

Oneグローバルバランス

追加型投信／内外／資産複合

- この目論見書により行う「Oneグローバルバランス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2025年6月17日に関東財務局長に提出しており、2025年6月18日にその効力が生じております。
- 「Oneグローバルバランス」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

アセットマネジメントOne株式会社

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

■委託会社への照会先

【コールセンター】 **0120-104-694** (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

【ホームページアドレス】 <https://www.am-one.co.jp/>

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

目 次

第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	5
第1【ファンドの状況】	5
第2【管理及び運営】	59
第3【ファンドの経理状況】	67
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	252
第三部【委託会社等の情報】	254
第1【委託会社等の概況】	254
約款	301

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

One グローバルバランス

(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額[※]とします。

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

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

<基準価額の照会方法等>

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

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

(5) 【申込手数料】

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

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

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2025年6月18日から2025年12月16日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

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

（11）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（12）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

○振替受益権について

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

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

(参考)

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- ①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。
- ②当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 国内外の株式、公社債の4資産に分散投資します。

●上記資産に関しては、マザーファンド(*)を通じて実質的に投資します。

(*)ファンドが投資するマザーファンド(「主要投資対象マザーファンド」といいます。)は以下のとおりです。

- ・国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

また、「DIAMマネーマザーファンド」および短期金融資産に直接投資する場合があります。(「主要投資対象マザーファンド」および「DIAMマネーマザーファンド」を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。)

※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 主要投資対象マザーファンドへの投資割合については、公的年金の基本ポートフォリオ(*)を考慮しつつ、投資環境分析による各資産の魅力度判定に応じた機動的な変更を行うことで、信託財産の成長をめざします。

(*)国民年金、厚生年金の積立金を運用している、年金積立金管理運用独立行政法人(Government Pension Investment Fund 以下「GPIF」といいます。)の基本ポートフォリオです。

※当ファンドは、アセットマネジメントOneがGPIFの基本ポートフォリオを考慮しつつ、独自に資産配分比率を決定するものであり、GPIFと何ら関係を有するものではありません。

※当ファンドの運用は、GPIFの運用成果に連動することをめざすものではありません。

※GPIFの基本ポートフォリオの資産構成が変更される場合や、GPIFの基本ポートフォリオが参照できなくなる場合などは運用方法を変更することがあります。

3 実質組入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。

運用プロセス

公的年金のポートフォリオを参照

⇒公的年金の基本ポートフォリオを参考に
基本配分比率を決定

投資環境分析を実施

⇒基本配分比率から
機動的に配分比率を変更

ポートフォリオの構築

STEP1

「国内株式」、「外国株式」、「国内債券」および「外国債券」の各資産(以下「各資産」といいます。)について、年金積立金管理運用独立行政法人(GPIF)の基本ポートフォリオを参考に、基本配分比率を決定します。

STEP2

マクロ経済の各種指標から世界景気の状態(景気サイクル)を判定する「経済環境分析」と、金融市場の各種指標から金融市場の状態を判定する「市場環境分析」により、投資環境を分析します。
この結果をもとに各資産の魅力度を判定し、魅力度に応じて各資産への配分比率を基本配分比率から機動的に変更します。

STEP3

STEP1～2で決定した配分比率に従って、各資産への投資を行います。
※STEP2において各資産の魅力度が低いと判断する場合、各資産への配分比率を引き下げ、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産への投資割合を増加させます。

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年9月16日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

<商品分類>

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)
単位型	国内	株式
	海外	債券
追加型		不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

<属性区分>

・属性区分表

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

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

(注2) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・ 属性区分定義

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

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

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

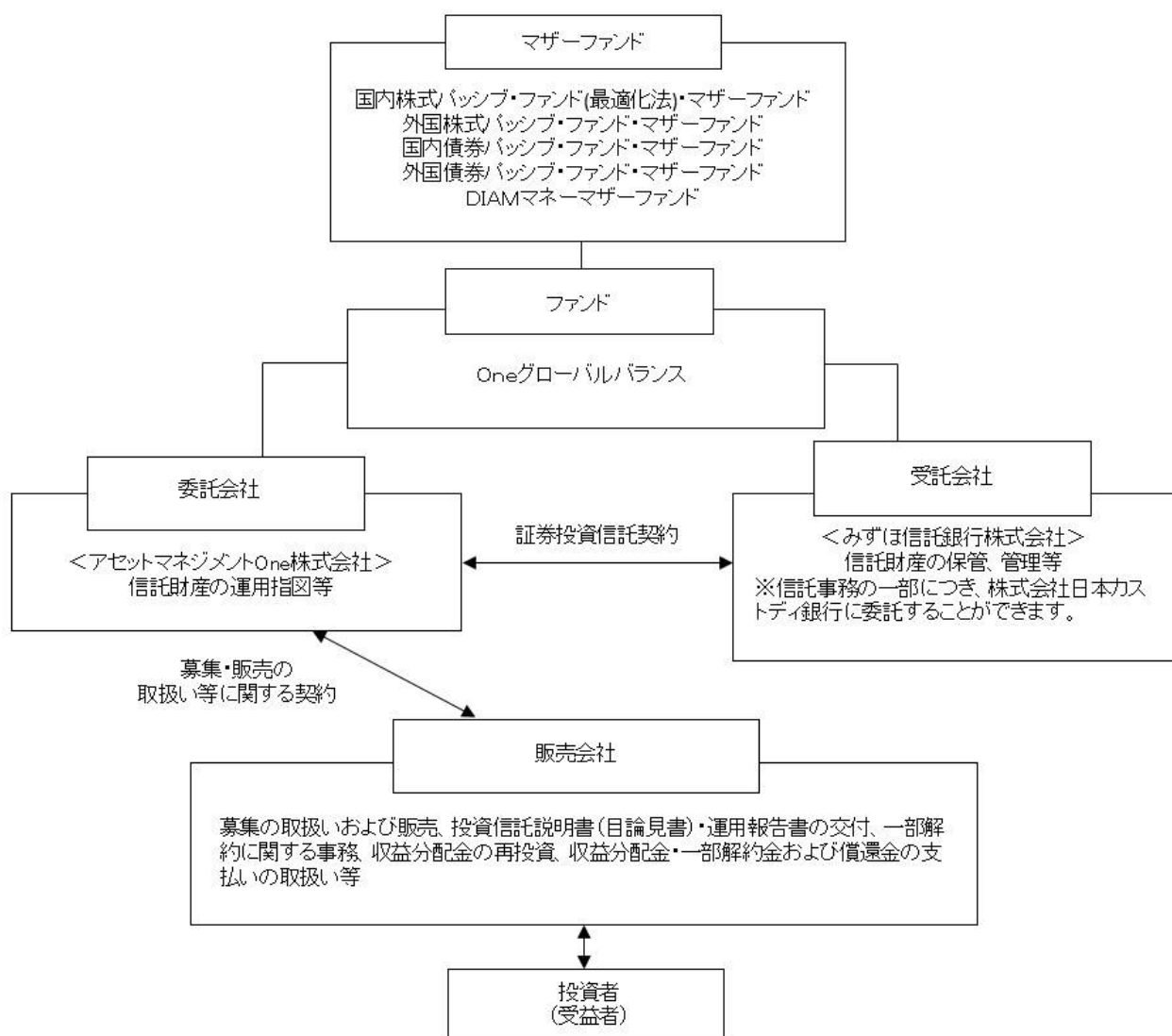
(注3) 当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式、債券を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

(2) 【ファンドの沿革】

2021年 9月16日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2023年12月20日 信託期間を2051年9月15日までに変更（当初は2031年9月12日まで）

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

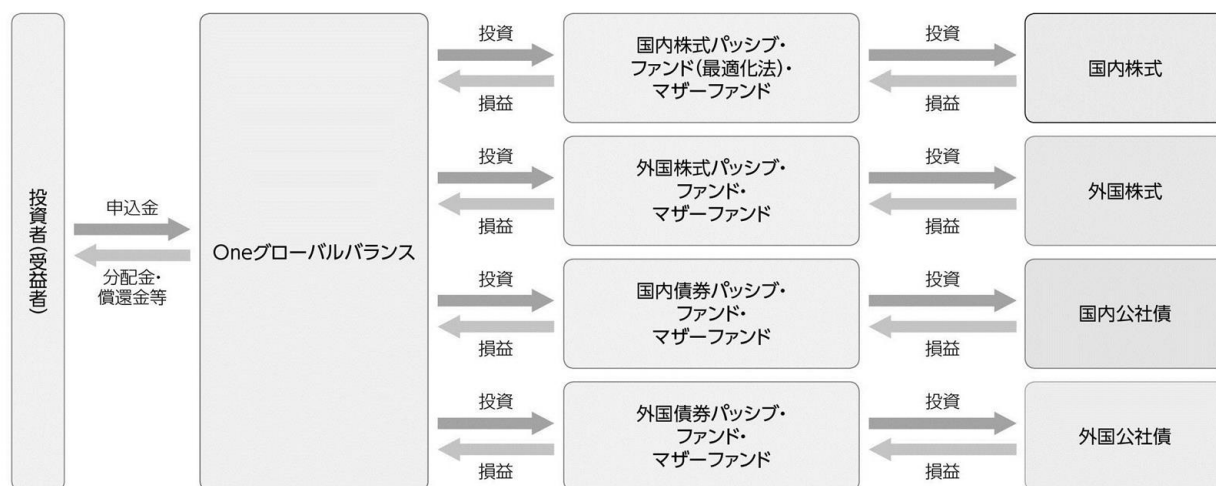
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



※当ファンドは、D I A Mマネーマザーファンドおよび短期金融資産に直接投資する場合があります。

○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2025年3月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

(2025年3月31日現在)

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、D I AMマネーマザーファンド受益証券や短期金融資産にも投資を行います。

<投資態度>

①以下のマザーファンド（主要投資対象マザーファンドといいます。）受益証券への投資を通じて、国内外の株式および公社債に実質的に投資を行います。

- ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

なお、D I AMマネーマザーファンド受益証券や短期金融資産にも投資を行います。

（上記のマザーファンドを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

②主要投資対象マザーファンド受益証券の投資割合については、公的年金が基本ポートフォリオで定める資産構成割合や、投資環境分析等を勘案のうえ決定します。

③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

④ファンドの資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～11.の証券または証書の性質を有するもの

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、次の15. で定めるものを除きます。)
 15. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
 18. 預託証券または預託証書(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つ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上記22. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書、12. および18. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに15. の証券ならびに12. および18. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13. の証券および14. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用すること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つ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上記5. の権利の性質を有するもの

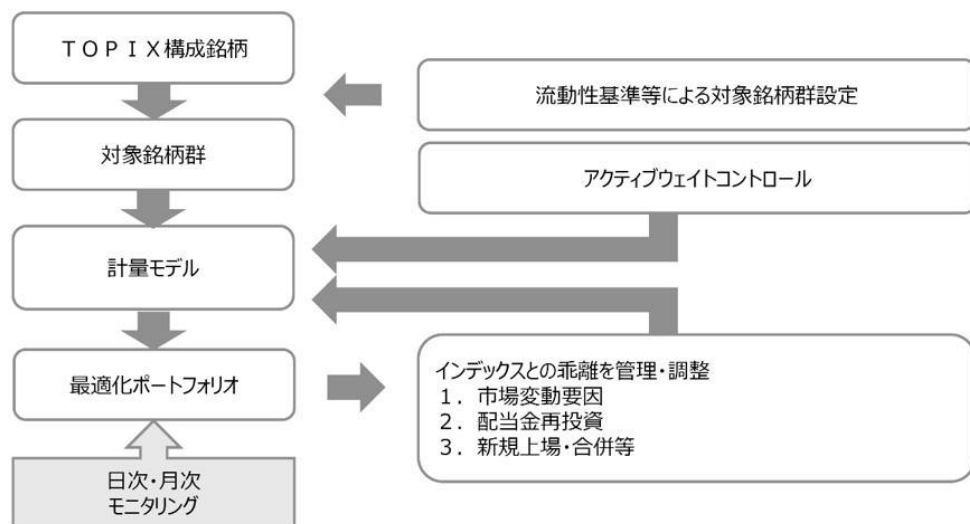
(参考) 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <p>※①東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>②JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（TOPIX）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>③JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>④JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>⑤本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</p>

- ⑦ J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（T O P I X）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧以上の項目に限らず、J P Xは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

運用プロセス

1. 流動性基準等による対象銘柄群設定
 マーケットインパクトの低減を図る為、T O P I X採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。
2. 最適化法によるポートフォリオの構築
 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。
3. インデックスとの乖離を管理
 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。
 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。
 - ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
 - ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
 - ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定



主な投資制限

1. 株式への投資割合には、制限を設けません。
2. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

	<p>4. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--	---

ファンド名	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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>※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。</p>

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

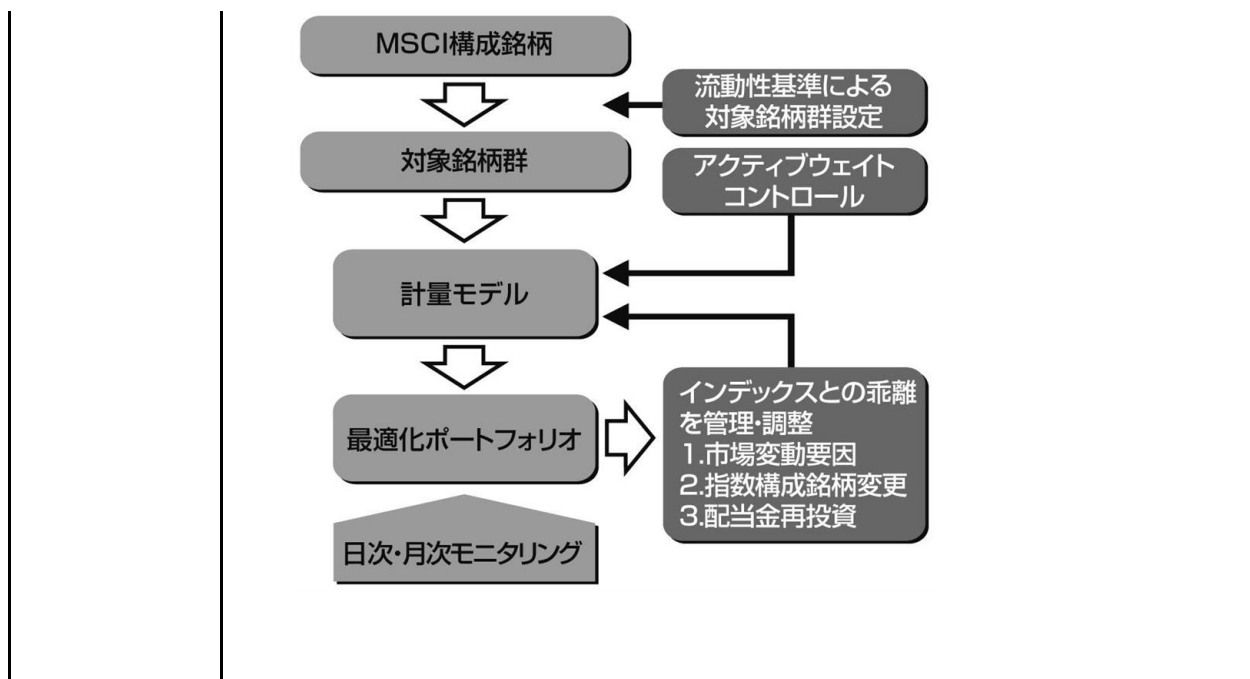
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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



<p>主な投資制限</p>	<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。
---------------	--

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA-BPI総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

す。

3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

※NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

運用プロセス

1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

NOMURA-BPI総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因

2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因

1)、2)が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

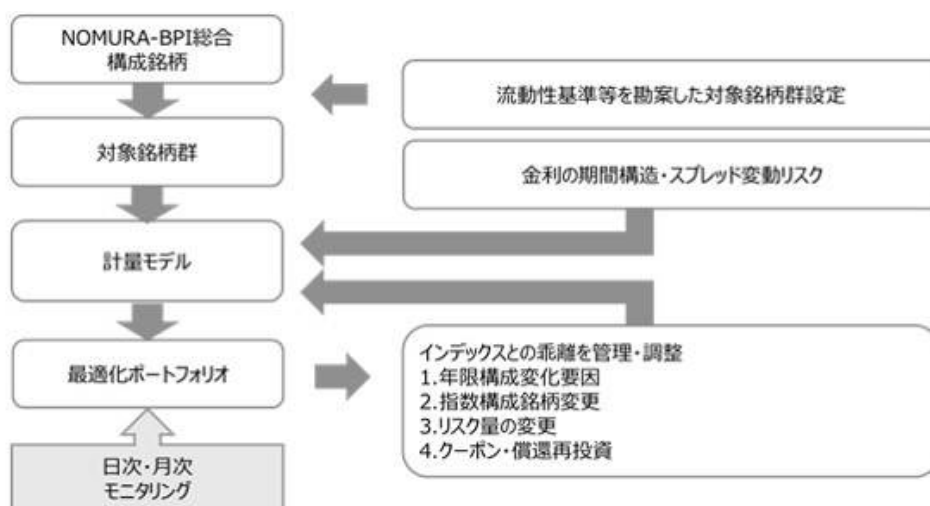
3. インデックスとの乖離を管理

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

組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン、償還再投資



主な投資制限

1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。

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。

	<p>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--	--

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。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>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築</p>

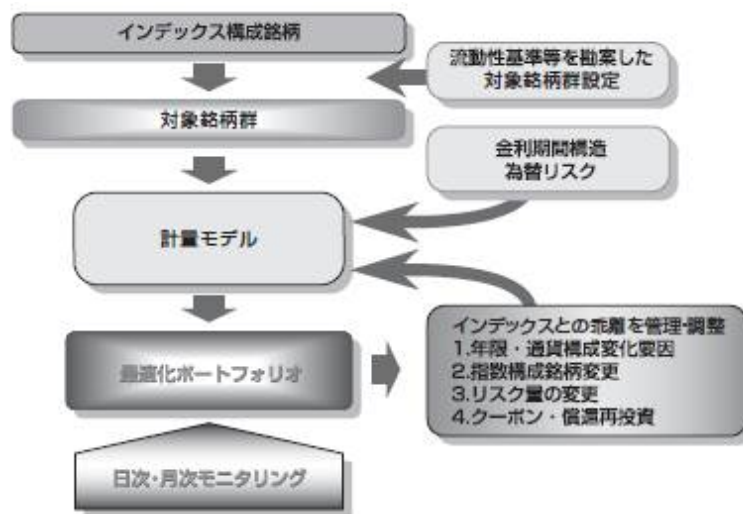
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限・通貨構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン・償還再投資



主な投資制限

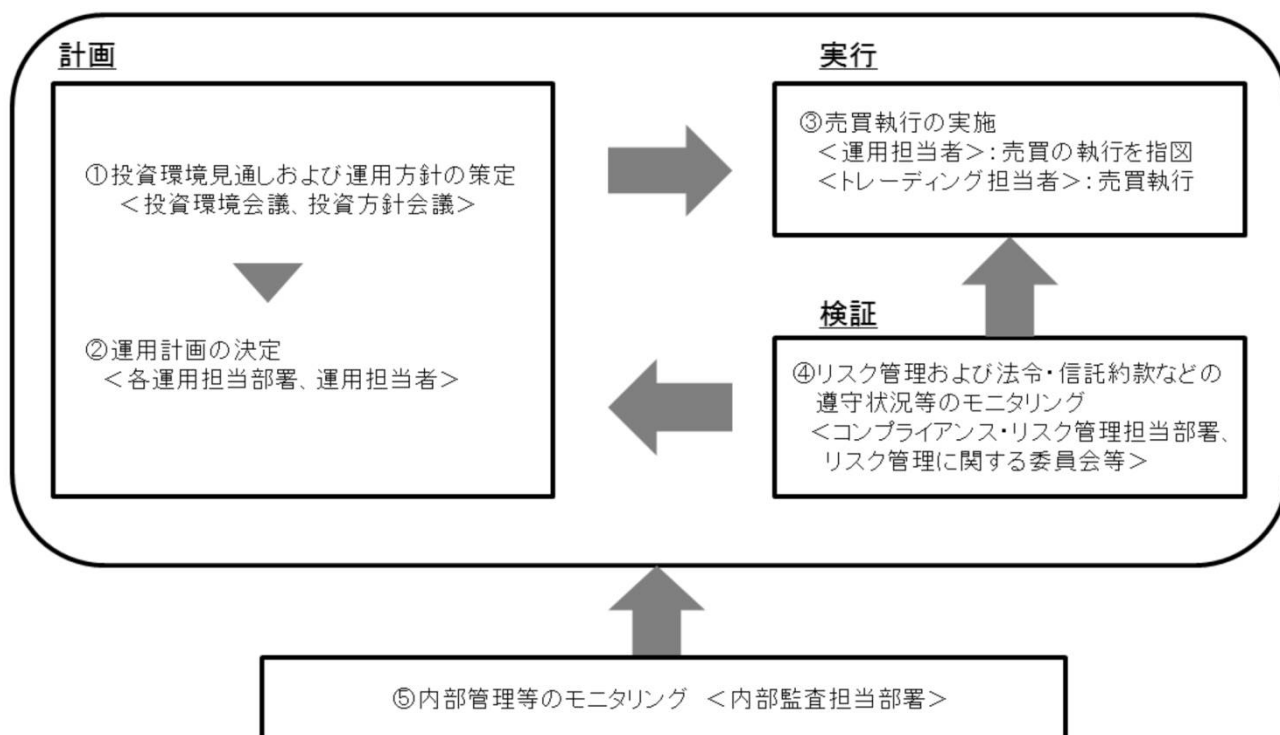
1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
2. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同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

ファンド名	D I A M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C D、C P、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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A A-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のC D、C Pを主要投資対象とします。</p> <p>（*）主要格付機関とは、R & I、J C R、M o o d y' s、S & Pとします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	<p>1. 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>6. 外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>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。</p> <p>8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は原則として月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用担当部署の部長等で構成されます。

② 運用計画の決定

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

③ 売買執行の実施

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

④ モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（人数60～80人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2025年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年9月16日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

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

②収益の分配方式

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

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

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

(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。

③収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

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

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

③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）

④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）

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。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

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。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

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。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

⑧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。

⑨信用取引の指図範囲（約款第22条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.～6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑩先物取引等の運用指図（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を回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑩で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑩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③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑩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。

⑪スワップ取引の運用指図（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、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。
- ⑫金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）
- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、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。
- ⑬デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26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。
- ⑭有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）
- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1. 2. の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - 2) 上記1) 1. 2. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 - 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

- ⑮公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2) 上記1)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑯公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑰特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30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。

⑱外国為替予約取引の指図（約款第31条）

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

す。

- 5) 委託会社は、外国為替の売買の予約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。

⑱資金の借入れ（約款第37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。

⑳同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

○資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数またはすべての資産の価値が同時に下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。当ファンドは、国内外の株式および公社債に資産配分を行います。

配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数またはすべての資産の価値が同時に下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、実質保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも基準価額が下落する可能性があります。

○信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

○流動性リスク

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

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

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- 収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。
 - ・収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
 - ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。
 - ・分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用に影響を受ける場合があります。
- 資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。
- 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。
- 当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、信託財産の純資産総額が30億円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。

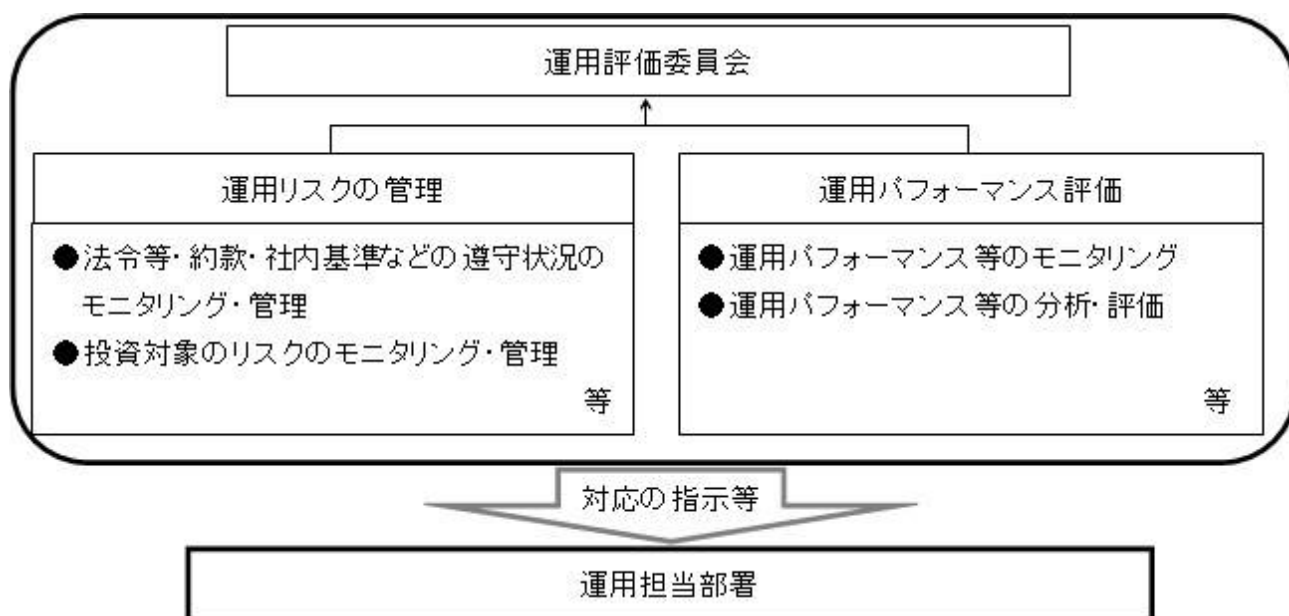
○注意事項

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

<リスク管理体制>

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

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

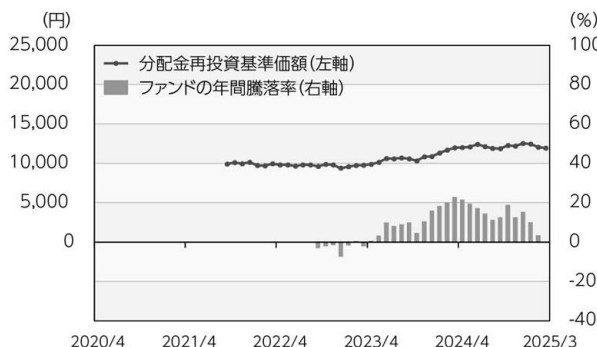


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

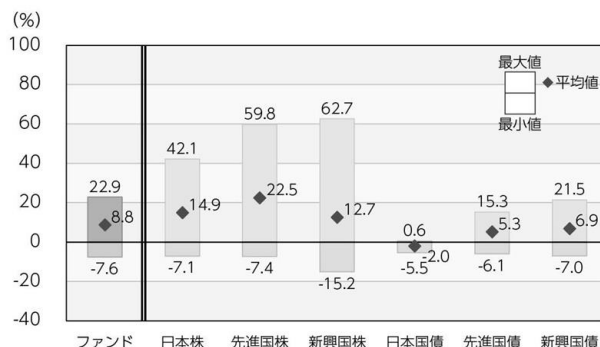
※リスク管理体制は2025年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2022年9月~2025年3月
代表的な資産クラス:2020年4月~2025年3月

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.133%（税抜1.03%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.50%	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0.50%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4) 【その他の手数料等】

- ・信託財産留保額

ありません。

- ・その他の費用

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

①信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、2025年3月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

<個別元本について>

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の<収益分配金の課税について>を参照。）

<収益分配金の課税について>

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

収益分配の際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

… (参考情報) ファンドの総経費率 …

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.15%	1.13%	0.01%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年9月20日~2024年9月17日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2025年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	1,820,779,357	98.41
内 日本	1,820,779,357	98.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	29,348,616	1.59
純資産総額	1,850,127,973	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2025年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	573,987,070,290	96.22
内 日本	573,987,070,290	96.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	22,548,849,738	3.78
純資産総額	596,535,920,028	100.00

その他資産の投資状況

2025年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	23,745,040,000	3.98
内 日本	23,745,040,000	3.98

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

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,695,640,191,296	96.40
内 アメリカ	1,237,036,482,196	70.33
内 イギリス	67,273,925,193	3.82
内 カナダ	57,866,658,334	3.29
内 スイス	51,630,537,368	2.94
内 フランス	48,733,579,699	2.77
内 ドイツ	46,279,761,826	2.63
内 アイルランド	31,360,969,367	1.78
内 オランダ	28,772,600,279	1.64
内 オーストラリア	28,335,453,887	1.61
内 スウェーデン	15,015,859,482	0.85
内 スペイン	14,029,147,637	0.80
内 イタリア	11,914,368,642	0.68
内 デンマーク	11,092,178,054	0.63
内 香港	6,745,328,551	0.38
内 シンガポール	5,806,639,989	0.33
内 フィンランド	4,808,463,124	0.27

	内 イスラエル	4,317,847,138	0.25
	内 ベルギー	3,527,497,875	0.20
	内 ジャージー	3,320,651,726	0.19
	内 ルクセンブルグ	3,190,919,654	0.18
	内 ケイマン諸島	3,133,826,912	0.18
	内 ノルウェー	2,964,047,550	0.17
	内 バミューダ	1,984,372,358	0.11
	内 オランダ領キュラソー	1,618,957,267	0.09
	内 リベリア	1,442,461,380	0.08
	内 ニュージーランド	1,270,277,073	0.07
	内 オーストリア	894,856,873	0.05
	内 ポルトガル	614,528,245	0.03
	内 パナマ	542,949,320	0.03
	内 マン島	115,044,297	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		2,278,259,519	0.13
	内 オーストラリア	1,815,106,567	0.10
	内 シンガポール	463,152,952	0.03
投資証券		30,437,911,738	1.73
	内 アメリカ	28,895,276,163	1.64
	内 フランス	723,856,515	0.04
	内 イギリス	468,224,812	0.03
	内 香港	350,554,248	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		30,536,607,598	1.74
純資産総額		1,758,892,970,151	100.00

その他資産の投資状況

2025年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	31,248,822,089	1.78
	内 アメリカ	24,045,477,456
	内 ドイツ	4,372,477,542
	内 イギリス	1,259,733,090
	内 カナダ	1,024,745,436
	内 オーストラリア	546,388,565

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

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	401,222,302,250	86.02
	内 日本	401,222,302,250
地方債証券	25,123,959,379	5.39
	内 日本	25,123,959,379
特殊債券	21,632,343,550	4.64
	内 日本	21,632,343,550

社債券		19,641,330,000	4.21
	内 日本	19,248,994,000	4.13
	内 フランス	392,336,000	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△1,199,283,534	△0.26
純資産総額		466,420,651,645	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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	271,003,403,464	98.57
内 アメリカ	128,406,683,559	46.70
内 中国	30,138,277,550	10.96
内 フランス	19,640,515,435	7.14
内 イタリア	18,433,281,926	6.70
内 ドイツ	15,454,921,917	5.62
内 イギリス	14,376,530,275	5.23
内 スペイン	11,794,320,056	4.29
内 カナダ	5,377,452,971	1.96
内 ベルギー	4,182,420,483	1.52
内 オランダ	3,443,061,921	1.25
内 オーストラリア	3,307,131,361	1.20
内 オーストリア	2,999,437,245	1.09
内 メキシコ	2,183,159,582	0.79
内 ポーランド	1,596,729,666	0.58
内 ポルトガル	1,579,125,770	0.57
内 フィンランド	1,389,620,750	0.51
内 マレーシア	1,353,804,387	0.49
内 アイルランド	1,251,087,387	0.46
内 シンガポール	1,045,190,161	0.38
内 イスラエル	857,851,690	0.31
内 ニュージーランド	773,111,793	0.28
内 デンマーク	569,512,130	0.21
内 スウェーデン	468,000,194	0.17
内 ノルウェー	382,175,255	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,937,659,825	1.43
純資産総額	274,941,063,289	100.00

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

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

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

2025年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	57,262,248	9.1572 524,363,875	9.4382 540,452,549	— —	29.21

2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	109,374,988	4.6088	4.8009	—	28.38
				504,091,246	525,098,379	—	
3	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	161,224,361	2.3503	2.4026	—	20.94
				378,934,026	387,357,649	—	
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	312,310,706	1.2190	1.1779	—	19.88
				380,724,880	367,870,780	—	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年3月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.41
合計	98.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2025年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	8,067,900	2,824.50 22,787,783,550	2,616.00 21,105,626,400	— —	3.54
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,235,400	3,483.00 18,234,898,200	3,765.00 19,711,281,000	— —	3.30
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,587,500	1,911.00 18,321,712,500	2,011.00 19,280,462,500	— —	3.23
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,899,100	4,080.00 15,908,328,000	3,458.00 13,483,087,800	— —	2.26
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,086,400	3,746.00 11,561,654,400	3,795.00 11,712,888,000	— —	1.96
6	任天堂 日本	株式 その他製品	958,300	10,805.00 10,354,431,500	10,110.00 9,688,413,000	— —	1.62
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,217,300	10,700.00 13,025,110,000	7,657.00 9,320,866,100	— —	1.56
8	キーエンス 日本	株式 電気機器	151,800	63,100.00 9,578,580,000	58,480.00 8,877,264,000	— —	1.49
9	東京海上ホールディングス 日本	株式	1,459,300	5,038.00	5,736.00	—	1.40

	日本	保険業		7,351,953,400	8,370,544,800	—	
10	みずほフィナンシャルグループ	株式	2,017,400	4,160.00	4,051.00	—	1.37
	日本	銀行業		8,392,384,000	8,172,487,400	—	
11	三菱商事	株式	2,967,600	2,521.50	2,626.50	—	1.31
	日本	卸売業		7,482,803,400	7,794,401,400	—	
12	伊藤忠商事	株式	1,079,400	6,683.00	6,901.00	—	1.25
	日本	卸売業		7,213,630,200	7,448,939,400	—	
13	三菱重工業	株式	2,680,600	2,209.50	2,526.00	—	1.14
	日本	機械		5,922,785,700	6,771,195,600	—	
14	三井物産	株式	2,359,100	2,866.50	2,799.50	—	1.11
	日本	卸売業		6,762,360,150	6,604,300,450	—	
15	日本電信電話	株式	45,277,400	146.90	144.70	—	1.10
	日本	情報・通信業		6,651,250,060	6,551,639,780	—	
16	東京エレクトロン	株式	321,200	25,500.00	20,110.00	—	1.08
	日本	電気機器		8,190,600,000	6,459,332,000	—	
17	武田薬品工業	株式	1,354,500	4,137.00	4,413.00	—	1.00
	日本	医薬品		5,603,566,500	5,977,408,500	—	
18	信越化学工業	株式	1,352,300	4,704.00	4,236.00	—	0.96
	日本	化学		6,361,219,200	5,728,342,800	—	
19	ソフトバンクグループ	株式	750,900	9,683.00	7,479.00	—	0.94
	日本	情報・通信業		7,270,964,700	5,615,981,100	—	
20	KDDI	株式	2,239,000	2,437.00	2,359.50	—	0.89
	日本	情報・通信業		5,456,443,000	5,282,920,500	—	
21	ソフトバンク	株式	24,381,600	199.91	208.40	—	0.85
	日本	情報・通信業		4,874,187,593	5,081,125,440	—	
22	第一三共	株式	1,407,900	3,833.00	3,511.00	—	0.83
	日本	医薬品		5,396,480,700	4,943,136,900	—	
23	HOYA	株式	294,400	18,840.00	16,780.00	—	0.83
	日本	精密機器		5,546,496,000	4,940,032,000	—	
24	本田技研工業	株式	3,596,000	1,436.50	1,342.50	—	0.81
	日本	輸送用機器		5,165,654,000	4,827,630,000	—	
25	三菱電機	株式	1,559,200	2,439.50	2,720.00	—	0.71
	日本	電気機器		3,803,668,400	4,241,024,000	—	
26	富士通	株式	1,410,600	2,991.00	2,951.00	—	0.70
	日本	電気機器		4,219,104,600	4,162,680,600	—	
27	ファーストリテイリング	株式	90,300	48,860.00	44,060.00	—	0.67
	日本	小売業		4,412,058,000	3,978,618,000	—	
28	セブン&アイ・ホールディングス	株式	1,773,800	2,385.50	2,163.00	—	0.64
	日本	小売業		4,231,399,900	3,836,729,400	—	
29	日本たばこ産業	株式	908,200	3,921.00	4,114.00	—	0.63
	日本	食料品		3,561,052,200	3,736,334,800	—	
30	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	株式	1,095,600	3,237.00	3,225.00	—	0.59

	日本	保険業	3,546,457,200	3,533,310,000	—	
--	----	-----	---------------	---------------	---	--

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年3月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	96.22
合計	96.22

(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。

投資株式の業種別投資比率

2025年3月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	16.70
銀行業		9.17
情報・通信業		7.29
輸送用機器		6.96
卸売業		6.48
機械		5.36
化学		4.72
サービス業		4.39
小売業		4.36
医薬品		4.07
保険業		3.39
食料品		2.99
その他製品		2.87
陸運業		2.32
建設業		2.12
精密機器		2.11
不動産業		1.86
電気・ガス業		1.25
その他金融業		1.10
証券、商品先物取引業		0.86
鉄鋼		0.84
非鉄金属		0.74
海運業		0.65
ゴム製品		0.63
ガラス・土石製品		0.61
石油・石炭製品		0.53
金属製品		0.48
繊維製品		0.41
空運業		0.34
鉱業		0.26
倉庫・運輸関連業		0.14
パルプ・紙		0.13
水産・農林業		0.08
合計	96.22	

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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	2,699,439	36,492.50 98,509,302,990	32,580.40 87,948,823,991	— —	5.00
2	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	4,396,343	20,681.16 90,921,482,236	16,397.85 72,090,609,991	— —	4.10
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,267,814	60,988.01 77,321,457,687	56,638.17 71,806,672,467	— —	4.08
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,698,951	34,063.38 57,872,024,864	28,815.49 48,956,113,026	— —	2.78
5	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	391,437	109,625.01 42,911,285,540	86,234.16 33,755,242,766	— —	1.92
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	1,049,185	27,593.23 28,950,406,438	23,075.42 24,210,386,211	— —	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	894,077	27,890.98 24,936,686,287	23,334.09 20,862,474,257	— —	1.19
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	518,938	52,692.78 27,344,286,969	39,405.99 20,449,268,752	— —	1.16
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	799,569	34,640.09 27,697,148,990	25,286.82 20,218,559,299	— —	1.15
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	238,781	71,931.33 17,175,835,826	78,693.87 18,790,601,259	— —	1.07
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	505,579	41,241.18 20,850,677,543	36,310.93 18,358,044,689	— —	1.04

12	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	144,900	126,382.60 18,312,839,008	122,981.69 17,820,047,634	— —	1.01
13	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	310,373	52,926.98 16,427,105,793	51,262.93 15,910,629,993	— —	0.90
14	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	789,127	16,206.20 12,788,753,585	17,602.98 13,890,994,374	— —	0.79
15	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイダー ／ヘルス ケア・ サービス	165,447	78,155.59 12,930,608,480	77,158.30 12,765,609,392	— —	0.73
16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	147,028	84,386.90 12,407,238,099	80,832.00 11,884,568,354	— —	0.68
17	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	79,728	159,707.85 12,733,187,958	139,002.76 11,082,412,304	— —	0.63
18	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	76,831	157,829.68 12,126,212,750	139,629.25 10,727,855,060	— —	0.61
19	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	422,475	24,394.13 10,305,913,691	25,123.84 10,614,196,669	— —	0.60
20	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	432,492	23,386.35 10,114,412,315	24,477.91 10,586,504,230	— —	0.60
21	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	793,959	15,494.91 12,302,328,130	12,731.62 10,108,390,635	— —	0.57
22	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	317,549	28,925.52 9,185,270,243	30,694.96 9,747,154,107	— —	0.55
23	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	178,607	61,033.87 10,901,077,355	53,550.58 9,564,509,870	— —	0.54
24	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	733,320	10,305.03 7,556,884,829	10,521.72 7,715,789,470	— —	0.44
25	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	307,006	23,254.28 7,139,204,852	24,833.77 7,624,118,480	— —	0.43
26	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,230,791	7,007.81 8,625,153,944	6,167.69 7,591,149,650	— —	0.43
27	SAP SE ドイツ	株式 ソフト ウェア	187,657	44,776.55 8,402,634,361	39,993.23 7,505,011,438	— —	0.43

28	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	470,156	14,065.49 6,612,976,750	15,344.40 7,214,266,239	— —	0.41
29	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	70,798	118,494.90 8,389,202,060	101,397.24 7,178,722,363	— —	0.41
30	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	172,159	48,592.34 8,365,609,966	40,365.91 6,949,355,457	— —	0.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年3月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	96.40
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.13
投資証券	1.73
合計	98.26

