,839.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	29.770	205,413.000	

SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	70.910	321,931.400	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	123.720	371,160.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	51.240	66,612.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	22.750	109,200.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	27.950	86,645.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	32.600	104,320.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.950	100,965.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	49.350	118,440.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	10.980	233,874.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	10.270	135,564.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	100	72.330	7,233.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	67.660	128,554.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	36,700	8.070	296,169.000	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	21.420	252,756.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	57,600	15.760	907,776.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,800	296.000	1,716,800.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	60,800	4.720	286,976.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	7.960	123,380.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,600	84.390	135,024.000	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	4,050	51.520	208,656.000	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	14.850	126,225.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	23.020	93,461.200	
SG MICRO CORP	3,395	81.800	277,711.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	20,240	163.590	3,311,061.600	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	91.910	277,200.560	
WUXI APPTec CO LTD	13,972	76.000	1,061,872.000	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	51,400	6.280	322,792.000	

FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	24.600	253,380.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	84,000	4.100	344,400.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	4.060	334,950.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	44.550	325,215.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	136.000	348,160.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	25,300	13.940	352,682.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	29.150	216,438.750	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	960	64.550	61,968.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	245.530	270,083.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	61.910	68,101.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,655	33.450	189,159.750	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	52.370	131,972.400	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	156.030	468,090.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	57.500	310,500.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	53,400	4.420	236,028.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	40.380	109,026.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	29.450	241,490.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	5,030	107.300	539,719.000	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	3,325	31.990	106,366.750	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	12.790	163,712.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.580	294,894.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	3.340	236,138.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	21.060	225,342.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.240	204,352.000	

SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	66.200	145,640.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	42.800	124,120.000	
CGN POWER CO LTD	13,200	3.030	39,996.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	199,300	4.960	988,528.000	
GONGNIU GROUP CO LTD	1,900	92.780	176,282.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	64.640	206,848.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	172.890	138,312.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	102.410	157,301.760	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	4,600	38.040	174,984.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	117,600	4.370	513,912.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.630	223,230.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	40.810	130,592.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	44.140	101,522.000	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	900	81.830	73,647.000	
HOYMILES POWER ELECTRONICS INC	596	220.260	131,274.960	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	4,000	54.980	219,920.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	5.940	258,390.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	5,070	25.610	129,842.700	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	62.980	88,172.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	33.470	204,167.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	25.400	40,640.000	
SHENZHEN SED INDUSTRY CO LTD	7,600	21.680	164,768.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	39.140	234,840.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,860	49.900	142,714.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	19.100	221,025.200	

ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	7.130	253,828.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	7,077	48.150	340,757.550	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	75.750	219,675.000	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	5,320	15.710	83,577.200	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	105.730	274,898.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,900	39.630	313,077.000	
ZHUZHOU CRRCTIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	36.990	170,154.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	2,600	150.080	390,208.000	
PIOTECH INC	592	260.990	154,506.080	
ASR MICROELECTRONICS CO LTD	4,000	66.680	266,720.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	8.740	351,348.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,800	169.420	474,376.000	
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP INC	5,600	44.650	250,040.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,060	38.540	156,472.400	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,100	281.070	309,177.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	127.770	408,864.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	324.300	793,562.100	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	17.400	330,600.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	840	285.980	240,223.200	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	29.900	257,140.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.120	393,472.000	
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	16,800	16.690	280,392.000	
PETROCHINA CO LTD	117,300	6.870	805,851.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	305,700	4.730	1,445,961.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	413,100	3.570	1,474,767.000	

BANK OF CHINA LTD	196,000	3.940	772,240.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	173,000	5.470	946,310.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	28.490	393,162.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,900	30.580	1,036,662.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	98,300	27.500	2,703,250.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	52,800	39.190	2,069,232.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	106,900	14.110	1,508,359.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	159,500	6.670	1,063,865.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	133,400	3.820	509,588.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	14.120	600,100.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	6,000	1,704.920	10,229,520.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	194,300	5.710	1,109,453.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	59,700	20.950	1,250,715.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	38,700	23.090	893,583.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.000	191,500.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	120,200	22.620	2,718,924.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	7.330	605,458.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	2.900	667,870.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	228,800	4.760	1,089,088.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	9.500	527,250.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.680	401,576.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	29,600	26.360	780,256.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	66,400	4.540	301,456.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	124,800	4.340	541,632.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	133,600	6.110	816,296.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	21.820	506,224.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	14.060	580,678.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	7.780	459,020.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	25.980	303,966.000	

POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	55,700	9.770	544,189.000	
CRRC CORP LTD	141,700	5.180	734,006.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	33,352	45.590	1,520,517.680	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	19.620	341,388.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	14.140	569,842.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	85,600	5.530	473,368.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,600	30.160	199,056.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	25,700	20.800	534,560.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	12.990	626,118.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.090	414,317.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	6.350	356,870.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	27.200	337,280.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	7.070	186,648.000	
GEMDALE CORP	39,700	4.910	194,927.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	33,300	13.730	457,209.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	16,000	76.190	1,219,040.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.240	333,688.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	103,500	11.670	1,207,845.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	8.870	488,737.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	12.750	487,050.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	41,712	21.260	886,797.120	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.930	176,714.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	82.300	806,540.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	9.310	287,679.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.570	349,325.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	71.650	315,260.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.300	82,500.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	37,200	5.230	194,556.000	

AIR CHINA LTD	44,800	7.920	354,816.000	
TBEA CO LTD	24,180	13.470	325,704.600	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	6.350	276,225.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	3.070	172,534.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	4.970	517,874.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	21,200	27.590	584,908.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	34.500	358,800.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	29.090	200,721.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	17.260	257,174.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	4.220	144,746.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	5,800	16.580	96,164.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	25,200	9.370	236,124.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	8.620	284,460.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	14.580	345,546.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	17.400	198,360.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	34.800	323,640.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	7.180	411,414.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	15,853	7.390	117,153.670	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	48,070	9.930	477,335.100	
CMOC GROUP LIMITED	53,400	4.900	261,660.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	37,900	10.600	401,740.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	5.970	201,786.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	50.960	458,640.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	22.780	458,333.600	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	21.450	167,310.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	9.300	257,610.000	
PEOPLE.CN CO LTD	7,000	33.080	231,560.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	84,500	2.960	250,120.000	

HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.420	380,986.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	21,000	19.520	409,920.000	
YUTONG BUS CO LTD	23,900	13.250	316,675.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	6.050	259,545.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	4.100	325,950.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	14.090	211,617.710	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	5.270	305,660.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	21.340	164,318.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	29.460	302,377.440	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	17.940	291,525.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	17.000	56,100.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	6.040	272,404.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.500	147,500.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	36.450	371,790.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.550	180,495.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.630	169,728.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	36.950	169,970.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	7.590	127,512.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	800	26.430	21,144.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	14,200	7.740	109,908.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	8.620	192,657.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	3.740	147,356.000	
HISENSE VISUAL TECHNOLOGY CO LTD	300	22.330	6,699.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	5.670	111,132.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	12.630	294,279.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,500	242.200	605,500.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	6.670	227,447.000	

SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	6,380	231.500	1,476,970.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	10.390	130,914.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	5.750	326,600.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	6.370	159,250.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	1,250	39.000	48,750.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	16.110	327,033.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	2.830	82,636.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	2,700	31.220	84,294.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	8.690	277,211.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	12.820	161,532.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	12.550	327,555.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	29.590	124,278.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.490	258,068.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	7.590	360,221.400	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	15.470	196,469.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	15.100	88,033.000	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	10.280	200,460.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.360	145,848.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	9.240	206,976.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	20,900	16.880	352,792.000	
TONGWEI CO LTD	17,000	23.660	402,220.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	10,654	46.930	499,992.220	
JCET GROUP CO LTD	10,900	29.750	324,275.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	23.150	157,420.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	67.090	167,725.000	

SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	30.880	163,664.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	28.570	299,699.300	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	89.970	152,949.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	10.080	204,079.680	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	2.350	146,640.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	13.600	179,520.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	3,924	52.770	207,069.480	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	6.930	135,828.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	12.090	236,964.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	10.960	215,912.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	13.760	216,032.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	2,210	62.710	138,589.100	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	35.600	174,440.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	18.150	101,640.000	
SHEDE SPIRITS CO LTD	2,100	94.400	198,240.000	
BTG HOTELS GROUP CO LTD	14,800	16.470	243,756.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	42.400	178,080.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,500	48.490	72,735.000	
YUNNAN BOTANEE BIO- TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	68.010	61,209.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	1,540	59.930	92,292.200	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	29.130	75,738.000	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	1,000	189.180	189,180.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	67.810	108,496.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	105.140	147,196.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	45.700	324,470.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	26.480	293,928.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	4.440	673,992.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	24.050	278,980.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	67,300	5.630	378,899.000	

PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	100.510	100,510.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	840	245.000	205,800.000	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	2,320	81.660	189,451.200	
3PEAK INC	1,200	153.990	184,788.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	160	44.030	7,044.800	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,800	80.340	626,652.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	43,468	20.730	901,091.640	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	15.990	203,073.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	132.910	239,238.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	4.840	354,772.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	30.950	315,690.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	40,151	19.240	772,505.240	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	27,119	36.350	985,775.650	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	4,400	51.020	224,488.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	28.040	196,280.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	8.690	114,708.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	70.400	492,800.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	1,000	13.030	13,030.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	14.740	599,918.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	7.040	739,200.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	45.710	155,414.000	
SERES GROUP CO LTD	9,000	78.990	710,910.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	68.840	364,852.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,800	48.610	136,108.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	6.540	544,128.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	12,200	9.820	119,804.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	18.330	208,962.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	57.130	79,982.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	17.580	35,160.000	

	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	4,100	12.240	50,184.000	
	JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	950	35.900	34,105.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	12.240	372,096.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	6.870	290,601.000	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	3,200	74.410	238,112.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	15.370	282,808.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,012	22.410	89,908.920	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,004	36.170	144,824.680	
	G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	500	268.080	134,040.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	46.870	137,797.800	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	17.100	193,401.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	8.680	427,924.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	51.170	337,722.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.630	250,080.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	37.510	168,795.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	103,500	2.380	246,330.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	11.930	127,651.000	
	オフショア・人民元 小計	13,954,547		178,314,815.340 (3,606,488,466)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	374,259	15.500	5,801,014.500	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	257,559	5.221	1,344,715.530	
	OORED00 QSC	60,920	10.000	609,200.000	
	QATAR FUEL QSC	46,222	15.720	726,609.840	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,416	16.840	630,085.440	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	69,658	9.904	689,892.830	
	INDUSTRIES QATAR QSC	122,724	12.020	1,475,142.480	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	132,031	18.110	2,391,081.410	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	190,107	3.230	614,045.610	
	MASRAF AL RAYAN	463,723	2.366	1,097,168.610	
	BARWA REAL ESTATE CO	209,228	2.701	565,124.820	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	382,470	1.565	598,565.550	

	DUKHAN BANK	131,518	3.812	501,346.610	
カタール・リアル	小計	2,477,835		17,043,993.230 (680,566,650)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	665,826	0.700	466,078.200	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	152,316	0.492	74,939.470	
	GULF BANK KSCP	146,991	0.269	39,540.570	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	606,206	0.879	532,855.070	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	125,143	0.527	65,950.360	
	MABANEE CO KPSC	61,792	0.820	50,669.440	
	BOUBYAN BANK KSCP	107,429	0.583	62,631.100	
クウェート・ディナール	小計	1,865,703		1,292,664.210 (610,434,820)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	39,057	15,800.000	617,100,600.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,049	31,980.000	641,167,020.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	37,131	27,900.000	1,035,954,900.000	
コロンビア・ペソ	小計	96,237		2,294,222,520.000 (83,592,292)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	21,587	37.500	809,512.500	
	JARIR MARKETING CO	45,430	14.620	664,186.600	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	5,690	130.600	743,114.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	30,535	46.000	1,404,610.000	
	SAUDI BRITISH BANK	81,756	34.100	2,787,879.600	
	AL RAJHI BANK	158,494	78.500	12,441,779.000	
	ARAB NATIONAL BANK	54,333	23.500	1,276,825.500	
	BANK ALBILAD	39,341	37.950	1,492,990.950	
	BANK AL-JAZIRA	29,917	17.140	512,777.380	
	BANQUE SAUDI FRANSI	47,778	36.900	1,763,008.200	
	RIYAD BANK	118,733	27.250	3,235,474.250	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,345	14.880	615,213.600	
	SAUDI TELECOM CO	162,535	38.400	6,241,344.000	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,341	133.200	2,443,021.200	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	73,081	79.900	5,839,171.900	
	SAUDI ELECTRICITY CO	67,449	18.320	1,235,665.680	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	27,847	22.100	615,418.700	
	SAVOLA GROUP	20,951	37.850	792,995.350	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	23,986	12.020	288,311.720	
ALMARAI CO JSC	19,978	57.700	1,152,730.600		

	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,024	161.600	488,678.400	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	31,604	33.050	1,044,512.200	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,164	37.150	377,592.600	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	60,476	11.080	670,074.080	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	46,657	14.780	689,590.460	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	29,849	11.000	328,339.000	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	36,059	14.720	530,788.480	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,510	213.200	1,387,932.000	
	ALINMA BANK	79,834	36.000	2,874,024.000	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	104,013	38.500	4,004,500.500	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,975	115.000	917,125.000	
	DALLAH HEALTHCARE CO	2,553	173.200	442,179.600	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	215,578	32.950	7,103,295.100	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	7,189	279.600	2,010,044.400	
	ACWA POWER CO	7,732	233.800	1,807,741.600	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	3,981	136.000	541,416.000	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,248	331.600	745,436.800	
	NAHDI MEDICAL CO	3,277	132.200	433,219.400	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,500	181.600	635,600.000	
	ELM CO	1,951	781.200	1,524,121.200	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	6,635	58.000	384,830.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	239,164	34.950	8,358,781.800	
	サウジアラビア・リアル 小計	1,999,080		83,655,853.350 (3,248,356,786)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	94,700	26.000	2,462,200.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	303,000	18.200	5,514,600.000	
	CP AXTRA PCL NVDR	159,300	26.250	4,181,625.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	45,400	127.000	5,765,800.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,317,300	1.560	3,614,988.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	650,500	6.750	4,390,875.000	
	SHIN CORP PCL	70,700	69.750	4,931,325.000	

CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	18.800	5,640,000.000	
ADVANCED INFO SERVICE PCL	93,000	220.000	20,460,000.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	548,420	12.000	6,581,040.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	252,700	81.000	20,468,700.000	
PTT PCL	795,100	35.750	28,424,825.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	80,500	46.250	3,723,125.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	656,100	7.650	5,019,165.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	63,750	292.000	18,615,000.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	357,600	60.000	21,456,000.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	177,700	65.500	11,639,350.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	880,200	25.750	22,665,150.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	48,200	214.000	10,314,800.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	296,710	27.250	8,085,347.500	
THAI OIL PCL NVDR	89,000	51.000	4,539,000.000	
CP ALL PCL NVDR	455,000	52.750	24,001,250.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	643,100	7.300	4,694,630.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	113,645	142.000	16,137,590.000	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	135,122	25.500	3,445,611.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	183,408	38.750	7,107,060.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	142,900	44.250	6,323,325.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	629,900	8.100	5,102,190.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	238,100	45.500	10,833,550.000	
OSOTSPA PCL NVDR	90,600	21.500	1,947,900.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	527,100	3.720	1,960,812.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	157,833	38.750	6,116,028.750	
SCG PACKAGING PCL NVDR	97,800	38.250	3,740,850.000	
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	277,100	20.000	5,542,000.000	
SCB X PCL NVDR	67,700	99.250	6,719,225.000	
TRUE CORP PCL NVDR	896,328	5.150	4,616,089.200	
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	58,700	43.250	2,538,775.000	
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	76,900	46.750	3,595,075.000	
タイ・パーツ 小計	13,071,116		332,914,876.450	