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2025年3月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
ソフトウェア	外国	8.21
半導体・半導体製造装置		7.82
銀行		6.11
コンピュータ・周辺機器		5.26
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.59
医薬品		4.51
石油・ガス・消耗燃料		4.00
資本市場		3.52
金融サービス		3.51
保険		3.41
大規模小売り		3.23
航空宇宙・防衛		2.34
ヘルスケア機器・用品		2.16
ホテル・レストラン・レジャー		1.93
生活必需品流通・小売り		1.82
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.76
機械		1.73
バイオテクノロジー		1.73
電力		1.66
自動車		1.61
専門小売り		1.57
化学		1.53
娯楽		1.40
情報技術サービス	1.29	
飲料	1.29	
金属・鉱業	1.18	

食品	1.11
各種電気通信サービス	1.08
電気設備	1.03
家庭用品	0.98
専門サービス	0.96
繊維・アパレル・贅沢品	0.88
陸上運輸	0.88
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.88
総合公益事業	0.76
通信機器	0.73
コングロマリット	0.69
タバコ	0.68
商業サービス・用品	0.65
建設関連製品	0.61
電子装置・機器・部品	0.49
パーソナルケア用品	0.48
メディア	0.45
消費者金融	0.44
商社・流通業	0.43
航空貨物・物流サービス	0.38
建設・土木	0.33
建設資材	0.32
不動産管理・開発	0.28
無線通信サービス	0.27
家庭用耐久財	0.23
エネルギー設備・サービス	0.20
容器・包装	0.20
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	0.09
ガス	0.09
自動車用部品	0.09
水道	0.09
紙製品・林産品	0.07
販売	0.07
ヘルスケア・テクノロジー	0.07
旅客航空輸送	0.05
海上運輸	0.04
各種消費者サービス	0.02
合計	96.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	7,100,000,000	98.18 6,971,235,000	98.18 6,970,780,000	0.005 2027/6/20	1.49
2	349回 利付国庫債券	国債証	6,050,000,000	97.98	97.96	0.1	1.27

	(10年)	日本	券		5,928,334,500	5,926,943,000	2027/12/20	
3	350回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,800,000,000	97.74 5,669,210,000	97.73 5,668,340,000	0.1 2028/3/20	1.22
4	348回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,570,000,000	98.18 5,469,015,900	98.16 5,467,512,000	0.1 2027/9/20	1.17
5	377回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,950,000,000	98.15 4,858,466,500	97.57 4,830,160,500	1.2 2034/12/20	1.04
6	366回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,880,000,000	93.82 4,578,483,600	93.36 4,555,968,000	0.2 2032/3/20	0.98
7	463回 利付国庫債券 (2年)	日本	国債証 券	4,500,000,000	99.54 4,479,354,000	99.53 4,478,895,000	0.4 2026/8/1	0.96
8	347回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,500,000,000	98.40 4,428,225,000	98.38 4,427,415,000	0.1 2027/6/20	0.95
9	372回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,600,000,000	96.58 4,442,680,000	95.74 4,404,316,000	0.8 2033/9/20	0.94
10	368回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,750,000,000	93.20 4,427,285,000	92.60 4,398,642,500	0.2 2032/9/20	0.94
11	351回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,400,000,000	97.45 4,288,098,000	97.42 4,286,480,000	0.1 2028/6/20	0.92
12	373回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,400,000,000	94.63 4,164,072,000	93.78 4,126,408,000	0.6 2033/12/20	0.88
13	365回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,330,000,000	93.59 4,052,599,000	93.04 4,028,761,900	0.1 2031/12/20	0.86
14	364回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,310,000,000	93.86 4,045,544,300	93.39 4,025,281,400	0.1 2031/9/20	0.86
15	371回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,300,000,000	93.54 4,022,594,000	92.93 3,996,291,000	0.4 2033/6/20	0.86
16	374回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,200,000,000	95.56 4,013,910,000	95.06 3,992,856,000	0.8 2034/3/20	0.86
17	370回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,150,000,000	94.77 3,932,996,500	94.08 3,904,652,000	0.5 2033/3/20	0.84
18	360回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,100,000,000	95.03 3,896,394,000	94.59 3,878,395,000	0.1 2030/9/20	0.83
19	346回 利付国庫債券		国債証	3,840,000,000	98.61	98.60	0.1	0.81

	(10年)	日本	券		3,786,624,000	3,786,470,400	2027/3/20	
20	150回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	3,770,000,000	98.64	98.65	0.005	0.80
		日本			3,718,728,000	3,719,105,000	2026/12/20	
21	367回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,970,000,000	93.57	93.01	0.2	0.79
		日本			3,714,808,400	3,692,735,200	2032/6/20	
22	361回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,900,000,000	94.77	94.28	0.1	0.79
		日本			3,696,147,000	3,677,232,000	2030/12/20	
23	375回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,780,000,000	98.24	97.27	1.1	0.79
		日本			3,713,780,400	3,676,881,600	2034/6/20	
24	362回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,910,000,000	94.51	94.00	0.1	0.79
		日本			3,695,419,200	3,675,595,500	2031/3/20	
25	359回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,850,000,000	95.27	94.90	0.1	0.78
		日本			3,667,933,500	3,653,650,000	2030/6/20	
26	345回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,660,000,000	98.82	98.81	0.1	0.78
		日本			3,616,812,000	3,616,482,600	2026/12/20	
27	353回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,690,000,000	96.90	96.77	0.1	0.77
		日本			3,575,831,400	3,570,849,900	2028/12/20	
28	376回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,720,000,000	96.26	95.22	0.9	0.76
		日本			3,580,905,000	3,542,221,200	2034/9/20	
29	344回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,570,000,000	99.01	99.03	0.1	0.76
		日本			3,534,657,000	3,535,442,400	2026/9/20	
30	358回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,650,000,000	95.45	95.17	0.1	0.74
		日本			3,483,952,500	3,473,997,000	2030/3/20	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年3月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	86.02
地方債証券	5.39
特殊債券	4.64
社債券	4.21
合計	100.26

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証券	1,121,400,000	99.08 1,111,083,994	101.01 1,132,745,416	4.375 2034/5/15	0.41
2	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証券	1,121,400,000	96.39 1,081,012,083	98.32 1,102,629,692	4 2034/2/15	0.40
3	US T N/B 4.625 02/15/35 アメリカ	国債証券	1,046,640,000	102.95 1,077,579,937	102.92 1,077,303,286	4.625 2035/2/15	0.39
4	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,172,236,800	89.28 1,046,656,348	91.22 1,069,345,543	2.75 2032/8/15	0.39
5	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,046,640,000	100.13 1,048,091,396	102.07 1,068,390,487	4.5 2033/11/15	0.39
6	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,249,987,200	82.26 1,028,358,603	84.16 1,052,064,425	1.25 2031/8/15	0.38
7	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 中国	国債証券	1,028,820,000	101.14 1,040,609,659	100.81 1,037,157,763	2.18 2026/8/15	0.38
8	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,084,020,000	93.60 1,014,659,650	95.51 1,035,366,132	3.5 2033/2/15	0.38
9	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,046,640,000	95.77 1,002,464,434	97.71 1,022,743,084	3.875 2033/8/15	0.37
10	US T N/B 3.875 08/15/34 アメリカ	国債証券	1,046,640,000	95.19 996,351,652	97.11 1,016,467,334	3.875 2034/8/15	0.37
11	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証券	958,860,240	101.95 977,615,354	101.57 973,953,083	2.69 2026/8/12	0.35
12	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,054,116,000	90.39 952,842,626	92.30 973,019,071	2.875 2032/5/15	0.35
13	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27 中国	国債証券	967,090,800	99.62 963,447,648	99.73 964,560,261	1.42 2027/11/15	0.35
14	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	1,001,784,000	92.51 926,845,854	94.43 946,020,631	3.375 2033/5/15	0.34
15	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,058,601,600	84.73 896,999,448	86.62 917,054,984	1.875 2032/2/15	0.33
16	US T N/B 4.25 12/31/26 アメリカ	国債証券	897,120,000	100.31 899,981,812	100.50 901,605,600	4.25 2026/12/31	0.33
17	US T N/B 4.125 01/31/27 アメリカ	国債証券	897,120,000	100.12 898,223,457	100.31 899,941,020	4.125 2027/1/31	0.33
18	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	855,978,240	105.45 902,699,283	104.93 898,178,908	2.68 2030/5/21	0.33
19	FRANCE OAT 0.75 02/25/28 フランス	国債証券	920,614,400	95.14 875,937,232	95.60 880,157,768	0.75 2028/2/25	0.32
20	US T N/B 6.25 05/15/30 アメリカ	国債証券	786,325,680	108.76 855,252,039	110.36 867,845,540	6.25 2030/5/15	0.32
21	US T N/B 4.25 11/15/34 アメリカ	国債証券	867,216,000	97.97 849,668,421	99.94 866,741,736	4.25 2034/11/15	0.32
22	US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	897,120,000	95.94	96.51	0.75	0.31

	アメリカ	券		860,744,581	865,878,492	2026/4/30	
23	US T N/B 3.5 01/31/28 アメリカ	国債証 券	849,273,600	98.20 834,009,569	98.90 839,934,909	3.5 2028/1/31	0.31
24	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証 券	837,312,000	98.41 824,082,207	99.89 836,445,247	4.125 2032/11/15	0.30
25	US T N/B 4.25 01/15/28 アメリカ	国債証 券	822,360,000	99.90 821,556,916	100.88 829,652,021	4.25 2028/1/15	0.30
26	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	947,956,800	86.12 816,393,707	86.84 823,259,745	1.625 2031/5/15	0.30
27	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証 券	812,767,800	101.11 821,844,606	100.79 819,252,467	2.3 2026/5/15	0.30
28	US T N/B 0.75 05/31/26 アメリカ	国債証 券	841,797,600	95.66 805,347,106	96.27 810,476,809	0.75 2026/5/31	0.29
29	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証 券	822,360,000	91.14 749,536,164	92.40 759,895,976	1.125 2028/2/29	0.28
30	US T N/B 4.25 01/31/30 アメリカ	国債証 券	747,600,000	100.72 753,020,100	101.16 756,302,527	4.25 2030/1/31	0.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2025年3月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.57
合計	98.57

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2025年3月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0706月	買建	892	24,344,511,360	23,745,040,000	3.98

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年3月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Jun25	買建	572	24,427,964,568	24,045,477,456	1.37
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun25	買建	512	4,449,820,497	4,372,477,542	0.25
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun25	買建	75	1,260,760,336	1,259,733,090	0.07
	モンテリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun25	買建	33	1,025,793,562	1,024,745,436	0.06
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Jun25	買建	29	540,339,246	546,388,565	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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

直近日（2025年3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 (2022年9月16日)	69	69	0.9842	0.9842
第2計算期間末 (2023年9月19日)	426	426	1.0763	1.0763
第3計算期間末 (2024年9月17日)	1,390	1,390	1.1587	1.1587
2024年3月末日	856	—	1.1985	—
4月末日	957	—	1.2009	—
5月末日	1,101	—	1.2102	—
6月末日	1,204	—	1.2443	—

7月末日	1,348	—	1.2124	—
8月末日	1,408	—	1.1892	—
9月末日	1,449	—	1.1885	—
10月末日	1,613	—	1.2273	—
11月末日	1,613	—	1.2198	—
12月末日	1,769	—	1.2547	—
2025年1月末日	1,841	—	1.2477	—
2月末日	1,805	—	1.2071	—
3月末日	1,850	—	1.1951	—

②【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2024年9月18日～2025年3月17日	—

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	△1.6
第2計算期間	9.4
第3計算期間	7.7
2024年9月18日～2025年3月17日	3.7

（注）収益率は期間騰落率です。

（4）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	113,391,367	42,328,958
第2計算期間	527,599,029	202,667,624
第3計算期間	1,424,544,061	620,047,322
2024年9月18日～ 2025年3月17日	706,153,400	367,767,207

（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。

基準価額・純資産の推移 (2021年9月16日~2025年3月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、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:2021年9月16日)

分配の推移(税引前)

2022年 9月	0円
2023年 9月	0円
2024年 9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	29.21
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	28.38
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.94
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.88

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.54
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	3.30
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	3.23
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.26
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.96

■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	5.00
2	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	4.10
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.08
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.78
5	META PLATFORMS INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.92

○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。

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	153回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2027/6/20	1.49
2	349回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/12/20	1.27
3	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.22
4	348回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/9/20	1.17
5	377回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.2	2034/12/20	1.04

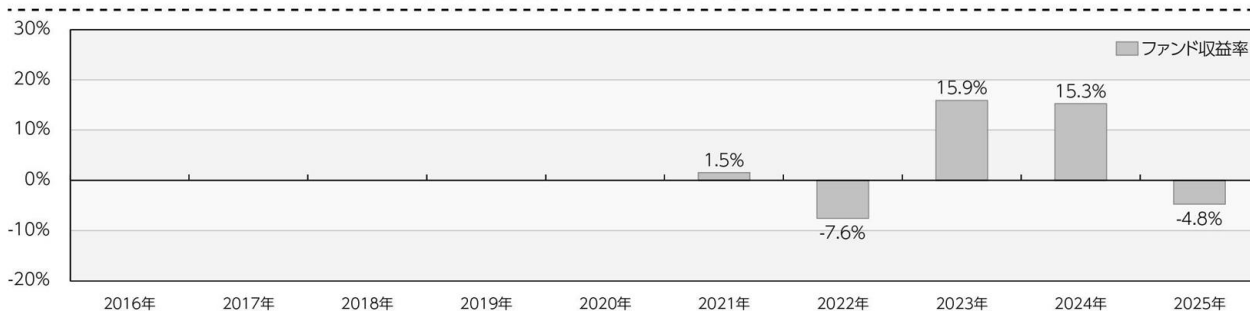
■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 4.375 05/15/34	国債証券	アメリカ	4.375	2034/5/15	0.41
2	US T N/B 4.0 02/15/34	国債証券	アメリカ	4	2034/2/15	0.40
3	US T N/B 4.625 02/15/35	国債証券	アメリカ	4.625	2035/2/15	0.39
4	US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	アメリカ	2.75	2032/8/15	0.39
5	US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	アメリカ	4.5	2033/11/15	0.39

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。

※2021年は設定日から年末までの収益率、および2025年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合には、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。

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

<基準価額の照会方法等>

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

・お申込手数料

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

※解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口

数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は、2021年9月16日（設定日）から原則として2051年9月15日までです。

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

(4) 【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年9月17日から翌年9月16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、信託財産の純資産総額が30億円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。以下イ. 償還規定c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解

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

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

ロ. 信託約款の変更等

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

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

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。

ニ. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、2022年以降の毎年9月16日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年9月20日から2024年9月17日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 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Oneグローバルバランスの2023年9月20日から2024年9月17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、Oneグローバルバランスの2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

1【財務諸表】

【Oneグローバルバランス】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2023年9月19日現在	第3期 2024年9月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	22,784,731	24,789,824
親投資信託受益証券	409,266,239	1,371,945,209
未収入金	—	5,500,000
流動資産合計	432,050,970	1,402,235,033
資産合計		
	432,050,970	1,402,235,033
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,062,281	4,802,702
未払受託者報酬	52,153	187,658
未払委託者報酬	1,739,667	6,256,650
その他未払費用	6,094	22,183
流動負債合計	5,860,195	11,269,193
負債合計		
	5,860,195	11,269,193
純資産の部		
元本等		
元本	395,993,814	1,200,490,553
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	30,196,961	190,475,287
(分配準備積立金)	23,716,114	14,067,173
元本等合計	426,190,775	1,390,965,840
純資産合計		
	426,190,775	1,390,965,840
負債純資産合計		
	432,050,970	1,402,235,033

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自 2022年9月17日 至 2023年9月19日	第3期 自 2023年9月20日 至 2024年9月17日
営業収益		
受取利息	130	22,237
有価証券売買等損益	33,382,631	27,078,970
営業収益合計	33,382,761	27,101,207
営業費用		
支払利息	5,676	1,756
受託者報酬	67,989	278,502
委託者報酬	2,268,600	9,286,067
その他費用	7,888	32,882
営業費用合計	2,350,153	9,599,207
営業利益又は営業損失(△)	31,032,608	17,502,000
経常利益又は経常損失(△)	31,032,608	17,502,000
当期純利益又は当期純損失(△)	31,032,608	17,502,000
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(△)	7,044,936	25,503,513
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△1,125,359	30,196,961
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,334,648	236,823,786
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,681,002	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,653,646	236,823,786
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	68,543,947
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	68,543,947
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	30,196,961	190,475,287

(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3期	
	自 2023年9月20日	至 2024年9月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年9月16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9月19日、当計算期間末日を2024年9月17日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	2023年9月19日現在	2024年9月17日現在
1. 期首元本額	71,062,409円	395,993,814円
期中追加設定元本額	527,599,029円	1,424,544,061円
期中一部解約元本額	202,667,624円	620,047,322円
2. 受益権の総数	395,993,814口	1,200,490,553口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年9月17日 至 2023年9月19日	自 2023年9月20日 至 2024年9月17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(2,879,597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(20,785,283円)、信託約款に規定される収益調整金(6,480,847円)及び分配準備積立金(51,234円)より分配対象収益は30,196,961円(1万口当たり762.56円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,985,253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(176,408,114円)及び分配準備積立金(9,081,920円)より分配対象収益は190,475,287円(1万口当たり1,586.64円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期	第3期
	自 2022年9月17日 至 2023年9月19日	自 2023年9月20日 至 2024年9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ロー	同左

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>同左</p>
--------------------------	--	-----------

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2023年9月19日現在	第3期 2024年9月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期 2023年9月19日現在	第3期 2024年9月17日現在

	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	32,484,246	24,747,511
合計	32,484,246	24,747,511

(デリバティブ取引等に関する注記)
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第2期 2023年9月19日現在	第3期 2024年9月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0763円 (10,763円)	1.1587円 (11,587円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年9月17日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	89,970,928	406,074,786	
	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	218,170,191	267,498,471	
	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	46,242,509	408,857,767	
	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	124,704,594	289,514,185	
親投資信託受益証券	合計	479,088,222	1,371,945,209	
合計			1,371,945,209	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年9月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,709,609,438
株式	539,415,442,040
派生商品評価勘定	78,956,410
未収入金	202,044,119
未収配当金	217,869,601
差入委託証拠金	620,702,876
流動資産合計	547,244,624,484
資産合計	547,244,624,484
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,417,060
前受金	89,640,000
未払解約金	72,781,000
流動負債合計	181,838,060
負債合計	181,838,060
純資産の部	
元本等	
元本	121,209,440,968
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	425,853,345,456
元本等合計	547,062,786,424
純資産合計	547,062,786,424
負債純資産合計	547,244,624,484

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9月20日 至 2024年9月17日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年9月17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	116,525,629,287円
同期中追加設定元本額	52,331,846,132円
同期中一部解約元本額	47,648,034,451円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,375,305,602円
たわらノーロード 国内株式くらっ専用>	6,129,695,098円
One DC 国内株式インデックスファンド	34,103,208,810円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,494,391,569円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,958,569円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	7,816,793円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	18,464,444円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	25,971,845円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	23,787,518円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	11,462,434円
たわらノーロード TOPIX	3,000,545,562円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,930,783,987円
たわらノーロード バランス (堅実型)	52,057,574円
たわらノーロード バランス (標準型)	406,160,484円
たわらノーロード バランス (積極型)	742,224,338円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	2,389,055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)	140,871,405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)	431,517,327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)	395,639,480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)	585,884,804円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	288,577円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,172,141円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	27,441,177円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,733,738円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	15,796,318円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (安定型)	10,674円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (バランス型)	49,545円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (積極型)	439,685円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金> O n eグローバルバランス	33,437,112,099円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	89,970,928円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	890,971,321円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,229,959,047円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	3,895,134,255円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	244,083,540円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	852,049,680円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	1,014,093,300円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	25,854,132円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	971,013,845円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	12,880,508円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	260,339,155円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	325,204,830円
投資のソムリエ	572,843,797円
クルーズコントロール	5,947,063,286円
投資のソムリエ<DC年金>	35,585,879円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	684,396,390円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	369,446,669円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,415,687,910円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	300,385,019円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	874,419,543円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	63,103,334円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	32,758,675円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	2,941,909円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	154,724,734円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	593,740,816円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	98,179,798円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	229,990,397円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	61,151,635円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	35,389,571円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	21,552,121円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	713,400,793円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	5,651,037円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	1,042,539円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2070)	29,726,754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)	41,699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)	275,133円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	252,745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)	2,656,967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)	207,527円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	404,731円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	685,293円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	92,609,788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）	199,462円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	85,890,626円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022-10（適格機関投資家限定）	359,385,111円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01（適格機関投資家限定）	664,237円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2024-05（適格機関投資家限定）	363,541,380円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	102,134,834円
AMOn eマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	2,168,588円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	20,351,578円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	29,381,715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）	432,241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）	3,458,466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）	31,370,493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）	58,116,551円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,433,807円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	9,213,781円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,886,481円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	77,275円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	516,872円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,500,268円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	228,371,452円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	355,319,857円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,103,271,712円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	8,612,519円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	12,745,738円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	118,794,670円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	23,782,075円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	50,709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）	107,771,167円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	6,909,262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）	25,445,504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）	50,290,104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）	114,046,880円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	15,622,767円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	6,000,539円
動的パッケージファンド<DC年金>	17,295,366円
コア資産形成ファンド	8,076,598円
MHAMトピックスファンド	781,025,764円

MHAM TOPIXファンドVA (適格機関投資家専用)	43,736,527円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,926,589,438円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2,425,971,240円
計	121,209,440,968円
2. 受益権の総数	121,209,440,968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9月20日 至 2024年9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年9月17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	2024年9月17日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	
株式	△1,132,548,164	
合計	△1,132,548,164	

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間 (2024年2月8日から2024年9月17日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2024年9月17日現在			
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	7,670,585,000	—		7,730,225,000
合計	7,670,585,000	—		7,730,225,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年9月17日現在	
1口当たり純資産額	4.5134円
(1万口当たり純資産額)	(45,134円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年9月17日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	8,700	4,325.00	37,627,500	
ニッセイ	210,200	921.70	193,741,340	
マルハニチロ	31,100	3,088.00	96,036,800	
雪国まいたけ	17,900	1,011.00	18,096,900	
カネコ種苗	5,800	1,371.00	7,951,800	
サカタのタネ	23,900	3,355.00	80,184,500	
ホクト	16,800	1,808.00	30,374,400	
ホクリヨウ	1,300	981.00	1,275,300	
ショーボンドホールディングス	28,600	5,584.00	159,702,400	

ミライト・ワン	63,500	2,015.50	127,984,250
タマホーム	13,200	3,920.00	51,744,000
サンヨーホームズ	1,000	705.00	705,000
日本アクア	3,000	868.00	2,604,000
ファーストコーポレーション	2,000	754.00	1,508,000
ベステラ	1,700	900.00	1,530,000
r o b o t h o m e	41,200	138.00	5,685,600
キャンディル	1,400	590.00	826,000
住石ホールディングス	29,700	977.00	29,016,900
日鉄鉱業	8,400	4,155.00	34,902,000
三井松島ホールディングス	12,600	4,600.00	57,960,000
I N P E X	635,600	1,849.00	1,175,224,400
石油資源開発	24,300	5,260.00	127,818,000
K&Oエナジーグループ	9,500	3,250.00	30,875,000
リョーサン菱洋ホールディングス	29,800	2,592.00	77,241,600
ダイセキ環境ソリューション	1,500	1,005.00	1,507,500
第一カッター興業	6,000	1,493.00	8,958,000
明豊ファシリティワークス	1,700	832.00	1,414,400
安藤・間	121,800	1,119.00	136,294,200
東急建設	65,800	719.00	47,310,200
コムシスホールディングス	67,100	3,125.00	209,687,500
ビーアールホールディングス	30,800	361.00	11,118,800
高松コンストラクショングループ	15,700	2,977.00	46,738,900
東建コーポレーション	5,200	11,650.00	60,580,000
ソネック	1,000	927.00	927,000
ヤマウラ	10,700	1,127.00	12,058,900
オリエンタル白石	78,000	388.00	30,264,000
大成建設	134,800	6,275.00	845,870,000
大林組	526,000	1,807.00	950,482,000
清水建設	417,000	999.70	416,874,900
飛鳥建設	15,100	1,422.00	21,472,200
長谷工コーポレーション	135,000	1,883.00	254,205,000
松井建設	13,700	744.00	10,192,800
銭高組	500	3,400.00	1,700,000
鹿島建設	326,100	2,595.50	846,392,550
不動テトラ	10,300	2,231.00	22,979,300
大末建設	1,400	1,623.00	2,272,200
鉄建建設	10,500	2,380.00	24,990,000
西松建設	27,900	5,261.00	146,781,900
三井住友建設	109,600	396.00	43,401,600
大豊建設	5,000	3,515.00	17,575,000
佐田建設	2,100	859.00	1,803,900
ナカノフドー建設	3,600	470.00	1,692,000
奥村組	23,800	4,370.00	104,006,000
東鉄工業	18,200	3,395.00	61,789,000
イチケン	800	2,556.00	2,044,800
富士ピー・エス	2,400	442.00	1,060,800
浅沼組	54,500	677.00	36,896,500
戸田建設	198,900	985.60	196,035,840
熊谷組	24,200	3,435.00	83,127,000

北野建設	600	3,800.00	2,280,000
植木組	1,000	1,619.00	1,619,000
矢作建設工業	20,000	1,575.00	31,500,000
ピーエス・コンストラクション	18,600	1,004.00	18,674,400
日本ハウスホールディングス	31,400	359.00	11,272,600
大東建託	54,200	17,670.00	957,714,000
新日本建設	20,700	1,591.00	32,933,700
サムティホールディングス	28,700	2,625.00	75,337,500
東亜道路工業	28,100	1,345.00	37,794,500
日本道路	17,200	1,679.00	28,878,800
東亜建設工業	44,300	917.00	40,623,100
日本国土開発	41,800	495.00	20,691,000
若築建設	5,000	3,255.00	16,275,000
東洋建設	37,000	1,342.00	49,654,000
五洋建設	208,500	595.00	124,057,500
世紀東急工業	18,800	1,579.00	29,685,200
福田組	5,500	5,400.00	29,700,000
日本ドライケミカル	800	3,270.00	2,616,000
住友林業	127,200	6,420.00	816,624,000
日本基礎技術	3,100	676.00	2,095,600
巴コーポレーション	4,100	915.00	3,751,500
大和ハウス工業	406,800	4,573.00	1,860,296,400
ライト工業	27,200	2,109.00	57,364,800
積水ハウス	446,000	3,808.00	1,698,368,000
日特建設	14,000	1,003.00	14,042,000
北陸電気工事	10,200	1,174.00	11,974,800
ユアテック	32,400	1,532.00	49,636,800
日本リーテック	11,500	1,054.00	12,121,000
四電工	6,100	3,880.00	23,668,000
中電工	22,800	3,330.00	75,924,000
関電工	92,200	2,213.00	204,038,600
きんでん	102,200	3,286.00	335,829,200
東京エネシス	13,700	1,088.00	14,905,600
トーエネック	4,800	4,815.00	23,112,000
住友電設	13,900	4,015.00	55,808,500
日本電設工業	27,700	1,759.00	48,724,300
エクシオグループ	143,800	1,545.50	222,242,900
新日本空調	9,500	3,365.00	31,967,500
九電工	31,700	6,530.00	207,001,000
三機工業	31,700	2,230.00	70,691,000
日揮ホールディングス	145,400	1,204.50	175,134,300
中外炉工業	4,800	2,605.00	12,504,000
ヤマト	2,600	957.00	2,488,200
太平電業	9,100	5,120.00	46,592,000
高砂熱学工業	39,500	5,130.00	202,635,000
三晃金属工業	400	3,980.00	1,592,000
NEC ネットズエスアイ	58,600	2,656.00	155,641,600
朝日工業社	13,700	1,281.00	17,549,700
明星工業	28,400	1,167.00	33,142,800
大気社	16,900	4,730.00	79,937,000

ダイダン	19,300	2,942.00	56,780,600
日比谷総合設備	10,600	3,300.00	34,980,000
ニッポン	44,200	2,216.00	97,947,200
日清製粉グループ本社	136,600	1,858.00	253,802,800
日東富士製粉	2,400	6,890.00	16,536,000
昭和産業	14,300	2,888.00	41,298,400
鳥越製粉	2,900	681.00	1,974,900
中部飼料	20,500	1,485.00	30,442,500
フィード・ワン	21,700	833.00	18,076,100
東洋精糖	1,000	1,430.00	1,430,000
日本甜菜製糖	8,600	2,777.00	23,882,200
DM三井製糖ホールディングス	14,600	3,335.00	48,691,000
塩水港精糖	6,600	264.00	1,742,400
ウェルネオシュガー	7,400	2,160.00	15,984,000
L I F U L L	37,800	139.00	5,254,200
M I X I	33,100	2,877.00	95,228,700
ジェイエイシーリクルートメント	55,700	782.00	43,557,400
日本M&Aセンターホールディングス	245,600	636.50	156,324,400
メンバーズ	5,200	903.00	4,695,600
中広	800	518.00	414,400
UTグループ	20,000	2,650.00	53,000,000
アイティメディア	5,800	1,599.00	9,274,200
ケアネット	31,400	633.00	19,876,200
E・Jホールディングス	9,000	1,726.00	15,534,000
オープンアップグループ	46,400	2,062.00	95,676,800
コシダカホールディングス	46,100	999.00	46,053,900
アルトナー	1,500	1,794.00	2,691,000
パソナグループ	18,700	2,214.00	41,401,800
CDS	1,400	1,811.00	2,535,400
リンクアンドモチベーション	38,100	620.00	23,622,000
エス・エム・エス	54,100	2,122.00	114,800,200
サニーサイドアップグループ	1,800	531.00	955,800
パーソルホールディングス	1,569,400	270.80	424,993,520
リニカル	3,400	387.00	1,315,800
クックパッド	42,200	194.00	8,186,800
エスクリ	2,300	235.00	540,500
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,500	767.00	1,917,500
森永製菓	61,800	2,895.50	178,941,900
中村屋	3,600	3,230.00	11,628,000
江崎グリコ	42,300	4,323.00	182,862,900
名糖産業	5,800	1,872.00	10,857,600
井村屋グループ	8,900	2,529.00	22,508,100
不二家	10,300	2,718.00	27,995,400
山崎製パン	98,800	2,779.00	274,565,200
第一屋製パン	1,000	664.00	664,000
モロゾフ	4,600	4,495.00	20,677,000
亀田製菓	8,400	4,510.00	37,884,000
寿スピリッツ	69,700	1,722.50	120,058,250
カルビー	67,600	3,414.00	230,786,400
森永乳業	51,500	3,450.00	177,675,000

六甲バター	10,900	1,518.00	16,546,200
ヤクルト本社	211,000	3,182.00	671,402,000
明治ホールディングス	181,000	3,681.00	666,261,000
雪印メグミルク	35,800	2,635.00	94,333,000
プリマハム	19,800	2,342.00	46,371,600
日本ハム	63,500	5,428.00	344,678,000
林兼産業	1,700	478.00	812,600
丸大食品	14,900	1,782.00	26,551,800
S Foods	16,300	2,680.00	43,684,000
柿安本店	5,700	2,661.00	15,167,700
伊藤ハム米久ホールディングス	22,500	3,865.00	86,962,500
学情	7,700	1,663.00	12,805,100
スタジオアリス	7,600	2,077.00	15,785,200
クロスキャット	9,500	1,134.00	10,773,000
エプコ	1,500	793.00	1,189,500
システナ	227,400	374.00	85,047,600
N J S	3,400	3,375.00	11,475,000
デジタルアーツ	9,500	4,490.00	42,655,000
日鉄ソリューションズ	51,300	3,670.00	188,271,000
総合警備保障	257,500	1,046.50	269,473,750
キューブシステム	7,900	1,027.00	8,113,300
いちご	150,000	354.00	53,100,000
日本駐車場開発	175,700	232.00	40,762,400
コア	6,700	1,866.00	12,502,200
カカクコム	100,000	2,579.50	257,950,000
アイロムグループ	6,200	2,780.00	17,236,000
セントケア・ホールディング	11,200	742.00	8,310,400
サイネックス	1,000	669.00	669,000
ルネサンス	12,100	1,064.00	12,874,400
ディップ	23,500	2,762.00	64,907,000
S B Sホールディングス	13,200	2,453.00	32,379,600
デジタルホールディングス	7,900	930.00	7,347,000
新日本科学	14,000	1,150.00	16,100,000
キャリアデザインセンター	600	1,826.00	1,095,600
エムスリー	304,600	1,348.50	410,753,100
ツカダ・グローバルホールディング	3,300	393.00	1,296,900
プラス	700	554.00	387,800
ウェルネット	3,000	790.00	2,370,000
ワールドホールディングス	6,100	1,870.00	11,407,000
ディー・エヌ・エー	54,700	1,588.50	86,890,950
博報堂D Yホールディングス	196,600	1,174.00	230,808,400
ぐるなび	28,700	372.00	10,676,400
タカミヤ	21,100	431.00	9,094,100
ファンコミュニケーションズ	21,900	406.00	8,891,400
ライク	5,700	1,436.00	8,185,200
A o b a - B B T	2,100	319.00	669,900
エスプール	44,300	344.00	15,239,200
W D Bホールディングス	7,800	1,725.00	13,455,000
手間いらず	2,500	3,400.00	8,500,000
ティア	3,700	454.00	1,679,800

CDG	600	1,678.00	1,006,800
アドウェイズ	18,800	339.00	6,373,200
バリューコマース	13,400	1,087.00	14,565,800
インフォマート	145,400	323.00	46,964,200
サッポロホールディングス	48,500	7,655.00	371,267,500
アサヒグループホールディングス	369,500	5,479.00	2,024,490,500
キリンホールディングス	615,000	2,177.00	1,338,855,000
宝ホールディングス	99,700	1,156.50	115,303,050
オエノンホールディングス	44,100	396.00	17,463,600
養命酒製造	4,800	2,253.00	10,814,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	104,200	2,085.50	217,309,100
ライフドリンク カンパニー	3,000	7,600.00	22,800,000
サントリー食品インターナショナル	104,000	5,553.00	577,512,000
ダイドーグループホールディングス	16,700	2,980.00	49,766,000
伊藤園	49,900	3,266.00	162,973,400
キーコーヒー	16,500	2,045.00	33,742,500
ユニカフェ	1,800	926.00	1,666,800
日清オイリオグループ	20,800	5,370.00	111,696,000
不二製油グループ本社	34,300	3,347.00	114,802,100
かどや製油	400	3,660.00	1,464,000
J-オイルミルズ	16,900	1,974.00	33,360,600
サンエー	24,400	2,599.00	63,415,600
カワチ薬品	12,500	2,658.00	33,225,000
エービーシー・マート	69,300	3,111.00	215,592,300
ハードオフコーポレーション	6,300	1,919.00	12,089,700
高千穂交易	6,300	3,910.00	24,633,000
アスクル	38,300	2,009.00	76,944,700
ゲオホールディングス	17,900	1,511.00	27,046,900
アダストリア	19,000	3,435.00	65,265,000
ジーフット	4,300	287.00	1,234,100
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	700	563.00	394,100
オルパヘルスケアホールディングス	1,000	1,886.00	1,886,000
伊藤忠食品	3,600	7,200.00	25,920,000
くら寿司	18,600	3,620.00	67,332,000
キャンドウ	5,600	3,500.00	19,600,000
エレマテック	14,100	1,714.00	24,167,400
I Kホールディングス	1,900	357.00	678,300
パルグループホールディングス	31,100	2,442.00	75,946,200
エディオン	63,000	1,848.00	116,424,000
あらた	24,200	3,555.00	86,031,000
サーラコーポレーション	33,300	821.00	27,339,300
ワッツ	2,300	842.00	1,936,600
トーマンデバイス	2,300	5,530.00	12,719,000
ハローズ	7,300	4,170.00	30,441,000
J Pホールディングス	39,500	730.00	28,835,000
フジオフードグループ本社	17,900	1,342.00	24,021,800
あみやき亭	3,900	5,970.00	23,283,000
東京エレクトロン デバイス	15,900	3,485.00	55,411,500
ひらまつ	8,400	193.00	1,621,200

円谷フィールズホールディングス	25,600	2,250.00	57,600,000
双日	176,600	3,185.00	562,471,000
アルフレッサ ホールディングス	159,400	2,319.50	369,728,300
大黒天物産	4,800	11,660.00	55,968,000
ハニーズホールディングス	14,000	1,615.00	22,610,000
ファーマライズホールディングス	1,400	609.00	852,600
キッコーマン	489,200	1,605.00	785,166,000
味の素	347,100	5,346.00	1,855,596,600
ブルドックソース	7,700	1,771.00	13,636,700
キューピー	79,400	3,579.00	284,172,600
ハウス食品グループ本社	50,900	3,010.00	153,209,000
カゴメ	63,500	3,116.00	197,866,000
アリアケジャパン	14,700	5,060.00	74,382,000
ピエトロ	800	1,782.00	1,425,600
エバラ食品工業	3,500	2,755.00	9,642,500
やまみ	500	4,775.00	2,387,500
ニチレイ	67,600	4,461.00	301,563,600
横浜冷凍	39,800	955.00	38,009,000
東洋水産	74,700	9,231.00	689,555,700
イートアンドホールディングス	7,100	2,013.00	14,292,300
大冷	800	1,964.00	1,571,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,800	1,632.00	11,097,600
日清食品ホールディングス	155,700	3,957.00	616,104,900
一正蒲鉾	1,500	750.00	1,125,000
フジッコ	15,200	1,700.00	25,840,000
ロック・フィールド	18,000	1,434.00	25,812,000
日本たばこ産業	897,300	4,070.00	3,652,011,000
ケンコーマヨネーズ	10,300	2,367.00	24,380,100
わらべや日洋ホールディングス	9,900	2,329.00	23,057,100
なとり	9,300	2,069.00	19,241,700
イフジ産業	1,100	1,425.00	1,567,500
ファーマフーズ	19,600	853.00	16,718,800
北の達人コーポレーション	63,400	164.00	10,397,600
ユウグレナ	92,000	458.00	42,136,000
紀文食品	12,900	1,195.00	15,415,500
ピックルスホールディングス	8,700	1,009.00	8,778,300
スター・マイカ・ホールディングス	15,200	594.00	9,028,800
SREホールディングス	6,300	4,245.00	26,743,500
ADワークスグループ	8,300	203.00	1,684,900
片倉工業	13,800	2,015.00	27,807,000
グンゼ	10,700	5,480.00	58,636,000
ヒューリック	344,500	1,447.00	498,491,500
神栄	800	1,636.00	1,308,800
ラサ商事	7,300	1,407.00	10,271,100
アルペン	13,100	2,139.00	28,020,900
ハブ	1,700	751.00	1,276,700
ラクーンホールディングス	11,300	738.00	8,339,400
クオールホールディングス	21,900	1,381.00	30,243,900
アルコニックス	21,000	1,348.00	28,308,000
神戸物産	122,800	4,573.00	561,564,400

ソリトンシステムズ	7,700	1,034.00	7,961,800
ジンズホールディングス	12,200	5,200.00	63,440,000
ビックカメラ	94,900	1,554.00	147,474,600
DCMホールディングス	82,100	1,478.00	121,343,800
ペッパーフードサービス	39,000	181.00	7,059,000
ハイパー	1,200	321.00	385,200
MonotaRO	224,900	2,397.00	539,085,300
東京一番フーズ	1,500	514.00	771,000
DDグループ	2,300	1,284.00	2,953,200
あいホールディングス	26,200	2,342.00	61,360,400
ディーブイエックス	1,500	918.00	1,377,000
きちりホールディングス	1,500	841.00	1,261,500
J. フロント リテイリング	182,000	1,475.50	268,541,000
ドトール・日レスホールディングス	28,000	2,300.00	64,400,000
マツキヨココカラ&カンパニー	288,600	2,237.50	645,742,500
ブロンコビリー	9,300	3,695.00	34,363,500
ZOZO	101,200	4,929.00	498,814,800
トレジャー・ファクトリー	10,900	1,695.00	18,475,500
物語コーポレーション	26,600	3,645.00	96,957,000
三越伊勢丹ホールディングス	262,700	2,196.50	577,020,550
東洋紡	64,900	970.00	62,953,000
ユニチカ	48,500	285.00	13,822,500
富士紡ホールディングス	6,600	4,350.00	28,710,000
日清紡ホールディングス	113,900	903.30	102,885,870
倉敷紡績	10,600	4,510.00	47,806,000
ダイワボウホールディングス	70,200	2,688.50	188,732,700
シキボウ	10,800	1,016.00	10,972,800
日東紡績	19,000	5,540.00	105,260,000
トヨタ紡織	63,200	1,817.00	114,834,400
マクニカホールディングス	37,600	5,620.00	211,312,000
Hamee	6,500	1,037.00	6,740,500
マーケットエンタープライズ	500	823.00	411,500
ラクト・ジャパン	6,800	2,909.00	19,781,200
ウエルシアホールディングス	82,300	1,938.00	159,497,400
クリエイトSDホールディングス	22,400	3,100.00	69,440,000
グリムス	6,700	2,599.00	17,413,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,000	1,203.00	28,872,000
八洲電機	12,900	1,575.00	20,317,500
メディアスホールディングス	9,300	782.00	7,272,600
レスター	13,300	2,637.00	35,072,100
ジオリーブグループ	1,400	1,118.00	1,565,200
丸善CHIホールディングス	4,100	325.00	1,332,500
大光	2,800	601.00	1,682,800
OCHIホールディングス	800	1,373.00	1,098,400
TOKAIホールディングス	86,100	988.00	85,066,800
黒谷	1,600	592.00	947,200
ミサワ	1,200	616.00	739,200
ティーライフ	700	1,109.00	776,300
Cominix	1,200	896.00	1,075,200

エー・ピーホールディングス	1,400	987.00	1,381,800
三洋貿易	16,200	1,455.00	23,571,000
チムニー	1,200	1,325.00	1,590,000
シュッピン	14,300	1,178.00	16,845,400
ビューティガレージ	5,000	1,603.00	8,015,000
オイシックス・ラ・大地	21,500	1,340.00	28,810,000
ウイン・パートナーズ	10,300	1,144.00	11,783,200
ネクステージ	36,300	1,764.00	64,033,200
ジョイフル本田	44,000	2,139.00	94,116,000
エターナルホスピタリティグループ	5,800	3,575.00	20,735,000
ホットランド	12,300	2,331.00	28,671,300
すかいらーくホールディングス	216,800	2,340.00	507,312,000
SFPホールディングス	7,600	1,960.00	14,896,000
綿半ホールディングス	12,400	1,769.00	21,935,600
日本毛織	38,500	1,303.00	50,165,500
ダイトウボウ	8,100	101.00	818,100
トーア紡コーポレーション	1,800	401.00	721,800
ダイドーリミテッド	4,100	937.00	3,841,700
ヨシックスホールディングス	3,700	3,240.00	11,988,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,300	842.00	37,300,600
野村不動産ホールディングス	82,200	3,889.00	319,675,800
三重交通グループホールディングス	31,600	490.00	15,484,000
ディア・ライフ	25,100	878.00	22,037,800
コーセーアールイー	1,600	625.00	1,000,000
地主	11,300	1,989.00	22,475,700
プレサンスコーポレーション	19,500	1,859.00	36,250,500
フィル・カンパニー	2,300	588.00	1,352,400
THEグローバル社	3,400	633.00	2,152,200
ハウスコム	800	1,071.00	856,800
JPMC	8,500	1,094.00	9,299,000
サンセイラディック	1,500	960.00	1,440,000
エストラスト	600	700.00	420,000
フージャースホールディングス	22,600	1,030.00	23,278,000
オープンハウスグループ	54,200	5,482.00	297,124,400
東急不動産ホールディングス	444,100	955.20	424,204,320
飯田グループホールディングス	141,500	2,227.50	315,191,250
イーグランド	700	1,450.00	1,015,000
ムゲンエステート	2,500	1,507.00	3,767,500
帝国繊維	17,000	2,810.00	47,770,000
日本コークス工業	152,400	96.00	14,630,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,200	477.00	3,434,400
ミタチ産業	1,500	1,122.00	1,683,000
BENOS	9,400	2,457.00	23,095,800
あさひ	14,600	1,618.00	23,622,800
日本調剤	10,400	1,235.00	12,844,000
コスモス薬品	26,600	7,306.00	194,339,600
シップヘルスケアホールディングス	57,100	2,132.00	121,737,200
トーエル	1,600	790.00	1,264,000
ソフトクリエイトホールディングス	12,500	1,718.00	21,475,000

セブン&アイ・ホールディングス	1,606,800	2,158.50	3,468,277,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	107,400	1,063.00	114,166,200
明治電機工業	5,900	1,457.00	8,596,300
ツルハホールディングス	33,300	8,607.00	286,613,100
デリカフーズホールディングス	2,400	574.00	1,377,600
スターティアホールディングス	1,000	1,994.00	1,994,000
サンマルクホールディングス	12,800	2,127.00	27,225,600
フェリシモ	1,300	908.00	1,180,400
トリドールホールディングス	44,400	3,580.00	158,952,000
帝人	144,300	1,372.50	198,051,750
東レ	1,006,500	742.10	746,923,650
クラレ	218,800	1,954.50	427,644,600
旭化成	1,016,300	1,029.50	1,046,280,850
TOKYO BASE	16,900	228.00	3,853,200
稲葉製作所	8,600	1,759.00	15,127,400
宮地エンジニアリンググループ	7,600	4,135.00	31,426,000
トーカロ	44,700	1,721.00	76,928,700
アルファ	1,400	1,181.00	1,653,400
SUMCO	294,600	1,397.00	411,556,200
川田テクノロジーズ	11,000	2,515.00	27,665,000
RS Technologies	11,900	3,475.00	41,352,500
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,543.00	1,543,000
信和	2,200	764.00	1,680,800
ビーロッド	2,000	955.00	1,910,000
ファーストブラザーズ	1,000	1,086.00	1,086,000
And Doホールディングス	8,900	1,038.00	9,238,200
シーアールイー	6,700	1,388.00	9,299,600
ケイアイスター不動産	7,200	3,745.00	26,964,000
アグレ都市デザイン	1,000	1,507.00	1,507,000
グッドコムアセット	12,100	795.00	9,619,500
ジェイ・エス・ビー	6,100	2,675.00	16,317,500
ロードスターキャピタル	8,400	2,287.00	19,210,800
テンポイノベーション	1,600	933.00	1,492,800
グローバル・リンク・マネジメント	600	2,307.00	1,384,200
フェイスネットワーク	1,000	1,576.00	1,576,000
霞ヶ関キャピタル	6,000	13,500.00	81,000,000
住江織物	700	2,023.00	1,416,100
日本フェルト	2,800	486.00	1,360,800
イチカワ	700	1,646.00	1,152,200
エコナックホールディングス	4,800	115.00	552,000
日東製網	500	1,411.00	705,500
芦森工業	700	2,199.00	1,539,300
アツギ	2,300	736.00	1,692,800
ウイルプラスホールディングス	1,200	1,107.00	1,328,400
JMホールディングス	12,100	3,290.00	39,809,000
コメダホールディングス	38,800	2,721.00	105,574,800
サツドラホールディングス	2,200	799.00	1,757,800
アレンザホールディングス	12,100	1,066.00	12,898,600
串カツ田中ホールディングス	4,300	1,448.00	6,226,400

バロックジャパンリミテッド	12,400	765.00	9,486,000
クスリのアオキホールディングス	47,800	3,219.00	153,868,200
ダイニック	1,600	752.00	1,203,200
共和レザー	1,900	647.00	1,229,300
ピーバンドットコム	800	369.00	295,200
力の源ホールディングス	9,100	1,187.00	10,801,700
FOOD & LIFE COMPANIES	84,600	2,586.00	218,775,600
アセンテック	6,100	592.00	3,611,200
セーレン	29,000	2,683.00	77,807,000
ソトー	1,600	693.00	1,108,800
東海染工	500	718.00	359,000
小松マテーレ	21,900	751.00	16,446,900
ワコールホールディングス	27,900	4,372.00	121,978,800
ホギメディカル	17,700	4,365.00	77,260,500
クラウドディアホールディングス	1,400	344.00	481,600
T S I ホールディングス	45,100	897.00	40,454,700
マツオカコーポレーション	1,100	1,717.00	1,888,700
ワールド	21,300	1,910.00	40,683,000
T I S	159,100	3,574.00	568,623,400
テクミラホールディングス	2,300	341.00	784,300
グリー	50,300	436.00	21,930,800
GMOペパボ	1,900	1,329.00	2,525,100
コーエーテクモホールディングス	94,200	1,630.50	153,593,100
三菱総合研究所	7,300	4,040.00	29,492,000
ボルテージ	1,500	232.00	348,000
電算	600	1,420.00	852,000
A G S	1,500	843.00	1,264,500
ファインデックス	12,000	853.00	10,236,000
ブレインパッド	12,600	823.00	10,369,800
K L a b	36,000	180.00	6,480,000
ポルトウウィンホールディングス	25,700	433.00	11,128,100
ネクソン	330,100	2,697.00	890,279,700
アイスタイル	50,200	516.00	25,903,200
エムアップホールディングス	18,400	1,272.00	23,404,800
エイチーム	10,100	622.00	6,282,200
エニグモ	19,200	328.00	6,297,600
テクノスジャパン	3,000	675.00	2,025,000
e n i s h	5,100	174.00	887,400
コロプラ	51,100	560.00	28,616,000
オルトプラス	4,800	100.00	480,000
ブロードリーフ	60,300	645.00	38,893,500
クロス・マーケティンググループ	2,400	708.00	1,699,200
デジタルハーツホールディングス	9,400	817.00	7,679,800
メディアドゥ	6,900	1,400.00	9,660,000
じげん	43,800	578.00	25,316,400
ブイキューブ	18,000	210.00	3,780,000
エンカレッジ・テクノロジー	1,400	601.00	841,400
サイバーリンクス	2,000	744.00	1,488,000
ディー・エル・イー	3,600	117.00	421,200

フィックスターズ	15,000	1,581.00	23,715,000
CARTA HOLDINGS	8,500	1,361.00	11,568,500
オブティム	15,600	585.00	9,126,000
セレス	6,000	1,246.00	7,476,000
SHIFT	10,100	12,470.00	125,947,000
特種東海製紙	8,100	3,675.00	29,767,500
ティーガイア	15,800	3,800.00	60,040,000
セック	2,100	4,135.00	8,683,500
テクマトリックス	27,500	2,377.00	65,367,500
プロシップ	7,300	1,501.00	10,957,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	37,400	3,003.00	112,312,200
GMOペイメントゲートウェイ	34,300	9,117.00	312,713,100
ザッパラス	1,300	378.00	491,400
システムリサーチ	10,300	1,431.00	14,739,300
インターネットイニシアティブ	72,000	3,018.00	217,296,000
さくらインターネット	16,800	4,285.00	71,988,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,400	2,785.00	12,254,000
SRAホールディングス	7,600	4,200.00	31,920,000
システムインテグレータ	1,500	323.00	484,500
朝日ネット	16,200	645.00	10,449,000
eBASE	21,300	615.00	13,099,500
アバントグループ	19,000	2,193.00	41,667,000
アドソル日進	6,300	1,723.00	10,854,900
ODKソリューションズ	1,200	588.00	705,600
フリービット	6,600	1,235.00	8,151,000
コムチュア	21,800	1,529.00	33,332,200
アステリア	11,900	525.00	6,247,500
アイル	8,400	2,778.00	23,335,200
王子ホールディングス	625,400	570.50	356,790,700
日本製紙	84,700	900.00	76,230,000
三菱製紙	4,400	531.00	2,336,400
北越コーポレーション	74,000	1,450.00	107,300,000
中越パルプ工業	1,400	1,297.00	1,815,800
巴川コーポレーション	1,500	738.00	1,107,000
大王製紙	66,200	860.00	56,932,000
阿波製紙	1,500	437.00	655,500
マークライNZ	8,900	2,902.00	25,827,800
メディカル・データ・ビジョン	17,900	503.00	9,003,700
gumi	24,400	346.00	8,442,400
ショーケース	1,300	277.00	360,100
モバイルファクトリー	1,200	810.00	972,000
テラスカイ	6,600	2,146.00	14,163,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,700	2,004.00	15,430,800
PCIホールディングス	1,500	1,129.00	1,693,500
アイビーシー	800	640.00	512,000
ネオジャパン	5,000	1,989.00	9,945,000
PR TIMES	3,100	1,740.00	5,394,000

ラクス	71,100	2,251.00	160,046,100
ランドコンピュータ	2,500	802.00	2,005,000
ダブルスタンダード	4,400	1,477.00	6,498,800
オープンドア	8,800	697.00	6,133,600
マイネット	1,600	394.00	630,400
アカツキ	7,300	1,994.00	14,556,200
ベネフィットジャパン	300	1,137.00	341,100
Ubicomホールディングス	4,700	1,411.00	6,631,700
カナミックネットワーク	18,800	534.00	10,039,200
ノムラシステムコーポレーション	5,400	113.00	610,200
レンゴー	136,600	980.80	133,977,280
トーモク	8,600	2,379.00	20,459,400
ザ・パック	11,200	3,700.00	41,440,000
チェンジホールディングス	32,800	1,225.00	40,180,000
シンクロ・フード	3,200	516.00	1,651,200
オークネット	7,000	2,317.00	16,219,000
キャピタル・アセット・プランニング	1,100	810.00	891,000
セグエグループ	3,100	641.00	1,987,100
エイトレッド	800	1,602.00	1,281,600
マクロミル	29,500	785.00	23,157,500
ビーグリー	1,200	1,388.00	1,665,600
オロ	6,300	2,460.00	15,498,000
ユーザーローカル	6,300	1,866.00	11,755,800
テモナ	1,300	206.00	267,800
ニーズウェル	3,600	306.00	1,101,600
マネーフォワード	36,700	5,764.00	211,538,800
サインポスト	2,000	490.00	980,000
レゾナック・ホールディングス	134,800	3,111.00	419,362,800
住友化学	1,114,700	394.00	439,191,800
住友精化	7,100	5,280.00	37,488,000
日産化学	70,100	4,998.00	350,359,800
ラサ工業	5,700	2,601.00	14,825,700
クレハ	31,000	2,674.00	82,894,000
多木化学	5,800	3,885.00	22,533,000
テイカ	12,400	1,680.00	20,832,000
石原産業	24,900	1,440.00	35,856,000
片倉コープアグリ	1,300	944.00	1,227,200
日本曹達	17,800	4,830.00	85,974,000
東ソー	200,500	1,837.50	368,418,750
トクヤマ	48,500	2,680.00	129,980,000
セントラル硝子	16,100	3,375.00	54,337,500
東亜合成	72,200	1,576.50	113,823,300
大阪ソーダ	10,500	9,000.00	94,500,000
関東電化工業	29,000	938.00	27,202,000
SUN ASTERISK	10,700	537.00	5,745,900
デンカ	54,600	2,160.00	117,936,000
イビデン	79,000	4,370.00	345,230,000
信越化学工業	1,347,000	5,638.00	7,594,386,000
日本カーバイド工業	7,200	1,640.00	11,808,000
プラスアルファ・コンサルティング	18,900	2,128.00	40,219,200

電算システムホールディングス	6,700	2,610.00	17,487,000
堺化学工業	11,500	2,567.00	29,520,500
第一稀元素化学工業	16,400	806.00	13,218,400
エア・ウォーター	141,700	1,998.00	283,116,600
日本酸素ホールディングス	145,600	5,200.00	757,120,000
日本化学工業	5,500	2,631.00	14,470,500
東邦アセチレン	3,500	340.00	1,190,000
日本パーカライジング	66,900	1,205.00	80,614,500
高压ガス工業	22,000	880.00	19,360,000
チタン工業	600	846.00	507,600
四国化成ホールディングス	16,900	1,923.00	32,498,700
戸田工業	3,500	1,698.00	5,943,000
ステラ ケミファ	8,000	4,170.00	33,360,000
保土谷化学工業	4,700	4,620.00	21,714,000
日本触媒	87,400	1,697.00	148,317,800
大日精化学工業	10,500	2,974.00	31,227,000
カネカ	37,000	3,710.00	137,270,000
協和キリン	181,600	3,267.00	593,287,200
APPIER GROUP	45,700	1,729.00	79,015,300
三菱瓦斯化学	109,600	2,573.50	282,055,600
三井化学	123,900	3,787.00	469,209,300
東京応化工業	71,700	3,253.00	233,240,100
大阪有機化学工業	12,700	2,946.00	37,414,200
三菱ケミカルグループ	1,098,200	902.30	990,905,860
KHネオケム	27,100	1,979.00	53,630,900
ビジョナル	17,700	8,480.00	150,096,000
ダイセル	186,400	1,271.00	236,914,400
住友ベークライト	42,100	3,633.00	152,949,300
積水化学工業	299,100	2,162.50	646,803,750
日本ゼオン	103,000	1,293.00	133,179,000
アイカ工業	38,000	3,326.00	126,388,000
UBE	71,500	2,603.00	186,114,500
積水樹脂	22,300	2,294.00	51,156,200
タキロンシーアイ	38,300	868.00	33,244,400
旭有機材	10,100	3,840.00	38,784,000
ニチバン	8,100	1,928.00	15,616,800
リケンテクノス	28,000	993.00	27,804,000
大倉工業	7,100	2,561.00	18,183,100
積水化成成品工業	21,300	399.00	8,498,700
群栄化学工業	3,600	2,686.00	9,669,600
タイガースポリマー	2,300	764.00	1,757,200
ミライアル	1,200	1,400.00	1,680,000
ダイキアクシス	2,000	716.00	1,432,000
ダイキョーニシカワ	33,100	653.00	21,614,300
竹本容器	1,900	821.00	1,559,900
森六ホールディングス	7,700	2,238.00	17,232,600
恵和	9,700	1,006.00	9,758,200
日本化薬	114,700	1,279.00	146,701,300
カーリット	16,200	1,058.00	17,139,600
ソルクシーズ	4,300	296.00	1,272,800

CLホールディングス	3,700	925.00	3,422,500
プレステージ・インターナショナル	72,200	717.00	51,767,400
フェイス	1,300	398.00	517,400
プロトコーポレーション	16,400	1,440.00	23,616,000
ハイマックス	4,400	1,307.00	5,750,800
アミューズ	9,300	1,399.00	13,010,700
野村総合研究所	325,700	5,101.00	1,661,395,700
ドリームインキュベータ	5,200	2,177.00	11,320,400
クイック	10,700	2,104.00	22,512,800
TAC	2,300	163.00	374,900
CEホールディングス	2,400	460.00	1,104,000
日本システム技術	13,900	1,851.00	25,728,900
電通グループ	166,600	4,208.00	701,052,800
インテージホールディングス	17,000	1,635.00	27,795,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,700	832.00	5,574,400
東邦システムサイエンス	6,300	1,488.00	9,374,400
ぴあ	5,100	3,045.00	15,529,500
イオンファンタジー	5,500	2,132.00	11,726,000
ソースネクスト	68,900	196.00	13,504,400
シーティーエス	19,600	827.00	16,209,200
NEXYZ. Group	1,600	752.00	1,203,200
メディカルシステムネットワーク	17,200	431.00	7,413,200
日本精化	10,100	2,171.00	21,927,100
扶桑化学工業	16,000	3,650.00	58,400,000
トリケミカル研究所	18,200	3,315.00	60,333,000
シンプレクス・ホールディングス	22,900	2,364.00	54,135,600
HEROZ	5,900	1,033.00	6,094,700
ラクスル	36,400	1,130.00	41,132,000
メルカリ	73,400	2,497.50	183,316,500
I P S	4,400	2,199.00	9,675,600
F I G	5,800	326.00	1,890,800
システムサポート	5,800	2,031.00	11,779,800
ADEKA	52,400	2,866.50	150,204,600
日油	136,100	2,207.00	300,372,700
ミヨシ油脂	1,400	1,577.00	2,207,800
新日本理化	7,000	191.00	1,337,000
ハリマ化成グループ	10,600	848.00	8,988,800
イーソル	10,200	715.00	7,293,000
東海ソフト	800	1,223.00	978,400
ウイングアーク1st	15,700	3,005.00	47,178,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,000	839.00	4,195,000
サーバーワークス	3,100	2,751.00	8,528,100
東名	1,000	1,461.00	1,461,000
ヴィッツ	500	803.00	401,500
トビラシステムズ	1,500	739.00	1,108,500
Sansan	49,300	2,277.00	112,256,100
Link-Uグループ	1,100	512.00	563,200
ギフトィ	13,200	1,082.00	14,282,400
花王	365,700	6,946.00	2,540,152,200

第一工業製薬	6,000	2,960.00	17,760,000
石原ケミカル	6,700	2,232.00	14,954,400
日華化学	1,400	1,270.00	1,778,000
ニイタカ	1,100	1,868.00	2,054,800
三洋化成工業	9,200	4,125.00	37,950,000
メドレー	16,500	3,305.00	54,532,500
ベース	7,400	3,185.00	23,569,000
JMDC	25,600	4,650.00	119,040,000
武田薬品工業	1,331,300	4,209.00	5,603,441,700
アステラス製薬	1,319,300	1,689.00	2,228,297,700
住友ファーマ	111,400	594.00	66,171,600
塩野義製薬	183,000	6,355.00	1,162,965,000
わかもと製薬	5,300	240.00	1,272,000
日本新薬	39,500	3,340.00	131,930,000
中外製薬	470,900	6,867.00	3,233,670,300
科研製薬	25,700	3,923.00	100,821,100
エーザイ	183,000	5,672.00	1,037,976,000
理研ビタミン	12,800	2,547.00	32,601,600
ロート製薬	145,600	3,559.00	518,190,400
小野薬品工業	307,600	1,908.50	587,054,600
久光製薬	33,400	3,939.00	131,562,600
有機合成薬品工業	4,200	263.00	1,104,600
持田製薬	16,800	3,220.00	54,096,000
参天製薬	265,400	1,779.00	472,146,600
扶桑薬品工業	5,300	2,171.00	11,506,300
日本ケミファ	600	1,592.00	955,200
ツムラ	47,400	3,866.00	183,248,400
テルモ	836,000	2,621.50	2,191,574,000
H. U. グループホールディングス	45,100	2,654.50	119,717,950
キッセイ薬品工業	24,900	3,440.00	85,656,000
生化学工業	25,400	791.00	20,091,400
栄研化学	25,900	2,345.00	60,735,500
鳥居薬品	8,000	3,725.00	29,800,000
JCRファーマ	50,900	653.00	33,237,700
東和薬品	23,000	2,927.00	67,321,000
富士製薬工業	11,100	1,228.00	13,630,800
ゼリア新薬工業	21,000	2,214.00	46,494,000
ネクセラファーマ	70,600	1,265.00	89,309,000
第一三共	1,310,300	4,968.00	6,509,570,400
杏林製薬	32,600	1,506.00	49,095,600
大幸薬品	31,300	397.00	12,426,100
ダイト	11,500	2,214.00	25,461,000
大塚ホールディングス	375,400	8,044.00	3,019,717,600
ペプチドリーム	72,900	2,400.00	174,960,000
大日本塗料	16,600	1,058.00	17,562,800
日本ペイントホールディングス	664,800	860.70	572,193,360
関西ペイント	129,800	2,647.00	343,580,600
神東塗料	4,600	132.00	607,200
中国塗料	30,800	1,941.00	59,782,800
日本特殊塗料	2,400	1,187.00	2,848,800

藤倉化成	17,400	470.00	8,178,000
太陽ホールディングス	26,100	3,590.00	93,699,000
D I C	53,400	3,034.00	162,015,600
サカタインクス	33,300	1,552.00	51,681,600
a r t i e n c e	27,000	3,800.00	102,600,000
アルプス技研	13,300	2,717.00	36,136,100
サニックス	24,700	267.00	6,594,900
日本空調サービス	16,500	1,079.00	17,803,500
オリエンタルランド	815,800	3,902.00	3,183,251,600
フォーカスシステムズ	10,100	1,103.00	11,140,300
ダスキン	33,700	3,865.00	130,250,500
パーク24	115,100	1,784.50	205,395,950
明光ネットワークジャパン	18,700	677.00	12,659,900
ファルコホールディングス	6,900	2,313.00	15,959,700
クレスコ	24,700	1,310.00	32,357,000
フジ・メディア・ホールディングス	144,600	1,685.50	243,723,300
秀英予備校	1,300	276.00	358,800
田谷	1,100	356.00	391,600
ラウンドワン	145,300	1,001.00	145,445,300
リゾートトラスト	66,900	2,900.00	194,010,000
オービック	50,300	25,875.00	1,301,512,500
ジャストシステム	21,700	3,545.00	76,926,500
TDCソフト	28,100	1,190.00	33,439,000
L I N E ヤフー	2,141,500	406.00	869,449,000
ビー・エム・エル	18,900	2,663.00	50,330,700
トレンドマイクロ	79,000	8,865.00	700,335,000
I Dホールディングス	10,200	1,375.00	14,025,000
リソー教育	78,800	250.00	19,700,000
日本オラクル	28,800	13,895.00	400,176,000
早稲田アカデミー	8,500	1,582.00	13,447,000
アルファシステムズ	4,000	2,836.00	11,344,000
フューチャー	37,500	1,796.00	67,350,000
C A C H o l d i n g s	9,200	1,752.00	16,118,400
トーセ	1,500	628.00	942,000
ユー・エス・エス	345,900	1,360.50	470,596,950
オービックビジネスコンサルタント	21,300	7,394.00	157,492,200
アイティフォー	19,200	1,374.00	26,380,800
東京個別指導学院	18,400	403.00	7,415,200
東計電算	4,200	4,820.00	20,244,000
サイバーエージェント	340,600	1,024.00	348,774,400
楽天グループ	1,084,800	942.90	1,022,857,920
エックスネット	700	1,408.00	985,600
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,427.00	10,845,200
S B I グローバルアセットマネジメン ト	30,300	587.00	17,786,100
テー・オー・ダブリュー	30,400	313.00	9,515,200
大塚商会	170,600	3,542.00	604,265,200
サイボウズ	20,700	1,690.00	34,983,000
山田コンサルティンググループ	6,800	2,363.00	16,068,400
セントラルスポーツ	5,600	2,495.00	13,972,000

パラカ	4,600	1,763.00	8,109,800
電通総研	14,600	5,470.00	79,862,000
ACCESS	15,700	1,719.00	26,988,300
デジタルガレージ	24,000	2,850.00	68,400,000
イーエムシステムズ	25,000	523.00	13,075,000
ウェザーニューズ	4,600	5,720.00	26,312,000
C I J	37,500	424.00	15,900,000
ビジネスエンジニアリング	3,200	3,980.00	12,736,000
日本エンタープライズ	5,000	117.00	585,000
WOWOW	11,400	1,046.00	11,924,400
スカラ	13,700	467.00	6,397,900
インテリジェント ウェイブ	1,800	904.00	1,627,200
フルキャストホールディングス	12,700	1,558.00	19,786,600
エン・ジャパン	25,000	2,502.00	62,550,000
セルソース	10,100	1,237.00	12,493,700
あすか製薬ホールディングス	15,500	2,156.00	33,418,000
サワイグループホールディングス	34,300	5,994.00	205,594,200
富士フイルムホールディングス	837,200	3,822.00	3,199,778,400
コニカミノルタ	338,300	402.70	136,233,410
資生堂	314,000	3,338.00	1,048,132,000
ライオン	191,300	1,539.00	294,410,700
高砂香料工業	11,300	5,270.00	59,551,000
マンダム	32,500	1,210.00	39,325,000
ミルボン	24,100	2,962.00	71,384,200
コーセー	30,700	8,000.00	245,600,000
コタ	15,200	1,649.00	25,064,800
シーボン	700	1,299.00	909,300
ポーラ・オルビスホールディングス	77,100	1,440.50	111,062,550
ノエビアホールディングス	13,200	5,340.00	70,488,000
アジュバンホールディングス	1,300	816.00	1,060,800
新日本製薬	8,600	1,803.00	15,505,800
I - n e	5,000	1,834.00	9,170,000
アクシージア	9,900	581.00	5,751,900
エステー	11,600	1,492.00	17,307,200
アグロ カネショウ	5,300	1,280.00	6,784,000
コニシ	43,400	1,261.00	54,727,400
長谷川香料	28,700	2,963.00	85,038,100
小林製薬	39,400	5,418.00	213,469,200
荒川化学工業	12,900	1,204.00	15,531,600
メック	12,500	3,620.00	45,250,000
日本高純度化学	3,400	3,030.00	10,302,000
タカラバイオ	40,400	1,019.00	41,167,600
J C U	16,600	3,390.00	56,274,000
新田ゼラチン	2,300	888.00	2,042,400
O A Tアグリオ	5,500	1,859.00	10,224,500
デクセリアルズ	37,100	5,828.00	216,218,800
アース製薬	13,500	5,260.00	71,010,000
北興化学工業	13,300	1,287.00	17,117,100
大成ラミック	4,300	2,665.00	11,459,500
クミアイ化学工業	59,700	787.00	46,983,900

日本農薬	27,600	591.00	16,311,600
富士興産	1,100	1,488.00	1,636,800
ニチレキ	19,600	2,569.00	50,352,400
ユシロ化学工業	7,700	1,526.00	11,750,200
ビービー・カストロール	2,000	861.00	1,722,000
富士石油	43,800	356.00	15,592,800
MORESCO	1,300	1,209.00	1,571,700
出光興産	780,900	987.80	771,373,020
ENEOSホールディングス	2,381,300	738.00	1,757,399,400
コスモエネルギーホールディングス	44,600	7,581.00	338,112,600
ANYCOLOR	21,400	2,390.00	51,146,000
テスホールディングス	31,600	282.00	8,911,200
インフロニア・ホールディングス	169,600	1,172.50	198,856,000
横浜ゴム	76,000	3,034.00	230,584,000
TOYO TIRE	86,500	1,963.50	169,842,750
ブリヂストン	440,300	5,280.00	2,324,784,000
住友ゴム工業	147,500	1,497.00	220,807,500
藤倉コンポジット	14,400	1,211.00	17,438,400
オカモト	7,200	5,210.00	37,512,000
アキレス	9,500	1,544.00	14,668,000
フコク	7,800	1,652.00	12,885,600
ニッタ	15,200	3,610.00	54,872,000
クリエートメディック	1,600	950.00	1,520,000
住友理工	23,300	1,448.00	33,738,400
三ツ星ベルト	17,500	3,945.00	69,037,500
バンドー化学	22,200	1,813.00	40,248,600
AGC	146,200	4,321.00	631,730,200
日本板硝子	71,900	340.00	24,446,000
石塚硝子	600	2,433.00	1,459,800
有沢製作所	26,300	1,436.00	37,766,800
日本山村硝子	1,300	1,461.00	1,899,300
日本電気硝子	55,800	3,222.00	179,787,600
オハラ	7,200	1,375.00	9,900,000
住友大阪セメント	25,000	3,864.00	96,600,000
太平洋セメント	86,100	3,112.00	267,943,200
リソルホールディングス	300	4,545.00	1,363,500
日本ヒューム	13,200	1,269.00	16,750,800
日本コンクリート工業	29,200	342.00	9,986,400
三谷セキサン	6,300	5,620.00	35,406,000
アジアパイルホールディングス	21,500	816.00	17,544,000
東海カーボン	138,700	827.00	114,704,900
日本カーボン	8,600	4,250.00	36,550,000
東洋炭素	10,600	5,110.00	54,166,000
ノリタケ	16,600	3,700.00	61,420,000
TOTO	99,300	4,750.00	471,675,000
日本碍子	174,900	1,828.50	319,804,650
日本特殊陶業	125,900	3,926.00	494,283,400
ダントーホールディングス	1,200	378.00	453,600
MARUWA	5,500	36,100.00	198,550,000
品川リフラクトリーズ	18,500	1,659.00	30,691,500

黒崎播磨	12,400	2,090.00	25,916,000
ヨータイ	9,300	1,725.00	16,042,500
東京窯業	3,600	406.00	1,461,600
ニッカトー	2,400	517.00	1,240,800
フジインコーポレーテッド	40,300	2,217.00	89,345,100
クニミネ工業	1,500	1,058.00	1,587,000
エーアンドエーマテリアル	1,200	1,183.00	1,419,600
ニチアス	38,100	5,090.00	193,929,000
日本製鉄	720,500	2,998.00	2,160,059,000
神戸製鋼所	311,200	1,657.50	515,814,000
中山製鋼所	35,500	771.00	27,370,500
合同製鐵	8,600	4,175.00	35,905,000
JFEホールディングス	430,400	1,848.00	795,379,200
東京製鐵	43,500	1,981.00	86,173,500
共英製鋼	17,700	1,671.00	29,576,700
大和工業	29,200	7,021.00	205,013,200
東京鐵鋼	6,900	5,040.00	34,776,000
大阪製鐵	7,200	3,340.00	24,048,000
淀川製鋼所	16,100	5,440.00	87,584,000
中部鋼鈑	10,300	2,329.00	23,988,700
丸一鋼管	47,200	3,294.00	155,476,800
モリ工業	3,600	5,330.00	19,188,000
大同特殊鋼	97,500	1,359.00	132,502,500
日本高周波鋼業	2,000	396.00	792,000
日本冶金工業	11,300	4,405.00	49,776,500
山陽特殊製鋼	15,300	1,840.00	28,152,000
愛知製鋼	8,900	3,480.00	30,972,000
日本金属	1,500	653.00	979,500
ミガロホールディングス	1,500	1,904.00	2,856,000
大平洋金属	13,200	1,310.00	17,292,000
新日本電工	92,500	294.00	27,195,000
栗本鐵工所	7,200	4,135.00	29,772,000
虹 技	700	1,035.00	724,500
日本鑄鉄管	600	1,221.00	732,600
日本製鋼所	41,700	4,149.00	173,013,300
三菱製鋼	11,500	1,302.00	14,973,000
日亜鋼業	5,700	291.00	1,658,700
日本精線	12,600	1,074.00	13,532,400
エンビプロ・ホールディングス	13,700	493.00	6,754,100
大紀アルミニウム工業所	19,700	1,062.00	20,921,400
日本輕金属ホールディングス	45,400	1,567.00	71,141,800
三井金属鈹業	45,100	4,438.00	200,153,800
東邦亜鉛	10,100	891.00	8,999,100
三菱マテリアル	110,500	2,371.00	261,995,500
住友金属鈹山	179,500	3,642.00	653,739,000
DOWAホールディングス	38,200	4,799.00	183,321,800
古河機械金属	20,400	1,551.00	31,640,400
エス・サイエンス	32,700	23.00	752,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,900	2,275.00	61,197,500
東邦チタニウム	32,000	1,019.00	32,608,000

UACJ	21,800	5,090.00	110,962,000
CKサンエツ	2,800	3,340.00	9,352,000
古河電気工業	51,400	3,144.00	161,601,600
住友電気工業	578,700	2,256.00	1,305,547,200
フジクラ	182,400	4,136.00	754,406,400
SWCC	17,400	5,130.00	89,262,000
カナレ電気	1,000	1,374.00	1,374,000
平河ビューテック	9,900	1,431.00	14,166,900
いよぎんホールディングス	175,800	1,293.50	227,397,300
しずおかフィナンシャルグループ	325,300	1,228.50	399,631,050
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	124,400	1,423.50	177,083,400
楽天銀行	68,600	3,015.00	206,829,000
京都フィナンシャルグループ	186,000	2,115.00	393,390,000
リョービ	16,400	1,918.00	31,455,200
アーレスティ	3,700	583.00	2,157,100
AREホールディングス	58,100	1,788.00	103,882,800
東洋製罐グループホールディングス	88,800	2,285.50	202,952,400
ホッカンホールディングス	7,500	1,660.00	12,450,000
コロナ	8,600	921.00	7,920,600
横河ブリッジホールディングス	24,100	2,629.00	63,358,900
駒井ハルテック	1,000	1,629.00	1,629,000
高田機工	400	3,485.00	1,394,000
三和ホールディングス	154,200	3,394.00	523,354,800
文化シャッター	40,400	1,631.00	65,892,400
三協立山	19,500	727.00	14,176,500
アルインコ	11,900	968.00	11,519,200
東洋シャッター	1,300	792.00	1,029,600
LIXIL	241,700	1,726.00	417,174,200
日本ファイルコン	3,400	505.00	1,717,000
ノーリツ	21,900	1,870.00	40,953,000
長府製作所	17,400	2,005.00	34,887,000
リンナイ	74,100	3,411.00	252,755,100
ユニプレス	27,000	1,076.00	29,052,000
ダイニチ工業	2,500	615.00	1,537,500
日東精工	22,400	538.00	12,051,200
三洋工業	600	3,090.00	1,854,000
岡部	27,700	743.00	20,581,100
ジーテクト	19,700	1,544.00	30,416,800
東プレ	27,300	1,742.00	47,556,600
高周波熱錬	22,900	1,000.00	22,900,000
東京製綱	10,100	1,045.00	10,554,500
サンコール	15,700	380.00	5,966,000
モリテックスチール	4,700	184.00	864,800
パイオラックス	18,700	2,296.00	42,935,200
エイチワン	16,100	900.00	14,490,000
日本発条	136,800	1,770.00	242,136,000
中央発條	11,500	1,156.00	13,294,000
アドバネクス	600	905.00	543,000
三浦工業	63,300	3,437.00	217,562,100
タクマ	51,200	1,541.00	78,899,200

テクノプロ・ホールディングス	89,500	2,890.00	258,655,000
アトラグループ	1,600	140.00	224,000
アイ・アールジャパンホールディングス	7,900	902.00	7,125,800
Keep 技研	9,500	4,265.00	40,517,500
ファーストロジック	1,600	717.00	1,147,200
三機サービス	1,000	967.00	967,000
Gunosy	12,300	868.00	10,676,400
デザインワン・ジャパン	1,600	131.00	209,600
イー・ガーディアン	7,400	1,838.00	13,601,200
リブセンス	2,400	167.00	400,800
ジャパンマテリアル	47,300	1,746.00	82,585,800
ベクトル	18,400	905.00	16,652,000
ウチヤマホールディングス	2,300	328.00	754,400
チャーム・ケア・コーポレーション	12,900	1,369.00	17,660,100
キャリアリンク	5,600	2,589.00	14,498,400
I B J	12,000	703.00	8,436,000
アサンテ	7,600	1,670.00	12,692,000
バリューHR	13,300	1,614.00	21,466,200
M&Aキャピタルパートナーズ	12,600	2,160.00	27,216,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,100	1,005.00	6,130,500
ERIホールディングス	1,100	1,961.00	2,157,100
アビスト	500	3,415.00	1,707,500
シグマクシス・ホールディングス	20,200	1,599.00	32,299,800
ウィルグループ	12,900	898.00	11,584,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,500	141.00	916,500
メドピア	12,400	585.00	7,254,000
レアジョブ	1,100	380.00	418,000
リクルートホールディングス	1,110,300	8,650.00	9,604,095,000
エラン	20,400	828.00	16,891,200
ツガミ	32,400	1,344.00	43,545,600
オークマ	13,200	5,664.00	74,764,800
芝浦機械	14,200	3,625.00	51,475,000
アマダ	229,500	1,428.00	327,726,000
アイダエンジニアリング	35,000	768.00	26,880,000
F U J I	71,300	2,204.00	157,145,200
牧野フライス製作所	16,700	5,540.00	92,518,000
オーエスジー	66,700	1,932.50	128,897,750
ダイジェット工業	500	739.00	369,500
旭ダイヤモンド工業	34,900	832.00	29,036,800
DMG森精機	95,500	3,063.00	292,516,500
ソディック	39,900	728.00	29,047,200
ディスコ	73,000	33,710.00	2,460,830,000
日東工器	7,300	2,301.00	16,797,300
日進工具	14,000	748.00	10,472,000
パンチ工業	3,300	420.00	1,386,000
富士ダイス	10,200	754.00	7,690,800
土木管理総合試験所	2,500	310.00	775,000
日本郵政	1,611,500	1,352.50	2,179,553,750

バルシステム24ホールディングス	16,500	1,527.00	25,195,500
鎌倉新書	13,200	493.00	6,507,600
SMN	1,100	299.00	328,900
一蔵	700	528.00	369,600
グローバルキッズCOMPANY	1,100	740.00	814,000
エアトリ	11,300	1,177.00	13,300,100
アトラエ	11,700	792.00	9,266,400
ストライク	7,600	4,550.00	34,580,000
ソラスト	42,500	560.00	23,800,000
セラク	4,700	1,410.00	6,627,000
インソース	33,400	1,055.00	35,237,000
豊田自動織機	127,800	10,525.00	1,345,095,000
豊和工業	1,800	814.00	1,465,200
石川製作所	1,000	1,384.00	1,384,000
リケンNPR	16,400	2,296.00	37,654,400
東洋機械金属	2,800	642.00	1,797,600
津田駒工業	1,000	379.00	379,000
エンシュウ	1,300	629.00	817,700
島精機製作所	24,000	1,292.00	31,008,000
オプトラン	24,900	1,686.00	41,981,400
イワキ	10,200	2,654.00	27,070,800
フリー	14,200	1,058.00	15,023,600
ヤマシンフィルタ	36,100	444.00	16,028,400
日阪製作所	16,500	1,117.00	18,430,500
やまびこ	24,800	2,238.00	55,502,400
野村マイクロ・サイエンス	20,500	2,282.00	46,781,000
平田機工	7,300	4,680.00	34,164,000
PEGASUS	16,700	487.00	8,132,900
マルマエ	6,700	1,521.00	10,190,700
タツモ	10,800	2,514.00	27,151,200
ナブテスコ	95,000	2,293.00	217,835,000
三井海洋開発	19,200	2,736.00	52,531,200
レオン自動機	17,600	1,348.00	23,724,800
SMC	45,400	58,630.00	2,661,802,000
ホソカワミクロン	10,600	4,055.00	42,983,000
ユニオンツール	6,700	5,620.00	37,654,000
瑞光	10,900	1,230.00	13,407,000
オイレス工業	20,500	2,011.00	41,225,500
日精エー・エス・ビー機械	5,100	4,675.00	23,842,500
サトーホールディングス	20,700	1,948.00	40,323,600
技研製作所	14,200	1,731.00	24,580,200
日本エアテック	7,100	1,136.00	8,065,600
カワタ	1,600	846.00	1,353,600
日精樹脂工業	11,300	921.00	10,407,300
オカダアイヨン	1,200	2,060.00	2,472,000
ワイエイシイホールディングス	6,500	1,998.00	12,987,000
小松製作所	710,000	3,661.00	2,599,310,000
住友重機械工業	89,500	3,200.00	286,400,000
日立建機	60,200	3,338.00	200,947,600
日工	22,500	675.00	15,187,500