				(1,368,280,142)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,881	710.500	4,178,450.500	
	CEZ	12,777	987.500	12,617,287.500	
	MONETA MONEY BANK AS	33,423	92.000	3,074,916.000	
チェコ・コルナ	小計	52,081		19,870,654.000 (127,428,517)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,279,808	43.000	227,031,744.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	6,880	23,999.000	165,113,120.000	
	BANCO DE CHILE	3,730,618	98.700	368,211,996.600	
	EMPRESAS CMPC SA	84,902	1,713.700	145,496,557.400	
	EMPRESAS COPEC SA	29,969	6,537.500	195,922,337.500	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,173,923	51.680	60,668,340.640	
	ENEL AMERICAS SA	1,683,461	101.900	171,544,675.900	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	13,823,587	8.370	115,703,423.190	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	11,218	46,190.000	518,159,420.000	
	FALABELLA SA	78,482	2,197.900	172,495,587.800	
	CENCOSUD SA	115,184	1,663.000	191,550,992.000	
	ENEL CHILE SA	2,550,215	57.840	147,504,435.600	
チリ・ペソ	小計	28,568,247		2,479,402,630.630 (412,823,017)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	260,385	34.960	9,103,059.600	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	117,614	46.180	5,431,414.520	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	107,671	39.340	4,235,777.140	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,691	809.500	4,606,864.500	
	HEKTAS TICARET TAS	78,592	21.100	1,658,291.200	
	KOC HOLDING AS	60,321	141.800	8,553,517.800	
	SASA POLYESTER SANAYI	105,230	49.700	5,229,931.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	109,000	47.440	5,170,960.000	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	9,553	225.000	2,149,425.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,287	254.000	11,248,898.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	104,797	58.500	6,130,624.500	
	TURKIYE IS BANKASI	262,880	22.260	5,851,708.800	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	81,358	152.600	12,415,230.800	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	281,190	19.670	5,531,007.300	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	82,771	61.850	5,119,386.350	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	37,811	321.750	12,165,689.250	
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	78,429	21.940	1,720,732.260		

	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	3,431	714.500	2,451,449.500	
トルコ・リラ 小計		1,831,011		108,773,967.520 (546,241,110)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	11,459	8,930.000	102,328,870.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	36,818	2,766.000	101,838,588.000	
	OTP BANK NYRT	19,154	14,780.000	283,096,120.000	
ハンガリー・フォリント 小計		67,431		487,263,578.000 (200,724,820)	
フィリピン・ペ ソ	AYALA LAND INC	594,900	31.400	18,679,860.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	161,790	48.100	7,782,099.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	156,808	101.900	15,978,735.200	
	AYALA CORP	18,653	640.000	11,937,920.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	79,760	229.000	18,265,040.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	229,760	37.800	8,684,928.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	34,240	235.800	8,073,792.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	116,455	51.450	5,991,609.750	
	BDO UNIBANK INC	189,402	126.900	24,035,113.800	
	PLDT INC	5,690	1,252.000	7,123,880.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	820,375	32.650	26,785,243.750	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	75,450	112.800	8,510,760.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,383	826.000	16,010,358.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,420	372.600	9,098,892.000	
フィリピン・ペソ 小計		2,527,086		186,958,231.500 (490,597,095)	
ブラジル・レア ル	VALE SA	275,689	72.800	20,070,159.200	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	62,900	9.570	601,953.000	
	RAIA DROGASIL SA	104,664	28.190	2,950,478.160	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,450	45.150	923,317.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	98,300	40.900	4,020,470.000	
	BANCO DO BRASIL SA	70,700	54.450	3,849,615.000	
	ITAUSA SA	437,907	9.860	4,317,763.020	
	GERDAU SA	93,181	22.510	2,097,504.310	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	298,710	36.660	10,950,708.600	
	VIBRA ENERGIA SA	98,600	22.500	2,218,500.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	389,112	34.490	13,420,472.880	
	CCR SA	79,920	14.050	1,122,876.000	
	WEG SA	135,644	34.650	4,700,064.600	
	BANCO BRADESCO SA PREF	438,202	16.460	7,212,804.920	

BANCO BRADESCO SA	126,592	14.510	1,836,849.920		
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	48,206	17.200	829,143.200		
SUZANO SA	62,875	50.770	3,192,163.750		
CPFL ENERGIA SA	16,900	37.050	626,145.000		
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	395,847	32.020	12,675,020.940		
ENGIE BRASIL SA	15,287	43.750	668,806.250		
LOCALIZA RENT A CAR	74,689	61.080	4,562,004.120		
LOJAS RENNER SA	82,820	16.450	1,362,389.000		
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	61,204	25.900	1,585,183.600		
COSAN SA	98,200	17.520	1,720,464.000		
TOTVS SA	44,400	34.360	1,525,584.000		
EQUATORIAL ENERGIA SA	81,000	34.250	2,774,250.000		
JBS SA	62,900	23.880	1,502,052.000		
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	109,262	10.920	1,193,141.040		
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,198	67.660	1,840,216.680		
ENEVA SA	68,200	12.730	868,186.000		
HYPERA SA	29,800	35.560	1,059,688.000		
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	462,648	13.540	6,264,253.920		
MAGAZINE LUIZA SA	239,400	2.130	509,922.000		
PRIOR SA	63,800	44.550	2,842,290.000		
TELEFONICA BRASIL SA	33,228	53.500	1,777,698.000		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	58,100	31.110	1,807,491.000		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	412,761	4.350	1,795,510.350		
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	54,800	11.060	606,088.000		
AMBEV SA	382,795	14.310	5,477,796.450		
NATURA &CO HOLDING SA	68,800	16.930	1,164,784.000		
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	109,000	11.980	1,305,820.000		
TIM SA	70,700	17.910	1,266,237.000		
REDE D'OR SAO LUIZ SA	46,300	26.500	1,226,950.000		
RUMO SA	105,100	22.170	2,330,067.000		
ブラジル・リアル 小計	6,116,791		146,652,882.410 (4,322,476,387)		
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	560.000	752,640.000	
	BUDIMEX SA	1,092	576.000	628,992.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,918	117.950	1,287,778.100	
	BANK PEKAO SA	14,797	147.600	2,184,037.200	
	ORLEN SA	46,737	62.010	2,898,161.370	
	LPP SA	92	16,260.000	1,495,920.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,835	510.500	1,447,267.500	

	CD PROJEKT RED SA	4,671	112.150	523,852.650	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	69,851	49.540	3,460,418.540	
	CYFROWY POLSAT SA	21,710	13.140	285,269.400	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	79,636	8.880	707,167.680	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	48,154	48.160	2,319,096.640	
	DINO POLSKA SA	3,987	454.300	1,811,294.100	
	ALLEGRO.EU SA	41,696	30.225	1,260,261.600	
	PEPCO GROUP NV	16,587	24.500	406,381.500	
	ポーランド・ズロチ 小計	364,107		21,468,538.280 (775,057,169)	
マレーシア・リ ンギット	AMMB HOLDINGS BHD	168,600	4.020	677,772.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	522,200	5.760	3,007,872.000	
	CELCOMDIGI BHD	272,700	4.060	1,107,162.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	88,120	7.080	623,889.600	
	RHB BANK BHD	103,780	5.500	570,790.000	
	GAMUDA BHD	156,100	4.460	696,206.000	
	GENTING BHD	164,900	4.600	758,540.000	
	HONG LEONG BANK BHD	49,008	19.160	938,993.280	
	IOI CORP BHD	223,013	3.960	883,131.480	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,500	21.520	936,120.000	
	MALAYAN BANKING BHD	444,275	9.040	4,016,246.000	
	MISC BHD	102,180	7.100	725,478.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,200	117.500	728,500.000	
	PPB GROUP BHD	55,660	14.180	789,258.800	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,900	21.620	495,098.000	
	PETRONAS GAS BHD	61,000	16.700	1,018,700.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	240,100	2.640	633,864.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,300	5.230	498,419.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	213,550	9.910	2,116,280.500	
	QL RESOURCES BHD	102,850	5.470	562,589.500	
	DIALOG GROUP BHD	292,144	1.970	575,523.680	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	1,147,850	4.240	4,866,884.000	
	SIME DARBY BERHAD	234,400	2.360	553,184.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	239,500	2.330	558,035.000	
	MAXIS BHD	175,800	3.860	678,588.000	
	INARI AMERTRON BHD	221,900	2.830	627,977.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	217,400	7.060	1,534,844.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	192,300	5.860	1,126,878.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	284,100	4.800	1,363,680.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	161,500	4.430	715,445.000	