巴工業	5,900	3,980.00	23,482,000
井関農機	14,200	969.00	13,759,800
TOWA	16,800	5,780.00	97,104,000
丸山製作所	600	2,548.00	1,528,800
北川鉄工所	5,900	1,223.00	7,215,700
シンニッタン	6,800	211.00	1,434,800
ローツェ	78,000	1,805.00	140,790,000
タカキタ	1,800	435.00	783,000
クボタ	791,900	1,921.50	1,521,635,850
荏原実業	7,300	3,900.00	28,470,000
東洋エンジニアリング	21,700	698.00	15,146,600
三菱化工機	5,300	3,445.00	18,258,500
月島ホールディングス	20,500	1,298.00	26,609,000
帝国電機製作所	10,400	2,648.00	27,539,200
東京機械製作所	1,500	352.00	528,000
新東工業	30,700	973.00	29,871,100
澁谷工業	14,200	3,510.00	49,842,000
アイチコーポレーション	21,000	1,152.00	24,192,000
小森コーポレーション	37,200	1,121.00	41,701,200
鶴見製作所	11,600	3,715.00	43,094,000
日本ギア工業	1,900	439.00	834,100
酒井重工業	2,600	4,550.00	11,830,000
荏原製作所	310,900	1,940.00	603,146,000
石井鐵工所	600	8,350.00	5,010,000
西島製作所	13,100	2,570.00	33,667,000
北越工業	15,200	1,778.00	27,025,600
ダイキン工業	180,700	17,505.00	3,163,153,500
オルガノ	18,200	6,600.00	120,120,000
トーヨーカネツ	5,100	3,950.00	20,145,000
栗田工業	84,700	5,431.00	460,005,700
椿本チエイン	20,800	5,670.00	117,936,000
大同工業	1,500	789.00	1,183,500
日機装	38,700	981.00	37,964,700
木村化工機	11,600	693.00	8,038,800
レイズネクスト	21,400	1,603.00	34,304,200
アネスト岩田	23,300	1,283.00	29,893,900
ダイフク	255,700	2,625.50	671,340,350
サムコ	3,600	3,350.00	12,060,000
加藤製作所	1,700	1,177.00	2,000,900
油研工業	600	2,129.00	1,277,400
タダノ	87,100	909.60	79,226,160
フジテック	35,300	4,711.00	166,298,300
CKD	41,900	2,733.00	114,512,700
平和	44,800	2,106.00	94,348,800
理想科学工業	12,200	3,445.00	42,029,000
SANKYO	145,700	2,147.50	312,890,750
日本金銭機械	18,300	911.00	16,671,300
マースグループホールディングス	7,600	3,460.00	26,296,000
フクシマガリレイ	9,900	5,340.00	52,866,000
オーイズミ	2,000	372.00	744,000

ダイコク電機	7,400	3,405.00	25,197,000
竹内製作所	27,500	4,160.00	114,400,000
アマノ	43,000	4,175.00	179,525,000
JUKI	23,300	398.00	9,273,400
サンデン	7,600	139.00	1,056,400
ジャノメ	15,200	817.00	12,418,400
ブラザー工業	202,300	2,769.50	560,269,850
マックス	21,400	3,465.00	74,151,000
モリタホールディングス	26,300	1,978.00	52,021,400
グローリー	36,400	2,562.00	93,256,800
新晃工業	15,200	4,605.00	69,996,000
大和冷機工業	23,100	1,460.00	33,726,000
セガサミーホールディングス	135,200	2,900.00	392,080,000
T P R	19,200	2,203.00	42,297,600
ツバキ・ナカシマ	37,400	676.00	25,282,400
ホシザキ	97,600	4,704.00	459,110,400
大豊工業	13,200	596.00	7,867,200
日本精工	280,300	697.60	195,537,280
NTN	328,400	248.60	81,640,240
ジェイテクト	134,900	1,049.50	141,577,550
不二越	11,200	2,999.00	33,588,800
ミネベアミツミ	263,400	2,576.50	678,650,100
日本トムソン	41,200	463.00	19,075,600
THK	87,400	2,400.00	209,760,000
ユーシン精機	12,200	631.00	7,698,200
前澤給装工業	10,900	1,327.00	14,464,300
イーグル工業	16,700	2,045.00	34,151,500
前澤工業	2,100	1,212.00	2,545,200
P I L L A R	14,000	3,920.00	54,880,000
キット	50,700	1,012.00	51,308,400
日立製作所	3,639,500	3,410.00	12,410,695,000
三菱電機	1,659,100	2,302.50	3,820,077,750
富士電機	92,200	7,807.00	719,805,400
東洋電機製造	1,300	1,084.00	1,409,200
安川電機	164,600	4,381.00	721,112,600
シンフォニア テクノロジー	16,700	4,590.00	76,653,000
明電舎	28,000	3,070.00	85,960,000
オリジン	1,300	1,187.00	1,543,100
山洋電気	6,600	9,410.00	62,106,000
デンヨー	11,600	2,399.00	27,828,400
PHCホールディングス	28,300	1,098.00	31,073,400
KOKUSAI ELECTRIC	79,000	3,105.00	245,295,000
ソシオネクスト	110,200	2,781.00	306,466,200
ベイカレント	113,200	5,129.00	580,602,800
Orchestra Holdings	3,400	819.00	2,784,600
アイモバイル	19,600	503.00	9,858,800
キャリアインデックス	1,700	180.00	306,000
MS-Japan	6,300	999.00	6,293,700
船場	1,200	1,177.00	1,412,400

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	49,800	2,761.00	137,497,800
フルテック	800	1,122.00	897,600
グリーンズ	1,300	1,677.00	2,180,100
ツナググループ・ホールディングス	1,500	682.00	1,023,000
GAMEWITH	2,200	197.00	433,400
MS&Consulting	700	523.00	366,100
エル・ティール・エス	1,800	1,782.00	3,207,600
ミダックホールディングス	9,300	1,615.00	15,019,500
キュービーネットホールディングス	8,900	1,047.00	9,318,300
オープングループ	21,200	210.00	4,452,000
三櫻工業	22,900	729.00	16,694,100
マキタ	172,700	4,630.00	799,601,000
東芝テック	19,400	3,350.00	64,990,000
芝浦メカトロニクス	8,600	7,480.00	64,328,000
マブチモーター	66,500	2,135.50	142,010,750
ニデック	334,400	5,587.00	1,868,292,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,600	357.00	3,427,200
トレックス・セミコンダクター	7,700	1,501.00	11,557,700
東光高岳	9,100	1,727.00	15,715,700
ダブル・スコープ	43,300	355.00	15,371,500
宮越ホールディングス	6,800	1,791.00	12,178,800
ダイヘン	14,300	6,310.00	90,233,000
ヤーマン	29,400	823.00	24,196,200
JVCケンウッド	119,500	1,316.00	157,262,000
ミマキエンジニアリング	14,300	1,378.00	19,705,400
I-PEX	8,400	1,493.00	12,541,200
大崎電気工業	33,100	727.00	24,063,700
オムロン	115,700	5,980.00	691,886,000
日東工業	20,400	3,005.00	61,302,000
IDEC	22,300	2,538.00	56,597,400
正興電機製作所	1,700	1,214.00	2,063,800
不二電機工業	1,300	1,036.00	1,346,800
ジーエス・ユアサコーポレーション	59,000	2,881.00	169,979,000
サクサ	800	2,291.00	1,832,800
テクノメディカ	3,600	1,908.00	6,868,800
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,600	605.00	3,388,000
日本電気	198,800	13,305.00	2,645,034,000
富士通	1,393,800	2,931.50	4,085,924,700
沖電気工業	68,500	945.00	64,732,500
電気興業	6,100	1,954.00	11,919,400
サンケン電気	14,000	6,045.00	84,630,000
ナカヨ	800	1,162.00	929,600
アイホン	8,000	2,840.00	22,720,000
ルネサスエレクトロニクス	1,154,100	2,023.50	2,335,321,350
セイコーエプソン	194,400	2,565.50	498,733,200
ワコム	106,500	632.00	67,308,000
アルバック	33,100	7,198.00	238,253,800
アクセル	6,900	1,331.00	9,183,900

E I Z O	11,100	4,335.00	48,118,500
ジャパンディスプレイ	651,400	21.00	13,679,400
日本信号	34,400	947.00	32,576,800
京三製作所	31,500	501.00	15,781,500
能美防災	20,500	2,643.00	54,181,500
ホーチキ	11,300	1,921.00	21,707,300
星和電機	2,300	513.00	1,179,900
エレコム	36,300	1,418.00	51,473,400
パナソニック ホールディングス	1,789,300	1,201.50	2,149,843,950
シャープ	255,400	920.80	235,172,320
アンリツ	106,700	1,074.50	114,649,150
富士通ゼネラル	42,900	2,027.50	86,979,750
ソニーグループ	1,050,200	12,805.00	13,447,811,000
T D K	239,800	8,514.00	2,041,657,200
帝国通信工業	6,700	2,471.00	16,555,700
タムラ製作所	60,200	587.00	35,337,400
アルプスアルパイン	135,200	1,519.50	205,436,400
池上通信機	1,600	657.00	1,051,200
日本電波工業	18,100	1,031.00	18,661,100
鈴木	8,000	1,578.00	12,624,000
メイコー	15,000	5,510.00	82,650,000
日本トリム	3,400	3,660.00	12,444,000
フォスター電機	11,200	1,652.00	18,502,400
S M K	3,900	2,265.00	8,833,500
ヨコオ	13,200	1,477.00	19,496,400
ティアック	7,900	86.00	679,400
ホシデン	34,400	2,076.00	71,414,400
ヒロセ電機	22,000	18,015.00	396,330,000
日本航空電子工業	36,300	2,436.00	88,426,800
T O A	17,200	942.00	16,202,400
マクセル	33,300	1,744.00	58,075,200
古野電気	19,700	1,571.00	30,948,700
スミダコーポレーション	20,300	878.00	17,823,400
アイコム	5,800	2,591.00	15,027,800
リオン	6,200	1,986.00	12,313,200
横河電機	165,700	3,543.00	587,075,100
新電元工業	5,700	2,317.00	13,206,900
アズビル	103,200	4,626.00	477,403,200
東亜ディーケーケー	1,600	847.00	1,355,200
日本光電工業	124,700	2,063.00	257,256,100
チノー	6,200	2,160.00	13,392,000
共和電業	4,700	422.00	1,983,400
日本電子材料	9,200	2,330.00	21,436,000
堀場製作所	28,400	8,945.00	254,038,000
アドバンテスト	429,700	6,016.00	2,585,075,200
小野測器	2,100	562.00	1,180,200
エスベック	12,100	2,364.00	28,604,400
キーエンス	150,100	65,430.00	9,821,043,000
日置電機	7,800	7,950.00	62,010,000
シスメックス	388,400	2,821.00	1,095,676,400

日本マイクロニクス	24,800	3,545.00	87,916,000
メガチップス	11,600	5,060.00	58,696,000
OBARA GROUP	9,400	3,875.00	36,425,000
IMAGICA GROUP	14,900	479.00	7,137,100
澤藤電機	600	1,054.00	632,400
デンソー	1,237,400	2,011.50	2,489,030,100
原田工業	2,300	543.00	1,248,900
コーセル	16,100	1,026.00	16,518,600
イリソ電子工業	13,700	2,447.00	33,523,900
オブテックスグループ	27,600	1,621.00	44,739,600
千代田インテグレ	5,200	3,620.00	18,824,000
レーザーテック	68,800	22,290.00	1,533,552,000
スタンレー電気	96,000	2,743.00	263,328,000
ウシオ電機	66,200	2,042.50	135,213,500
岡谷電機産業	3,900	235.00	916,500
ヘリオス テクノ ホールディング	3,300	911.00	3,006,300
エノモト	1,000	1,397.00	1,397,000
日本セラミック	13,700	2,490.00	34,113,000
遠藤照明	1,500	1,368.00	2,052,000
古河電池	11,100	1,378.00	15,295,800
山一電機	13,300	2,319.00	30,842,700
図研	12,600	3,435.00	43,281,000
日本電子	37,600	5,204.00	195,670,400
カシオ計算機	108,300	1,141.50	123,624,450
ファナック	725,700	3,778.00	2,741,694,600
日本シイエムケイ	35,100	382.00	13,408,200
エンプラス	4,400	5,850.00	25,740,000
大真空	22,200	579.00	12,853,800
ローム	271,800	1,497.00	406,884,600
浜松ホトニクス	120,300	3,421.00	411,546,300
三井ハイテック	66,000	811.00	53,526,000
新光電気工業	53,100	5,542.00	294,280,200
京セラ	931,900	1,668.00	1,554,409,200
協栄産業	500	2,176.00	1,088,000
太陽誘電	73,000	2,789.50	203,633,500
村田製作所	1,339,500	2,635.00	3,529,582,500
双葉電子工業	28,900	500.00	14,450,000
日東電工	95,200	11,510.00	1,095,752,000
北陸電気工業	1,300	1,307.00	1,699,100
東海理化電機製作所	42,300	1,921.00	81,258,300
ニチコン	39,400	937.00	36,917,800
日本ケミコン	16,000	1,049.00	16,784,000
KOA	22,600	1,121.00	25,334,600
三井E&S	75,000	1,105.00	82,875,000
日立造船	133,700	953.00	127,416,100
三菱重工業	2,648,800	1,825.50	4,835,384,400
川崎重工業	122,300	4,933.00	603,305,900
IHI	112,800	6,754.00	761,851,200
名村造船所	46,700	1,398.00	65,286,600
サノヤスホールディングス	7,300	163.00	1,189,900

スプリックス	1,600	803.00	1,284,800
マネジメントソリューションズ	6,700	1,530.00	10,251,000
プロレド・パートナーズ	3,800	584.00	2,219,200
and factory	1,500	266.00	399,000
テノ・ホールディングス	700	564.00	394,800
フロンティア・マネジメント	3,900	1,146.00	4,469,400
ピアラ	1,100	257.00	282,700
コプロ・ホールディングス	1,200	1,519.00	1,822,800
ギークス	700	414.00	289,800
アンビスホールディングス	33,000	1,777.00	58,641,000
カーブスホールディングス	42,100	756.00	31,827,600
フォーラムエンジニアリング	21,100	962.00	20,298,200
FAST FITNESS JAPAN	5,200	1,218.00	6,333,600
Macbee Planet	4,300	2,856.00	12,280,800
日本車輛製造	4,900	2,086.00	10,221,400
三菱ロジスネクスト	23,900	1,266.00	30,257,400
近畿車輛	700	1,419.00	993,300
一家ホールディングス	1,500	703.00	1,054,500
フルサト・マルカホールディングス	12,800	2,197.00	28,121,600
ヤマエグループホールディングス	13,900	1,955.00	27,174,500
ジャパクラフトホールディングス	4,300	138.00	593,400
FPG	52,700	2,131.00	112,303,700
島根銀行	1,500	485.00	727,500
じもとホールディングス	4,400	280.00	1,232,000
全国保証	38,600	5,597.00	216,044,200
めぶきフィナンシャルグループ	684,300	547.60	374,722,680
ジャパンインベストメントアドバイザー	23,900	1,071.00	25,596,900
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,900	4,100.00	77,490,000
九州フィナンシャルグループ	285,900	681.90	194,955,210
かんぽ生命保険	150,400	2,553.00	383,971,200
ゆうちょ銀行	1,623,100	1,300.00	2,110,030,000
あんしん保証	2,400	181.00	434,400
富山第一銀行	46,900	1,033.00	48,447,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	785,700	771.40	606,088,980
ジェイリース	9,900	1,353.00	13,394,700
西日本フィナンシャルホールディングス	82,800	1,570.00	129,996,000
イントラスト	1,900	707.00	1,343,300
日本モーゲージサービス	2,600	405.00	1,053,000
CASA	2,000	812.00	1,624,000
SBIアルヒ	14,100	822.00	11,590,200
プレミアグループ	25,000	2,046.00	51,150,000
日産自動車	1,973,200	382.70	755,143,640
いすゞ自動車	421,100	1,988.50	837,357,350
トヨタ自動車	7,971,700	2,406.00	19,179,910,200
日野自動車	225,600	408.90	92,247,840
三菱自動車工業	585,000	372.30	217,795,500

エフテック	2,300	508.00	1,168,400
レシップホールディングス	2,200	588.00	1,293,600
GMB	1,100	1,153.00	1,268,300
ファルテック	1,100	458.00	503,800
武蔵精密工業	36,700	1,849.00	67,858,300
日産車体	15,200	995.00	15,124,000
新明和工業	43,200	1,262.00	54,518,400
極東開発工業	24,800	2,554.00	63,339,200
トピー工業	12,300	1,970.00	24,231,000
ティラド	3,400	3,520.00	11,968,000
曙ブレーキ工業	91,500	127.00	11,620,500
タチエス	27,700	1,858.00	51,466,600
NOK	58,300	2,258.00	131,641,400
フタバ産業	40,100	682.00	27,348,200
カヤバ	14,100	4,640.00	65,424,000
市光工業	27,100	408.00	11,056,800
大同メタル工業	29,300	474.00	13,888,200
プレス工業	59,800	571.00	34,145,800
ミクニ	4,200	336.00	1,411,200
太平洋工業	34,300	1,356.00	46,510,800
河西工業	7,900	155.00	1,224,500
アイシン	105,900	4,662.00	493,705,800
マツダ	496,100	1,037.00	514,455,700
今仙電機製作所	2,100	577.00	1,211,700
本田技研工業	3,553,300	1,457.00	5,177,158,100
スズキ	1,101,800	1,507.00	1,660,412,600
SUBARU	465,100	2,340.00	1,088,334,000
安永	2,200	597.00	1,313,400
ヤマハ発動機	648,100	1,238.50	802,671,850
小糸製作所	155,300	1,962.00	304,698,600
TBK	5,500	284.00	1,562,000
エクセディ	24,600	3,100.00	76,260,000
ミツバ	28,000	912.00	25,536,000
豊田合成	43,000	2,362.00	101,566,000
愛三工業	24,900	1,398.00	34,810,200
盟和産業	700	1,130.00	791,000
日本プラスト	4,400	368.00	1,619,200
ヨロズ	14,000	1,073.00	15,022,000
エフ・シー・シー	26,600	2,360.00	62,776,000
新家工業	700	4,875.00	3,412,500
シマノ	65,500	25,085.00	1,643,067,500
テイ・エス テック	53,400	1,735.00	92,649,000
三十三フィナンシャルグループ	13,200	1,650.00	21,780,000
第四北越フィナンシャルグループ	23,100	4,750.00	109,725,000
ひろぎんホールディングス	210,200	1,065.50	223,968,100
マーキュリアホールディングス	1,500	839.00	1,258,500
おきなわフィナンシャルグループ	12,700	2,252.00	28,600,400
ダイレクトマーケティングミックス	16,000	243.00	3,888,000
ポピンズ	2,300	1,466.00	3,371,800
LITALICO	12,100	1,191.00	14,411,100

コンフィデンス・インターワークス	500	1,756.00	878,000
十六フィナンシャルグループ	19,000	3,925.00	74,575,000
北國フィナンシャルホールディングス	14,400	4,380.00	63,072,000
ネットプロテクションズホールディングス	49,100	351.00	17,234,100
プロクレアホールディングス	16,900	1,763.00	29,794,700
F P パートナー	6,600	2,711.00	17,892,600
あいちフィナンシャルグループ	30,400	2,346.00	71,318,400
ジャムコ	8,000	1,257.00	10,056,000
小野建	16,100	1,471.00	23,683,100
はるやまホールディングス	2,500	576.00	1,440,000
南陽	1,500	1,067.00	1,600,500
ノジマ	46,000	1,926.00	88,596,000
佐島電機	11,100	1,847.00	20,501,700
カッパ・クリエイト	24,900	1,722.00	42,877,800
エコートレーディング	1,100	930.00	1,023,000
伯東	9,100	4,580.00	41,678,000
コンドーテック	12,300	1,213.00	14,919,900
中山福	3,100	375.00	1,162,500
ライトオン	4,000	335.00	1,340,000
ナガイレーベン	20,000	2,461.00	49,220,000
三菱食品	14,600	5,220.00	76,212,000
良品計画	189,000	2,555.00	482,895,000
パリミキホールディングス	4,400	352.00	1,548,800
松田産業	12,200	3,085.00	37,637,000
第一興商	61,400	1,731.00	106,283,400
メディopalホールディングス	161,300	2,590.00	417,767,000
アドヴァングループ	13,400	916.00	12,274,400
S P K	7,100	1,969.00	13,979,900
萩原電気ホールディングス	6,900	3,440.00	23,736,000
アルビス	5,100	2,811.00	14,336,100
アズワン	49,100	2,800.50	137,504,550
スズデン	5,400	1,793.00	9,682,200
尾家産業	800	2,016.00	1,612,800
シモジマ	10,700	1,279.00	13,685,300
ドウシシャ	14,600	2,130.00	31,098,000
小津産業	1,300	1,643.00	2,135,900
コナカ	6,200	233.00	1,444,600
高速	9,500	2,371.00	22,524,500
ハウス オブ ローゼ	700	1,495.00	1,046,500
G-7ホールディングス	17,400	1,653.00	28,762,200
たけびし	5,900	2,367.00	13,965,300
イオン北海道	47,000	918.00	43,146,000
コジマ	30,800	936.00	28,828,800
ヒマラヤ	2,000	888.00	1,776,000
コーナン商事	19,500	3,790.00	73,905,000
ネットワンシステムズ	58,500	3,612.00	211,302,000
エコス	5,900	2,094.00	12,354,600
ワタミ	16,700	841.00	14,044,700
マルシェ	1,900	198.00	376,200

リックス	3,600	2,826.00	10,173,600
システムソフト	53,400	60.00	3,204,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	320,500	3,815.00	1,222,707,500
丸文	14,100	1,015.00	14,311,500
西松屋チェーン	31,100	2,531.00	78,714,100
ゼンショーホールディングス	80,700	7,913.00	638,579,100
ハビネット	13,300	3,980.00	52,934,000
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,210.00	14,399,000
ハークスレイ	1,600	758.00	1,212,800
橋本総業ホールディングス	6,100	1,200.00	7,320,000
日本ライフライン	42,500	1,178.00	50,065,000
サイゼリヤ	23,400	5,130.00	120,042,000
タカショー	13,800	475.00	6,555,000
VTホールディングス	61,300	479.00	29,362,700
アルゴグラフィックス	13,700	5,120.00	70,144,000
魚力	5,500	2,484.00	13,662,000
I D O M	42,000	1,049.00	44,058,000
日本エム・ディ・エム	12,100	731.00	8,845,100
ポプラ	1,500	208.00	312,000
フジ・コーポレーション	7,500	2,036.00	15,270,000
ユナイテッドアローズ	18,600	2,148.00	39,952,800
進和	9,700	2,574.00	24,967,800
エスケイジャパン	1,400	732.00	1,024,800
ダイトロン	7,000	2,592.00	18,144,000
ハイデイ日高	23,500	2,695.00	63,332,500
シークス	22,500	1,027.00	23,107,500
京都きもの友禅ホールディングス	3,100	91.00	282,100
コロワイド	68,300	1,750.00	119,525,000
田中商事	1,600	671.00	1,073,600
オーハシテクニカ	8,300	1,779.00	14,765,700
壺番屋	62,800	1,029.00	64,621,200
白銅	4,400	2,423.00	10,661,200
トップカルチャー	2,100	148.00	310,800
P L A N T	1,300	1,536.00	1,996,800
スギホールディングス	95,800	2,479.00	237,488,200
ダイコー通産	600	1,140.00	684,000
薬王堂ホールディングス	7,600	2,498.00	18,984,800
島津製作所	199,200	4,551.00	906,559,200
J M S	13,800	502.00	6,927,600
クボテック	1,500	200.00	300,000
長野計器	10,900	2,419.00	26,367,100
ブイ・テクノロジー	7,800	2,444.00	19,063,200
スター精密	25,500	1,856.00	47,328,000
東京計器	11,500	2,729.00	31,383,500
愛知時計電機	6,600	1,974.00	13,028,400
インターアクション	9,000	1,162.00	10,458,000
オーバル	4,400	381.00	1,676,400
東京精密	30,800	7,032.00	216,585,600
マニー	60,000	1,800.50	108,030,000

ニコン	216,700	1,430.50	309,989,350
トプコン	72,900	1,445.00	105,340,500
オリンパス	858,600	2,544.00	2,184,278,400
理研計器	21,300	3,945.00	84,028,500
SCREENホールディングス	51,300	9,577.00	491,300,100
キヤノン電子	14,200	2,179.00	30,941,800
タムロン	20,600	4,360.00	89,816,000
HOYA	295,200	19,170.00	5,658,984,000
シード	3,100	508.00	1,574,800
ノーリツ鋼機	14,100	4,040.00	56,964,000
A&Dホロンホールディングス	22,000	2,089.00	45,958,000
朝日インテック	182,800	2,596.00	474,548,800
キヤノン	748,000	4,723.00	3,532,804,000
リコー	376,000	1,505.00	565,880,000
シチズン時計	137,900	900.00	124,110,000
リズム	800	3,995.00	3,196,000
大研医器	2,900	524.00	1,519,600
メニコン	51,500	1,297.50	66,821,250
シンシア	600	402.00	241,200
KYORITSU	7,400	159.00	1,176,600
中本パックス	1,200	1,586.00	1,903,200
パラマウントベッドホールディングス	31,100	2,483.00	77,221,300
トランザクション	9,900	2,200.00	21,780,000
粧美堂	1,500	592.00	888,000
ニホンフラッシュ	14,100	888.00	12,520,800
前田工織	26,000	1,680.00	43,680,000
永大産業	6,100	221.00	1,348,100
アートネイチャー	13,400	821.00	11,001,400
フルヤ金属	14,100	3,755.00	52,945,500
バンダイナムコホールディングス	407,100	3,221.00	1,311,269,100
アイフイスジャパン	1,500	553.00	829,500
SHOEI	42,200	2,199.00	92,797,800
フランスベッドホールディングス	19,300	1,215.00	23,449,500
マーベラス	24,300	581.00	14,118,300
パイロットコーポレーション	23,400	4,376.00	102,398,400
萩原工業	10,100	1,429.00	14,432,900
エイベックス	25,500	1,478.00	37,689,000
フジシールインターナショナル	30,500	2,314.00	70,577,000
タカラトミー	68,300	3,853.00	263,159,900
広済堂ホールディングス	48,500	506.00	24,541,000
エステールホールディングス	1,300	627.00	815,100
レック	19,300	1,262.00	24,356,600
タカノ	1,300	824.00	1,071,200
三光合成	18,900	538.00	10,168,200
プロネクス	15,700	1,250.00	19,625,000
ホクシン	4,000	103.00	412,000
ウッドワン	1,800	790.00	1,422,000
きもと	8,400	234.00	1,965,600
TOPPANホールディングス	178,700	4,237.00	757,151,900
大日本印刷	155,500	5,031.00	782,320,500

共同印刷	4,200	3,360.00	14,112,000
N I S S H A	25,600	1,936.00	49,561,600
光村印刷	400	1,501.00	600,400
藤森工業	12,000	4,250.00	51,000,000
ヴィア・ホールディングス	8,100	105.00	850,500
TAKARA & COMPANY	8,800	2,741.00	24,120,800
前澤化成工業	9,700	1,733.00	16,810,100
未来工業	5,300	3,340.00	17,702,000
アシックス	553,700	2,728.00	1,510,493,600
ツツミ	3,600	2,192.00	7,891,200
ウェーブロックホールディングス	2,000	614.00	1,228,000
J S P	10,600	1,918.00	20,330,800
ニチハ	18,800	3,480.00	65,424,000
ローランド	11,100	3,650.00	40,515,000
エフピコ	28,400	2,886.50	81,976,600
小松ウオール工業	6,100	2,972.00	18,129,200
ヤマハ	91,300	3,514.00	320,828,200
河合楽器製作所	4,400	2,778.00	12,223,200
クリナップ	14,700	690.00	10,143,000
ピジョン	95,500	1,524.00	145,542,000
天馬	10,100	2,520.00	25,452,000
キングジム	13,200	843.00	11,127,600
象印マホービン	44,800	1,666.00	74,636,800
リンテック	30,200	3,240.00	97,848,000
信越ポリマー	32,500	1,488.00	48,360,000
東リ	7,400	372.00	2,752,800
イトーキ	29,900	1,465.00	43,803,500
任天堂	946,900	7,546.00	7,145,307,400
三菱鉛筆	21,400	2,436.00	52,130,400
松風	6,800	4,655.00	31,654,000
タカラスタANDARD	30,800	1,570.00	48,356,000
コクヨ	74,900	2,493.50	186,763,150
ナカバヤシ	16,200	521.00	8,440,200
ニフコ	45,000	3,563.00	160,335,000
立川ブラインド工業	7,100	1,262.00	8,960,200
グロープライド	13,300	1,810.00	24,073,000
オカムラ	45,200	2,001.00	90,445,200
バルカー	12,700	3,285.00	41,719,500
MUTOHホールディングス	700	2,360.00	1,652,000
伊藤忠商事	1,066,700	7,310.00	7,797,577,000
丸紅	1,316,200	2,208.00	2,906,169,600
スクロール	23,500	953.00	22,395,500
高島	2,400	1,294.00	3,105,600
ヨンドシーホールディングス	15,000	1,851.00	27,765,000
三陽商会	7,200	2,338.00	16,833,600
長瀬産業	70,900	3,141.00	222,696,900
ナイガイ	1,800	235.00	423,000
蝶理	10,100	3,470.00	35,047,000
豊田通商	416,900	2,502.00	1,043,083,800
オンワードホールディングス	88,600	521.00	46,160,600

三共生興	22,000	561.00	12,342,000
兼松	66,200	2,394.00	158,482,800
美津濃	14,900	8,940.00	133,206,000
ツカモトコーポレーション	800	1,194.00	955,200
ルックホールディングス	4,600	2,534.00	11,656,400
三井物産	2,376,700	2,822.50	6,708,235,750
日本紙パルプ商事	7,600	6,650.00	50,540,000
東京エレクトロン	317,500	22,440.00	7,124,700,000
カメイ	16,900	1,992.00	33,664,800
東都水産	200	6,530.00	1,306,000
OUGホールディングス	500	2,589.00	1,294,500
スターゼン	11,000	2,939.00	32,329,000
セイコーグループ	21,000	3,715.00	78,015,000
山善	48,300	1,346.00	65,011,800
椿本興業	9,900	1,747.00	17,295,300
住友商事	960,300	3,118.00	2,994,215,400
B I P R O G Y	49,100	4,884.00	239,804,400
内田洋行	6,500	6,660.00	43,290,000
三菱商事	3,046,700	2,824.50	8,605,404,150
第一実業	14,900	2,249.00	33,510,100
キャノンマーケティングジャパン	36,700	4,741.00	173,994,700
西華産業	6,200	3,835.00	23,777,000
佐藤商事	11,100	1,347.00	14,951,700
東京産業	14,500	691.00	10,019,500
ユアサ商事	12,500	5,020.00	62,750,000
神鋼商事	4,000	6,570.00	26,280,000
トルク	3,900	210.00	819,000
阪和興業	28,500	4,820.00	137,370,000
正栄食品工業	10,600	4,540.00	48,124,000
カナデン	12,000	1,402.00	16,824,000
RYODEN	12,800	2,442.00	31,257,600
ニプロ	124,900	1,342.50	167,678,250
岩谷産業	36,200	7,852.00	284,242,400
ナイス	1,200	1,864.00	2,236,800
ニチモウ	1,200	1,830.00	2,196,000
極東貿易	9,500	1,476.00	14,022,000
アステナホールディングス	29,800	504.00	15,019,200
三愛オブリ	37,000	1,944.00	71,928,000
稲畑産業	31,200	3,235.00	100,932,000
G S I クレオス	8,500	1,962.00	16,677,000
明和産業	18,700	645.00	12,061,500
クワザワホールディングス	1,900	633.00	1,202,700
キムラタン	33,200	18.00	597,600
ゴールドウイン	26,700	7,963.00	212,612,100
ユニ・チャーム	313,300	5,080.00	1,591,564,000
デザート	25,800	4,355.00	112,359,000
キング	2,000	739.00	1,478,000
ワキタ	26,200	1,591.00	41,684,200
ヤマトインターナショナル	4,000	320.00	1,280,000
東邦ホールディングス	42,900	4,759.00	204,161,100

サンゲツ	36,600	2,810.00	102,846,000
ミツウロコグループホールディングス	20,300	1,640.00	33,292,000
シナネンホールディングス	4,400	6,250.00	27,500,000
伊藤忠エネクス	39,400	1,580.00	62,252,000
サンリオ	128,800	3,755.00	483,644,000
サンワテクノス	7,900	1,934.00	15,278,600
新光商事	21,300	963.00	20,511,900
トーヨー	6,100	2,665.00	16,256,500
三信電気	6,300	1,956.00	12,322,800
東陽テクニカ	14,500	1,669.00	24,200,500
モスフードサービス	23,200	3,485.00	80,852,000
加賀電子	14,400	5,340.00	76,896,000
都築電気	7,800	2,213.00	17,261,400
ソーダニッカ	16,700	1,151.00	19,221,700
立花エレテック	10,500	2,507.00	26,323,500
木曽路	23,900	2,373.00	56,714,700
SRSホールディングス	26,100	1,222.00	31,894,200
千趣会	29,300	303.00	8,877,900
リテールパートナーズ	23,500	1,368.00	32,148,000
上新電機	15,800	2,736.00	43,228,800
日本瓦斯	84,000	2,298.00	193,032,000
ロイヤルホールディングス	27,900	2,388.00	66,625,200
東天紅	400	785.00	314,000
いなげや	15,500	1,196.00	18,538,000
チヨダ	15,100	962.00	14,526,200
ライフコーポレーション	16,600	3,655.00	60,673,000
リンガーハット	20,400	2,172.00	44,308,800
MrMaxHD	20,000	685.00	13,700,000
テンアライド	4,900	299.00	1,465,100
AOKIホールディングス	34,000	1,214.00	41,276,000
オークワ	22,900	939.00	21,503,100
コメリ	24,400	3,700.00	90,280,000
青山商事	33,800	1,332.00	45,021,600
しまむら	37,200	7,939.00	295,330,800
はせがわ	2,500	329.00	822,500
高島屋	202,200	1,101.50	222,723,300
松屋	27,000	862.00	23,274,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	81,000	2,160.00	174,960,000
近鉄百貨店	6,900	2,027.00	13,986,300
丸井グループ	105,300	2,483.00	261,459,900
クレディセゾン	93,500	3,393.00	317,245,500
アクシアル リテイリング	43,300	935.00	40,485,500
井筒屋	2,500	434.00	1,085,000
イオン	537,800	4,019.00	2,161,418,200
イズミ	28,000	3,662.00	102,536,000
フォーバル	6,200	1,367.00	8,475,400
平和堂	26,600	2,454.00	65,276,400
フジ	24,300	2,135.00	51,880,500
ヤオコー	18,800	10,035.00	188,658,000
ゼビオホールディングス	21,600	1,248.00	26,956,800

ケーブホールディングス	106,600	1,536.00	163,737,600
PAL TAC	21,300	4,237.00	90,248,100
三谷産業	27,900	320.00	8,928,000
Olympicグループ	2,500	495.00	1,237,500
日産東京販売ホールディングス	5,200	452.00	2,350,400
あおぞら銀行	106,100	2,545.50	270,077,550
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,994,900	1,419.00	12,763,763,100
りそなホールディングス	1,694,800	971.30	1,646,159,240
三井住友トラスト・ホールディングス	525,900	3,355.00	1,764,394,500
三井住友フィナンシャルグループ	1,034,300	8,750.00	9,050,125,000
千葉銀行	411,500	1,115.00	458,822,500
群馬銀行	286,500	907.10	259,884,150
武蔵野銀行	20,600	2,676.00	55,125,600
千葉興業銀行	34,800	929.00	32,329,200
筑波銀行	64,900	237.00	15,381,300
七十七銀行	43,000	3,825.00	164,475,000
秋田銀行	9,900	2,204.00	21,819,600
山形銀行	16,400	1,029.00	16,875,600
岩手銀行	9,300	2,326.00	21,631,800
東邦銀行	116,800	250.00	29,200,000
東北銀行	1,600	1,130.00	1,808,000
ふくおかフィナンシャルグループ	128,600	3,562.00	458,073,200
スルガ銀行	110,500	1,122.00	123,981,000
八十二銀行	316,900	804.90	255,072,810
山梨中央銀行	16,500	1,584.00	26,136,000
大垣共立銀行	28,000	1,820.00	50,960,000
福井銀行	13,200	1,805.00	23,826,000
清水銀行	5,900	1,449.00	8,549,100
富山銀行	1,000	1,625.00	1,625,000
滋賀銀行	24,600	3,195.00	78,597,000
南都銀行	22,100	3,050.00	67,405,000
百五銀行	138,800	526.00	73,008,800
紀陽銀行	52,900	1,709.00	90,406,100
ほくほくフィナンシャルグループ	91,400	1,561.50	142,721,100
山陰合同銀行	92,500	1,204.00	111,370,000
鳥取銀行	1,200	1,257.00	1,508,400
百十四銀行	14,400	2,469.00	35,553,600
四国銀行	21,800	967.00	21,080,600
阿波銀行	20,700	2,447.00	50,652,900
大分銀行	8,800	3,105.00	27,324,000
宮崎銀行	8,900	2,685.00	23,896,500
佐賀銀行	8,700	2,050.00	17,835,000
琉球銀行	31,300	1,016.00	31,800,800
セブン銀行	462,800	285.20	131,990,560
みずほフィナンシャルグループ	1,993,700	2,746.50	5,475,697,050
高知銀行	1,700	798.00	1,356,600
山口フィナンシャルグループ	144,900	1,539.50	223,073,550
芙蓉総合リース	13,400	10,735.00	143,849,000
みずほリース	123,700	1,009.00	124,813,300
東京センチュリー	110,300	1,646.50	181,608,950

SBIホールディングス	237,000	3,211.00	761,007,000
日本証券金融	54,300	1,942.00	105,450,600
アイフル	217,300	315.00	68,449,500
日本アジア投資	3,600	203.00	730,800
名古屋銀行	9,400	6,240.00	58,656,000
北洋銀行	223,800	377.00	84,372,600
大光銀行	1,200	1,343.00	1,611,600
愛媛銀行	19,900	1,056.00	21,014,400
トマト銀行	1,300	1,145.00	1,488,500
京葉銀行	60,600	700.00	42,420,000
栃木銀行	74,000	259.00	19,166,000
北日本銀行	4,800	2,351.00	11,284,800
東和銀行	27,200	584.00	15,884,800
福島銀行	5,100	240.00	1,224,000
大東銀行	2,200	666.00	1,465,200
リコーリース	13,900	5,060.00	70,334,000
イオンフィナンシャルサービス	84,700	1,238.50	104,900,950
アコム	263,600	362.40	95,528,640
ジャックス	15,800	3,860.00	60,988,000
オリエントコーポレーション	48,300	937.00	45,257,100
オリックス	885,700	3,337.00	2,955,580,900
三菱HCキャピタル	658,100	1,019.00	670,603,900
ジャフコグループ	43,900	2,016.00	88,502,400
九州リースサービス	1,400	991.00	1,387,400
トモニホールディングス	139,800	376.00	52,564,800
大和証券グループ本社	1,144,200	996.20	1,139,852,040
野村ホールディングス	2,483,800	743.40	1,846,456,920
岡三証券グループ	129,600	635.00	82,296,000
丸三証券	49,000	966.00	47,334,000
東洋証券	39,300	406.00	15,955,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	175,200	486.00	85,147,200
光世証券	1,300	422.00	548,600
水戸証券	43,500	416.00	18,096,000
いちよし証券	27,700	677.00	18,752,900
松井証券	72,600	806.00	58,515,600
SOMPOホールディングス	666,500	3,174.00	2,115,471,000
日本取引所グループ	380,800	3,377.00	1,285,961,600
マネックスグループ	144,800	610.00	88,328,000
極東証券	20,200	1,437.00	29,027,400
岩井コスモホールディングス	16,800	1,989.00	33,415,200
アイザワ証券グループ	21,400	1,771.00	37,899,400
フィデアホールディングス	15,200	1,440.00	21,888,000
池田泉州ホールディングス	204,700	320.00	65,504,000
アニコムホールディングス	50,200	659.00	33,081,800
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	992,000	3,117.00	3,092,064,000
マネーパートナーズグループ	5,100	218.00	1,111,800
スパークス・グループ	16,400	1,289.00	21,139,600
小林洋行	2,200	274.00	602,800

第一生命ホールディングス	694,500	3,484.00	2,419,638,000
東京海上ホールディングス	1,442,100	4,925.00	7,102,342,500
アドバンテッジリスクマネジメント	2,500	545.00	1,362,500
イー・ギャランティ	24,000	1,373.00	32,952,000
アサックス	2,100	715.00	1,501,500
NECキャピタルソリューション	7,300	3,785.00	27,630,500
T&Dホールディングス	396,500	2,366.00	938,119,000
アドバンスクリエイト	11,300	1,001.00	11,311,300
三井不動産	2,049,200	1,373.00	2,813,551,600
三菱地所	926,700	2,250.00	2,085,075,000
平和不動産	23,900	4,010.00	95,839,000
東京建物	129,000	2,221.00	286,509,000
京阪神ビルディング	27,700	1,572.00	43,544,400
住友不動産	213,600	4,665.00	996,444,000
太平洋興発	2,000	735.00	1,470,000
テーオーシー	26,300	633.00	16,647,900
レオパレス21	147,700	590.00	87,143,000
スターツコーポレーション	21,300	3,360.00	71,568,000
フジ住宅	18,600	698.00	12,982,800
空港施設	20,800	579.00	12,043,200
明和地所	9,500	954.00	9,063,000
ゴールドクレスト	12,200	3,265.00	39,833,000
リログループ	77,300	1,817.00	140,454,100
エスリード	7,000	4,490.00	31,430,000
日神グループホールディングス	23,700	487.00	11,541,900
日本エスコン	27,600	1,016.00	28,041,600
MIRARTHホールディングス	67,900	494.00	33,542,600
AVANTIA	1,800	770.00	1,386,000
イオンモール	76,500	2,081.50	159,234,750
毎日コムネット	2,000	705.00	1,410,000
ファースト住建	1,400	1,089.00	1,524,600
ランド	819,200	8.00	6,553,600
カチタス	39,700	1,750.00	69,475,000
東祥	10,800	680.00	7,344,000
トーセイ	24,600	2,221.00	54,636,600
穴吹興産	800	1,995.00	1,596,000
サンフロンティア不動産	22,000	1,751.00	38,522,000
FJネクストホールディングス	15,600	1,237.00	19,297,200
インテリックス	1,300	667.00	867,100
ランドビジネス	1,900	204.00	387,600
サンネクスタグループ	1,700	985.00	1,674,500
グランディハウス	12,600	547.00	6,892,200
東武鉄道	164,800	2,590.00	426,832,000
相鉄ホールディングス	53,700	2,414.00	129,631,800
東急	420,500	1,868.50	785,704,250
京浜急行電鉄	185,600	1,175.50	218,172,800
小田急電鉄	248,000	1,726.00	428,048,000
京王電鉄	72,100	3,594.00	259,127,400
京成電鉄	96,700	4,524.00	437,470,800
富士急行	18,500	2,605.00	48,192,500

東日本旅客鉄道	826,600	2,890.00	2,388,874,000
西日本旅客鉄道	355,800	2,702.50	961,549,500
東海旅客鉄道	577,600	3,341.00	1,929,761,600
西武ホールディングス	181,300	3,839.00	696,010,700
鴻池運輸	25,500	2,363.00	60,256,500
西日本鉄道	39,900	2,271.50	90,632,850
ハマキョウレックス	12,800	4,900.00	62,720,000
サカイ引越センター	16,600	2,442.00	40,537,200
近鉄グループホールディングス	149,700	3,537.00	529,488,900
阪急阪神ホールディングス	199,600	4,500.00	898,200,000
南海電気鉄道	66,700	2,358.50	157,311,950
京阪ホールディングス	82,600	3,055.00	252,343,000
神戸電鉄	4,100	2,605.00	10,680,500
名古屋鉄道	154,400	1,715.00	264,796,000
山陽電気鉄道	11,300	2,023.00	22,859,900
アルプス物流	12,200	5,770.00	70,394,000
トランコム	4,400	7,330.00	32,252,000
ヤマトホールディングス	181,900	1,641.50	298,588,850
山九	36,200	4,777.00	172,927,400
日新	11,400	4,250.00	48,450,000
丸運	3,300	530.00	1,749,000
丸全昭和運輸	9,300	4,950.00	46,035,000
センコーグループホールディングス	79,000	1,231.00	97,249,000
トナミホールディングス	3,300	5,660.00	18,678,000
ニッコンホールディングス	46,100	3,755.00	173,105,500
日本石油輸送	300	2,879.00	863,700
福山通運	13,700	3,745.00	51,306,500
セイノーホールディングス	84,100	2,399.50	201,797,950
神奈川中央交通	4,100	3,345.00	13,714,500
AZ-COM丸和ホールディングス	38,300	1,103.00	42,244,900
日本郵船	387,800	4,836.00	1,875,400,800
商船三井	325,100	4,802.00	1,561,130,200
川崎汽船	360,600	1,998.50	720,659,100
NSユナイテッド海運	7,900	4,290.00	33,891,000
明海グループ	3,600	713.00	2,566,800
飯野海運	54,900	1,181.00	64,836,900
共栄タンカー	1,100	997.00	1,096,700
九州旅客鉄道	105,800	4,143.00	438,329,400
SGホールディングス	251,300	1,553.00	390,268,900
NIPPON EXPRESSホールディングス	55,900	7,156.00	400,020,400
ID&Eホールディングス	9,300	3,990.00	37,107,000
日本航空	367,700	2,453.00	901,968,100
ANAホールディングス	407,400	3,031.00	1,234,829,400
ビーウィズ	3,200	1,853.00	5,929,600
サンウェルズ	5,900	1,987.00	11,723,300
パスコ	1,000	2,137.00	2,137,000
TREホールディングス	29,500	1,555.00	45,872,500
人・夢・技術グループ	6,300	1,704.00	10,735,200
西本Wismettacホールディング	9,600	1,332.00	12,787,200

グス				
シルバーライフ	4,300	830.00	3,569,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	2,533.00	1,013,200	
Genky Drug Stores	13,800	3,710.00	51,198,000	
コア商事ホールディングス	11,100	601.00	6,671,100	
KPPグループホールディングス	41,100	664.00	27,290,400	
ナルミヤ・インターナショナル	1,000	1,205.00	1,205,000	
ブックオフグループホールディングス	10,400	1,311.00	13,634,400	
ギフトホールディングス	7,700	2,599.00	20,012,300	
三菱倉庫	35,800	5,232.00	187,305,600	
三井倉庫ホールディングス	13,900	5,990.00	83,261,000	
住友倉庫	39,900	2,682.00	107,011,800	
澁澤倉庫	6,900	2,896.00	19,982,400	
ヤマタネ	7,100	3,175.00	22,542,500	
東陽倉庫	1,000	1,321.00	1,321,000	
乾汽船	17,600	1,138.00	20,028,800	
日本トランスシティ	30,300	894.00	27,088,200	
ケイヒン	1,000	1,946.00	1,946,000	
中央倉庫	7,900	1,406.00	11,107,400	
川西倉庫	1,100	1,120.00	1,232,000	
安田倉庫	10,300	1,639.00	16,881,700	
ファイズホールディングス	700	862.00	603,400	
NISSOホールディングス	13,200	768.00	10,137,600	
大栄環境	27,900	3,015.00	84,118,500	
日本管財ホールディングス	16,200	2,605.00	42,201,000	
東洋埠頭	1,100	1,299.00	1,428,900	
上組	69,000	3,271.00	225,699,000	
サンリツ	1,300	798.00	1,037,400	
キムラユニティー	1,600	1,449.00	2,318,400	
キューソー流通システム	9,900	1,881.00	18,621,900	
東海運	2,800	323.00	904,400	
エーアイティー	9,400	1,655.00	15,557,000	
内外トランスライン	6,000	2,730.00	16,380,000	
ショーエイコーポレーション	1,700	568.00	965,600	
日本コンセプト	5,400	1,632.00	8,812,800	
TBSホールディングス	75,600	3,946.00	298,317,600	
日本テレビホールディングス	133,200	2,335.00	311,022,000	
朝日放送グループホールディングス	14,200	638.00	9,059,600	
テレビ朝日ホールディングス	36,600	1,971.00	72,138,600	
スカパーJ SATホールディングス	116,800	837.00	97,761,600	
テレビ東京ホールディングス	10,800	3,710.00	40,068,000	
日本BS放送	1,900	887.00	1,685,300	
ビジョン	22,600	1,302.00	29,425,200	
スマートバリュー	1,500	309.00	463,500	
U-NEXT HOLDINGS	16,800	5,610.00	94,248,000	
ワイヤレスゲート	2,200	246.00	541,200	
日本通信	147,900	159.00	23,516,100	
クロップス	700	949.00	664,300	
日本電信電話	44,739,500	148.40	6,639,341,800	
KDDI	1,106,200	4,737.00	5,240,069,400	

ソフトバンク	2,403,100	1,988.50	4,778,564,350
光通信	14,900	32,160.00	479,184,000
エムティーアイ	10,300	1,139.00	11,731,700
GMOインターネットグループ	48,900	2,397.50	117,237,750
ファイバーゲート	7,900	1,046.00	8,263,400
アイドママーケティングコミュニケーション	1,700	219.00	372,300
KADOKAWA	79,500	2,989.00	237,625,500
学研ホールディングス	27,600	994.00	27,434,400
ゼンリン	25,600	858.00	21,964,800
昭文社ホールディングス	2,100	378.00	793,800
インプレスホールディングス	4,900	152.00	744,800
東京電力ホールディングス	1,351,900	633.20	856,023,080
中部電力	552,700	1,688.00	932,957,600
関西電力	579,100	2,344.00	1,357,410,400
中国電力	260,400	965.20	251,338,080
北陸電力	153,300	923.70	141,603,210
東北電力	394,900	1,347.00	531,930,300
四国電力	139,600	1,282.50	179,037,000
九州電力	345,600	1,563.00	540,172,800
北海道電力	145,000	955.90	138,605,500
沖縄電力	38,400	1,060.00	40,704,000
電源開発	123,100	2,365.00	291,131,500
エフオン	11,100	370.00	4,107,000
イーレックス	26,800	697.00	18,679,600
レノバ	39,900	930.00	37,107,000
東京瓦斯	292,100	3,364.00	982,624,400
大阪瓦斯	298,800	3,336.00	996,796,800
東邦瓦斯	65,000	4,096.00	266,240,000
北海道瓦斯	8,900	3,060.00	27,234,000
広島ガス	31,900	386.00	12,313,400
西部ガスホールディングス	15,700	1,856.00	29,139,200
静岡ガス	34,100	1,086.00	37,032,600
メタウォーター	17,900	1,694.00	30,322,600
M&A総研ホールディングス	16,400	2,904.00	47,625,600
アイネット	9,100	1,515.00	13,786,500
松竹	7,700	10,270.00	79,079,000
東宝	83,700	5,845.00	489,226,500
エイチ・アイ・エス	49,200	1,659.00	81,622,800
東映	24,900	4,515.00	112,423,500
ラックランド	7,100	1,974.00	14,015,400
NTTデータグループ	393,200	2,465.00	969,238,000
共立メンテナンス	48,500	2,259.50	109,585,750
イチネンホールディングス	16,200	1,810.00	29,322,000
建設技術研究所	7,800	4,380.00	34,164,000
スペース	10,100	1,118.00	11,291,800
アインホールディングス	22,000	5,115.00	112,530,000
燦ホールディングス	14,400	1,180.00	16,992,000
ピー・シー・エー	8,600	1,978.00	17,010,800
スバル興業	6,000	2,973.00	17,838,000

東京テアトル	1,400	1,106.00	1,548,400
タナベコンサルティンググループ	5,900	1,237.00	7,298,300
ビジネスブレイン太田昭和	5,900	1,828.00	10,785,200
ナガワ	4,800	7,180.00	34,464,000
東京都競馬	11,300	4,120.00	46,556,000
常磐興産	1,400	1,651.00	2,311,400
カナモト	23,800	2,941.00	69,995,800
D T S	29,700	3,965.00	117,760,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	68,800	5,435.00	373,928,000
シーイーシー	19,000	1,798.00	34,162,000
カプコン	268,900	3,226.00	867,471,400
ニシオホールディングス	12,800	4,060.00	51,968,000
アイ・エス・ビー	7,100	1,457.00	10,344,700
アゴーラ ホスピタリティグループ	33,100	43.00	1,423,300
日本空港ビルデング	52,300	4,910.00	256,793,000
トランス・コスモス	17,200	3,520.00	60,544,000
乃村工藝社	67,100	815.00	54,686,500
S C S K	105,200	2,996.00	315,179,200
藤田観光	6,900	9,230.00	63,687,000
K N T - C Tホールディングス	9,200	1,277.00	11,748,400
トーカイ	13,500	2,141.00	28,903,500
白洋舎	800	2,375.00	1,900,000
セコム	157,000	11,040.00	1,733,280,000
N S W	6,700	2,970.00	19,899,000
セントラル警備保障	8,300	2,750.00	22,825,000
アイネス	11,700	1,600.00	18,720,000
丹青社	29,800	842.00	25,091,600
メイテックグループホールディングス	52,500	3,244.00	170,310,000
T K C	26,900	3,805.00	102,354,500
富士ソフト	41,600	9,350.00	388,960,000
応用地質	14,300	2,510.00	35,893,000
船井総研ホールディングス	30,800	2,275.00	70,070,000
N S D	53,100	3,290.00	174,699,000
進学会ホールディングス	1,700	227.00	385,900
丸紅建材リース	400	2,841.00	1,136,400
オオバ	2,300	1,005.00	2,311,500
コナミグループ	56,400	13,840.00	780,576,000
いであ	1,000	2,257.00	2,257,000
学究社	6,100	1,948.00	11,882,800
イオンディライト	16,500	4,115.00	67,897,500
ナック	13,200	550.00	7,260,000
福井コンピュータホールディングス	9,300	2,471.00	22,980,300
ダイセキ	31,400	3,785.00	118,849,000
ステップ	5,600	1,943.00	10,880,800
泉州電業	10,900	4,655.00	50,739,500
GENKI GLOBAL DINI NG CONCEPTS	9,000	4,265.00	38,385,000
トラスコ中山	33,300	2,430.00	80,919,000

ヤマダホールディングス	488,300	443.90	216,756,370
オートバックスセブン	55,200	1,469.00	81,088,800
モリト	12,700	1,340.00	17,018,000
アークランズ	47,300	1,721.00	81,403,300
ニトリホールディングス	57,700	22,735.00	1,311,809,500
グルメ杵屋	12,900	1,087.00	14,022,300
愛眼	4,200	161.00	676,200
ケーユーホールディングス	7,400	1,039.00	7,688,600
吉野家ホールディングス	58,400	3,188.00	186,179,200
加藤産業	19,600	4,250.00	83,300,000
北恵	1,500	903.00	1,354,500
イノテック	10,100	1,426.00	14,402,600
イエローハット	25,200	2,397.00	60,404,400
松屋フーズホールディングス	7,500	5,970.00	44,775,000
JBC Cホールディングス	10,100	4,375.00	44,187,500
JKホールディングス	12,400	966.00	11,978,400
サガミホールディングス	23,700	1,676.00	39,721,200
日伝	10,400	3,210.00	33,384,000
ミロク情報サービス	13,500	1,837.00	24,799,500
北沢産業	3,300	359.00	1,184,700
杉本商事	7,600	3,085.00	23,446,000
因幡電機産業	41,100	3,825.00	157,207,500
王将フードサービス	11,900	8,380.00	99,722,000
ミニストップ	11,600	1,646.00	19,093,600
アークス	29,100	2,525.00	73,477,500
バローホールディングス	30,400	2,231.00	67,822,400
東テック	15,900	2,393.00	38,048,700
ミスミグループ本社	239,600	2,525.50	605,109,800
アルテック	2,900	220.00	638,000
ベルク	7,800	6,310.00	49,218,000
大 庄	8,500	1,068.00	9,078,000
タキヒヨー	1,400	1,199.00	1,678,600
ファーストリテイリング	89,200	44,070.00	3,931,044,000
ソフトバンクグループ	741,900	8,168.00	6,059,839,200
蔵王産業	600	2,520.00	1,512,000
スズケン	56,700	5,162.00	292,685,400
サンドラッグ	53,500	4,151.00	222,078,500
サックスパー ホールディングス	13,200	810.00	10,692,000
ジェコス	9,600	889.00	8,534,400
ヤマザワ	1,300	1,227.00	1,595,100
やまや	700	3,015.00	2,110,500
ベルーナ	38,200	708.00	27,045,600
合計	246,772,900		539,415,442,040

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年9月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	13,571,689,960
コール・ローン	3,726,604,566
株式	1,460,565,147,522
投資信託受益証券	2,329,195,677
投資証券	28,698,140,205
派生商品評価勘定	266,421,508
未収入金	26,554,958
未収配当金	2,004,201,968
差入委託証拠金	12,445,175,813
流動資産合計	1,523,633,132,177
資産合計	1,523,633,132,177
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	71,514,683
未払解約金	192,285,000
流動負債合計	263,799,683
負債合計	263,799,683
純資産の部	
元本等	
元本	172,295,819,280
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	1,351,073,513,214
元本等合計	1,523,369,332,494
純資産合計	1,523,369,332,494
負債純資産合計	1,523,633,132,177

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9月20日 至 2024年9月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年9月17日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	158,050,663,273円
同期中追加設定元本額	66,846,323,545円
同期中一部解約元本額	52,601,167,538円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,863,561,954円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	1,326,759円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	6,348,704円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	15,654,615円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	17,590,613円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	19,319,935円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	9,714,158円
たわらノーロード 先進国株式	68,307,839,664円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,990,634,280円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,008,643,751円
たわらノーロード バランス (堅実型)	74,735,318円
たわらノーロード バランス (標準型)	781,253,881円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,149,314,695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)	42,567,928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)	249,660,896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)	274,740,818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)	496,797,078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)	247,665円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	14,518,936円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	5,047,326円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	15,673,885円
たわらノーロード 全世界株式	5,828,032,692円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (安定型)	678円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (バランス型)	3,107円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (積極型)	2,512円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	58,154,093,733円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3,653,285,837円
O n e グローバルバランス	46,242,509円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	119,388,477円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	662,865,780円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	958,202,851円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	62,498,075円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	189,788,756円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	210,302,443円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	16,014,340円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	602,328,460円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	111,796,003円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	135,229,298円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	169,363,733円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	297,797,409円
投資のソムリエ	5,904,056,541円
クルーズコントロール	9,109,881円
投資のソムリエ<DC年金>	678,987,167円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	193,869,593円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	347,055,002円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	529,079,256円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,519,539,643円
ワールドアセットバランス (基本コース)	80,909,672円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	228,746,305円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	61,181,583円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	32,057,364円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	5,108,934円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	153,444,160円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	151,881,249円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	362,990,150円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	119,407,451円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	55,230,877円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	34,647,371円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	21,101,296円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	184,712,882円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	5,534,057円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	29,470,175円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070）	40,154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）	703,996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）	732,670円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08（適格機関投資家限定）	25,391,096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）	450,023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II 2021-04（適格機関投資家限定）	1,912,718円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	5,419,919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）	458,337円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	10,178,959円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01（適格機関投資家限定）	1,271,825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）	463,897,001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）	33,976,083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）	970,603,867円
外国株式パッシブ・ファンド2（適格機関投資家限定）	1,040,558,398円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	101,359,334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）	448,456円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	4,616,075円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,238,530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）	3,433,579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）	16,602,424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）	30,763,422円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	1,288,146円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	7,315,368円

D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	763,812円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	27,134円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	273,597円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,191,570円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	80,570,440円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	164,573,213円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	584,026,658円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	22,504,922円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	19,892,143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)	125,912,427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)	4,125,861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)	119,400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)	38,036,558円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,657,611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)	13,472,153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)	17,750,656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)	60,376,897円
動的パッケージファンド<DC年金>	13,755,969円
コア資産形成ファンド	6,416,100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>	2,448,436,977円
MHAM外国株式インデックスファンド	129,898,732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>	1,025,865,789円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,532,655,643円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2,008,065,648円
計	172,295,819,280円
2. 受益権の総数	172,295,819,280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9月20日 至 2024年9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運

用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年9月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月17日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	133,996,102,175	
投資信託受益証券	367,546,546	
投資証券	4,367,599,334	
合計	138,731,248,055	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2024年2月16日から2024年9月17日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年9月17日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	3,604,519,252	—	3,589,981,369	△14,537,883
イギリス・ポンド	2,784,241,840	—	2,771,484,250	△12,757,590
オーストラリア・ドル	139,412,250	—	139,360,500	△51,750
カナダ・ドル	64,796,469	—	64,612,394	△184,075
ユーロ	110,908,168	—	110,174,752	△733,416
	505,160,525	—	504,349,473	△811,052

合計	3,604,519,252	—	3,589,981,369	△14,537,883
----	---------------	---	---------------	-------------

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2024年9月17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	31,318,181,116	—	31,527,625,824	209,444,708
合計	31,318,181,116	—	31,527,625,824	209,444,708

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年9月17日現在	
1口当たり純資産額	8.8416円
(1万口当たり純資産額)	(88,416円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年9月17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	1,538,961	184.890	284,538,499.290	
	ABBOTT LABORATORIES	287,066	117.630	33,767,573.580	
	AES CORP	109,122	19.010	2,074,409.220	

INTL BUSINESS MACHINES CORP	149,324	217.160	32,427,199.840	
ADVANCED MICRO DEVICES	263,800	152.080	40,118,704.000	
ADOBE INC	73,008	521.500	38,073,672.000	
CHUBB LTD	64,673	291.320	18,840,538.360	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	35,948	288.870	10,384,298.760	
ALLSTATE CORP	43,830	190.560	8,352,244.800	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	107,679	204.680	22,039,737.720	
AMGEN INC	87,375	335.260	29,293,342.500	
HESS CORP	44,111	128.920	5,686,790.120	
AMERICAN EXPRESS CO	95,397	261.090	24,907,202.730	
AMERICAN ELECTRIC POWER	86,607	104.950	9,089,404.650	
AFLAC INC	89,636	110.170	9,875,198.120	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	73.000	7,894,950.000	
ANALOG DEVICES	83,181	223.280	18,572,653.680	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	107,814	72.510	7,817,593.140	
VALERO ENERGY CORP	53,486	133.750	7,153,752.500	
ANSYS INC	14,299	318.050	4,547,796.950	
APPLE INC	2,392,952	216.320	517,643,376.640	
APPLIED MATERIALS INC	136,038	187.580	25,518,008.040	
ALBEMARLE CORP	18,991	89.350	1,696,845.850	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	60.410	4,923,656.640	
AMEREN CORP	44,814	85.470	3,830,252.580	
AUTODESK INC	36,571	267.730	9,791,153.830	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	67,072	278.600	18,686,259.200	
AUTOZONE INC	2,840	3,101.040	8,806,953.600	
AVERY DENNISON CORP	13,185	221.040	2,914,412.400	
BALL CORP	51,188	67.000	3,429,596.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	217,637	451.780	98,324,043.860	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	123,730	70.530	8,726,676.900	
BAXTER INTERNATIONAL INC	80,219	40.260	3,229,616.940	
BECTON DICKINSON & CO	47,568	234.040	11,132,814.720	
AMETEK INC	39,830	168.350	6,705,380.500	
VERIZON COMM INC	687,578	45.000	30,941,010.000	
WR BERKLEY CORP	47,410	58.750	2,785,337.500	
BEST BUY CO INC	35,626	98.790	3,519,492.540	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	330.260	997,715.460	
YUM! BRANDS INC	44,894	134.560	6,040,936.640	
FIRSTENERGY CORP	83,697	44.340	3,711,124.980	
BOEING CO	95,044	155.550	14,784,094.200	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	238,118	83.510	19,885,234.180	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE	21,827	100.310	2,189,466.370	

INC				
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	29,288	152.450	4,464,955.600	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,393.250	4,752,375.750	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	338,213	49.990	16,907,267.870	
ONEOK INC	94,258	93.680	8,830,089.440	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,940	136.120	1,761,392.800	
UNITED RENTALS INC	10,788	741.960	8,004,264.480	
SEMPRA	102,894	83.600	8,601,938.400	
FEDEX CORP	37,676	292.630	11,025,127.880	
VERISIGN INC	14,698	182.460	2,681,797.080	
AMPHENOL CORP	195,105	63.270	12,344,293.350	
BROWN-FORMAN CORP	37,107	46.620	1,729,928.340	
QUANTA SERVICES INC	23,271	271.540	6,319,007.340	
CSX CORP	315,936	33.810	10,681,796.160	
COTERRA ENERGY INC	114,711	22.920	2,629,176.120	
CAMPBELL SOUP CO	38,172	51.560	1,968,148.320	
CONSTELLATION BRANDS INC	26,080	253.650	6,615,192.000	
CARDINAL HEALTH INC	38,298	113.280	4,338,397.440	
CARLISLE COS INC	7,520	418.290	3,145,540.800	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	168,166	17.830	2,998,399.780	
CATERPILLAR INC	81,417	347.960	28,329,859.320	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	13,645	192.970	2,633,075.650	
JPMORGAN CHASE & CO	472,746	207.860	98,264,983.560	
CHURCH & DWIGHT CO INC	38,911	105.220	4,094,215.420	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	25,734	137.180	3,530,190.120	
CINTAS CORP	59,888	204.950	12,274,045.600	
CISCO SYSTEMS INC	661,570	51.030	33,759,917.100	
CLOROX COMPANY	21,216	165.950	3,520,795.200	
COCA-COLA CO/THE	667,450	72.100	48,123,145.000	
COPART INC	142,034	49.750	7,066,191.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	125,111	105.430	13,190,452.730	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	40,263	232.460	9,359,536.980	
MOLINA HEALTHCARE INC	9,939	360.770	3,585,693.030	
NRG ENERGY, INC.	34,874	80.780	2,817,121.720	
COMCAST CORP-CL A	639,334	39.360	25,164,186.240	
CONAGRA BRANDS INC	73,639	32.600	2,400,631.400	
CONSOLIDATED EDISON INC	55,106	104.850	5,777,864.100	
CMS ENERGY CORP	55,381	70.480	3,903,252.880	
COOPER COS INC	31,884	111.230	3,546,457.320	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	55.500	1,689,198.000	
CORNING INC	136,980	42.910	5,877,811.800	
HEICO CORP-CL A	14,337	204.020	2,925,034.740	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	270.400	2,553,116.800	

CUMMINS INC	23,003	301.070	6,925,513.210	
DR HORTON INC	49,181	194.600	9,570,622.600	
DANAHER CORP	110,150	276.030	30,404,704.500	
MOODY'S CORP	26,808	484.840	12,997,590.720	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	82,266	77.870	6,406,053.420	
TARGET CORP	77,092	152.840	11,782,741.280	
DEERE & CO	42,745	394.660	16,869,741.700	
MORGAN STANLEY	197,752	100.090	19,792,997.680	
REPUBLIC SERVICES INC	35,619	205.360	7,314,717.840	
COSTAR GROUP INC	66,181	77.900	5,155,499.900	
DECKERS OUTDOOR CORP	4,174	937.680	3,913,876.320	
THE WALT DISNEY CO	299,622	91.850	27,520,280.700	
DOLLAR TREE INC	35,355	71.910	2,542,378.050	
DOVER CORP	24,827	186.770	4,636,938.790	
OMNICOM GROUP	30,586	101.090	3,091,938.740	
DTE ENERGY CO	33,700	126.360	4,258,332.000	
DUKE ENERGY CORP	123,490	117.700	14,534,773.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	20,935	160.140	3,352,530.900	
EBAY INC	84,227	64.360	5,420,849.720	
BANK OF AMERICA CORP	1,156,533	39.100	45,220,440.300	
CITIGROUP INC	309,121	58.390	18,049,575.190	
EASTMAN CHEMICAL CO	21,268	105.380	2,241,221.840	
EATON CORP PLC	65,433	306.550	20,058,486.150	
CADENCE DESIGN SYS INC	45,352	273.130	12,386,991.760	
ECOLAB INC	41,402	253.200	10,482,986.400	
REVVITY INC	21,035	122.800	2,583,098.000	
ELECTRONIC ARTS INC	41,850	146.520	6,131,862.000	
SALESFORCE INC	160,262	256.910	41,172,910.420	
ERIE INDEMNITY CO	4,050	527.900	2,137,995.000	
EMERSON ELECTRIC CO	96,074	102.390	9,837,016.860	
ATMOS ENERGY CORP	24,532	138.270	3,392,039.640	
ENTERGY CORP	33,557	128.460	4,310,732.220	
EOG RESOURCES INC	93,097	121.670	11,327,111.990	
EQUIFAX INC	20,304	304.110	6,174,649.440	
EQT CORP	90,040	33.550	3,020,842.000	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	37,953	85.130	3,230,938.890	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	121.080	2,714,008.200	
EXXON MOBIL CORP	736,584	112.710	83,020,382.640	
NEXTERA ENERGY INC	335,117	84.640	28,364,302.880	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,019	453.980	2,732,505.620	
FAIR ISAAC CORP	4,009	1,894.980	7,596,974.820	
ASSURANT INC	8,766	192.920	1,691,136.720	
FASTENAL CO	95,215	70.090	6,673,619.350	
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	42.380	4,467,275.800	
M&T BANK CORP	28,540	173.080	4,939,703.200	
FISERV INC	96,211	175.350	16,870,598.850	
FORD MOTOR CO	628,645	10.800	6,789,366.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	20.110	954,762.470	

FREEMPORT-MCMORAN INC	244,611	42.890	10,491,365.790	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,871.320	2,964,170.880	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	35,237	299.550	10,555,243.350	
GENERAL DYNAMICS CORP	37,825	307.550	11,633,078.750	
GENERAL MILLS INC	94,669	74.630	7,065,147.470	
GENUINE PARTS CO	23,115	137.350	3,174,845.250	
GILEAD SCIENCES INC	207,279	83.160	17,237,321.640	
GARTNER INC	12,872	510.080	6,565,749.760	
MCKESSON CORP	21,558	519.820	11,206,279.560	
NVIDIA CORP	4,041,467	116.780	471,962,516.260	
GRACO INC	27,006	83.970	2,267,693.820	
GE AEROSPACE	178,355	181.440	32,360,731.200	
WW GRAINGER INC	7,145	1,008.210	7,203,660.450	
HALLIBURTON CO	139,251	28.410	3,956,120.910	
MONSTER BEVERAGE CORP	124,258	50.750	6,306,093.500	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	52,386	485.160	25,415,591.760	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	30,142	231.710	6,984,202.820	
HENRY SCHEIN INC	20,863	69.870	1,457,697.810	
HEICO CORP	6,878	262.220	1,803,549.160	
HERSHEY FOODS CORP	24,324	200.810	4,884,502.440	
HP INC	164,781	33.760	5,563,006.560	
F5 INC	8,981	213.420	1,916,725.020	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	92.470	1,676,018.750	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	344.980	2,627,022.700	
JUNIPER NETWORKS INC	50,704	38.630	1,958,695.520	
HOLOGIC INC	38,399	82.700	3,175,597.300	
HOME DEPOT INC	163,334	382.010	62,395,221.340	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29,668	69.860	2,072,606.480	
HORMEL FOODS CORP	49,054	32.530	1,595,726.620	
CENTERPOINT ENERGY INC	115,509	28.210	3,258,508.890	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	603.500	2,967,409.500	
HUBBELL INC	8,750	408.820	3,577,175.000	
HUMANA INC	19,544	315.230	6,160,855.120	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,365	167.400	2,572,101.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	240,636	14.640	3,522,911.040	
BIOGEN INC	23,241	199.580	4,638,438.780	
IDEX CORP	12,292	202.680	2,491,342.560	
ILLINOIS TOOL WORKS	48,604	255.130	12,400,338.520	
INTUIT INC	45,642	646.250	29,496,142.500	
IDEXX LABORATORIES INC	13,177	511.380	6,738,454.260	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	37,323	368.890	13,768,081.470	
INTEL CORP	699,796	20.910	14,632,734.360	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	103.640	4,248,514.520	
INTERNATIONAL PAPER CO	53,419	49.830	2,661,868.770	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	63,859	31.170	1,990,485.030	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	177.060	2,099,400.420	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	105.720	2,070,631.920	
INCYTE CORP	28,067	66.410	1,863,929.470	
EMCOR GROUP INC	7,710	402.690	3,104,739.900	
JOHNSON & JOHNSON	395,455	166.990	66,037,030.450	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	51,256	116.630	5,977,987.280	
KLA CORPORATION	22,406	736.400	16,499,778.400	
DEVON ENERGY CORP	106,971	39.640	4,240,330.440	
KELLANOVA	47,714	80.680	3,849,565.520	
KEYCORP	144,072	16.270	2,344,051.440	
KIMBERLY-CLARK CORP	55,965	144.200	8,070,153.000	
BLACKROCK INC/NEW YORK	24,260	895.180	21,717,066.800	
KROGER CO	109,187	56.190	6,135,217.530	
LAM RESEARCH CORP	21,501	758.470	16,307,863.470	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	7,446	429.140	3,195,376.440	
PACKAGING CORP OF AMERICA	15,558	214.590	3,338,591.220	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,313	99.290	2,314,747.770	
LENNAR CORP	40,713	187.210	7,621,880.730	
ELI LILLY & CO	132,776	923.540	122,623,947.040	
BATH & BODY WORKS INC	34,638	28.910	1,001,384.580	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	121,332	128.910	15,640,908.120	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	47,654	138.310	6,591,024.740	
LOCKHEED MARTIN CORP	35,987	572.920	20,617,672.040	
LOEWS CORP	30,289	78.840	2,387,984.760	
LOWE'S COS INC	93,476	256.640	23,989,680.640	
DOMINION ENERGY INC	142,221	58.530	8,324,195.130	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	36.440	1,472,212.440	
MCCORMICK & CO INC	40,279	84.760	3,414,048.040	
MCDONALD'S CORPORATION	117,769	296.690	34,940,884.610	
S&P GLOBAL INC	52,178	527.380	27,517,633.640	
EVEREST GROUP LTD	6,670	389.430	2,597,498.100	
MARKEL GROUP INC	2,404	1,574.830	3,785,891.320	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	103,592	69.360	7,185,141.120	
MARSH & MCLENNAN COS	79,966	231.170	18,485,740.220	
MASCO CORP	34,561	81.040	2,800,823.440	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,993	529.780	5,294,091.540	
METLIFE INC	97,405	77.380	7,537,198.900	
MEDTRONIC PLC	213,060	90.110	19,198,836.600	
CVS HEALTH CORP	203,209	58.370	11,861,309.330	
MERCK & CO. INC.	416,758	117.960	49,160,773.680	

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	69,835	70.370	4,914,288.950
MICROSOFT CORP	1,159,976	431.340	500,344,047.840
MICRON TECH INC	181,508	87.180	15,823,867.440
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	92,397	77.000	7,114,569.000
3M CO	89,105	134.610	11,994,424.050
ENTEGRIS INC	23,675	110.150	2,607,801.250
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	203.730	1,563,424.020
MOTOROLA SOLUTIONS INC	27,968	443.180	12,394,858.240
ILLUMINA INC	27,148	129.520	3,516,208.960
XCEL ENERGY INC	88,125	64.560	5,689,350.000
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	17,037	122.250	2,082,773.250
NETAPP INC	32,785	117.860	3,864,040.100
NEWMONT CORP	192,440	53.130	10,224,337.200
NVR INC	570	9,425.370	5,372,460.900
NIKE INC-CL B	201,444	79.800	16,075,231.200
NORDSON CORP	8,735	253.370	2,213,186.950
NORFOLK SOUTHERN CORP	36,835	247.070	9,100,823.450
EVERSOURCE ENERGY	57,685	68.400	3,945,654.000
NISOURCE INC	87,442	34.380	3,006,255.960
NORTHERN TRUST CORP	32,868	89.750	2,949,903.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	23,196	521.270	12,091,378.920
WELLS FARGO & CO	577,428	53.790	31,059,852.120
NUCOR CORP	40,395	142.960	5,774,869.200
CHENIERE ENERGY INC	36,422	182.550	6,648,836.100
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	62,919	140.950	8,868,433.050
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	104,338	51.290	5,351,496.020
OLD DOMINION FREIGHT LINE	31,348	191.920	6,016,308.160
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,613	1,130.720	10,869,611.360
ORACLE CORP	272,634	170.330	46,437,749.220
PACCAR INC	84,799	95.700	8,115,264.300
PTC INC	20,087	173.760	3,490,317.120
EXELON CORP	172,366	40.430	6,968,757.380
PARKER HANNIFIN CORP	20,955	596.780	12,505,524.900
PAYCHEX INC	51,491	135.190	6,961,068.290
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,452	249.560	2,857,961.120
PPL CORPORATION	135,783	32.680	4,437,388.440
PEPSICO INC	226,865	177.210	40,202,746.650
PENTAIR PLC	25,545	92.950	2,374,407.750
PFIZER INC	923,282	30.070	27,763,089.740
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	39.470	1,591,390.930
CONOCOPHILLIPS	189,812	105.550	20,034,656.600
PG&E CORP	322,749	20.010	6,458,207.490
ALTRIA GROUP INC	281,350	51.700	14,545,795.000
PNC FINANCIAL SERVICES	65,407	180.920	11,833,434.440

GROUP				
BROWN & BROWN INC	40,458	104.110	4,212,082.380	
GARMIN LTD	25,779	172.620	4,449,970.980	
PPG INDUSTRIES INC	37,839	127.340	4,818,418.260	
COSTCO WHOLESALE CORP	72,977	907.870	66,253,628.990	
T ROWE PRICE GROUP INC	37,719	105.865	3,993,121.930	
QUEST DIAGNOSTICS	19,786	156.360	3,093,738.960	
PROCTER & GAMBLE CO	388,009	177.240	68,770,715.160	
PROGRESSIVE CORP	97,016	256.310	24,866,170.960	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	78,981	84.770	6,695,219.370	
PULTE GROUP INC	33,950	140.060	4,755,037.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	43,206	111.050	4,798,026.300	
QUALCOMM INC	182,791	166.610	30,454,808.510	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	32,000	119.730	3,831,360.000	
EXACT SCIENCES CORP	29,779	69.480	2,069,044.920	
RELIANCE INC	8,747	279.290	2,442,949.630	
REGENERON PHARMACEUTICALS	17,597	1,153.080	20,290,748.760	
RESMED INC	24,715	251.770	6,222,495.550	
US BANCORP	256,841	44.690	11,478,224.290	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	60,197	114.220	6,875,701.340	
ROSS STORES INC	53,462	153.170	8,188,774.540	
ROLLINS INC	45,708	50.910	2,326,994.280	
ROPER TECHNOLOGIES INC	17,283	556.560	9,619,026.480	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,355	262.080	4,810,478.400	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	39,604	169.740	6,722,382.960	
RPM INTERNATIONAL INC	22,264	122.160	2,719,770.240	
ACCENTURE PLC-CL A	102,509	354.120	36,300,487.080	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	219,788	75.530	16,600,587.640	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	293.970	4,767,311.490	
AXON ENTERPRISE INC	12,002	385.770	4,630,011.540	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	39,040	242.260	9,457,830.400	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	93,547	85.030	7,954,301.410	
BOOKING HOLDINGS INC	5,593	3,979.000	22,254,547.000	
SCHLUMBERGER LTD	234,824	40.400	9,486,889.600	
SCHWAB (CHARLES) CORP	250,248	63.690	15,938,295.120	
POOL CORP	6,305	358.490	2,260,279.450	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	35,309	107.430	3,793,245.870	
SEI INVESTMENTS CO	20,388	67.480	1,375,782.240	
ELEVANCE HEALTH INC	37,612	553.500	20,818,242.000	
CENCORA INC	29,520	241.240	7,121,404.800	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	42,607	82.170	3,501,017.190	