	MR DIY GROUP M BHD	245,100	1.540	377,454.000	
マレーシア・リンギット 小計		6,547,930		34,763,402.840 (1,080,390,939)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	262,900	12.890	3,388,781.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	107,100	87.270	9,346,617.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,360	321.180	5,254,504.800	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	15,860	172.560	2,736,801.600	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	44,800	161.020	7,213,696.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	211,800	166.060	35,171,508.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	87,025	36.300	3,159,007.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,495	256.470	3,974,002.650	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	121,600	34.830	4,235,328.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	15,465	402.900	6,230,848.500	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	254,352	80.250	20,411,748.000	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	158,000	42.630	6,735,540.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,800	181.290	7,759,212.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	429,800	66.110	28,414,078.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	32,490	256.040	8,318,739.600	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	22,800	155.350	3,541,980.000	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	104,000	22.090	2,297,360.000	
AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,549,478	15.890	24,621,205.420		
BANCO DEL BAJIO SA	69,500	53.830	3,741,185.000		
メキシコ・ペソ 小計		3,561,625		186,552,143.070 (1,563,437,545)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	54,745	3.126	171,132.870	
	ALPHA BANK A.E.	185,624	1.485	275,651.640	
	NATIONAL BANK OF GREECE	65,590	5.956	390,654.040	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,083	13.300	213,903.900	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	201,792	1.608	324,481.530	
	MYTILINEOS HOLDINGS	7,737	36.000	278,532.000	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,506	24.860	136,879.160	
	OPAP SA	16,204	14.860	240,791.440	
	JUMBO SA	9,500	25.500	242,250.000	
	PUBLIC POWER CORP	16,875	10.800	182,250.000	

ユーロ 小計		582,786		2,456,526.580 (384,642,932)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	92,300.000	158,756,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,928	109,400.000	320,323,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,478	252,500.000	625,695,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,655	84,900.000	310,309,500.000	
	COWAY CO LTD	4,084	53,100.000	216,860,400.000	
	KT&G CORP	7,940	90,800.000	720,952,000.000	
	KAKAO CORP	25,233	51,700.000	1,304,546,100.000	
	KUM YANG CO LTD	2,599	116,000.000	301,484,000.000	
	HANWHA OCEAN CO LTD	4,022	25,750.000	103,566,500.000	
	SK TELECOM CO LTD	3,745	49,900.000	186,875,500.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	23,496	7,160.000	168,231,360.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,142	238,500.000	272,367,000.000	
	LG UPLUS CORP	17,131	10,320.000	176,791,920.000	
	DOOSAN ENERBILITY	36,105	15,720.000	567,570,600.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	4,225	56,900.000	240,402,500.000	
	LG H&H CO LTD	762	320,500.000	244,221,000.000	
	LG CHEM LTD	4,014	478,500.000	1,920,699,000.000	
	LG CHEM LTD	599	302,000.000	180,898,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	35,462	36,650.000	1,299,682,300.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	19,891	15,750.000	313,283,250.000	
	S-OIL CORP	3,289	66,700.000	219,376,300.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	9,175	31,400.000	288,095,000.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,664	39,550.000	224,011,200.000	
	POSCO FUTURE M CO LTD	2,535	343,000.000	869,505,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,749	159,800.000	279,490,200.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	2,521	64,300.000	162,100,300.000	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,314	109,400.000	362,551,600.000	
	HYUNDAI MOBIS	4,901	226,500.000	1,110,076,500.000	
	SK HYNIX INC	44,244	127,500.000	5,641,110,000.000	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,695	36,100.000	205,589,500.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	1,864	108,100.000	201,498,400.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	11,041	185,100.000	2,043,689,100.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,036	80,100.000	163,083,600.000		
HYUNDAI STEEL CO	7,149	34,750.000	248,427,750.000		
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,785	11,860.000	258,370,100.000		
KIA CORPORATION	20,809	86,400.000	1,797,897,600.000		
KOREA ZINC CO LTD	676	498,500.000	336,986,000.000		

KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,377	19,340.000	413,431,180.000	
KOREAN AIR CO LTD	14,033	22,700.000	318,549,100.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,209	126,100.000	152,454,900.000	
KT CORP	5,536	34,500.000	190,992,000.000	
HLB INC	8,598	33,350.000	286,743,300.000	
LG ELECTRONICS INC	8,590	94,600.000	812,614,000.000	
LG CORP	7,447	82,400.000	613,632,800.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,234	10,490.000	96,864,660.000	
NAVER CORP	10,646	217,500.000	2,315,505,000.000	
L&F CO LTD	2,034	188,000.000	382,392,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,443	61,500.000	211,744,500.000	
KANGWON LAND INC	9,245	16,130.000	149,121,850.000	
POSCO HOLDINGS INC	5,858	471,500.000	2,762,047,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	12,226	25,300.000	309,317,800.000	
COSMOAM&T CO LTD	2,095	156,700.000	328,286,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,431	450,000.000	1,993,950,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,412	150,900.000	665,770,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	386,689	72,600.000	28,073,621,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	53,776	7,890.000	424,292,640.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,128	131,300.000	410,706,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	65,955	58,400.000	3,851,772,000.000	
YUHAN CORP	4,477	65,800.000	294,586,600.000	
HANON SYSTEMS	13,064	6,970.000	91,056,080.000	
GS HOLDINGS CORP	3,803	41,950.000	159,535,850.000	
LG DISPLAY CO LTD	18,254	12,430.000	226,897,220.000	
CELLTRION INC	8,929	167,700.000	1,497,393,300.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3,934	60,300.000	237,220,200.000	
HANA FINANCIAL GROUP	23,702	41,450.000	982,447,900.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,673	176,400.000	295,117,200.000	
CELLTRION PHARM INC	1,764	82,800.000	146,059,200.000	
POSCO ICT CO LTD	4,364	49,400.000	215,581,600.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,524	69,200.000	451,460,800.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,280	125,400.000	285,912,000.000	
JYP ENTERTAINMENT CORP	2,605	94,400.000	245,912,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,838	135,600.000	656,032,800.000	
ECOPRO CO LTD	1,628	667,000.000	1,085,876,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	713	316,500.000	225,664,500.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,252	236,500.000	296,098,000.000	
SK INC	2,931	170,800.000	500,614,800.000	

	KB FINANCIAL GROUP INC	31,057	51,800.000	1,608,752,600.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,645	47,050.000	265,597,250.000	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,375	58,500.000	489,937,500.000	
	HANMI PHARM CO LTD	574	328,000.000	188,272,000.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,531	46,400.000	256,638,400.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	3,720	61,300.000	228,036,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,013	111,300.000	224,046,900.000	
	NETMARBLE CORP	2,112	59,400.000	125,452,800.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	49,019	12,810.000	627,933,390.000	
	ECOPRO BM CO LTD	3,992	313,000.000	1,249,496,000.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,801	90,200.000	252,650,200.000	
	KRAFTON INC	2,300	207,000.000	476,100,000.000	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,996	123,100.000	245,707,600.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,878	86,500.000	162,447,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	8,026	49,600.000	398,089,600.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,340	70,000.000	163,800,000.000	
	HYBE CO LTD	1,649	237,500.000	391,637,500.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,782	430,500.000	1,628,151,000.000	
	KAKAObANK CORP	13,292	26,000.000	345,592,000.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,268	79,800.000	101,186,400.000	
	KAKAOPAY CORP	2,237	48,400.000	108,270,800.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,071	165,600.000	508,557,600.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,453	124,800.000	805,334,400.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,418	709,000.000	1,005,362,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,320	38,950.000	90,364,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,542	43,000.000	195,306,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,659	73,900.000	639,900,100.000	
	韓国・ウォン 小計	1,276,445		89,485,268,200.000 (9,897,070,663)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	88,000	10.520	925,760.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	6.920	705,840.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	160,000	3.430	548,800.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	8,700	120.290	1,046,523.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	109,000	17.220	1,876,980.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,500	25.650	1,090,125.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	350,000	4.100	1,435,000.000	

ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	482,000	4.250	2,048,500.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	181,000	13.760	2,490,560.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	54,000	27.250	1,471,500.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	234,000	4.120	964,080.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	713,600	6.630	4,731,168.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	324,120	12.960	4,200,595.200	
CHINA RESOURCES LAND LTD	266,888	25.700	6,859,021.600	
CITIC LTD	469,000	7.160	3,358,040.000	
LENOVO GROUP LTD	582,000	9.560	5,563,920.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,696,000	4.860	8,242,560.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	116,390	6.600	768,174.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,989,200	3.900	7,757,880.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	74,000	13.240	979,760.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	221,000	10.380	2,293,980.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	63,500	50.000	3,175,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	286,000	6.870	1,964,820.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	94,000	5.280	496,320.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	157,200	6.640	1,043,808.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	120,000	9.930	1,191,600.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	310,000	3.560	1,103,600.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	199,000	7.090	1,410,910.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	54,500	17.780	969,010.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	491,000	7.830	3,844,530.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	83,200	24.550	2,042,560.000	
BYD CO LTD	84,500	210.800	17,812,600.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	8.030	1,284,800.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	284,592	2.380	677,328.960	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	218,000	5.900	1,286,200.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,000	93.200	932,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	553,788	8.850	4,901,023.800	

AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.310	724,890.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	153,200	14.980	2,294,936.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	190,000	10.180	1,934,200.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	597,000	9.970	5,952,090.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	429,000	11.640	4,993,560.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	194,400	7.020	1,364,688.000	
WEICHAI POWER CO LTD	152,440	13.400	2,042,696.000	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	7.170	817,380.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	9.210	1,657,800.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	52,000	51.200	2,662,400.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	262,000	5.180	1,357,160.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	220,000	3.860	849,200.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	129,333	33.650	4,352,055.450	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	94,000	4.790	450,260.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	823,250	3.370	2,774,352.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	247,000	20.900	5,162,300.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	539,400	305.600	164,840,640.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	541,500	33.750	18,275,625.000	
LI NING CO LTD	192,000	21.350	4,099,200.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	456,000	1.510	688,560.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	438,000	2.860	1,252,680.000	
AIR CHINA / HONG KONG	156,000	5.150	803,400.000	
ZTE CORP	63,288	16.720	1,058,175.360	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	270,500	24.650	6,667,825.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,250	6.980	1,732,785.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	686,205	4.630	3,177,129.150	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	180,250	8.610	1,551,952.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	64,500	20.850	1,344,825.000	
BAIDU INC	182,250	111.800	20,375,550.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,770,530	4.440	34,501,153.200	

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	67,200	78.250	5,258,400.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	202,000	3.860	779,720.000	
MINTH GROUP LTD	66,000	15.700	1,036,200.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	3.650	591,300.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	342,000	3.340	1,142,280.000	
BANK OF CHINA LTD	6,396,200	2.820	18,037,284.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	77,500	7.590	588,225.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	315,970	25.400	8,025,638.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,278,235	3.630	19,159,993.050	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	95,000	9.480	900,600.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	95,500	6.740	643,670.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	147,600	3.280	484,128.000	
CHINA COAL ENERGY CO	140,000	6.700	938,000.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	18.880	1,038,400.000	
ZHUZHOU CRRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	37,600	23.800	894,880.000	
CMOC GROUP LIMITED	315,000	4.060	1,278,900.000	
CHINA CITIC BANK-H	724,800	3.550	2,573,040.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	56,900	68.200	3,880,580.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	103,400	73.400	7,589,560.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	19.540	683,900.000	
FOSUN INTERNATIONAL	212,528	4.220	896,868.160	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	316,000	3.390	1,071,240.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,200	25.100	1,912,620.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,582,000	1.090	1,724,380.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	62,500	15.000	937,500.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	351,000	3.340	1,172,340.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	141,000	5.280	744,480.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	63,500	31.350	1,990,725.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	425,000	4.530	1,925,250.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	223,000	15.300	3,411,900.000	

CRRC CORP LTD - H	385,000	3.270	1,258,950.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	121,500	4.550	552,825.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	118,000	13.600	1,604,800.000	
SINOPHARM GROUP CO	104,000	18.700	1,944,800.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	214,527	3.460	742,263.420	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	204,000	5.660	1,154,640.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	289,000	5.600	1,618,400.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	70,400	10.840	763,136.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	178,800	10.300	1,841,640.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	97,000	7.340	711,980.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	155,000	12.300	1,906,500.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	69,000	14.680	1,012,920.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	531,656	2.570	1,366,355.920	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.200	499,400.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,278,000	2.830	6,446,740.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	73,000	17.060	1,245,380.000	
FAR EAST HORIZON LTD	127,000	5.850	742,950.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	61,200	8.020	490,824.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	146,000	15.460	2,257,160.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	239,600	4.140	991,944.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	672,000	2.440	1,639,680.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	16.480	758,080.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	287,500	4.040	1,161,500.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	667,000	3.570	2,381,190.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	102,000	20.200	2,060,400.000	

EAST BUY HOLDING LTD	32,500	33.650	1,093,625.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	175,000	6.540	1,144,500.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	41,400	18.120	750,168.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	64,000	14.600	934,400.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,522,000	0.810	2,852,820.000	
XIAOMI CORP	1,239,000	14.620	18,114,180.000	
BEIGENE LTD	56,400	106.700	6,017,880.000	
WUXI APPTec CO LTD	30,612	81.150	2,484,163.800	
MEITUAN	410,510	86.650	35,570,691.500	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	112,400	13.700	1,539,880.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	136,000	14.500	1,972,000.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,000	4.120	1,590,320.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	99,500	39.750	3,955,125.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	500,000	0.730	365,000.000	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	40,300	38.650	1,557,595.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	133,000	5.750	764,750.000	
HANSON PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	88,000	14.400	1,267,200.000	
CHINA FEIHE LTD	336,000	4.230	1,421,280.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,316,768	70.500	92,832,144.000	
JD.COM INC	189,535	104.800	19,863,268.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	140,000	6.280	879,200.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	75.700	575,320.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	188,800	53.850	10,166,880.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	198,800	21.300	4,234,440.000	
BILIBILI INC	15,640	93.450	1,461,558.000	
AKESO INC	40,000	43.200	1,728,000.000	
NETEASE INC	156,800	165.000	25,872,000.000	
GDS HOLDINGS LTD	90,500	8.640	781,920.000	
ZAI LAB LTD	70,500	20.950	1,476,975.000	
NONGFU SPRING CO LTD	158,200	44.950	7,111,090.000	
LI AUTO INC	93,200	135.700	12,647,240.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	88,050	37.050	3,262,252.500	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	30,400	41.400	1,258,560.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	62,400	26.550	1,656,720.000	

	CHINA VANKE CO LTD-H	163,161	7.090	1,156,811.490	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	121,200	62.850	7,617,420.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	35,600	19.940	709,864.000	
	JD LOGISTICS INC	148,100	9.160	1,356,596.000	
	TRIP.COM GROUP LTD	44,350	260.800	11,566,480.000	
	XPENG INC	79,000	60.400	4,771,600.000	
	MINISO GROUP HOLDING LTD	28,600	39.850	1,139,710.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	42,000	16.860	708,120.000	
	CGN POWER CO LTD	826,000	1.860	1,536,360.000	
	GF SECURITIES CO LTD	83,200	9.670	804,544.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	48,400	35.350	1,710,940.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	115,800	9.800	1,134,840.000	
	3SBIO INC	127,500	7.160	912,900.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	95,500	4.730	451,715.000	
	CHINA LITERATURE LTD	38,600	27.450	1,059,570.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	25,000	11.960	299,000.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	100,000	5.890	589,000.000	
	BOC AVIATION LTD	18,100	55.500	1,004,550.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	61,200	19.120	1,170,144.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	98,000	13.320	1,305,360.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	122,800	11.240	1,380,272.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	309,500	29.350	9,083,825.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	520,000	1.840	956,800.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	33,040	26.800	885,472.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	15.120	907,200.000	
	香港・ドル 小計	67,811,256		855,143,044.560 (15,922,763,487)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	41,505	532.000	22,080,660.000	
	ACER INC	241,110	35.200	8,487,072.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	57,738	398.500	23,008,593.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	39,334	444.500	17,483,963.000	
	ASIA CEMENT CORP	203,290	41.800	8,497,522.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	556,935	13.500	7,518,622.500	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	79,495	78.700	6,256,256.500	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	41,042	258.500	10,609,357.000	

MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,335	179.000	10,262,965.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	110,686	174.500	19,314,707.000	
QUANTA COMPUTER INC	221,492	203.000	44,962,876.000	
EVA AIRWAYS CORP	191,977	32.350	6,210,455.950	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	44,975	184.500	8,297,887.500	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	469,004	17.850	8,371,721.400	
CHINA AIRLINES	231,823	21.650	5,018,967.950	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	160,684	45.000	7,230,780.000	
CHINA STEEL CORP	949,704	26.100	24,787,274.400	
ADVANTECH CO LTD	37,817	352.000	13,311,584.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	343,344	31.200	10,712,332.800	
DELTA ELECTRONICS INC	157,087	312.500	49,089,687.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	112,226	72.100	8,091,494.600	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	304,804	120.500	36,728,882.000	
AUO CORP	526,500	16.600	8,739,900.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	139,574	99.100	13,831,783.400	
EVERGREEN MARINE CORP	83,315	118.500	9,872,827.500	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	225,768	30.950	6,987,519.600	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	40,131	182.000	7,303,842.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	14,780	577.000	8,528,060.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	47,194	508.000	23,974,552.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	303,987	80.000	24,318,960.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	281,888	63.300	17,843,510.400	
MEDIATEK INC	123,366	943.000	116,334,138.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	631,886	63.200	39,935,195.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	678,042	22.100	14,984,728.200	
HOTAI MOTOR CO LTD	24,801	701.000	17,385,501.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	125,016	81.600	10,201,305.600	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	808,482	26.550	21,465,197.100	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	789,260	44.850	35,398,311.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,307,205	12.450	16,274,702.250	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,122,221	25.600	28,728,857.600	

HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,009,392	101.500	102,453,288.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	931,327	39.250	36,554,584.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,131	2,290.000	18,619,990.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	900,807	17.900	16,124,445.300	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,048,098	8.840	9,265,186.320	
INVENTEC CO LTD	216,699	42.300	9,166,367.700	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	165,759	113.000	18,730,767.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	842,432	19.250	16,216,816.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,415,862	27.500	38,936,205.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	850,200	27.600	23,465,520.000	
NAN YA PLASTICS CORP	380,616	67.600	25,729,641.600	
WISTRON CORP	214,789	92.600	19,889,461.400	
POU CHEN CORP	168,225	31.100	5,231,797.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	378,799	74.100	28,069,005.900	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,363	271.000	12,564,373.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	87,341	82.200	7,179,430.200	
E INK HOLDINGS INC	69,588	178.500	12,421,458.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121,517	36.600	4,447,522.200	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	112,538	67.700	7,618,822.600	
TAIWAN CEMENT CORP	552,189	34.600	19,105,739.400	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,992,751	570.000	1,135,868,070.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	902,277	48.550	43,805,548.350	
WAN HAI LINES LTD	51,482	51.100	2,630,730.200	
WALSIN LIHWA CORP	237,342	37.000	8,781,654.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	247,693	27.400	6,786,788.200	
YAGEO CORP	27,060	601.000	16,263,060.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	152,894	44.000	6,727,336.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	145,465	30.200	4,393,043.000	
GLOBAL UNICHIP CORP	6,904	1,895.000	13,083,080.000	
INNOLUX CORPORATION	691,396	12.900	8,919,008.400	
WPG HOLDINGS CO LTD	133,999	79.200	10,612,720.800	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	17,565	250.000	4,391,250.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	4,925	2,460.000	12,115,500.000	
PEGATRON CORP	160,827	81.700	13,139,565.900	

	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	6,039	3,335.000	20,140,065.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,248	1,010.000	11,360,480.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	124,224	181.000	22,484,544.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	5,851	1,105.000	6,465,355.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	61,247	103.000	6,308,441.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	800,565	26.750	21,415,113.750	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	301,591	45.850	13,827,947.350	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	4,934	1,535.000	7,573,690.000	
	WIWYNN CORP	8,037	1,750.000	14,064,750.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	246,182	129.500	31,880,569.000	
	SILERGY CORP	26,552	410.500	10,899,596.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	275,444	28.800	7,932,787.200	
	PHARMAESSENTIA CORP	17,593	338.000	5,946,434.000	
	MOMO.COM INC	6,487	510.000	3,308,370.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	17,128	579.000	9,917,112.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,658	348.500	5,108,313.000	
	台湾・ドル 小計	28,147,855		2,696,383,896.970 (12,488,571,657)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	23,375	236.610	5,530,758.750	
	CLICKS GROUP LTD	19,196	312.110	5,991,263.560	
	DISCOVERY LTD	43,836	134.070	5,877,092.520	
	GOLD FIELDS LTD	73,014	268.320	19,591,116.480	
	REMGRO LTD	42,134	149.000	6,277,966.000	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	43,521	112.500	4,896,112.500	
	EXXARO RESOURCES LTD	22,354	187.670	4,195,175.180	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,033	1,932.810	13,593,452.730	
	MTN GROUP LTD	135,709	105.130	14,267,087.170	
	FIRSTRAND LTD	407,476	66.500	27,097,154.000	
	NASPERS LTD	15,109	3,385.000	51,143,965.000	
	NEDBANK GROUP LTD	36,051	204.260	7,363,777.260	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,517	767.330	4,233,359.610	
	SASOL LTD	46,231	178.000	8,229,118.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,113	260.440	10,447,029.720	
	STANDARD BANK GROUP LTD	108,537	193.520	21,004,080.240	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77,293	68.300	5,279,111.900	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,167	186.160	5,615,888.720	

ABSA GROUP LTD	67,695	159.640	10,806,829.800	
SANLAM LTD	142,680	67.730	9,663,716.400	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	69,363	71.700	4,973,327.100	
KUMBA IRON ORE LTD	5,386	588.560	3,169,984.160	
OUTSURANCE GROUP LTD	70,350	43.000	3,025,050.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	51,270	99.000	5,075,730.000	
NEPI ROCKCASTLE NV	35,926	117.000	4,203,342.000	
OLD MUTUAL LTD	391,487	11.750	4,599,972.250	
REINET INVESTMENTS SCA	11,809	430.000	5,077,870.000	
PEPKOR HOLDINGS LTD	169,735	18.770	3,185,925.950	
SIBANYE STILLWATER LTD	224,039	22.180	4,969,185.020	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	29,798	115.330	3,436,603.340	
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	34,625	327.410	11,336,571.250	
BID CORP LTD	26,932	409.950	11,040,773.400	
南アフリカ・ランド 小計	2,507,761		305,198,390.010 (2,337,819,667)	
合計	603,929,919		78,370,789.997 (78,370,789,997)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	91,500.000	3,144,855.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	29,700.000	923,670.000	
		ENERGISA SA	19,800.000	1,032,570.000	
		KLABIN SA	59,500.000	1,234,030.000	
	ブラジル・レアル 小計		200,500.000	6,335,125.000 (186,722,741)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,226,875.000	15,127,368.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,100.000	6,633,090.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	158,335.000	35,334,038.600	
メキシコ・ペソ 小計		1,428,310.000	57,094,497.350 (478,491,853)		
投資信託受益証券 合計			1,628,810	665,214,594 (665,214,594)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	235,400.000	6,847,786.000	
	メキシコ・ペソ 小計		235,400.000	6,847,786.000 (57,389,240)	
投資証券 合計			235,400	57,389,240 (57,389,240)	
合計				722,603,834 (722,603,834)	