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	39,074	379.060	14,811,390.440	
CENTENE CORP	88,199	76.570	6,753,397.430	
SMITH (A. O.) CORP	19,563	81.700	1,598,297.100	
SNAP-ON INC	8,204	281.440	2,308,933.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	57,528	117.730	6,772,771.440	
EDISON INTERNATIONAL	63,206	86.250	5,451,517.500	
SOUTHERN CO	177,549	89.890	15,959,879.610	
TRUIST FINANCIAL CORP	220,054	42.130	9,270,875.020	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	28.540	562,238.000	
AT&T INC	1,188,945	22.270	26,477,805.150	
CHEVRON CORP	285,740	142.090	40,600,796.600	
STANLEY BLACK & DECKER INC	26,546	102.590	2,723,354.140	
STATE STREET CORP	49,873	85.460	4,262,146.580	
STARBUCKS CORP	186,934	96.310	18,003,613.540	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	111.010	2,546,236.370	
STRYKER CORP	56,625	371.960	21,062,235.000	
NETFLIX INC	70,518	696.500	49,115,787.000	
GEN DIGITAL INC	92,583	26.620	2,464,559.460	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	52.310	1,433,294.000	
SYNOPSYS INC	25,583	498.570	12,754,916.310	
SYSCO CORP	83,870	77.120	6,468,054.400	
INTUITIVE SURGICAL INC	57,979	491.390	28,490,300.810	
TELEFLEX INC	6,985	246.050	1,718,659.250	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	183,707	18.070	3,319,585.490	
TERADYNE INC	24,830	127.980	3,177,743.400	
TEXAS INSTRUMENTS INC	150,972	198.470	29,963,412.840	
TEXTRON INC	29,841	88.330	2,635,855.530	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	62,983	614.150	38,681,009.450	
TORO CO	18,011	84.710	1,525,711.810	
DAVITA INC	9,106	165.190	1,504,220.140	
TRACTOR SUPPLY CO	18,106	283.390	5,131,059.340	
BIO-TECHNE CORP	25,934	74.760	1,938,825.840	
TRIMBLE INC	37,504	58.410	2,190,608.640	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,817	585.730	3,992,921.410	
TYSON FOODS INC	47,194	61.850	2,918,948.900	
MARATHON OIL CORP	92,952	26.660	2,478,100.320	
UNION PACIFIC CORP	99,869	252.430	25,209,931.670	
RTX CORP	217,381	119.200	25,911,815.200	
UNITEDHEALTH GROUP INC	151,415	589.140	89,204,633.100	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,903	234.990	2,327,105.970	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	10.420	847,416.920	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	42,736	489.430	20,916,280.480	
VULCAN MATERIALS CO	21,478	242.870	5,216,361.860	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	139,773	9.020	1,260,752.460
WALMART INC	727,712	80.560	58,624,478.720
WASTE MANAGEMENT INC	65,065	208.320	13,554,340.800
WATERS CORP	9,995	328.650	3,284,856.750
WATSCO INC	5,565	487.330	2,711,991.450
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,464	296.780	3,402,285.920
JM SMUCKER CO/THE-NEW	19,624	120.880	2,372,149.120
WESTERN DIGITAL CORP	53,991	64.090	3,460,283.190
WABTEC CORP	28,400	170.190	4,833,396.000
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,319	97.250	2,462,272.750
WYNN RESORTS LTD	15,379	78.950	1,214,172.050
NASDAQ INC	71,851	73.300	5,266,678.300
CME GROUP INC	57,788	218.530	12,628,411.640
WILLIAMS COS INC	199,751	45.440	9,076,685.440
WILLIAMS-SONOMA INC	19,292	145.020	2,797,725.840
DICK' S SPORTING GOODS INC	9,703	212.330	2,060,237.990
LKQ CORP	43,882	40.430	1,774,149.260
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	60.510	2,452,107.240
WEC ENERGY GROUP INC	56,102	96.140	5,393,646.280
MICROSTRATEGY INC-CL A	25,390	134.530	3,415,716.700
CARMAX INC	27,022	79.040	2,135,818.880
TJX COMPANIES INC	187,055	119.610	22,373,648.550
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	9,012	343.790	3,098,235.480
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.680	574,260.320
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	36.920	868,653.760
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	20,338	270.370	5,498,785.060
CBRE GROUP INC	48,577	119.500	5,804,951.500
REGIONS FINANCIAL CORP	152,588	22.300	3,402,712.400
DOMINO' S PIZZA INC	5,925	408.970	2,423,147.250
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,931	885.230	7,020,759.130
CRH PLC	113,508	89.170	10,121,508.360
WESTLAKE CORP	6,030	141.200	851,436.000
T-MOBILE US INC	87,670	205.850	18,046,869.500
LAS VEGAS SANDS CORP	59,474	40.260	2,394,423.240
MOSAIC CO/THE	48,502	25.430	1,233,405.860
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	259.000	1,586,634.000
CELANESE CORP	19,797	123.800	2,450,868.600
DEXCOM INC	68,840	70.090	4,824,995.600
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	187.650	3,669,308.100
EXPEDIA GROUP INC	21,978	135.790	2,984,392.620
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	79.730	2,469,158.370
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,417	445.140	7,307,863.380

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	92,984	161.910	15,055,039.440
LIVE NATION	27,355	101.520	2,777,079.600
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	222,207	57.660	12,812,455.620
TRANSDIGM GROUP INC	9,087	1,372.920	12,475,724.040
MASTERCARD INC	136,565	497.710	67,969,766.150
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	33.180	783,811.140
OWENS CORNING	13,227	167.770	2,219,093.790
LEIDOS HOLDINGS INC	20,679	154.810	3,201,315.990
AERCAP HOLDINGS NV	33,912	93.940	3,185,693.280
FIRST SOLAR INC	16,384	233.310	3,822,551.040
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	20,698	211.640	4,380,524.720
SUPER MICRO COMPUTER INC	8,410	449.100	3,776,931.000
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	98.410	2,075,860.540
DELTA AIR LINES INC	30,555	45.320	1,384,752.600
INSULET CORP	12,022	233.890	2,811,825.580
DISCOVER FINANCIAL	39,188	133.910	5,247,665.080
TE CONNECTIVITY LTD	52,304	145.880	7,630,107.520
LULULEMON ATHLETICA INC	19,016	265.300	5,044,944.800
MERCADOLIBRE INC	7,476	2,105.510	15,740,792.760
ULTA BEAUTY INC	7,914	389.290	3,080,841.060
MSCI INC	13,320	566.660	7,547,911.200
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	256,470	125.970	32,307,525.900
VISA INC	257,370	290.480	74,760,837.600
KEURIG DR PEPPER INC	173,573	37.350	6,482,951.550
AMERICAN WATER WORKS CO INC	31,751	149.090	4,733,756.590
MARATHON PETROLEUM CORP	59,718	161.010	9,615,195.180
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	84.100	1,802,263.000
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	339,285	21.470	7,284,448.950
XYLEM INC	39,414	132.790	5,233,785.060
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	46,489	94.080	4,373,685.120
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	265.210	1,718,826.010
EPAM SYSTEMS INC	9,031	205.460	1,855,509.260
HCA HEALTHCARE INC	32,407	403.430	13,073,956.010
VERISK ANALYTICS INC	23,047	269.400	6,208,861.800
CORPAY INC	11,338	307.630	3,487,908.940
NXP SEMICONDUCTOR NV	41,485	230.010	9,541,964.850
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	21,225	158.450	3,363,101.250
TARGA RESOURCES CORP	33,263	150.590	5,009,075.170
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,578	212.610	3,737,258.580
SS&C TECHNOLOGIES	34,295	75.510	2,589,615.450

HOLDINGS INC				
DOLLAR GENERAL CORP	35,900	85.750	3,078,425.000	
FORTINET INC	104,427	76.340	7,971,957.180	
HYATT HOTELS CORP	6,647	144.850	962,817.950	
TESLA INC	472,150	226.780	107,074,177.000	
ENPHASE ENERGY INC	21,539	111.490	2,401,383.110	
GENERAL MOTORS CO	184,183	46.870	8,632,657.210	
ALLY FINANCIAL INC	47,540	33.030	1,570,246.200	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	208.140	2,475,825.300	
APTIV PLC	43,097	68.790	2,964,642.630	
PHILLIPS 66	70,901	127.340	9,028,533.340	
META PLATFORMS INC	360,241	533.280	192,109,320.480	
IQVIA HOLDINGS INC	30,188	239.380	7,226,403.440	
DIAMONDBACK ENERGY INC	30,171	174.810	5,274,192.510	
SERVICENOW INC	33,536	892.460	29,929,538.560	
PALO ALTO NETWORKS INC	52,833	346.110	18,286,029.630	
WORKDAY INC	34,894	249.210	8,695,933.740	
ABBVIE INC	288,444	195.730	56,457,144.120	
ZOETIS INC	73,745	194.250	14,324,966.250	
NEWS CORP/NEW-CL A	74,964	26.090	1,955,810.760	
CDW CORP	22,475	221.450	4,977,088.750	
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	95.140	6,004,285.400	
TWILIO INC	25,710	60.300	1,550,313.000	
SNAP INC	174,273	9.640	1,679,991.720	
TRADE DESK INC A	73,200	105.370	7,713,084.000	
OKTA INC	25,106	74.030	1,858,597.180	
BAKER HUGHES CO	166,560	33.980	5,659,708.800	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	64.760	1,410,796.600	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	10.280	1,664,969.360	
BROADCOM INC	727,443	164.020	119,315,200.860	
ARES MANAGEMENT CORP	29,981	149.390	4,478,861.590	
MONGODB INC	12,304	290.050	3,568,775.200	
BURLINGTON STORES INC	10,565	272.080	2,874,525.200	
VEEVA SYSTEMS INC	25,024	217.030	5,430,958.720	
EVERGY INC	45,274	62.010	2,807,440.740	
ALLEGION PLC	13,423	142.720	1,915,730.560	
DAYFORCE INC	29,460	59.600	1,755,816.000	
STERIS PLC	15,540	243.730	3,787,564.200	
DOCUSIGN INC	31,974	56.760	1,814,844.240	
WIX.COM LTD	8,997	156.590	1,408,840.230	
KKR & CO INC	104,432	126.540	13,214,825.280	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	9,649	57.540	555,203.460	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	39,400	67.620	2,664,228.000	
MODERNA INC	52,618	69.170	3,639,587.060	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40,232	218.100	8,774,599.200	
CIGNA GROUP	46,332	366.850	16,996,894.200	
DELL TECHNOLOGIES INC	47,920	115.400	5,529,968.000	

DOW INC	113,128	50.660	5,731,064.480
OVINTIV INC	48,592	39.160	1,902,862.720
AMCOR PLC	223,348	11.120	2,483,629.760
PINTEREST INC	90,936	28.890	2,627,141.040
FOX CORP-A	36,501	39.710	1,449,454.710
FOX CORP-B	27,507	36.770	1,011,432.390
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	38,708	267.810	10,366,389.480
AVANTOR INC	107,376	27.200	2,920,627.200
DYNATRACE INC	46,540	51.550	2,399,137.000
CLOUDFLARE INC	46,487	79.930	3,715,705.910
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	119.550	2,022,546.900
CARRIER GLOBAL CORP	129,836	77.110	10,011,653.960
OTIS WORLDWIDE CORP	66,367	94.810	6,292,255.270
UBER TECHNOLOGIES INC	306,298	71.520	21,906,432.960
CORTEVA INC	116,431	56.270	6,551,572.370
MATCH GROUP INC	44,764	35.180	1,574,797.520
BLACKSTONE INC	118,639	154.560	18,336,843.840
CARLYLE GROUP INC	34,847	41.080	1,431,514.760
DATADOG INC	44,539	111.400	4,961,644.600
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	101.440	3,133,481.600
VERTIV HOLDINGS CO	57,675	86.990	5,017,148.250
INGERSOLL RAND INC	69,666	90.940	6,335,426.040
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	70,281	86.640	6,089,145.840
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	169.090	1,511,833.690
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	118,889	13.200	1,569,334.800
DRAFTKINGS INC	75,786	38.240	2,898,056.640
CHORD ENERGY CORP	10,665	134.410	1,433,482.650
AON PLC	32,567	350.690	11,420,921.230
WARNER BROS DISCOVERY INC	398,011	8.560	3,406,974.160
TEXAS PACIFIC LAND CORP	3,255	838.610	2,729,675.550
BENTLEY SYSTEMS INC	27,315	49.360	1,348,268.400
COINBASE GLOBAL INC	32,033	161.500	5,173,329.500
AIRBNB INC	73,863	117.550	8,682,595.650
CONSTELLATION ENERGY CORP	52,525	199.250	10,465,606.250
MONDAY.COM LTD	6,356	263.130	1,672,454.280
SOLVENTUM CORP	21,683	71.790	1,556,622.570
COREBRIDGE FINANCIAL INC	39,050	27.180	1,061,379.000
APPROVIN CORP	35,297	116.250	4,103,276.250
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	28.260	1,757,008.980
ROBLOX CORP	78,921	46.240	3,649,307.040
VIATRIS INC	184,148	11.810	2,174,787.880
CHESAPEAKE ENERGY CORP	19,577	73.060	1,430,295.620
HF SINCLAIR CORP	25,560	45.300	1,157,868.000
SNOWFLAKE INC	48,671	112.840	5,492,035.640
DOORDASH INC	51,630	130.870	6,756,818.100
ARISTA NETWORKS INC	43,596	359.160	15,657,939.360

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	65,347	117.160	7,656,054.520
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	36.790	584,703.470
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	337,084	36.310	12,239,520.040
FNF GROUP	38,907	60.610	2,358,153.270
JACOBS SOLUTIONS INC	21,170	144.790	3,065,204.300
MARVELL TECHNOLOGY INC	139,693	73.400	10,253,466.200
APA CORP	67,758	24.440	1,656,005.520
LINDE PLC	78,457	474.910	37,260,013.870
ROBINHOOD MARKETS INC	87,606	22.210	1,945,729.260
U-HAUL HOLDING CO	16,864	69.420	1,170,698.880
ASPEN TECHNOLOGY INC	5,007	226.100	1,132,082.700
TOAST INC	56,667	26.570	1,505,642.190
GE VERNOVA INC	44,235	229.930	10,170,953.550
GRAB HOLDINGS LTD	369,622	3.500	1,293,677.000
CATALENT INC	27,357	60.160	1,645,797.120
SYNCHRONY FINANCIAL	70,641	47.330	3,343,438.530
VERALTO CORP	40,316	109.960	4,433,147.360
SAMSARA INC	33,531	46.940	1,573,945.140
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	32,552	77.590	2,525,709.680
BUNGE GLOBAL SA	21,715	97.290	2,112,652.350
KENVUE INC	312,155	23.380	7,298,183.900
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	40.600	2,964,327.800
CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	273.400	1,858,846.600
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	149.480	4,142,539.240
HUBSPOT INC	7,895	495.410	3,911,261.950
QORVO INC	14,144	100.460	1,420,906.240
SMURFIT WESTROCK PLC	82,035	46.730	3,833,495.550
FERGUSON ENTERPRISES INC	32,186	197.220	6,347,722.920
LABCORP HOLDINGS INC	12,876	225.760	2,906,885.760
GODADDY INC	22,398	150.300	3,366,419.400
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	30,382	224.340	6,815,897.880
TRANSUNION	31,262	101.180	3,163,089.160
ALBERTSONS COS INC	54,086	18.860	1,020,061.960
BLOCK INC	90,085	65.780	5,925,791.300
DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	82.000	5,595,270.000
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	35,323	81.880	2,892,247.240
KRAFT HEINZ CO	152,849	35.630	5,446,009.870
FORTIVE CORP	55,370	73.720	4,081,876.400
WASTE CONNECTIONS INC	43,910	185.510	8,145,744.100
ALPHABET INC-CL A	967,928	158.060	152,990,699.680
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	206,262	17.230	3,553,894.260
PAYPAL HOLDINGS INC	161,904	71.070	11,506,517.280

	SEA LTD ADR	58,070	79.880	4,638,631.600	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	57,347	40.780	2,338,610.660	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	62.590	1,400,388.660	
	ALPHABET INC-CL C	828,146	158.990	131,666,932.540	
	PURE STORAGE INC	50,378	49.580	2,497,741.240	
	ZSCALER INC	14,051	171.780	2,413,680.780	
	ATLASSIAN CORP PLC	25,643	165.150	4,234,941.450	
	ROKU INC	19,331	74.370	1,437,646.470	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,049	343.370	5,167,375.130	
	VISTRA CORP	56,019	89.400	5,008,098.600	
アメリカ・ドル	小計	60,138,521		7,901,683,248.580 (1,112,319,950,901)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	17.615	1,079,711.420	
	ASHTAD GROUP	71,219	53.460	3,807,367.740	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	26.890	1,224,785.720	
	BARCLAYS PLC	2,403,221	2.210	5,311,118.410	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	198,192	5.084	1,007,608.120	
	BT GROUP PLC	952,952	1.475	1,405,604.200	
	BUNZL PLC	53,979	36.720	1,982,108.880	
	AVIVA PLC	429,205	4.914	2,109,113.370	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	39.610	814,896.530	
	DIAGEO PLC	357,390	24.660	8,813,237.400	
	SCHRODERS PLC	110,366	3.382	373,257.810	
	DCC PLC	17,471	52.650	919,848.150	
	NATIONAL GRID PLC	790,592	10.470	8,277,498.240	
	KINGFISHER PLC	336,026	2.903	975,483.470	
	BAE SYSTEMS PLC	513,661	13.355	6,859,942.650	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	327,352	29.700	9,722,354.400	
	HALMA PLC	62,208	26.000	1,617,408.000	
	NEXT PLC	18,588	104.100	1,935,010.800	
	IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	22.410	2,827,671.390	
	ANGLO AMERICAN PLC	206,873	20.995	4,343,298.630	
	COMPASS GROUP PLC	273,244	24.600	6,721,802.400	
	HSBC HOLDINGS PLC	3,082,693	6.547	20,182,391.070	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	949,467	2.266	2,151,492.220	
	CENTRICA PLC	793,776	1.171	929,511.690	
	UNILEVER PLC	411,663	49.500	20,377,318.500	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,134	10.560	1,215,815.040	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	22.320	1,228,559.760	
	PEARSON PLC	84,159	10.575	889,981.420	
	PERSIMMON PLC	56,989	16.540	942,598.060	
	PRUDENTIAL PLC	474,188	6.150	2,916,256.200	
	RIO TINTO PLC	186,012	47.740	8,880,212.880	
	VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.784	2,808,995.950	

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	114,964	45.850	5,271,099.400	
RELX PLC	305,847	36.400	11,132,830.800	
RENTOKIL INITIAL PLC	418,475	3.758	1,572,629.050	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,353,514	4.958	6,710,722.410	
NATWEST GROUP PLC	1,067,086	3.366	3,591,811.470	
SSE PLC	183,547	19.935	3,659,009.440	
BP PLC	2,765,335	4.061	11,230,025.430	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	10.175	1,548,594.300	
SMITHS GROUP PLC	51,695	18.160	938,781.200	
SPIRAX GROUP PLC	10,751	73.650	791,811.150	
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	7.594	2,753,037.630	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,385,556	0.581	6,034,008.030	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.655	943,123.260	
TESCO PLC	1,122,991	3.706	4,161,804.640	
3I GROUP PLC	161,058	32.390	5,216,668.620	
SMITH & NEPHEW PLC	156,657	11.900	1,864,218.300	
GSK PLC	685,370	16.320	11,185,238.400	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	80,360	105.000	8,437,800.000	
WPP PLC	176,061	7.412	1,304,964.130	
ASTRAZENECA PLC	255,392	120.160	30,687,902.720	
WHITBREAD PLC	31,475	30.630	964,079.250	
INTERTEK GROUP PLC	29,397	50.350	1,480,138.950	
INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	78.500	2,109,609.000	
SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.946	783,067.420	
ADMIRAL GROUP PLC	40,084	28.900	1,158,427.600	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	15,910	48.830	776,885.300	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	34,042	19.530	664,840.260	
EXPERIAN PLC	153,056	37.730	5,774,802.880	
MONDI PLC	67,554	14.025	947,444.850	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,623	11.055	725,462.260	
INFORMA PLC	223,961	8.466	1,896,053.820	
GLENCORE PLC	1,687,455	3.777	6,373,517.530	
ENTAIN PLC	96,924	7.256	703,280.540	
COCA-COLA HBC AG	31,035	28.020	869,600.700	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	5.460	741,620.880	
M&G PLC	454,395	2.074	942,415.230	
ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	18.350	515,176.250	
WISE PLC	96,207	6.300	606,104.100	
JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.543	589,535.550	
HALEON PLC	1,236,138	3.940	4,870,383.720	
SHELL PLC	1,042,388	25.385	26,461,019.380	
AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	8.776	1,256,617.880	
MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	4.672	1,009,731.320	
イギリス・ボンド 小計	44,051,018		315,908,155.570 (58,708,371,631)	

イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	34.970	6,553,517.880	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	33.470	8,002,108.010	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	731.800	2,436,894.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	244,057	19.560	4,773,754.920	
	ICL GROUP LTD	103,067	14.900	1,535,698.300	
	NICE LTD	10,202	614.900	6,273,209.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	136.400	4,016,161.600	
	AZRIELI GROUP	4,672	245.000	1,144,640.000	
イスラエル・シュケル 小計	821,259		34,735,984.510 (1,304,308,430)		
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	40.350	1,142,147.100	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	565,203	32.790	18,533,006.370	
	FORTESCUE LTD	272,505	17.190	4,684,360.950	
	TELSTRA GROUP LTD	843,086	4.010	3,380,774.860	
	ASX LTD	31,215	64.010	1,998,072.150	
	BHP GROUP LTD	829,122	39.550	32,791,775.100	
	AMPOL LTD	31,828	28.930	920,784.040	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	27.730	2,540,733.520	
	CSL LIMITED	80,345	296.690	23,837,558.050	
	REA GROUP LTD	9,317	201.640	1,878,679.880	
	TRANSURBAN GROUP	520,681	13.890	7,232,259.090	
	COCHLEAR LTD	10,446	290.070	3,030,071.220	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	9.550	2,460,958.600	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	278,827	142.990	39,869,472.730	
	RIO TINTO LIMITED	61,394	110.810	6,803,069.140	
	APA GROUP	222,829	7.570	1,686,815.530	
	ARISTOCRAT LEISU	96,033	55.930	5,371,125.690	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	7.750	2,790,635.500	
	PRO MEDICUS LTD	11,011	162.170	1,785,653.870	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	69,336	53.220	3,690,061.920	
	ORICA LTD	91,188	17.640	1,608,556.320	
	BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	20.050	1,535,569.350	
	MACQUARIE GROUP LTD	59,208	228.400	13,523,107.200	
	SUNCORP GROUP LTD	199,628	18.260	3,645,207.280	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	504,627	38.780	19,569,435.060	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	7.030	791,992.770	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	255,447	16.670	4,258,301.490	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	191,685	15.830	3,034,373.550	
	REECE LTD	31,558	27.950	882,046.100	
	SANTOS LTD	582,512	7.000	4,077,584.000	
SONIC HEALTHCARE	88,200	27.190	2,398,158.000		

	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	33.470	1,319,387.400	
	WESFARMERS LTD	184,873	70.580	13,048,336.340	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	319,683	24.100	7,704,360.300	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	203,840	35.120	7,158,860.800	
	SEEK LTD	58,513	22.750	1,331,170.750	
	MINERAL RESOURCES LTD	28,865	38.270	1,104,663.550	
	BRAMBLES LTD	220,767	18.540	4,093,020.180	
	PILBARA MINERALS LTD	404,496	2.880	1,164,948.480	
	CAR GROUP LTD	58,310	36.850	2,148,723.500	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	28,600	41.890	1,198,054.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	11.140	1,502,897.400	
	XERO LTD	23,149	144.400	3,342,715.600	
	LOTTERY CORP LTD	366,780	5.120	1,877,913.600	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.050	1,179,882.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	487,805	31.200	15,219,516.000	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.800	1,568,453.800	
	SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.170	2,164,279.460	
	COLES GROUP LTD	230,734	19.030	4,390,868.020	
	WISETECH GLOBAL LTD	27,325	131.450	3,591,871.250	
	オーストラリア・ドル 小計	11,011,380		296,862,268.860 (28,169,260,692)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	83,530	112.190	9,371,230.700	
	BARRICK GOLD CORP	302,207	27.880	8,425,531.160	
	BANK OF MONTREAL	120,115	117.980	14,171,167.700	
	BANK OF NOVA SCOTIA	197,216	71.530	14,106,860.480	
	NATIONAL BANK OF CANADA	56,424	126.880	7,159,077.120	
	BCE INC	14,197	46.710	663,141.870	
	BROOKFIELD CORP	228,204	68.500	15,631,974.000	
	SAPUTO INC	34,582	29.410	1,017,056.620	
	DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	17,471	135.440	2,366,272.240	
	CGI INC	34,495	157.660	5,438,481.700	
	CCL INDUSTRIES INC	27,743	81.470	2,260,222.210	
	CAE INC	55,407	23.950	1,326,997.650	
	CAMECO CORP	73,563	55.100	4,053,321.300	
	ROGERS COMM-CL B	62,818	55.620	3,493,937.160	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	154,899	83.590	12,948,007.410	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	342,624	43.930	15,051,472.320	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	157.830	1,406,423.130	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	35.890	586,083.700	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	87,929	163.870	14,408,925.230	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,175	61.920	1,311,156.000	
	OPEN TEXT CORP	40,459	43.670	1,766,844.530	
	EMPIRE CO LTD	20,608	39.760	819,374.080	

KINROSS GOLD CORP	192,737	12.860	2,478,597.820
RB GLOBAL INC	31,137	115.660	3,601,305.420
FORTIS INC	82,632	61.990	5,122,357.680
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	117,480	16.770	1,970,139.600
TELUS CORP	31,890	23.030	734,426.700
GREAT WEST LIFE CO INC	43,551	45.520	1,982,441.520
IMPERIAL OIL LTD	32,165	91.050	2,928,623.250
ENBRIDGE INC	361,385	55.960	20,223,104.600
IGM FINANCIAL INC	12,478	39.120	488,139.360
MANULIFE FINANCIAL CORP	283,749	38.440	10,907,311.560
LOBLAW CO LTD	24,803	180.800	4,484,382.400
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	125,335	75.750	9,494,126.250
MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	54.530	2,305,473.870
SUN LIFE FINANCIAL INC	96,171	76.810	7,386,894.510
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,425	1,684.980	5,771,056.500
METRO INC	35,059	86.400	3,029,097.600
EMERA INC	44,643	53.360	2,382,150.480
ONEX CORP	10,157	91.170	926,013.690
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	28.880	1,599,172.240
POWER CORP OF CANADA	89,864	42.350	3,805,740.400
QUEBECOR INC-B	30,598	34.550	1,057,160.900
ROYAL BANK OF CANADA	229,091	167.580	38,391,069.780
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	151,435	118.610	17,961,705.350
STANTEC INC	18,358	107.730	1,977,707.340
SUNCOR ENERGY INC	210,788	49.920	10,522,536.960
LUNDIN MINING CORP	119,660	12.480	1,493,356.800
TECK RESOURCES LTD-CL B	72,863	63.950	4,659,588.850
THOMSON REUTERS CORP	24,837	234.870	5,833,466.190
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	128.970	1,689,120.090
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	289,353	85.490	24,736,787.970
TC ENERGY CORP	164,747	63.550	10,469,671.850
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	124.800	1,011,129.600
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	226.680	2,230,304.520
INTACT FINANCIAL CORP	28,756	254.610	7,321,565.160
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	73,865	84.600	6,248,979.000
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,326	4,355.410	14,486,093.660
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,674	169.790	5,038,348.460
TOURMALINE OIL CORP	59,089	59.110	3,492,750.790
KEYERA CORP	39,997	41.140	1,645,476.580
PARKLAND CORP	24,129	34.510	832,691.790
ALTAGAS LTD	47,249	35.310	1,668,362.190
PEMBINA PIPELINE CORP	94,699	55.320	5,238,748.680

	DOLLARAMA INC	45,462	136.480	6,204,653.760	
	MEG ENERGY CORP	47,181	24.640	1,162,539.840	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	22.360	5,070,510.120	
	ARC RESOURCES LTD	96,301	23.210	2,235,146.210	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	73,200	28.320	2,073,024.000	
	TMX GROUP LTD	46,884	43.700	2,048,830.800	
	BRP INC	4,307	82.190	353,992.330	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	17.840	1,762,948.800	
	NUTRIEN LTD	77,339	63.290	4,894,785.310	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	196.610	2,278,906.510	
	WSP GLOBAL INC	20,394	233.250	4,756,900.500	
	IA FINANCIAL CORP INC	16,448	105.930	1,742,336.640	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	54.590	1,947,061.530	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28,942	41.240	1,193,568.080	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	67,223	61.410	4,128,164.430	
	AIR CANADA	41,858	16.400	686,471.200	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	51,117	94.990	4,855,603.830	
	SHOPIFY INC	201,125	99.980	20,108,477.500	
	FIRSTSERVICE CORP	7,857	245.830	1,931,486.310	
	HYDRO ONE LTD	56,437	47.940	2,705,589.780	
カナダ・ドル 小計		6,715,692		469,551,733.750 (48,626,777,547)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	289,800	4.620	1,338,876.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	5.130	832,086.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	327,981	38.000	12,463,278.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	11.110	1,554,289.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.840	639,402.120	
	KEPPEL LTD	249,600	6.330	1,579,968.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	531,098	15.230	8,088,622.540	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	3.290	4,411,330.700	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.500	1,586,000.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	218,866	32.280	7,064,994.480	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.140	811,690.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.910	1,179,393.900	
シンガポール・ドル 小計		4,929,258		41,549,930.740 (4,511,906,979)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	72.500	1,720,715.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	432,575	86.760	37,530,207.000	
	CIE FINANC RICHEMONT	88,051	118.850	10,464,861.350	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	114,903	264.100	30,345,882.300	
	SCHINDLER HOLDING-PART	7,599	241.600	1,835,918.400	

CERT				
SIKA INHABER	25,179	267.600	6,737,900.400	
SGS SA-REG	22,978	95.600	2,196,696.800	
NOVARTIS AG-REG SHS	324,603	98.410	31,944,181.230	
BALOISE HOLDING AG -R	8,117	169.700	1,377,454.900	
BARRY CALLEBAUT AG	717	1,456.000	1,043,952.000	
CLARIANT AG-REG	45,795	12.370	566,484.150	
SWISSCOM AG-REG	4,457	552.000	2,460,264.000	
ABB LTD	261,937	46.890	12,282,225.930	
ADECCO GROUP AG-REG	26,454	27.080	716,374.320	
GEBERIT AG	6,081	540.200	3,284,956.200	
LONZA GROUP AG-REG	12,043	550.800	6,633,284.400	
LINDT & SPRUENGLI PART	161	10,880.000	1,751,680.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	106,200.000	1,699,200.000	
GIVAUDAN-REG	1,459	4,557.000	6,648,663.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	23,540	512.000	12,052,480.000	
ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	283.800	1,365,078.000	
HOLCIM LTD	86,530	81.360	7,040,080.800	
TEMENOS GROUP	10,930	59.600	651,428.000	
BACHEM HOLDING AG	4,673	75.350	352,110.550	
SONOVA HOLDING AG	8,100	303.500	2,458,350.000	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,251	246.800	2,036,346.800	
STRAUMANN HOLDING AG	19,254	123.050	2,369,204.700	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	153.850	661,555.000	
THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	30.500	282,399.500	
HELVETIA HOLDING AG	4,906	137.100	672,612.600	
SCHINDLER NAMEN	4,209	233.000	980,697.000	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	699.800	3,151,199.400	
BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	89.150	437,102.450	
EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	685.500	853,447.500	
SWISS PRIME SITE AG	13,356	96.650	1,290,857.400	
AVOLTA AG	12,933	32.580	421,357.140	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,730	1,192.000	4,446,160.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	47.100	1,512,569.400	
SWISS RE LTD	49,210	116.150	5,715,741.500	
BKW AG	3,194	154.000	491,876.000	
SIG GROUP AG	50,969	16.530	842,517.570	
ALCON INC	82,167	83.340	6,847,797.780	
SANDOZ GROUP AG	65,523	34.580	2,265,785.340	
GALDERMA GROUP AG	9,843	79.640	783,896.520	
UBS GROUP AG	529,700	25.070	13,279,579.000	
VAT GROUP AG	4,131	402.500	1,662,727.500	
スイス・フラン 小計	2,463,142		236,165,858.830 (39,338,147,105)	
スウェーデン・ クローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	456,651	178.600	81,557,868.600	
ATLAS COPCO AB-B SHS	237,988	157.500	37,483,110.000	
ERICSSON LM-B SHS	465,668	75.300	35,064,800.400	

GETINGE AB-B SHS	38,925	223.000	8,680,275.000	
LUNDBERGS B	14,872	564.500	8,395,244.000	
SKF AB-B SHS	66,600	186.700	12,434,220.000	
SANDVIK AB	169,218	206.300	34,909,673.400	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	250,203	156.800	39,231,830.400	
SKANSKA AB-B SHS	70,728	205.900	14,562,895.200	
SWEDBANK AB	132,581	217.000	28,770,077.000	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,795	143.800	13,343,921.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	104.300	22,825,637.800	
TRELLEBORG AB-B SHS	37,154	389.400	14,467,767.600	
VOLVO AB-A SHS	24,198	257.800	6,238,244.400	
VOLVO AB-B SHS	263,434	254.300	66,991,266.200	
HOLMEN AB-B SHS	19,972	425.200	8,492,094.400	
TELE2 AB-B SHS	100,027	118.250	11,828,192.750	
INDUSTRIVARDEN A	15,292	358.400	5,480,652.800	
INDUSTRIVARDEN C	31,300	356.000	11,142,800.000	
SAAB AB-B	47,156	233.000	10,987,348.000	
SECURITAS AB-B SHS	76,085	120.950	9,202,480.750	
INVESTOR AB-B SHS	271,548	303.750	82,482,705.000	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	170.600	17,856,531.400	
ASSA ABLOY AB-B	172,830	329.100	56,878,353.000	
TELIA CO AB	344,810	33.190	11,444,243.900	
BOLIDEN AB	53,939	294.300	15,874,247.700	
ALFA LAVAL AB	44,407	462.200	20,524,915.400	
FASTIGHETS AB BALDER	117,966	85.920	10,135,638.720	
INDUTRADE AB	39,178	305.400	11,964,961.200	
HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	65.600	3,133,646.400	
NIBE INDUSTRIER AB	212,832	46.710	9,941,382.720	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	332.000	12,078,492.000	
HEXAGON AB-B SHS	333,533	99.200	33,086,473.600	
SAGAX AB	44,607	269.400	12,017,125.800	
EPIROC AB-A	103,115	193.800	19,983,687.000	
EPIROC AB-B	61,487	172.600	10,612,656.200	
ESSITY AB-B	99,980	324.300	32,423,514.000	
EQT AB	55,194	353.900	19,533,156.600	
ADDTECH AB	47,848	311.400	14,899,867.200	
VOLVO CAR AB	143,747	24.490	3,520,364.030	
BEIJER REF AB	50,493	173.050	8,737,813.650	
LIFCO AB	39,631	331.000	13,117,861.000	
EVOLUTION AB	28,266	1,001.000	28,294,266.000	
INVESTMENT AB LATOUR	27,638	319.500	8,830,341.000	
スウェーデン・クローナ 小計	5,311,561		939,462,643.220 (12,983,373,729)	
デンマーク・ク ローネ				
CARLSBERG AS-B	15,167	794.200	12,045,631.400	
A P MOLLER A/S	663	10,110.000	6,702,930.000	

	AP MOLLER MAERSK A	543	9,825.000	5,334,975.000	
	DANSKE BANK A/S	113,672	205.600	23,370,963.200	
	GENMAB A/S	11,219	1,776.500	19,930,553.500	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	59,656	467.800	27,907,076.800	
	ROCKWOOL AS	1,677	2,934.000	4,920,318.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	531,207	922.100	489,825,974.700	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	169,829	159.150	27,028,285.350	
	COLOPLAST-B	21,291	942.000	20,056,122.000	
	DSV A/S	28,190	1,371.500	38,662,585.000	
	DEMANT A/S	17,700	282.200	4,994,940.000	
	TRYG A/S	58,222	158.000	9,199,076.000	
	ZEALAND PHARMA A/S	11,566	915.000	10,582,890.000	
	PANDORA A/S	12,473	1,190.500	14,849,106.500	
	ORSTED A/S	31,744	442.500	14,046,720.000	
デンマーク・クローネ 小計		1,084,819		729,458,147.450 (15,304,031,934)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	229,726	7.540	1,732,134.040	
	FISHER & PAYKEL	95,209	38.400	3,656,025.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	3.360	1,050,749.280	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.950	373,862.300	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	6.140	1,469,351.120	
ニュージーランド・ドル 小計		939,800		8,282,122.340 (721,124,392)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	187.000	13,673,066.000	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	62.020	13,717,707.640	
	TELENOR ASA	86,976	135.600	11,793,945.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	14,874	1,101.000	16,376,274.000	
	ORKLA ASA	116,068	99.500	11,548,766.000	
	EQUINOR ASA	141,333	267.900	37,863,110.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	308.800	9,083,043.200	
	AKER BP ASA	55,995	229.800	12,867,651.000	
	SALMAR ASA	12,897	548.500	7,074,004.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	194.700	5,007,878.700	
	DNB BANK ASA	143,909	214.800	30,911,653.200	
ノルウェー・クローネ 小計		921,487		169,917,100.540 (2,256,499,095)	
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	25,025	92.950	2,326,073.750	
	KINGSPAN GROUP PLC	24,704	79.850	1,972,614.400	
	AIR LIQUIDE	93,549	169.520	15,858,426.480	
	AIRBUS SE	96,341	129.420	12,468,452.220	
	AXA SA	290,876	36.190	10,526,802.440	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	107,926	30.120	3,250,731.120	
	ADIDAS AG	25,992	219.300	5,700,045.600	
	GENERALI	159,200	25.980	4,136,016.000	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	190.800	595,296.000	
	DANONE	112,535	65.300	7,348,535.500	
	SAFRAN SA	55,863	203.300	11,356,947.900	

INTESA SANPAOLO	2, 332, 761	3. 739	8, 722, 193. 370	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	53, 290	72. 520	3, 864, 590. 800	
ACCOR SA	31, 427	38. 350	1, 205, 225. 450	
BOUYGUES	29, 123	32. 040	933, 100. 920	
BNP PARIBAS	169, 516	63. 290	10, 728, 667. 640	
THALES SA	15, 023	147. 650	2, 218, 145. 950	
CAPGEMINI SA	25, 063	190. 150	4, 765, 729. 450	
LOTUS BAKERIES NV	77	12, 120. 000	933, 240. 000	
UNICREDIT SPA	248, 386	37. 100	9, 215, 120. 600	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12, 403	111. 250	1, 379, 833. 750	
D' IETEREN TRDG	4, 146	197. 800	820, 078. 800	
COMMERZBANK AG	179, 069	15. 595	2, 792, 581. 050	
EIFFAGE	12, 706	92. 260	1, 172, 255. 560	
FRESENIUS SE & CO KGAA	68, 521	34. 040	2, 332, 454. 840	
PUBLICIS GROUPE	36, 027	96. 700	3, 483, 810. 900	
IBERDROLA SA	987, 192	13. 520	13, 346, 835. 840	
ENI SPA	382, 505	14. 114	5, 398, 675. 570	
JERONIMO MARTINS	45, 606	16. 760	764, 356. 560	
KESKO OYJ-B	56, 685	18. 115	1, 026, 848. 770	
KBC GROUPE	40, 769	68. 940	2, 810, 614. 860	
HANNOVER RUECK SE	9, 638	256. 200	2, 469, 255. 600	
WARTSILA OYJ	77, 148	18. 700	1, 442, 667. 600	
L' OREAL	39, 449	365. 900	14, 434, 389. 100	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	45, 009	603. 600	27, 167, 432. 400	
GEA GROUP AG	25, 513	42. 080	1, 073, 587. 040	
BOLLORE	114, 808	5. 905	677, 941. 240	
MEDIOBANCA SPA	86, 792	14. 950	1, 297, 540. 400	
MICHELIN (CGDE) -B	109, 281	36. 230	3, 959, 250. 630	
CONTINENTAL AG	17, 635	53. 280	939, 592. 800	
DEUTSCHE POST AG-REG	164, 447	39. 620	6, 515, 390. 140	
OMV AG	23, 354	36. 340	848, 684. 360	
VERBUND AG	10, 663	73. 450	783, 197. 350	
PERNOD-RICARD	33, 037	126. 300	4, 172, 573. 100	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23, 311	39. 770	927, 078. 470	
RENAULT SA	27, 902	38. 770	1, 081, 760. 540	
REPSOL SA	195, 049	11. 735	2, 288, 900. 010	
MERCK KGAA	20, 216	166. 050	3, 356, 866. 800	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	76, 705	78. 660	6, 033, 615. 300	
RWE AG	98, 751	32. 670	3, 226, 195. 170	
SEB SA	2, 596	93. 000	241, 428. 000	
SOCIETE GENERALE-A	116, 635	22. 275	2, 598, 044. 620	
VINCI S. A.	82, 885	109. 600	9, 084, 196. 000	
SODEXO	12, 910	78. 200	1, 009, 562. 000	
SOFINA	2, 281	252. 400	575, 724. 400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	91, 287	227. 150	20, 735, 842. 050	

VIVENDI SE	135,782	10.100	1,371,398.200
SAP SE	172,672	200.150	34,560,300.800
TELEFONICA S. A	755,720	4.307	3,254,886.040
TOTALENERGIES SE	349,989	61.220	21,426,326.580
E. ON SE	374,168	13.655	5,109,264.040
VOEST-ALPINE AG	18,032	20.680	372,901.760
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	72.900	1,303,889.400
SIEMENS AG-REG	124,123	162.900	20,219,636.700
UPM-KYMMENE OYJ	86,201	29.110	2,509,311.110
ING GROEP NV-CVA	531,085	16.298	8,655,623.330
PUMA AG	17,210	38.380	660,519.800
BAYER AG	157,617	26.710	4,209,950.070
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	11.005	1,056,259.900
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	29,704	80.500	2,391,172.000
MERCEDES-BENZ GROUP AG	129,331	56.540	7,312,374.740
BASF SE	143,233	43.555	6,238,513.310
BEIERSDORF AG	15,743	126.950	1,998,573.850
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	93.760	2,023,903.360
PRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	37.260	1,253,128.320
ASM INTERNATIONAL NV	7,821	567.600	4,439,199.600
ORANGE	286,957	10.905	3,129,266.080
SAMPO OYJ-A SHS	70,999	41.980	2,980,538.020
RANDSTAD NV	15,584	42.600	663,878.400
ALLIANZ SE	64,162	287.500	18,446,575.000
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	4.103	2,073,824.420
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	30.990	4,545,210.330
HERMES INTL	5,272	1,896.000	9,995,712.000
ENDESA S. A.	50,946	19.835	1,010,513.910
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	5.886	639,496.240
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	47.740	2,700,842.760
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	22,488	485.900	10,926,919.200
ARCELOR MITTAL (NL)	98,225	20.510	2,014,594.750
DASSAULT SYSTEMES SA	111,221	35.500	3,948,345.500
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	41.000	1,428,276.000
RHEINMETALL STAMM	7,339	518.200	3,803,069.800
HEINEKEN NV	47,066	81.960	3,857,529.360
AKZO NOBEL	26,032	57.440	1,495,278.080
ASML HOLDING NV	65,838	719.900	47,396,776.200
AEGON LTD	232,433	5.434	1,263,040.920
VOLKSWAGEN AG PFD	33,164	91.080	3,020,577.120
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	950,968	9.322	8,864,923.690
KERING	12,764	225.550	2,878,920.200
ACCIONA S. A.	5,005	129.900	650,149.500
FORTUM OYJ	73,699	14.030	1,033,996.970

AGEAS	24,086	47.360	1,140,712.960	
UCB SA	20,020	164.450	3,292,289.000	
NEMETSCHEK SE	10,222	88.050	900,047.100	
CARREFOUR SA	90,642	15.345	1,390,901.490	
NOKIA OYJ	827,068	3.797	3,140,377.190	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	125,932	27.700	3,488,316.400	
WOLTERS KLUWER-CVA	41,015	157.650	6,466,014.750	
SANOFI	185,839	103.320	19,200,885.480	
STMICROELECTRONICS NV	110,999	24.890	2,762,765.110	
ELISA OYJ	20,242	46.920	949,754.640	
BANCO SANTANDER SA	2,590,110	4.440	11,500,088.400	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	17.390	1,140,592.710	
QIAGEN N.V.	34,544	41.755	1,442,384.720	
DEUTSCHE BANK AG-REG	308,007	14.598	4,496,286.180	
BMW VORZUG	7,821	68.850	538,475.850	
ENEL SPA	1,353,187	7.132	9,650,929.680	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	578,390	26.910	15,564,474.900	
SARTORIUS AG	4,533	240.000	1,087,920.000	
LEONARDO SPA	64,915	20.780	1,348,933.700	
CTS EVENTIM AG	11,578	85.750	992,813.500	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	219,873	29.050	6,387,310.650	
RATIONAL AG	860	879.000	755,940.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	7,150	57.000	407,550.000	
BECHTLE AG	14,521	36.900	535,824.900	
KONINKLIJKE KPN NV	600,608	3.731	2,240,868.440	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	52.400	1,207,191.200	
TELEPERFORMANCE	9,581	99.800	956,183.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	32,080	208.200	6,679,056.000	
EURAZEO	5,673	72.200	409,590.600	
BANCO SABADELL	905,307	1.891	1,711,935.530	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	68.800	888,758.400	
HEINEKEN HOLDING NV-A	18,337	68.400	1,254,250.800	
INDITEX	175,294	50.380	8,831,311.720	
ESSILORLUXOTTICA	48,453	208.100	10,083,069.300	
SNAM SPA	317,518	4.601	1,460,900.310	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	14.260	2,380,293.460	
TENARIS SA	76,002	12.820	974,345.640	
TELECOM ITALIA SPA	1,970,516	0.249	490,658.480	
TERNA SPA	207,655	8.144	1,691,142.320	
BIOMERIEUX	5,003	108.500	542,825.500	
GRIFOLS SA	53,226	10.100	537,582.600	
NESTE OYJ	66,248	16.265	1,077,523.720	
RECORDATI SPA	18,197	50.550	919,858.350	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	7.602	638,111.880	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	276.400	2,402,468.800	
KONE OYJ	54,590	49.820	2,719,673.800	
ELIA GROUP	4,078	105.800	431,452.400	

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,801	182.400	875,702.400
ENGIE	302,123	15.970	4,824,904.310
ALSTOM	70,027	17.250	1,207,965.750
IPSEN SA	5,964	109.700	654,250.800
ARKEMA SA	10,489	79.100	829,679.900
LEGRAND SA	45,141	102.500	4,626,952.500
AMPLIFON SPA	20,249	27.270	552,190.230
ADP	6,104	115.500	705,012.000
ORION OYJ	22,095	47.090	1,040,453.550
METSO CORPORATION	102,831	8.448	868,716.280
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	17.030	1,355,332.550
SYMRISE AG	22,612	120.600	2,727,007.200
REXEL SA	33,916	25.050	849,595.800
PRYSMIAN SPA	45,653	61.520	2,808,572.560
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	103.600	251,644.400
CAIXABANK	569,844	5.430	3,094,252.920
BUREAU VERITAS SA	54,064	29.980	1,620,838.720
GETLINK	65,097	16.175	1,052,943.970
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	15.760	625,482.880
AMADEUS IT GROUP SA	75,491	63.720	4,810,286.520
BRENTAG SE	21,559	63.660	1,372,445.940
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	20.040	858,433.440
EDENRED	42,160	35.570	1,499,631.200
TALANX AG	10,349	76.550	792,215.950
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	93.560	1,114,767.400
VONOVIA SE	120,979	33.200	4,016,502.800
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	9.790	1,607,087.240
KNORR-BREMSE AG	10,342	74.350	768,927.700
OCI NV	19,612	26.850	526,582.200
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	49.410	2,221,572.420
FERRARI NV	20,905	416.800	8,713,204.000
ASR NEDERLAND NV	27,365	43.460	1,189,282.900
AIB GROUP PLC	293,677	5.325	1,563,830.020
NORDEA BANK ABP	541,540	10.375	5,618,477.500
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	38.160	659,900.880
MONCLER SPA	33,422	50.760	1,696,500.720
NEXI SPA	83,576	6.076	507,807.770
PROSUS NV	232,662	32.250	7,503,349.500
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	67.380	1,237,837.980
JDE PEET'S BV	14,385	20.440	294,029.400
EXOR NV	16,552	97.650	1,616,302.800
SIEMENS ENERGY AG	100,301	29.110	2,919,762.110
INPOST SA	36,721	17.080	627,194.680
EURONEXT NV	14,077	100.600	1,416,146.200
IMCD NV	9,332	156.000	1,455,792.000
NN GROUP NV	43,478	44.690	1,943,031.820
FINECOBANK SPA	96,393	15.080	1,453,606.440

	ARGENX SE	9,669	485.500	4,694,299.500	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	141,064	23.390	3,299,486.960	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	83,468	31.060	2,592,516.080	
	DSM-FIRMENICH AG	32,472	120.400	3,909,628.800	
	SYENQO SA	11,217	71.730	804,595.410	
	ZALANDO SE	31,321	24.000	751,704.000	
	STELLANTIS NV	363,425	13.590	4,938,945.750	
	FERROVIAL SE	84,753	37.780	3,201,968.340	
	AENA SME SA	11,603	191.800	2,225,455.400	
	CELLNEX TELECOM SAU	84,967	36.700	3,118,288.900	
	BANCO BPM SPA	202,727	5.974	1,211,091.090	
	ABN AMRO BANK NV	75,982	16.210	1,231,668.220	
	SCOUT24 SE	10,048	73.700	740,537.600	
	COVESTRO AG	27,558	55.620	1,532,775.960	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	143,260	58.120	8,326,271.200	
	POSTE ITALIANE SPA	88,762	12.675	1,125,058.350	
	AMUNDI SA	11,288	67.350	760,246.800	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	44,691	11.070	494,729.370	
	ADYEN NV	3,621	1,284.600	4,651,536.600	
	DELIVERY HERO SE	34,547	27.830	961,443.010	
	ユーロ 小計	30,227,154		829,789,302.520 (129,903,515,310)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	281,796	70.400	19,838,438.400	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	57.050	5,323,563.700	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	192,391	221.200	42,556,889.200	
	MTR CORP	338,941	26.950	9,134,459.950	
	HANG SENG BANK LTD	122,096	90.150	11,006,954.400	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	23.800	7,091,733.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	54.150	11,524,203.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	19.200	3,878,400.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,947,406	6.310	12,288,131.860	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	28.350	9,551,228.400	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	23.450	15,957,607.750	
	SINO LAND CO	659,200	8.040	5,299,968.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	248,565	79.000	19,636,635.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	62.250	3,300,495.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	108.900	23,430,488.400	
	AIA GROUP LTD	1,813,316	54.750	99,279,051.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	10.120	8,067,016.320	
	SANDS CHINA LTD	335,800	14.000	4,701,200.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	18.800	2,632,000.000	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	21.950	5,622,163.250	
	WH GROUP LTD	1,550,000	5.880	9,114,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	427,945	41.900	17,930,895.500	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	30.800	8,198,806.000	
香港・ドル	小計	11,468,603		355,364,328.730 (6,417,879,777)	
合計		180,083,694		1,460,565,147,522 (1,460,565,147,522)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年9月17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	1,241,396.730	
		GOODMAN GROUP	271,455.000	9,671,941.650	
		GPT GROUP	349,447.000	1,771,696.290	
		MIRVAC GROUP	700,332.000	1,575,747.000	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	3,054,179.800	
		STOCKLAND	369,843.000	1,949,072.610	
	VICINITY CENTRES	545,645.000	1,271,352.850		
	オーストラリア・ドル	小計	3,226,165.000	20,535,386.930 (1,948,602,866)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,708,291.270		
	CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,796,569.320		
シンガポール・ドル	小計	1,398,309.000	3,504,860.590 (380,592,811)		
投資信託受益証券 合計			4,624,474	2,329,195,677 (2,329,195,677)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,674.000	3,451,224.540	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	2,088,245.250	
		AMERICAN TOWER CORP	77,402.000	18,601,248.640	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,671,638.920	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,527.000	5,478,497.220	
		BXP INC	24,473.000	1,994,549.500	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	2,105,195.430	
		CROWN CASTLE INC	72,473.000	8,714,878.250	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	54,719.000	8,802,645.530	
		EQUINIX INC	15,799.000	13,848,929.430	
		EQUITY LIFESTYLE	27,290.000	2,055,209.900	

	PROPERTIES			
	EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	4,207,668.080	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	3,117,778.950	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	34,180.000	6,071,393.400	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	41,252.000	2,130,665.800	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	117,820.000	2,640,346.200	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	1,927,845.900	
	INVITATION HOMES INC	96,467.000	3,547,091.590	
	IRON MOUNTAIN INC	48,519.000	5,734,460.610	
	KIMCO REALTY	111,968.000	2,693,950.080	
	MID AMERICA	20,193.000	3,365,163.450	
	PROLOGIS INC	153,817.000	19,885,461.760	
	PUBLIC STORAGE	26,190.000	9,506,708.100	
	REALTY INCOME CORP	142,885.000	8,956,031.800	
	REGENCY CENTERS CORP	27,176.000	2,031,949.520	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	18,280.000	4,480,245.200	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	53,666.000	8,849,523.400	
	SUN COMMUNITIES INC	21,879.000	3,192,364.890	
	UDR INC	50,449.000	2,369,589.530	
	VENTAS INC	68,228.000	4,414,351.600	
	VICI PROPERTIES INC	164,307.000	5,593,010.280	
	WELLTOWER INC	100,158.000	12,938,410.440	
	WEYERHAEUSER CO	114,764.000	3,730,977.640	
	WP CAREY INC	32,996.000	2,110,424.160	
	アメリカ・ドル 小計	2,091,022.000	192,307,674.990 (27,071,151,410)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	818,472.020	
	SEGRO PLC	207,676.000	1,878,221.740	
	イギリス・ポンド 小計	329,021.000	2,696,693.760 (501,153,568)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	24,471.000	1,378,206.720	
	カナダ・ドル 小計	24,471.000	1,378,206.720 (142,727,088)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	277,870.100	
	GECINA SA	8,697.000	932,318.400	
	KLEPIERRE	36,407.000	1,062,356.260	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	18,477.000	1,431,967.500	
	WAREHOUSES DE PAUW	31,043.000	768,003.820	
	ユーロ 小計	99,690.000	4,472,516.080 (700,172,392)	
香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	15,666,431.200	
	香港・ドル 小計	410,116.000	15,666,431.200 (282,935,747)	
投資証券 合計		2,954,320	28,698,140,205 (28,698,140,205)	

合計		31,027,335,882 (31,027,335,882)
----	--	------------------------------------

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額 に対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 572銘柄	73.02	—	—	—	76.39
	投資証券 34銘柄	—	—	—	1.78	
イギリス・ポンド	株式 75銘柄	3.85	—	—	—	3.97
	投資証券 2銘柄	—	—	—	0.03	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.09	—	—	—	0.09
オーストラリア・ドル	株式 50銘柄	1.85	—	—	—	2.02
	投資信託受益証券 7銘柄	—	—	0.13	—	
カナダ・ドル	株式 84銘柄	3.19	—	—	—	3.27
	新株予約権証券 1銘柄	—	0.00	—	—	
	投資証券 1銘柄	—	—	—	0.01	
シンガポール・ドル	株式 12銘柄	0.30	—	—	—	0.33
	投資信託受益証券 2銘柄	—	—	0.02	—	
スイス・フラン	株式 46銘柄	2.58	—	—	—	2.64
スウェーデン・クローナ	株式 44銘柄	0.85	—	—	—	0.87
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	1.00	—	—	—	1.03
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.05	—	—	—	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.15	—	—	—	0.15
ユーロ	株式 214銘柄	8.53	—	—	—	8.76
	投資証券 5銘柄	—	—	—	0.05	
香港・ドル	株式 23銘柄	0.42	—	—	—	0.45
	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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年9月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,056,254,776
国債証券	460,849,624,400
地方債証券	26,448,950,407
特殊債券	26,214,791,068
社債券	21,843,018,800
未収利息	1,068,297,209
前払費用	403,084,074
流動資産合計	538,884,020,734
資産合計	538,884,020,734
負債の部	
流動負債	
未払解約金	198,744,000
流動負債合計	198,744,000
負債合計	198,744,000
純資産の部	
元本等	
元本	439,336,848,356
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	99,348,428,378
元本等合計	538,685,276,734
純資産合計	538,685,276,734
負債純資産合計	538,884,020,734

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9月20日 至 2024年9月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年9月17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	456,657,713,948円
同期中追加設定元本額	680,951,293,916円
同期中一部解約元本額	698,272,159,508円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	31,192,983,039円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	49,680,795円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	91,497,323円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	51,017,965円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	661,076,252円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	277,464,096円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	31,567,666円
たわらノーロード 国内債券	20,156,941,650円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	7,253,790,900円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,696,610,234円
たわらノーロード バランス（標準型）	3,594,966,496円
たわらノーロード バランス（積極型）	531,698,968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）	218,673,228円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	2,492,425,931円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	3,005,889,973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）	922,928,937円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	49,744,766円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	22,588,606円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	195,434,863円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	7,716,525円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	16,586円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	16,586円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,672,194,388円
O n e グローバルバランス	218,170,191円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	11,710,618,795円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	17,701,963,265円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	8,107,607,908円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,484,856,843円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,819,837,860円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	542,208,832円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	93,375,152円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,507,090,002円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,436,914円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	5,764,106,353円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,607,347,676円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	569,216,433円
投資のソムリエ	82,611,089,412円
クルーズコントロール	154,132,975円
投資のソムリエ<DC年金>	9,611,100,862円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	8,335,169,041円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,974,976,967円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	11,203,834,071円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	32,179,317,232円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	742,788,275円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	388,323,683円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	108,351,732円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,161,202,369円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,935,792,637円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,125,563,365円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,655,166,203円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	851,309,526円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	419,674,244円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	255,590,842円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,316,792,663円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	67,268,133円
O n e グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	179,154,145円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	492,692円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,187,773,562円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,192,751,669円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,175,862,198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)	718,198,433円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,172,603,514円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	3,031,372,081円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	2,036,575,469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)	827,978,363円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	2,067,363,068円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	1,965,767,302円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,903,644,788円
O n e コアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,068,557,042円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,433,810,475円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	200,375,503円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	262,940,369円
O n e 収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	4,064,184,282円

One 収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ (適格機関投資家限定)	4,050,598,427円
One 収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ (適格機関投資家限定)	3,998,262,930円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	1,981,293,599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)	48,410,391円
AMOne コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	817,696,087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)	147,957,589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)	91,273,758円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	22,328,088円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	54,294,829円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	28,367,713円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	405,565円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,047,918円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	8,845,236円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,393,686,942円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,094,353,586円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,334,791,022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)	50,778,894円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	125,271,351円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,403,484,167円
DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	94,073,813円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	599,171円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	1,129,880,421円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	27,145,963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)	200,282,606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)	263,722,491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)	747,080,222円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	201,712,558円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	55,027,002円
コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	387,569,601円
動的パッケージファンド<DC年金>	222,734,677円
コア資産形成ファンド	103,990,089円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	13,055,168,994円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	24,821,940,976円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	22,359,429,226円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	114,425,239円
計	439,336,848,356円
2. 受益権の総数	439,336,848,356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9月20日
----	--------------

	至 2024年9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年9月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月17日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	△1,432,388,200
地方債証券	△132,270,550
特殊債証券	△242,178,792
社債証券	△79,813,000
合計	△1,886,650,542

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年2月15日から2024年9月17日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年9月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2261円 (12,261円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年9月17日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 5 3回 利付国庫債券 (2年)	3,000,000,000	2,992,560,000	
	4 5 5回 利付国庫債券 (2年)	2,900,000,000	2,890,082,000	
	4 5 6回 利付国庫債券 (2年)	2,000,000,000	1,994,600,000	
	4 5 7回 利付国庫債券 (2年)	3,200,000,000	3,190,144,000	
	4 5 9回 利付国庫債券 (2年)	2,000,000,000	1,995,560,000	
	4 6 0回 利付国庫債券 (2年)	2,500,000,000	2,497,775,000	
	4 6 3回 利付国庫債券 (2年)	700,000,000	700,322,000	
	1 4 6回 利付国庫債券 (5年)	4,700,000,000	4,688,203,000	
	1 4 7回 利付国庫債券 (5年)	3,350,000,000	3,333,216,500	
	1 4 8回 利付国庫債券 (5年)	2,000,000,000	1,987,440,000	
	1 4 9回 利付国庫債券 (5年)	3,180,000,000	3,156,881,400	
	1 5 0回 利付国庫債券 (5年)	12,370,000,000	12,267,576,400	
	1 5 1回 利付国庫債券 (5年)	1,600,000,000	1,585,120,000	
	1 5 2回 利付国庫債券 (5年)	1,790,000,000	1,777,577,400	
	1 5 3回 利付国庫債券 (5年)	5,210,000,000	5,156,024,400	
	1 5 4回 利付国庫債券 (5年)	4,000,000,000	3,965,520,000	
	1 5 5回 利付国庫債券 (5年)	2,700,000,000	2,691,738,000	
	1 5 6回 利付国庫債券 (5年)	2,300,000,000	2,285,579,000	

年)			
1 5 7回 利付国庫債券 (5年)	300,000,000	297,927,000	
1 5 8回 利付国庫債券 (5年)	2,500,000,000	2,474,100,000	
1 5 9回 利付国庫債券 (5年)	1,000,000,000	988,540,000	
1 6 0回 利付国庫債券 (5年)	1,600,000,000	1,587,568,000	
1 6 1回 利付国庫債券 (5年)	600,000,000	597,558,000	
1 6 2回 利付国庫債券 (5年)	1,600,000,000	1,592,112,000	
1 6 3回 利付国庫債券 (5年)	3,650,000,000	3,646,386,500	
1 6 4回 利付国庫債券 (5年)	1,500,000,000	1,484,955,000	
1 6 5回 利付国庫債券 (5年)	1,000,000,000	994,150,000	
1 6 6回 利付国庫債券 (5年)	500,000,000	499,160,000	
1 6 7回 利付国庫債券 (5年)	1,600,000,000	1,595,408,000	
1 6 8回 利付国庫債券 (5年)	400,000,000	402,380,000	
1 6 9回 利付国庫債券 (5年)	1,000,000,000	1,001,540,000	
1 7 0回 利付国庫債券 (5年)	3,700,000,000	3,719,758,000	
1 7 1回 利付国庫債券 (5年)	2,200,000,000	2,191,310,000	
1回 利付国庫債券 (40年)	110,000,000	122,211,100	
2回 利付国庫債券 (40年)	330,000,000	351,842,700	
3回 利付国庫債券 (40年)	540,000,000	572,248,800	
4回 利付国庫債券 (40年)	720,000,000	758,736,000	
5回 利付国庫債券 (40年)	710,000,000	714,430,400	
6回 利付国庫債券 (40年)	940,000,000	921,256,400	
7回 利付国庫債券 (40年)	1,030,000,000	959,311,100	
8回 利付国庫債券 (40年)	990,000,000	849,311,100	
9回 利付国庫債券 (40年)	1,480,000,000	916,919,200	
10回 利付国庫債券 (40年)	1,730,000,000	1,256,170,300	

1 1回 利付国庫債券（4 0年）	1,380,000,000	955,760,400	
1 2回 利付国庫債券（4 0年）	1,420,000,000	865,064,000	
1 3回 利付国庫債券（4 0年）	1,720,000,000	1,025,722,000	
1 4回 利付国庫債券（4 0年）	2,320,000,000	1,471,042,400	
1 5回 利付国庫債券（4 0年）	2,570,000,000	1,794,322,600	
1 6回 利付国庫債券（4 0年）	1,640,000,000	1,252,681,200	
1 7回 利付国庫債券（4 0年）	600,000,000	593,100,000	
1回 CT利付国庫債券（1 0年）	1,700,000,000	1,690,446,000	
2回 CT利付国庫債券（1 0年）	1,500,000,000	1,526,490,000	
3 4 1回 利付国庫債券（1 0年）	3,620,000,000	3,620,000,000	
3 4 2回 利付国庫債券（1 0年）	3,520,000,000	3,507,363,200	
3 4 3回 利付国庫債券（1 0年）	3,090,000,000	3,075,724,200	
3 4 4回 利付国庫債券（1 0年）	3,570,000,000	3,550,793,400	
3 4 5回 利付国庫債券（1 0年）	5,060,000,000	5,028,881,000	
3 4 6回 利付国庫債券（1 0年）	4,540,000,000	4,508,492,400	
3 4 7回 利付国庫債券（1 0年）	4,500,000,000	4,465,035,000	
3 4 8回 利付国庫債券（1 0年）	3,770,000,000	3,737,502,600	
3 4 9回 利付国庫債券（1 0年）	8,350,000,000	8,270,842,000	
3 5 0回 利付国庫債券（1 0年）	9,600,000,000	9,500,544,000	
3 5 1回 利付国庫債券（1 0年）	3,400,000,000	3,361,036,000	
3 5 2回 利付国庫債券（1 0年）	3,370,000,000	3,326,864,000	
3 5 3回 利付国庫債券（1 0年）	3,690,000,000	3,637,565,100	
3 5 4回 利付国庫債券（1 0年）	2,460,000,000	2,420,394,000	
3 5 5回 利付国庫債券（1 0年）	3,730,000,000	3,664,948,800	
3 5 6回 利付国庫債券（1 0年）	3,400,000,000	3,336,012,000	
3 5 7回 利付国庫債券（1 0年）	5,200,000,000	5,096,104,000	

0年)			
358回 利付国庫債券(10年)	5,950,000,000	5,825,645,000	
359回 利付国庫債券(10年)	4,150,000,000	4,058,285,000	
360回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,004,347,000	
361回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	3,998,074,000	
362回 利付国庫債券(10年)	4,210,000,000	4,097,508,800	
363回 利付国庫債券(10年)	3,970,000,000	3,856,180,100	
364回 利付国庫債券(10年)	4,410,000,000	4,273,245,900	
365回 利付国庫債券(10年)	3,530,000,000	3,412,027,400	
366回 利付国庫債券(10年)	4,240,000,000	4,119,711,200	
367回 利付国庫債券(10年)	5,470,000,000	5,299,992,400	
368回 利付国庫債券(10年)	5,950,000,000	5,748,414,000	
369回 利付国庫債券(10年)	3,120,000,000	3,079,689,600	
370回 利付国庫債券(10年)	6,250,000,000	6,154,625,000	
371回 利付国庫債券(10年)	5,700,000,000	5,549,748,000	
372回 利付国庫債券(10年)	5,400,000,000	5,427,324,000	
373回 利付国庫債券(10年)	4,850,000,000	4,776,668,000	
374回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,500,000,000	
375回 利付国庫債券(10年)	3,380,000,000	3,463,891,600	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	122,593,900	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	110,238,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	229,152,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	225,764,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	270,955,000	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	257,167,600	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	166,441,500	

14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	389,755,600	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	300,531,400	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	277,538,400	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	309,765,600	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	455,036,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	318,743,600	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	382,677,900	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	352,910,200	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	336,429,000	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	406,283,500	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	375,602,700	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	712,491,600	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	719,572,000	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	893,569,600	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	985,508,400	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	995,869,600	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	802,872,000	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,093,025,100	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,276,748,200	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,329,564,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,140,305,600	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,470,037,400	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,435,085,600	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	879,920,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,269,677,200	
40回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,061,559,200	

年)			
4 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,060,000,000	1,074,013,200	
4 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,000,000,000	1,011,100,000	
4 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	710,000,000	715,814,900	
4 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,130,000,000	1,137,638,800	
4 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,150,000,000	1,116,178,500	
4 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,190,000,000	1,152,062,800	
4 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,340,000,000	1,317,421,000	
4 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,470,000,000	1,389,899,700	
4 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,300,000,000	1,225,705,000	
5 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,750,000,000	1,457,242,500	
5 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,520,000,000	1,123,188,800	
5 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,400,000,000	1,079,932,000	
5 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,320,000,000	1,037,797,200	
5 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2,930,000,000	2,401,135,000	
5 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,080,000,000	881,474,400	
5 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,140,000,000	926,637,600	
5 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,330,000,000	1,076,661,600	
5 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,660,000,000	1,338,325,200	
5 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,220,000,000	956,126,200	
6 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	630,000,000	515,925,900	
6 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	660,000,000	512,338,200	
6 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,020,000,000	747,517,200	
6 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	650,000,000	461,012,500	
6 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,100,000,000	775,588,000	
6 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	900,000,000	631,359,000	

66回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	760,166,000	
67回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	800,005,500	
68回 利付国庫債券(30年)	2,340,000,000	1,709,370,000	
69回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,016,260,000	
70回 利付国庫債券(30年)	2,100,000,000	1,562,190,000	
71回 利付国庫債券(30年)	2,130,000,000	1,577,307,600	
72回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	950,910,600	
73回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	946,589,100	
74回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,207,457,600	
75回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,301,074,400	
76回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,156,029,600	
77回 利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	1,834,040,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,045,560,000	
79回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,197,772,500	
80回 利付国庫債券(30年)	1,380,000,000	1,318,438,200	
81回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,365,315,000	
82回 利付国庫債券(30年)	1,710,000,000	1,629,903,600	
83回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,561,785,000	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	71,575,000	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	173,612,500	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	605,552,400	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	123,522,000	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	123,343,200	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	609,942,000	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,320,600	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	487,169,100	

年)			
9 1回 利付国庫債券 (20年)	110,000,000	114,237,200	
9 2回 利付国庫債券 (20年)	1,160,000,000	1,204,868,800	
9 3回 利付国庫債券 (20年)	370,000,000	384,896,200	
9 4回 利付国庫債券 (20年)	670,000,000	698,635,800	
9 5回 利付国庫債券 (20年)	550,000,000	578,853,000	
9 6回 利付国庫債券 (20年)	120,000,000	125,641,200	
9 7回 利付国庫債券 (20年)	660,000,000	695,692,800	
9 8回 利付国庫債券 (20年)	160,000,000	168,177,600	
9 9回 利付国庫債券 (20年)	750,000,000	791,340,000	
1 0 0回 利付国庫債券 (20年)	830,000,000	881,891,600	
1 0 1回 利付国庫債券 (20年)	230,000,000	245,966,600	
1 0 2回 利付国庫債券 (20年)	500,000,000	537,075,000	
1 0 3回 利付国庫債券 (20年)	160,000,000	171,272,000	
1 0 4回 利付国庫債券 (20年)	110,000,000	116,936,600	
1 0 5回 利付国庫債券 (20年)	640,000,000	682,617,600	
1 0 6回 利付国庫債券 (20年)	500,000,000	535,265,000	
1 0 7回 利付国庫債券 (20年)	600,000,000	642,000,000	
1 0 8回 利付国庫債券 (20年)	690,000,000	732,531,600	
1 0 9回 利付国庫債券 (20年)	350,000,000	372,305,500	
1 1 0回 利付国庫債券 (20年)	440,000,000	472,027,600	
1 1 1回 利付国庫債券 (20年)	460,000,000	496,997,800	
1 1 2回 利付国庫債券 (20年)	740,000,000	796,077,200	
1 1 3回 利付国庫債券 (20年)	2,470,000,000	2,667,525,900	
1 1 6回 利付国庫債券 (20年)	530,000,000	579,321,800	
1 1 7回 利付国庫債券 (20年)	1,870,000,000	2,033,999,000	

1 1 8回 利付国庫債券 (20年)	955,000,000	1,036,843,500	
1 1 9回 利付国庫債券 (20年)	470,000,000	504,874,000	
1 2 0回 利付国庫債券 (20年)	500,000,000	531,500,000	
1 2 1回 利付国庫債券 (20年)	1,040,000,000	1,126,195,200	
1 2 2回 利付国庫債券 (20年)	870,000,000	937,033,500	
1 2 3回 利付国庫債券 (20年)	1,450,000,000	1,592,158,000	
1 2 5回 利付国庫債券 (20年)	900,000,000	996,651,000	
1 2 6回 利付国庫債券 (20年)	910,000,000	995,949,500	
1 2 7回 利付国庫債券 (20年)	1,140,000,000	1,240,491,000	
1 2 8回 利付国庫債券 (20年)	200,000,000	218,148,000	
1 3 0回 利付国庫債券 (20年)	1,110,000,000	1,205,215,800	
1 3 1回 利付国庫債券 (20年)	1,100,000,000	1,186,922,000	
1 3 2回 利付国庫債券 (20年)	530,000,000	572,516,600	
1 3 3回 利付国庫債券 (20年)	1,230,000,000	1,337,256,000	
1 3 4回 利付国庫債券 (20年)	900,000,000	979,983,000	
1 3 5回 利付国庫債券 (20年)	130,000,000	140,617,100	
1 3 6回 利付国庫債券 (20年)	360,000,000	386,672,400	
1 3 7回 利付国庫債券 (20年)	480,000,000	519,499,200	
1 3 8回 利付国庫債券 (20年)	1,060,000,000	1,131,094,200	
1 3 9回 利付国庫債券 (20年)	680,000,000	730,646,400	
1 4 0回 利付国庫債券 (20年)	950,000,000	1,029,030,500	
1 4 1回 利付国庫債券 (20年)	1,560,000,000	1,689,651,600	
1 4 2回 利付国庫債券 (20年)	730,000,000	796,700,100	
1 4 3回 利付国庫債券 (20年)	2,130,000,000	2,291,155,800	
1 4 4回 利付国庫債券 (20年)	1,050,000,000	1,120,539,000	
1 4 5回 利付国庫債券 (20年)	2,250,000,000	2,438,595,000	

0年)			
146回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,426,659,200	
147回 利付国庫債券(20年)	1,290,000,000	1,385,485,800	
148回 利付国庫債券(20年)	1,730,000,000	1,840,996,800	
149回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	2,432,827,300	
150回 利付国庫債券(20年)	2,330,000,000	2,449,296,000	
151回 利付国庫債券(20年)	2,360,000,000	2,431,012,400	
152回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,302,249,600	
153回 利付国庫債券(20年)	2,560,000,000	2,652,595,200	
154回 利付国庫債券(20年)	2,420,000,000	2,477,789,600	
155回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,281,140,000	
156回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,126,806,800	
157回 利付国庫債券(20年)	2,380,000,000	2,158,184,000	
158回 利付国庫債券(20年)	1,540,000,000	1,441,239,800	
159回 利付国庫債券(20年)	1,940,000,000	1,830,293,000	
160回 利付国庫債券(20年)	2,120,000,000	2,016,819,600	
161回 利付国庫債券(20年)	1,760,000,000	1,646,832,000	
162回 利付国庫債券(20年)	1,930,000,000	1,798,702,100	
163回 利付国庫債券(20年)	3,330,000,000	3,090,906,000	
164回 利付国庫債券(20年)	1,970,000,000	1,796,206,600	
165回 利付国庫債券(20年)	3,070,000,000	2,785,073,300	
166回 利付国庫債券(20年)	2,760,000,000	2,562,273,600	
167回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,751,841,000	
168回 利付国庫債券(20年)	1,590,000,000	1,400,869,500	
169回 利付国庫債券(20年)	2,720,000,000	2,346,952,000	
170回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,458,158,000	

	171回 利付国庫債券(20年)	1,240,000,000	1,057,893,600	
	172回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,363,113,400	
	173回 利付国庫債券(20年)	1,960,000,000	1,682,052,400	
	174回 利付国庫債券(20年)	2,330,000,000	1,988,911,300	
	175回 利付国庫債券(20年)	2,020,000,000	1,744,613,400	
	176回 利付国庫債券(20年)	3,100,000,000	2,663,520,000	
	177回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,764,714,000	
	178回 利付国庫債券(20年)	3,200,000,000	2,723,968,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	1,810,000,000	1,533,522,500	
	180回 利付国庫債券(20年)	3,240,000,000	2,881,656,000	
	181回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,712,546,000	
	182回 利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,440,647,500	
	183回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,752,840,000	
	184回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,458,877,200	
	185回 利付国庫債券(20年)	2,800,000,000	2,575,748,000	
	186回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,865,496,000	
	187回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,609,526,000	
	188回 利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,286,384,000	
	189回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,250,280,000	
	国債証券 合計	478,605,000,000	460,849,624,400	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,166,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	108,828,500	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	194,792,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	390,304,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	292,281,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	223,692,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	105,565,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	206,922,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	311,163,000	

0年			
18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,428,000	
21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,351,000	
31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	205,084,000	
28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,244,000	
30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	395,804,000	
30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	394,320,000	
令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	97,087,000	
36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	243,142,500	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	196,670,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	194,738,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	290,625,000	
3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	116,179,000	
11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	107,226,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	327,741,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	108,247,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,071,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,279,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	193,404,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	194,114,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	193,418,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	192,480,000	
474回 大阪府公募公債 10年	300,000,000	288,660,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	215,404,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	101,320,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	92,869,000	
190回 大阪府公募公債	300,000,000	296,835,000	

5年			
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	108,202,807	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	390,292,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	195,002,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	194,800,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	97,160,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	111,918,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	204,414,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	308,862,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	102,152,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	100,586,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	194,890,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	97,333,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	194,000,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	102,559,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	103,099,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	202,792,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	321,402,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	327,294,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	107,253,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	211,404,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	144,033,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,108,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	196,116,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	205,542,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	98,933,000	

令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	194,928,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	79,905,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	85,136,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	195,366,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	166,702,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	209,286,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	108,780,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	106,729,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	317,319,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	101,568,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	99,443,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	197,210,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	194,988,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	97,263,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	102,659,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	139,520,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	106,394,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	108,832,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	321,138,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,494,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	192,622,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	102,904,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	101,142,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	91,530,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	194,524,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	105,542,000	

1 5 3回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	100,093,000	
1 5 7回 共同発行市場公募 地方債	120,000,000	119,313,600	
1 5 9回 共同発行市場公募 地方債	200,000,000	198,630,000	
1 6 0回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	496,240,000	
1 6 6回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	496,615,000	
1 6 9回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	496,525,000	
1 7 3回 共同発行市場公募 地方債	400,000,000	396,928,000	
1 7 4回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	98,988,000	
1 7 8回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,131,000	
1 7 9回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	495,665,000	
1 8 9回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	98,644,000	
1 9 4回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	293,772,000	
1 9 6回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	487,920,000	
2 0 3回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	97,417,000	
2 2 7回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	484,380,000	
2 2 8回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	482,265,000	
3 0年度3回 堺市公募公債	100,000,000	98,586,000	
令和2年度1回 福島県公募 公債	200,000,000	194,438,000	
2 9年度4回 大阪市公募公 債	200,000,000	198,010,000	
令和2年 2回 大阪市公募 公債	300,000,000	292,509,000	
6回 大阪市公募公債 2 0 年	200,000,000	214,120,000	
5 1 1回 名古屋市公募公債 1 0年	200,000,000	194,544,000	
1 6回 名古屋市公募公債 2 0年	100,000,000	105,451,000	
1 7回 名古屋市公募公債 2 0年	100,000,000	101,654,000	
4回 京都市公募公債 2 0 年	100,000,000	104,068,000	
9回 京都市公募公債 2 0 年	200,000,000	218,968,000	

24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	215,248,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	296,808,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	144,802,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	389,640,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	114,596,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	106,477,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	105,548,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	107,418,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	276,219,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	197,330,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	215,258,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	107,131,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	106,311,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	327,825,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	105,501,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	110,544,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	183,220,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	84,766,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	184,858,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	297,297,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	91,994,000	
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	296,706,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	195,194,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	194,438,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	196,422,000	
地方債証券 合計	26,739,330,000	26,448,950,407	
特殊債券			
9回 新関西国際空港社債	200,000,000	204,898,000	
12回 新関西国際空港社債	200,000,000	203,502,000	

7 8 回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	297,636,000	
1 2 5 回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	419,340,000	
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	72,885,000	
1 5 6 回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	386,508,000	
3 3 回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,329,000	
1 回 高速道路機構債	300,000,000	356,751,000	
1 9 回 高速道路機構債	150,000,000	171,601,500	
2 6 回 高速道路機構債	200,000,000	230,938,000	
3 6 回 高速道路機構債	300,000,000	347,262,000	
5 0 回 高速道路機構債	300,000,000	259,797,000	
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,521,000	
1 2 4 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,310,000	
1 5 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,068,000	
1 5 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	95,654,000	
1 6 2 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	90,307,000	
1 6 9 回 高速道路機構債	100,000,000	88,212,000	
1 7 2 回 高速道路機構債	200,000,000	180,098,000	
2 1 0 回 高速道路機構債	100,000,000	90,633,000	
9 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,034,000	
1 1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,114,000	
1 2 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	536,825,000	
1 5 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,210,000	
1 8 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,164,000	
2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	304,983,000	
2 5 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,753,000	
2 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	185,754,000	
第 2 6 2 回 政保道路債	500,000,000	502,965,000	
2 6 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	90,645,000	
2 7 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	298,260,000	
2 8 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	181,810,000	