(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 46銘柄	2.69	-	-	2.88
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 11銘柄	1.19	-	-	1.27
インド・ルピー	株式 131銘柄	15.83	-	-	16.96
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.80	-	-	1.93
オフショア・人民元	株式 496銘柄	4.26	-	-	4.56
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.80	-	-	0.86
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.72	-	-	0.77
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 42銘柄	3.83	-	-	4.11
タイ・バーツ	株式 38銘柄	1.61	-	-	1.73
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.15	-	-	0.16
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.49	-	-	0.52
トルコ・リラ	株式 18銘柄	0.64	-	-	0.69
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.24	-	-	0.25
フィリピン・ペソ	株式 14銘柄	0.58	-	-	0.62
ブラジル・レアル	株式 44銘柄 投資信託受益証 券 4銘柄	5.10 -	- 0.22	- -	5.70
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.91	-	-	0.98
マレーシア・リンギット	株式 31銘柄	1.27	-	-	1.37
メキシコ・ペソ	株式 19銘柄 投資信託受益証 券 3銘柄 投資証券 1銘柄	1.84 - -	- 0.56 -	- - 0.07	2.65
ユーロ	株式 11銘柄	0.45	-	-	0.49
韓国・ウォン	株式 103銘柄	11.68	-	-	12.51
香港・ドル	株式 183銘柄	18.79	-	-	20.13
台湾・ドル	株式 90銘柄	14.74	-	-	15.79
南アフリカ・ランド	株式 32銘柄	2.76	-	-	2.96

（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12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,042,502,390
コール・ローン	215,273,871
国債証券	94,966,519,966
未収利息	736,721,293
前払費用	402,190,274
流動資産合計	97,363,207,794
資産合計	97,363,207,794
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,582
未払解約金	13,018,000
流動負債合計	13,019,582
負債合計	13,019,582
純資産の部	
元本等	
元本	43,685,016,199
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	53,665,172,013
元本等合計	97,350,188,212
純資産合計	97,350,188,212
負債純資産合計	97,363,207,794

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	61,950,342,126円
同期中追加設定元本額	31,430,824,598円
同期中一部解約元本額	49,696,150,525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）	102,591,971円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,077,719,275円
たわらノーロード バランス（堅実型）	187,824,710円
たわらノーロード バランス（標準型）	580,611,931円
たわらノーロード バランス（積極型）	256,542,998円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	954,123円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	5,020,145円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	68,284,843円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,715,854円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	5,934,260円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	66,803,835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）	409,557,576円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	795,019,732円
投資のソムリエ	13,462,857,089円
クルーズコントロール	330,444,850円
投資のソムリエ<DC年金>	1,255,186,877円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	309,123,412円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,404,199,550円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,815,728,422円
ワールドアセットバランス（基本コース）	365,283,783円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	655,385,244円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	73,869,596円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	37,008,654円

リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	11,955,997円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	254,864,686円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	841,360,920円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	223,669,844円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	92,048,555円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	39,957,839円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	24,545,136円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	5,644,905円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	4,232,944円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	16,925,856円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	9,730,726,520円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	407,993,238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）	550,009,048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）	146,859,148円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	5,994,302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）	110,237,448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）	65,842,671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）	2,609,668,333円
計	43,685,016,199円
2. 受益権の総数	43,685,016,199口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年12月11日現在
----	---------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		1,985,011,689
合計		1,985,011,689

(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12月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年12月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	100,000,000	-	100,001,582		1,582
アメリカ・ドル	100,000,000	-	100,001,582		1,582
合計	100,000,000	-	100,001,582		1,582

(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12月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,2285円 (22,285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12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	4,000,000.000	3,534,000.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	5,000,000.000	4,144,265.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	9,000,000.000	7,458,786.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	8,000,000.000	7,788,640.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	8,000,000.000	7,722,000.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	3,000,000.000	2,702,652.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,369,844.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	6,000,000.000	5,554,728.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	5,000,000.000	3,480,960.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	5,000,000.000	3,984,010.000	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	8,658,346.140	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	15,000,000.000	13,122,336.450	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	7,000,000.000	6,271,269.620	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	6,000,000.000	5,707,741.980	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	7,000,000.000	5,159,693.700	
		BRAZIL 6.0 10/20/33	8,000,000.000	7,813,591.920	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30		2,000,000.000	1,648,661.500
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26		4,000,000.000	3,645,148.640		

CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	1,000,000.000	970,689.740	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	7,000,000.000	5,695,396.070	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	6,000,000.000	4,717,209.660	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	11,000,000.000	8,422,689.000	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	4,000,000.000	2,487,353.640	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	2,000,000.000	1,943,366.520	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	4,000,000.000	2,916,666.160	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	8,000,000.000	8,141,703.120	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	5,000,000.000	5,286,700.500	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	6,000,000.000	5,377,500.000	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	8,000,000.000	7,030,000.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	12,000,000.000	11,505,000.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	6,000,000.000	4,897,500.000	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	6,200,000.000	5,882,250.000	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	10,000,000.000	8,975,000.000	
HUNGARY 2.125 09/22/31	12,000,000.000	9,404,520.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	6,000,000.000	3,871,740.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	7,000,000.000	6,908,713.000	
HUNGARY 5.375 03/25/24	3,380,000.000	3,380,087.880	
HUNGARY 6.125 05/22/28	6,000,000.000	6,150,156.000	
HUNGARY 6.25 09/22/32	9,000,000.000	9,387,900.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,606,135.450	
INDONESIA 3.05 03/12/51	4,000,000.000	2,892,986.160	
INDONESIA 3.4 09/18/29	200,000.000	185,099.560	
INDONESIA 3.5 01/11/28	1,200,000.000	1,135,270.830	
INDONESIA 3.85 10/15/30	9,400,000.000	8,811,175.350	
INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,181,427.270	
INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	5,957,204.890	
INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,575,779.500	
INDONESIA 4.75 01/08/26	1,000,000.000	996,249.910	
INDONESIA 7.75 01/17/38	500,000.000	624,192.750	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	6,000,000.000	6,056,880.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	7,000,000.000	7,161,623.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	4,000,000.000	4,148,440.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	6,000,000.000	4,301,946.180	
PANAMA 3.16 01/23/30	11,000,000.000	9,188,876.180	
PANAMA 3.87 07/23/60	4,000,000.000	2,307,767.080	
PANAMA 4.5 01/19/63	8,000,000.000	5,065,096.240	
PANAMA 4.5 04/01/56	8,000,000.000	5,188,210.640	

PANAMA 6.4 02/14/35	5,000,000.000	4,794,607.400	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,019,475.740	
PERU 2.392 01/23/26	3,000,000.000	2,824,804.470	
PERU 2.78 12/01/60	4,000,000.000	2,389,106.200	
PERU 2.783 01/23/31	6,000,000.000	5,100,696.420	
PERU 3.0 01/15/34	11,000,000.000	8,990,222.230	
PERU 3.55 03/10/51	7,000,000.000	5,055,096.130	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	1,600,000.000	1,288,750.970	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	7,000,000.000	4,740,860.180	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	1,000,000.000	931,908.010	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	7,000,000.000	5,142,725.980	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	5,200,000.000	4,952,239.550	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	4,200,000.000	3,584,651.020	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	7,200,000.000	6,045,703.480	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	4,000,000.000	3,229,229.280	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	6,200,000.000	5,792,989.710	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	4,000,000.000	2,552,993.600	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	11,000,000.000	8,093,438.650	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	5,000,000.000	3,644,046.550	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	7,200,000.000	6,266,935.940	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	5,000,000.000	3,611,702.650	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	5,000,000.000	4,333,919.950	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	8,000,000.000	7,847,133.200	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	2,000,000.000	2,127,401.000	
ROMANIA 3.0 02/14/31	1,000,000.000	830,775.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	13,000,000.000	9,097,140.000	
ROMANIA 7.125 01/17/33	14,000,000.000	14,860,566.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	11,000,000.000	8,868,398.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	6,000,000.000	5,772,570.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	13,200,000.000	11,959,992.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	2,000,000.000	1,315,636.000	

SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	3,400,000.000	2,428,392.200	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	13,000,000.000	12,748,073.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,925,188.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	3,257,540.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	6,000,000.000	5,990,694.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	5,000,000.000	4,982,330.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	3,000,000.000	2,678,697.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	5,000,000.000	4,631,985.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	7,000,000.000	7,282,121.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	12,000,000.000	10,843,620.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	1,400,000.000	1,365,700.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	13,000,000.000	9,615,970.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	2,000,000.000	1,871,170.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	9,000,000.000	7,904,286.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	7,000,000.000	6,837,600.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	8,000,000.000	7,669,680.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	13,000,000.000	12,713,233.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	7,000,000.000	6,062,000.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	16,000,000.000	14,732,336.000	
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	2,000,000.000	1,909,800.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	5,000,000.000	3,414,295.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	3,000,000.000	2,896,305.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	1,000,000.000	1,027,076.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	8,000,000.000	6,590,404.160	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	5,000,000.000	4,437,581.350	

	UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	7,000,000.000	5,754,173.250	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	4,000,000.000	2,526,409.080	
	UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	4,000,000.000	2,591,234.320	
	UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,564,372.720	
	UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	8,000,000.000	6,318,167.040	
	UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	3,000,000.000	2,266,496.280	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	4,000,000.000	3,129,553.840	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	7,000,000.000	6,770,659.070	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	4,000,000.000	3,754,266.800	
	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	6,000,000.000	5,621,175.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	3,000,000.000	2,496,278.820	
	UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	5,000,000.000	4,860,363.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	5,000,000.000	5,101,633.700	
	アメリカ・ドル 小計	752,080,000.000 (109,352,432,000)	653,139,752.170 (94,966,519,966)	
国債証券	合計	109,352,432,000 (109,352,432,000)	94,966,519,966 (94,966,519,966)	
合計			94,966,519,966 (94,966,519,966)	

(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 126銘柄	97.55	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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12月29日現在

資産総額	5,460,203,218円
負債総額	15,251,417円
純資産総額（ - ）	5,444,951,801円
発行済数量	5,658,570,084口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9622円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2023年12月29日現在

資産総額	16,444,441,259円
負債総額	38,648,644円
純資産総額（ - ）	16,405,792,615円
発行済数量	17,064,992,867口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9614円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産総額	1,232,589,746,223円
負債総額	5,906,683,692円
純資産総額（ - ）	1,226,683,062,531円
発行済数量	160,245,586,045口
1口当たり純資産額（ / ）	7.6550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12月29日現在

資産総額	260,125,444,898円
負債総額	803,987,445円
純資産総額（ - ）	259,321,457,453円
発行済数量	217,042,526,416口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1948円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産総額	86,857,566,655円
負債総額	217,871,053円
純資産総額（ - ）	86,639,695,602円
発行済数量	45,658,712,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8976円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産総額	88,065,614,390円
負債総額	4,172,469円
純資産総額（ - ）	88,061,441,921円
発行済数量	56,790,729,394口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5506円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産総額	97,326,031,583円
負債総額	8,092,000円
純資産総額(-)	97,317,939,583円
発行済数量	43,286,242,424口
1口当たり純資産額(/)	2.2482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12月29日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2023年12月29日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年12月29日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,519,559,711,882
追加型株式投資信託	782	15,459,387,691,660
単位型公社債投資信託	21	36,053,040,155
単位型株式投資信託	202	1,079,470,098,766
合計	1,031	18,094,470,542,463

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第39期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

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

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います。

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてあります。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。

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,013
金銭の信託		28,384
未収委託者報酬		17,669
未収運用受託報酬		3,747
未収投資助言報酬		305
未収収益		13
前払費用		1,318
その他		2,504
	流動資産計	81,956
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	947
器具備品	1	100
リース資産	1	6
無形固定資産		
ソフトウェア		4,959
ソフトウェア仮勘定		2,954
電話加入権		2,002
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		8,557
関係会社株式		184
長期差入保証金		4,888
長期差入保証金		772
繰延税金資産		2,592
その他		120
	固定資産計	14,572
資産合計		96,529

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	418
リース債務	1
未払金	7,850
未払収益分配金	1
未払償還金	0
未払手数料	7,654
その他未払金	193
未払費用	7,452
未払法人税等	2,372
未払消費税等	1,076
契約負債	20
賞与引当金	861
役員賞与引当金	26
流動負債計	20,081
固定負債	
リース債務	5
退職給付引当金	2,701
時効後支払損引当金	72
固定負債計	2,780
負債合計	22,861
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	52,115
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,991
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,311
株主資本計	73,668
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
評価・換算差額等計	0
純資産合計	73,668
負債・純資産合計	96,529

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	49,984	
運用受託報酬	8,063	
投資助言報酬	1,082	
その他営業収益	13	
		営業収益計 59,144
営業費用		
支払手数料	21,623	
広告宣伝費	107	
公告費	0	
調査費	17,657	
調査費	6,728	
委託調査費	10,928	
委託計算費	280	
営業雑経費	372	
通信費	17	
印刷費	253	
協会費	33	
諸会費	29	
支払販売手数料	38	
		営業費用計 40,042
一般管理費		
給料	4,831	
役員報酬	77	
給料・手当	4,735	
賞与	19	
交際費	14	
寄付金	3	
旅費交通費	63	
租税公課	175	
不動産賃借料	508	
退職給付費用	206	
固定資産減価償却費	1 749	
福利厚生費	17	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	861	
役員賞与引当金繰入額	26	
機器リース料	0	
事務委託費	1,714	
事務用消耗品費	24	
器具備品費	0	
諸経費	120	
		一般管理費計 9,319
営業利益		9,782

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	3	
受取配当金	3	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	35	
雑収入	10	
	営業外収益計	53
営業外費用		
為替差損	7	
金銭の信託運用損	785	
早期割増退職金	0	
雑損失	3	
	営業外費用計	797
経常利益		9,038
特別損失		
固定資産除却損	2	
関係会社株式評価損	922	
	特別損失計	924
税引前中間純利益		8,113
法人税、住民税及び事業税		2,136
法人税等調整額		303
法人税等合計		2,440
中間純利益		5,673

(3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,040
中間純利益							5,673
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	5,366
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,311

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	57,481	79,034	0	0	79,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,040	11,040			11,040
中間純利益	5,673	5,673			5,673
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	5,366	5,366	0	0	5,366
当中間期末残高	52,115	73,668	0	0	73,668

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 ... 8～18年 器具備品 ... 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、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第39期中間会計期間末 （2023年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	577百万円
	器具備品	...	764百万円
	リース資産	...	2百万円

（中間損益計算書関係）

項目	第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	71百万円
	無形固定資産	...	678百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

（金融商品関係）

第39期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	28,384	28,384	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,386	28,386	-

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	28,384	-	28,384
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,386	-	28,386

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

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券（その他有価証券）	
非上場株式	182
関係会社株式	
非上場株式	4,888

（有価証券関係）

第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)			
1. 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額4,888百万円）については市場価格がない ことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略し ております。			
2. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0
（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額182百万円）については、市場価格がないことから、上 表に含めておりません。			

（持分法損益等）

当社は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。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	65,400百万円
資産合計	65,400百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	3,358百万円
負債合計	3,358百万円
純資産	62,041百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額49,546百万円及び顧客関連資産の金額19,028百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	3,824百万円
経常利益	3,824百万円
税引前中間純利益	3,824百万円
中間純利益	3,237百万円
1株当たり中間純利益	80,925円14銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額1,918百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第39期中間会計期間
(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

委託者報酬	49,984百万円
運用受託報酬	7,464百万円
投資助言報酬	1,082百万円
成功報酬(注)	599百万円
その他営業収益	13百万円
合計	59,144百万円

(注) 成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬及び運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,841,700円33銭
1株当たり中間純利益金額	141,837円37銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益金額	5,673百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	5,673百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社に対する出資比率が、2023年10月6日付で49.9%から23.4%に引き下がりました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（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

2024年2月9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2023年6月13日から2023年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス（基本コース）の2023年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2024年2月9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2023年6月13日から2023年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2023年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森重 俊寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。