3 0 0回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	99,260,000	
3 0 9回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	800,000,000	793,880,000	
3 1 9回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	200,000,000	186,034,000	
3 3 7回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	91,764,000	
3 9 8回 政保道路債	300,000,000	207,603,000	
4 1 3回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	122,318,000	
4 1 8回 高速道路機構債	200,000,000	141,852,000	
4 2 0回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	143,388,000	
2 8回 日本道路・機構承継 債	500,000,000	582,440,000	
1回 地方公共団体金融機構 債券 20年	200,000,000	212,512,000	
1回 地方公共団体金融機構 債券 20年	300,000,000	323,277,000	
2回 地方公共団体金融機構 債券 20年	300,000,000	324,018,000	
1 3回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	109,219,000	
7 9回 政保地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	306,387,000	
1 9回 地方公共団体金融機 構債券	200,000,000	215,926,000	
2 3回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	106,977,000	
2 4回 地方公共団体金融機 構債券 20年	200,000,000	214,336,000	
F 1 4 7回 地方公共団体金 融機構債券	200,000,000	203,876,000	
F 1 7 4回 地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	318,849,000	
3 6回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	105,561,000	
3 9回 地方公共団体金融機 構債券	500,000,000	519,145,000	
4 2回 地方公共団体金融機 構債券 20年	300,000,000	298,434,000	
4 4回 地方公共団体金融機 構債券 20年	200,000,000	204,108,000	
2 8 8回 政保地方公共団体 金融機構債券	300,000,000	294,543,000	
8 3回 地方公共団体金融機 構債券 10年	400,000,000	397,504,000	
9 1回 政保地方公共団体金 融機構債券	100,000,000	99,234,000	
5 9回 地方公共団体金融機	100,000,000	92,912,000	

構債券 20年			
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	495,875,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,218,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,039,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,936,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	247,782,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	208,263,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,375,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	214,950,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,429,380	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	102,046,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	102,227,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	203,018,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	145,826,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	103,113,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	214,860,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,721,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	381,601,500	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,118,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,835,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,826,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	257,340,000	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,415,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,077,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,353,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,817,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	297,012,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	90,006,000	

3 2 1回 住宅金融支援機構 債券	500,000,000	494,895,000	
3 2 5回 住宅金融支援機構 債券	500,000,000	494,895,000	
2 7回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	13,724,000	14,115,957	
2 9回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	86,595,000	89,944,494	
3 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	128,816,000	132,779,668	
3 8回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	18,414,000	18,942,113	
4 9回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	15,755,000	16,194,879	
5 2回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	18,433,000	18,887,557	
5 3回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	19,528,000	20,012,684	
6 0回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	23,610,000	24,127,531	
6 4回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	58,582,000	59,357,625	
7 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	26,359,000	26,799,458	
8 2回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	32,139,000	32,282,018	
8 4回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	32,574,000	32,716,674	
8 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	35,991,000	36,032,029	
9 0回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	37,835,000	37,613,286	
9 3回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	42,962,000	41,839,832	
9 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	48,314,000	47,325,495	
9 9回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	50,295,000	49,520,959	
1 1 4回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	191,244,000	180,591,709	
1 1 7回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	65,234,000	61,965,124	
1 1 8回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	64,739,000	61,593,979	
1 1 9回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	65,216,000	61,970,851	
1 2 6回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	203,019,000	191,517,973	
1 2 8回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	202,626,000	191,054,029	
1 3 0回貸付債権担保住宅金	138,804,000	130,689,518	

	融支援機構債券			
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	207,066,000	194,412,196	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	205,341,000	192,887,068	
	1 3 7 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	357,880,000	336,990,543	
	1 3 9 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	71,132,000	66,920,985	
	1 4 2 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	73,602,000	68,356,385	
	1 5 4 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	239,103,000	220,503,177	
	1 5 6 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	318,380,000	294,444,191	
	1 6 0 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	244,578,000	226,476,782	
	1 6 8 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	250,941,000	232,469,232	
	1 7 0 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	763,245,000	705,169,687	
	い第8 5 1 号 利付商工債	300,000,000	297,750,000	
	い第8 5 4 号 利付商工債	300,000,000	296,916,000	
	い第8 5 5 号 利付商工債	200,000,000	197,832,000	
	3 7 7 回 利附信金中金債 (5年)	300,000,000	297,750,000	
	1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	107,188,000	
	7 2 回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,668,000	
	7 7 回 東日本高速道路社債	300,000,000	295,539,000	
	8 5 回 中日本高速道路債券	300,000,000	298,824,000	
	8 7 回 中日本高速道路債券	400,000,000	397,380,000	
	7 8 回 鉄道建設・運輸施設 整備支援機構債券	100,000,000	100,853,000	
	9 0 回 鉄道建設・運輸施設 整備支援機構債券	200,000,000	193,592,000	
	特殊債券 合計	26,705,076,000	26,214,791,068	
社債券	2 5 回 フランス相互信用連 合銀行 (B F C M) 円貨社債 (2 0 1 7)	300,000,000	295,845,000	
	1 1 回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債 (2 0 1 6)	100,000,000	99,338,000	
	2 7 回 首都高速道路社債	400,000,000	397,976,000	
	3 7 回 成田国際空港社債	100,000,000	83,791,000	
	5 7 回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,270,000	
	6 7 回 東日本高速道路社債	200,000,000	195,284,000	
	7 9 回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,498,000	
	8 3 回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,332,000	
	9 0 回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,234,000	
	9 1 回 中日本高速道路債券	500,000,000	495,100,000	
	3 3 回 西日本高速道路債券	300,000,000	298,206,000	

34回	西日本高速道路債券	200,000,000	199,018,000	
61回	西日本高速道路債券	500,000,000	495,740,000	
62回	西日本高速道路債券	500,000,000	495,095,000	
24回	大和ハウス工業社債	200,000,000	198,192,000	
3回	ダイドーグループHD社債	300,000,000	291,525,000	
9回	野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	92,720,000	
14回	セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,086,000	
30回	東レ社債	300,000,000	297,543,000	
42回	王子ホールディングス社債	200,000,000	198,290,000	
23回	三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	181,458,000	
40回	三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,063,000	
17回	ダイセル社債	300,000,000	291,393,000	
16回	武田薬品工業社債	500,000,000	477,125,000	
4回	ENEOSホールディングス社債	300,000,000	292,509,000	
14回	ブリヂストン社債	300,000,000	294,303,000	
35回	三菱マテリアル社債	300,000,000	296,979,000	
17回	パナソニック社債	100,000,000	99,499,000	
19回	パナソニック社債	100,000,000	97,095,000	
23回	パナソニック社債	200,000,000	192,996,000	
58回	川崎重工業社債	300,000,000	285,537,000	
5回	三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	98,512,000	
26回	トヨタ自動車社債	200,000,000	198,424,000	
26回	豊田通商社債	100,000,000	90,079,000	
73回	三井物産社債	400,000,000	390,708,000	
88回	三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	104,142,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	102,901,000	
20回	三井住友信託銀行社債	300,000,000	296,871,000	
28回	芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,495,000	
17回	NTTファイナンス社債	300,000,000	295,980,000	
18回	NTTファイナンス社債	400,000,000	390,068,000	
69回	ホンダファイナンス社債	300,000,000	297,144,000	
81回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,771,000	
96回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,141,000	
80回	日立キャピタル社債	200,000,000	193,648,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	288,669,000	

23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	97,873,000	
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,140,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	193,710,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	296,775,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	296,160,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	99,567,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	198,488,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	102,033,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	87,527,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	107,133,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,628,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	215,970,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	90,571,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	82,517,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	90,065,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,239,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	62,757,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,585,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	166,596,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	140,728,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,757,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	194,290,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	72,344,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	63,521,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,322,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	166,216,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,977,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	123,748,800	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	61,600,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	290,511,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	194,230,000	
12回 ソフトバンク社債	400,000,000	390,244,000	
30回 光通信社債	200,000,000	189,084,000	
527回 中部電力社債	100,000,000	90,228,000	
532回 中部電力社債	200,000,000	194,650,000	

508回	関西電力社債	300,000,000	298,233,000	
530回	関西電力社債	400,000,000	392,584,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	169,946,000	
541回	関西電力社債	300,000,000	285,771,000	
396回	中国電力社債	200,000,000	192,316,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	96,930,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	100,735,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	100,464,000	
488回	東北電力社債	100,000,000	99,244,000	
521回	東北電力社債	400,000,000	389,628,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	197,082,000	
536回	東北電力社債	300,000,000	284,082,000	
320回	四国電力社債	300,000,000	287,685,000	
463回	九州電力社債	100,000,000	88,505,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	87,314,000	
491回	九州電力社債	300,000,000	287,424,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	81,250,000	
493回	九州電力社債	200,000,000	198,232,000	
507回	九州電力社債	200,000,000	192,918,000	
340回	北海道電力社債	300,000,000	298,272,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	176,016,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	99,019,000	
75回	電源開発社債	200,000,000	190,048,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	181,678,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	85,243,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	81,878,000	
57回	東京瓦斯社債	300,000,000	179,190,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	197,576,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	180,378,000	
社債券 合計		22,820,000,000	21,843,018,800	
合計			535,356,384,675	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年9月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	666,767,354
コール・ローン	1,927,849,200
国債証券	249,709,830,315
未収利息	1,664,609,377
前払費用	239,918,321
流動資産合計	254,208,974,567
資産合計	254,208,974,567
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,537,936
未払金	814,716,448
未払解約金	57,438,000
流動負債合計	876,692,384
負債合計	876,692,384
純資産の部	
元本等	
元本	109,119,510,468
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	144,212,771,715
元本等合計	253,332,282,183
純資産合計	253,332,282,183
負債純資産合計	254,208,974,567

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9月20日
	至 2024年9月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年9月17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	106,913,732,007円
同期中追加設定元本額	43,779,968,530円
同期中一部解約元本額	41,574,190,069円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,496,799,120円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	1,477,145円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	9,887,977円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	29,334,901円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	19,580,239円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	30,106,687円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	18,166,346円
たわらノーロード 先進国債券	22,772,537,023円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,825,323,244円
たわらノーロード バランス（堅実型）	75,092,280円
たわらノーロード バランス（標準型）	456,405,464円
たわらノーロード バランス（積極型）	111,599,985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）	21,227,283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）	1,109,859,869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）	2,082,299,165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）	1,110,406,883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）	625,915,095円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,475,222円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,891,591円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	196,104,513円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	32,071,712円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	29,225,320円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	4,297円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	4,355円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	4,058円

D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	7,002,422,691円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	2,180,655,873円
O n e グローバルバランス	124,704,594円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1 安定型	741,755,187円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	2,555,949,610円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3 成長型	3,046,986,335円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	363,159,880円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	831,101,709円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	800,668,446円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,468,703円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	955,746,909円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,942,671円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	154,157,168円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	166,188,124円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	280,555,631円
クルーズコントロール	109,636,898円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	224,640,619円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,114,652,945円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	877,791,417円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,302,102円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	696,239,692円
O n e グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	5,317,791円
O n e グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	54,910,058円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	899,232,529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)	213,196,003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)	213,732,958円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	362,834,193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)	128,714,010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)	544,565円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	543,745,826円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	345,609,226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)	148,457,316円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	370,014,079円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	352,239,775円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,062,853,820円
D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,358,522,690円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,510,188,290円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	55,599,206円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	41,587,340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)	355,117,307円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限	307,815,487円

定)	
D I A M グローバル・バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	189, 834, 231円
D I A M 国際分散バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	11, 603, 514円
D I A M 国際分散バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	18, 799, 030円
D I A M 国内重視バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	5, 896, 076円
D I A M 国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	52, 194円
D I A M 世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	1, 584, 040円
D I A M 世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	3, 064, 306円
D I A M バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1, 088, 901, 823円
D I A M バランスファンド3 7. 5 V A (適格機関投資家限定)	1, 179, 676, 336円
D I A M バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2, 253, 801, 706円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	43, 973, 455円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	91, 109, 106円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	971, 174, 068円
D I A M 世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	179, 048, 962円
D I A M 世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	155, 378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)	146, 778, 692円
D I A M 世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	137, 014, 287円
D I A M 世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	310, 682, 684円
D I A M 世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	31, 902, 144円
動的パッケージファンド<DC年金>	49, 708, 028円
コア資産形成ファンド	23, 188, 909円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジなし)<ラップ専用>	3, 519, 473, 075円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジあり)<ラップ専用>	12, 390, 230, 702円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5, 537, 749, 696円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	5, 085, 348, 579円
計	109, 119, 510, 468円
2. 受益権の総数	109, 119, 510, 468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9月20日 至 2024年9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運

	用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。
--	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年9月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月17日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	8,717,699,968	
合計	8,717,699,968	

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2024年2月22日から2024年9月17日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年9月17日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	
		1年超			評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	1,250,000,000	—		1,245,462,064	
アメリカ・ドル	609,031,000	—		606,059,906	△2,971,094
イギリス・ポンド	63,550,000	—		63,526,409	△23,591
オフショア・人民元	211,890,000	—		210,984,760	△905,240
ユーロ	365,529,000	—		364,890,989	△638,011
合計	1,250,000,000	—		1,245,462,064	△4,537,936

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年9月17日現在
1口当たり純資産額	2,3216円
(1万口当たり純資産額)	(23,216円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年9月17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 08/31/25	1,890,000.000	1,824,049.840	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,581,444.650	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,841,562.480	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,444,167.970	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,465,713.670	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,477,220.300	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,979,865.820	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,830,000.000	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,936,946.100	
		US T N/B 0.5 04/30/27	970,000.000	898,689.840	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,754,462.890	
		US T N/B 0.5 06/30/27	880,000.000	811,593.740	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,809,701.540	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,344,039.080	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,980,624.990	
		US T N/B 0.625 05/15/30	4,050,000.000	3,465,439.440	
		US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,829,460.900	
		US T N/B 0.625 08/15/30	6,740,000.000	5,724,655.840	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,570,937.500	

US T N/B 0.625 12/31/27	4,020,000.000	3,672,646.850	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,680,000.000	4,284,028.090	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,471,760.910	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,727,656.260	
US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,363,674.590	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,689,834.970	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,510,000.000	4,298,857.970	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,510,000.000	4,276,660.350	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,680,000.000	7,443,439.020	
US T N/B 1.0 07/31/28	5,270,000.000	4,809,801.360	
US T N/B 1.125 02/15/31	8,690,000.000	7,537,217.170	
US T N/B 1.125 02/28/27	3,300,000.000	3,118,886.720	
US T N/B 1.125 02/29/28	7,000,000.000	6,478,417.960	
US T N/B 1.125 05/15/40	1,800,000.000	1,219,851.550	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,060,000.000	2,727,178.120	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,230,000.000	3,873,176.350	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,270,586.310	
US T N/B 1.25 03/31/28	4,610,000.000	4,277,755.850	
US T N/B 1.25 04/30/28	5,700,000.000	5,280,070.270	
US T N/B 1.25 05/15/50	5,380,000.000	2,999,770.280	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,828,772.270	
US T N/B 1.25 06/30/28	2,710,000.000	2,502,250.960	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,360,000.000	7,208,540.570	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,573,624.230	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,476,566.410	
US T N/B 1.25 12/31/26	4,290,000.000	4,081,113.830	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,770,000.000	2,737,160.100	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,800,000.000	2,685,812.490	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,341,111.320	
US T N/B 1.375 11/15/31	5,890,000.000	5,095,655.250	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	3,003,074.980	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,227,957.000	
US T N/B 1.5 01/31/27	2,940,000.000	2,807,929.670	
US T N/B 1.5 02/15/30	2,830,000.000	2,559,823.430	
US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,625,488.300	
US T N/B 1.625 02/15/26	5,290,000.000	5,137,292.550	
US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	5,002,479.890	
US T N/B 1.625 05/15/31	7,340,000.000	6,529,159.350	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,460,000.000	3,183,875.750	
US T N/B 1.625 09/30/26	5,050,000.000	4,861,611.300	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,316,612.500	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,280,000.000	3,229,771.870	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,737,741.390	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	4,195,458.990	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,310,000.000	3,856,076.370	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,250,000.000	2,073,515.620	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	2,029,844.720	
US T N/B 1.875 02/15/32	7,980,000.000	7,121,682.440	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,100,000.000	3,831,375.000	
US T N/B 1.875 02/15/51	5,780,000.000	3,762,870.270	

US T N/B 1.875 02/28/27	5,210,000.000	5,015,642.550	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,700,000.000	4,401,017.580	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,794,162.480	
US T N/B 1.875 07/31/26	3,200,000.000	3,101,375.000	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,370,000.000	3,477,284.740	
US T N/B 2.0 02/15/50	500,000.000	337,675.780	
US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,886,799.220	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,500,000.000	4,357,617.210	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,150,000.000	3,127,657.200	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,850,000.000	2,779,195.300	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,672,358.590	
US T N/B 2.25 02/15/52	5,000,000.000	3,543,457.030	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,229,617.190	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,506,303.110	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	4,100,378.100	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,570,000.000	1,160,389.440	
US T N/B 2.25 08/15/49	4,140,000.000	2,968,671.050	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	5,026,399.990	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,154,144.910	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,877,846.870	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,823,437.520	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	2,018,397.650	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,830,000.000	3,724,076.560	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,770,000.000	3,599,687.290	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,760,000.000	4,211,099.990	
US T N/B 2.375 11/15/49	4,490,000.000	3,302,166.970	
US T N/B 2.5 02/15/45	700,000.000	550,074.210	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,370,000.000	1,066,994.510	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,240,634.370	
US T N/B 2.5 03/31/27	3,000,000.000	2,931,328.130	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,730,000.000	1,344,061.320	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,423,484.370	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,330,000.000	5,156,254.450	
US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,805,278.920	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,959,072.260	
US T N/B 2.625 12/31/25	3,000,000.000	2,955,937.500	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,439,800.790	
US T N/B 2.75 04/30/27	2,500,000.000	2,455,859.370	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,202,804.700	
US T N/B 2.75 07/31/27	4,120,000.000	4,042,267.170	
US T N/B 2.75 08/15/32	9,840,000.000	9,299,568.690	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	1,043,125.770	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,794,932.200	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,056,000.000	886,008.750	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,807,954.100	
US T N/B 2.875 04/30/29	4,000,000.000	3,905,468.740	
US T N/B 2.875 05/15/28	3,560,000.000	3,491,511.710	
US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,692,938.450	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,890,000.000	2,455,371.090	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,800,000.000	3,100,042.950	

US T N/B 2.875 05/15/52	7,010,000.000	5,694,118.970	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,928,122.820	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,470,000.000	1,229,057.800	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,580,000.000	1,309,178.110	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,360,000.000	3,321,675.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,960,000.000	2,501,893.750	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,224,033.180	
US T N/B 3.0 02/15/49	2,010,000.000	1,679,763.270	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	947,088.260	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	1,102,597.260	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,366,621.860	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,510,000.000	2,101,291.590	
US T N/B 3.0 08/15/52	4,740,000.000	3,950,771.450	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,732,982.190	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,247,654.680	
US T N/B 3.0 11/15/45	2,360,000.000	2,013,006.240	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,221,742.180	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,540,000.000	1,363,381.240	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,426,227.540	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,590,000.000	1,391,622.650	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,040,000.000	3,013,400.000	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	3,065,779.680	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,180,000.000	4,129,464.460	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	921,187.500	
US T N/B 3.25 05/15/42	3,060,000.000	2,778,862.500	
US T N/B 3.25 06/30/27	2,700,000.000	2,686,500.000	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,500,000.000	3,470,742.160	
US T N/B 3.375 05/15/33	6,700,000.000	6,597,537.070	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,730,000.000	1,574,908.190	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,693,700.000	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,450,000.000	3,083,909.150	
US T N/B 3.5 01/31/28	3,680,000.000	3,688,481.250	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,700,000.000	2,705,958.980	
US T N/B 3.5 02/15/33	7,250,000.000	7,212,758.760	
US T N/B 3.5 04/30/28	3,100,000.000	3,108,173.830	
US T N/B 3.5 04/30/30	3,000,000.000	3,006,093.750	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,541,177.720	
US T N/B 3.625 02/15/53	4,800,000.000	4,517,062.490	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,524,130.840	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,500,000.000	2,520,996.100	
US T N/B 3.625 05/15/26	3,900,000.000	3,898,095.700	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,510,000.000	3,307,215.220	
US T N/B 3.625 05/31/28	2,500,000.000	2,517,333.970	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,393,226.950	
US T N/B 3.75 04/15/26	6,000,000.000	6,007,148.460	
US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,550,996.080	
US T N/B 3.75 06/30/30	3,200,000.000	3,246,375.000	
US T N/B 3.75 08/15/27	1,500,000.000	1,512,714.840	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,220,000.000	1,202,700.770	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,407,132.020	

US T N/B 3.75 12/31/28	500,000.000	506,503.900	
US T N/B 3.875 01/15/26	4,300,000.000	4,305,710.910	
US T N/B 3.875 02/15/43	3,500,000.000	3,452,763.670	
US T N/B 3.875 05/15/43	1,300,000.000	1,279,636.720	
US T N/B 3.875 08/15/33	7,000,000.000	7,147,929.670	
US T N/B 3.875 08/15/34	2,200,000.000	2,246,234.350	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,100,000.000	1,109,667.960	
US T N/B 3.875 09/30/29	2,950,000.000	3,008,481.430	
US T N/B 3.875 11/30/27	3,300,000.000	3,343,699.220	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,800,000.000	2,856,109.360	
US T N/B 3.875 12/31/27	3,600,000.000	3,651,257.800	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,856,328.130	
US T N/B 4.0 01/15/27	4,000,000.000	4,043,984.360	
US T N/B 4.0 01/31/31	2,000,000.000	2,058,203.120	
US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	4,015,156.240	
US T N/B 4.0 02/15/34	6,000,000.000	6,184,218.720	
US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	3,080,976.570	
US T N/B 4.0 02/29/28	6,200,000.000	6,315,281.250	
US T N/B 4.0 06/30/28	3,500,000.000	3,571,982.430	
US T N/B 4.0 07/31/30	3,500,000.000	3,597,617.170	
US T N/B 4.0 10/31/29	1,000,000.000	1,025,664.060	
US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	3,136,635.920	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,760,000.000	4,783,335.120	
US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,148,894.540	
US T N/B 4.125 02/15/27	1,000,000.000	1,014,453.120	
US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,739,380.870	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,563,085.950	
US T N/B 4.125 08/15/53	2,600,000.000	2,677,187.500	
US T N/B 4.125 08/31/30	2,500,000.000	2,586,865.210	
US T N/B 4.125 10/31/27	3,340,000.000	3,408,104.660	
US T N/B 4.125 11/15/32	8,600,000.000	8,949,542.920	
US T N/B 4.25 02/15/54	2,000,000.000	2,106,250.000	
US T N/B 4.25 02/28/29	4,930,000.000	5,099,950.210	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,000,000.000	2,087,656.240	
US T N/B 4.25 03/15/27	3,850,000.000	3,922,112.300	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	1,003,214.820	
US T N/B 4.25 06/30/29	1,000,000.000	1,036,289.060	
US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	4,012,981.350	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,107,148.420	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,000,000.000	1,074,531.250	
US T N/B 4.375 05/15/34	6,500,000.000	6,898,632.780	
US T N/B 4.375 05/15/40	500,000.000	534,931.640	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,430,000.000	1,527,083.580	
US T N/B 4.375 07/15/27	2,500,000.000	2,562,011.720	
US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	4,059,296.880	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	2,104,140.620	
US T N/B 4.375 08/31/28	3,500,000.000	3,621,953.120	
US T N/B 4.375 11/30/28	6,000,000.000	6,221,953.140	
US T N/B 4.375 11/30/30	3,000,000.000	3,147,949.230	
US T N/B 4.375 12/15/26	1,800,000.000	1,833,363.280	

	US T N/B 4.5 02/15/44	1,300,000.000	1,387,343.750	
	US T N/B 4.5 04/15/27	800,000.000	820,187.500	
	US T N/B 4.5 05/15/27	1,000,000.000	1,025,976.560	
	US T N/B 4.5 05/31/29	2,700,000.000	2,826,984.370	
	US T N/B 4.5 07/15/26	4,100,000.000	4,164,382.790	
	US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,061,960.140	
	US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,595,031.840	
	US T N/B 4.5 11/15/33	7,000,000.000	7,489,453.160	
	US T N/B 4.625 02/15/40	1,390,000.000	1,527,099.590	
	US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,677,998.250	
	US T N/B 4.625 05/15/54	4,600,000.000	5,154,156.250	
	US T N/B 4.625 05/31/31	2,000,000.000	2,133,554.680	
	US T N/B 4.625 06/15/27	4,500,000.000	4,638,691.390	
	US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,571,298.810	
	US T N/B 4.625 09/30/28	2,300,000.000	2,403,365.240	
	US T N/B 4.625 09/30/30	3,000,000.000	3,186,152.340	
	US T N/B 4.625 10/15/26	3,400,000.000	3,473,046.880	
	US T N/B 4.625 11/15/26	3,900,000.000	3,988,054.660	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,372,122.660	
	US T N/B 4.75 11/15/43	2,020,000.000	2,229,377.720	
	US T N/B 4.75 11/15/53	3,100,000.000	3,535,816.400	
	US T N/B 4.875 04/30/26	2,000,000.000	2,037,421.880	
	US T N/B 4.875 10/31/28	3,000,000.000	3,165,878.900	
	US T N/B 4.875 10/31/30	4,500,000.000	4,844,091.780	
	US T N/B 5.0 05/15/37	855,000.000	972,729.480	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,446,134.760	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,860,000.000	2,067,869.510	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,481,328.120	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,200,000.000	1,297,171.870	
	US T N/B 6.25 05/15/30	5,259,000.000	6,007,585.780	
アメリカ・ドル 小計		881,720,000.000 (124,119,724,400)	828,108,933.230 (116,572,894,529)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,671,153.570	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,200,408.180	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,940,000.000	1,555,070.620	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,430,000.000	2,273,333.040	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	490,000.000	407,057.700	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,880,000.000	1,654,152.960	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	610,861.060	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	3,050,000.000	2,197,244.400	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,640,000.000	711,153.200	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,250,000.000	662,105.000	

UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,400,000.000	1,105,104.000	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,030,000.000	906,838.360	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,870,000.000	2,392,581.240	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,670,000.000	1,150,688.450	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	291,930.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,400,000.000	1,314,488.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,730,000.000	896,616.260	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	2,450,000.000	1,591,264.450	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,230,000.000	1,182,712.650	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,200,000.000	716,710.560	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,410,000.000	760,695.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	959,325.710	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	701,294.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	404,874.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	1,030,000.000	637,746.130	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,110,000.000	621,278.100	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,190,000.000	931,499.150	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	210,000.000	205,852.500	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	830,688.110	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,660,000.000	1,443,370.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	3,500,000.000	3,395,046.200	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,050,000.000	941,850.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	880,000.000	751,080.000	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,700,000.000	1,687,613.120	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,150,000.000	1,127,732.780	
UK TREASURY 3.75 03/07/27	1,300,000.000	1,299,585.090	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,370,000.000	1,243,549.000	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,626,415.200	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,300,000.000	1,228,063.200	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	1,400,000.000	1,432,566.800	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	820,000.000	772,572.020	
UK TREASURY 4.125	2,440,000.000	2,458,996.860	

	01/29/27			
	UK TREASURY 4. 125 07/22/29	1,200,000.000	1,227,037.920	
	UK TREASURY 4. 25 03/07/36	1,300,000.000	1,349,985.770	
	UK TREASURY 4. 25 06/07/32	1,570,000.000	1,640,635.870	
	UK TREASURY 4. 25 07/31/34	200,000.000	208,080.880	
	UK TREASURY 4. 25 09/07/39	760,000.000	777,293.940	
	UK TREASURY 4. 25 12/07/27	1,210,000.000	1,236,471.890	
	UK TREASURY 4. 25 12/07/40	1,090,000.000	1,107,474.650	
	UK TREASURY 4. 25 12/07/46	1,280,000.000	1,271,783.420	
	UK TREASURY 4. 25 12/07/49	1,147,000.000	1,135,332.810	
	UK TREASURY 4. 25 12/07/55	1,512,000.000	1,491,512.400	
	UK TREASURY 4. 375 07/31/54	80,000.000	80,373.820	
	UK TREASURY 4. 5 06/07/28	2,100,000.000	2,162,808.900	
	UK TREASURY 4. 5 09/07/34	1,250,000.000	1,327,667.620	
	UK TREASURY 4. 5 12/07/42	1,745,000.000	1,813,311.510	
	UK TREASURY 4. 625 01/31/34	1,350,000.000	1,444,886.100	
	UK TREASURY 4. 75 10/22/43	700,000.000	747,426.120	
	UK TREASURY 4. 75 12/07/30	1,995,000.000	2,130,482.840	
	UK TREASURY 4. 75 12/07/38	1,430,000.000	1,547,807.400	
	UK TREASURY 6. 0 12/07/28	1,180,000.000	1,296,529.480	
	イギリス・ポンド 小計	86,169,000.000 (16,013,646,960)	73,950,070.010 (13,742,881,011)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0. 5 02/27/26	1,430,000.000	1,356,344.990	
	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	700,000.000	678,164.900	
	ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	820,000.000	759,787.400	
	ISRAEL FIXED BOND 1. 0 03/31/30	3,110,000.000	2,572,296.550	
	ISRAEL FIXED BOND 1. 3 04/30/32	2,350,000.000	1,838,682.300	
	ISRAEL FIXED BOND 1. 5 05/31/37	2,490,000.000	1,672,707.300	
	ISRAEL FIXED BOND 1. 75 08/31/25	1,600,000.000	1,564,670.400	

	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	750,000.000	469,869.750	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,660,000.000	1,567,753.800	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	3,810,000.000	3,501,108.060	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,442,626.110	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,410,000.000	1,457,110.920	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,266,691.840	
イスラエル・シケル 小計		23,160,000.000 (869,639,472)	20,147,814.320 (756,534,309)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,402,154.800	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,515,000.000	1,428,342.000	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,970,000.000	2,474,901.000	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	670,000.000	574,270.400	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,800,000.000	1,507,104.000	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,810,000.000	1,582,048.600	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,420,000.000	836,067.600	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,591,795.500	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,080,000.000	1,037,923.200	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,660,000.000	1,574,393.800	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	797,952.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,250,000.000	1,128,812.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,130,000.000	1,108,326.600	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,600,000.000	1,560,416.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,353,254.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	882,856.400	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,820,000.000	1,708,889.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,000,000.000	992,780.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,220,000.000	1,113,664.800	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,820,000.000	1,768,767.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,080,000.000	1,061,704.800	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,340,000.000	1,333,434.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,617,536.000	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,749,557.000		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,740,000.000	1,797,350.400		
AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	430,000.000	457,666.200		
オーストラリア・ドル 小計		37,375,000.000 (3,546,513,750)	34,441,967.600 (3,268,198,306)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	12,440,000.000	12,497,094.620	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 06/15/26	4,000,000.000	4,021,879.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.85 05/15/27	16,000,000.000	16,159,643.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND	24,000,000.000	24,222,057.600	

1.91 07/15/29			
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.04 02/25/27	35,000,000.000	35,488,120.500	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.05 04/15/29	29,040,000.000	29,476,921.320	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.12 06/25/31	18,410,000.000	18,640,349.600	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.18 08/15/26	50,000,000.000	50,719,360.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.27 05/25/34	21,590,000.000	21,962,440.450	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.28 03/25/31	23,000,000.000	23,511,952.400	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.28 11/25/25	31,800,000.000	32,121,602.940	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.3 05/15/26	49,500,000.000	50,220,106.200	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.33 12/15/25	4,000,000.000	4,044,436.800	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.35 02/25/34	21,000,000.000	21,501,362.400	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.37 01/15/29	24,000,000.000	24,675,132.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.39 11/15/26	35,000,000.000	35,685,405.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.4 07/15/28	31,000,000.000	31,860,250.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,559,030.500	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,727,879.010	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.5 07/25/27	35,410,000.000	36,398,618.870	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.52 08/25/33	23,000,000.000	23,886,146.300	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.54 12/25/30	21,000,000.000	21,810,915.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.55 10/15/28	23,000,000.000	23,794,429.200	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.6 09/01/32	19,300,000.000	20,165,790.280	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.6 09/15/30	18,000,000.000	18,756,777.600	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.62 04/15/28	10,000,000.000	10,346,840.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.62 06/25/30	25,000,000.000	26,056,130.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.62 09/25/29	18,000,000.000	18,752,922.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.67 05/25/33	19,500,000.000	20,476,084.200	

CHINA GOVERNMENT BOND 2. 67 11/25/33	27,880,000.000	29,324,342.910	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 68 05/21/30	33,600,000.000	35,112,742.560	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 69 08/12/26	46,600,000.000	47,716,843.560	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 69 08/15/32	16,000,000.000	16,819,571.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 75 02/17/32	15,500,000.000	16,347,092.050	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 75 06/15/29	22,000,000.000	23,032,286.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 76 05/15/32	9,000,000.000	9,501,370.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 79 12/15/29	22,000,000.000	23,117,131.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 8 03/24/29	11,000,000.000	11,520,390.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 8 03/25/30	10,000,000.000	10,514,230.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 8 11/15/32	19,300,000.000	20,438,657.540	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 85 06/04/27	28,000,000.000	29,010,282.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 88 02/25/33	11,200,000.000	11,973,282.720	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 89 11/18/31	11,100,000.000	11,813,994.180	
CHINA GOVERNMENT BOND 2. 91 10/14/28	20,100,000.000	21,078,190.620	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 0 10/15/53	4,900,000.000	5,702,450.950	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 01 05/13/28	39,000,000.000	40,823,503.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 02 05/27/31	21,000,000.000	22,504,366.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 03 03/11/26	49,000,000.000	50,181,110.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 12 10/25/52	11,500,000.000	13,595,519.650	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 13 11/21/29	8,000,000.000	8,558,108.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 19 04/15/53	10,800,000.000	12,960,575.640	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 25 06/06/26	18,450,000.000	19,035,547.650	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 27 11/19/30	9,000,000.000	9,781,099.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 3. 28 12/03/27	18,500,000.000	19,510,558.800	
CHINA GOVERNMENT BOND	11,000,000.000	11,819,508.800	

	3. 29 05/23/29			
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,820,000.000	10,774,681.340	
	3. 32 04/15/52			
	CHINA GOVERNMENT BOND	21,100,000.000	25,752,568.990	
	3. 39 03/16/50			
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,450,000.000	13,178,221.210	
	3. 53 10/18/51			
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.000	5,316,198.500	
	3. 59 08/03/27			
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,600,000.000	13,710,479.900	
	3. 72 04/12/51			
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.000	18,323,561.200	
	3. 81 09/14/50			
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,300,000.000	21,298,603.640	
	3. 86 07/22/49			
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.000	13,809,456.170	
	4. 08 10/22/48			
	オフショア・人民元 小計	1,289,090,000.000 (25,541,900,351)	1,358,496,205.270 (26,917,107,962)	
カナダ・ドル	CANADA 0. 25 03/01/26	1,810,000.000	1,739,368.010	
	CANADA 0. 5 09/01/25	1,910,000.000	1,859,116.400	
	CANADA 0. 5 12/01/30	2,600,000.000	2,274,683.970	
	CANADA 1. 0 06/01/27	550,000.000	526,974.360	
	CANADA 1. 0 09/01/26	2,670,000.000	2,578,685.320	
	CANADA 1. 25 03/01/27	2,110,000.000	2,035,444.110	
	CANADA 1. 25 06/01/30	1,940,000.000	1,792,016.130	
	CANADA 1. 5 06/01/26	1,700,000.000	1,660,785.280	
	CANADA 1. 5 06/01/31	2,970,000.000	2,746,187.250	
	CANADA 1. 5 12/01/31	1,140,000.000	1,047,042.310	
	CANADA 1. 75 12/01/53	2,180,000.000	1,632,372.040	
	CANADA 2. 0 06/01/28	930,000.000	909,332.250	
	CANADA 2. 0 06/01/32	1,590,000.000	1,504,891.540	
	CANADA 2. 0 12/01/51	3,160,000.000	2,540,478.310	
	CANADA 2. 25 12/01/29	900,000.000	883,250.950	
	CANADA 2. 5 12/01/32	1,520,000.000	1,487,986.940	
	CANADA 2. 75 06/01/33	1,330,000.000	1,324,278.420	
	CANADA 2. 75 09/01/27	1,050,000.000	1,051,313.990	
	CANADA 2. 75 12/01/48	500,000.000	474,512.820	
	CANADA 2. 75 12/01/55	1,050,000.000	985,855.230	
	CANADA 2. 75 12/01/64	390,000.000	368,799.440	
	CANADA 3. 0 04/01/26	1,350,000.000	1,349,271.410	
	CANADA 3. 0 06/01/34	1,700,000.000	1,719,494.710	
	CANADA 3. 0 10/01/25	1,660,000.000	1,655,354.320	
	CANADA 3. 25 09/01/28	1,400,000.000	1,430,161.360	
	CANADA 3. 25 12/01/33	1,620,000.000	1,674,327.150	
	CANADA 3. 25 12/01/34	570,000.000	587,784.060	
	CANADA 3. 5 03/01/28	1,030,000.000	1,057,572.370	
	CANADA 3. 5 03/01/34	400,000.000	422,253.560	
	CANADA 3. 5 12/01/45	900,000.000	964,321.560	
	CANADA 4. 0 03/01/29	1,700,000.000	1,794,115.230	

	CANADA 4.0 05/01/26	500,000.000	507,659.410	
	CANADA 4.0 06/01/41	590,000.000	665,937.910	
	CANADA 4.0 08/01/26	500,000.000	510,158.460	
	CANADA 5.0 06/01/37	330,000.000	401,144.200	
	CANADA 5.75 06/01/29	640,000.000	728,425.650	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,010,000.000	1,235,378.270	
カナダ・ドル 小計		49,900,000.000 (5,167,644,000)	48,126,734.700 (4,984,004,646)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	280,000.000	273,726.660	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	499,226.250	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	840,000.000	803,478.910	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	630,000.000	555,660.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	570,000.000	496,187.850	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	690,000.000	687,833.760	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	770,000.000	755,755.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	240,000.000	237,039.600	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	240,000.000	243,168.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	684,759.900	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	683,760.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	620,000.000	636,702.800	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	300,000.000	305,430.360	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	640,646.000	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	320,000.000	330,464.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	141,660.880	
	SINGAPORE 3.375 05/01/34	310,000.000	334,994.520	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	320,000.000	344,960.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	824,411.030		
シンガポール・ドル 小計		9,505,000.000 (1,032,147,950)	9,479,865.520 (1,029,418,597)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,820,000.000	4,336,602.200	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,285,718.400	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,960,000.000	3,780,334.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,010,000.000	6,908,932.450	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,300,000.000	3,277,651.100	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,030,000.000	4,162,408.060	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,340,000.000	3,938,661.600	
スウェーデン・クローナ 小計		29,850,000.000 (412,527,000)	29,690,308.610 (410,320,065)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,429,506.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,560,000.000	2,672,835.710	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,850,000.000	4,643,713.730	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,140,000.000	4,788,263.110	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,640,000.000	3,619,625.100	
	DENMARK 2.25 11/15/26	1,210,000.000	1,216,915.150	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,540,000.000	1,565,225.200	
	DENMARK 4.5 11/15/39	6,550,000.000	8,397,922.020	
デンマーク・クローネ 小計		32,570,000.000	31,334,006.020	

		(683,318,600)	(657,387,446)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	950,000.000	841,906.150	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	380,000.000	359,884.150	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	758,472.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	271,377.420	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	1,410,000.000	1,228,639.740	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	790,000.000	670,024.700	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	810,000.000	582,249.540	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	729,519.110	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	910,000.000	875,221.910	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	131,810.650	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/36	100,000.000	99,950.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	817,245.510	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	200,000.000	207,475.260	
ニュージーランド・ドル 小計		8,510,000.000 (740,965,700)	7,573,776.140 (659,448,689)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,950,000.000	2,606,500.520	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,610,000.000	4,189,695.220	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,510,000.000	3,416,856.520	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,700,000.000	4,548,566.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,742,666.180	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,420,000.000	2,331,186.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,530,000.000	2,355,961.300	
	NORWAY 3.0 08/15/33	3,500,000.000	3,447,731.000	
	NORWAY 3.5 10/06/42	2,160,000.000	2,232,411.840	
NORWAY 3.625 04/13/34	1,350,000.000	1,390,245.790		
ノルウェー・クローネ 小計		30,650,000.000 (407,032,000)	29,261,820.370 (388,596,975)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,280,000.000	2,084,289.920	
	POLAND 04/25/26	1,000,000.000	933,300.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,720,000.000	3,801,035.420	
	POLAND 1.75 04/25/32	5,250,000.000	4,154,881.500	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,920,000.000	2,810,603.110	
	POLAND 2.5 07/25/27	5,060,000.000	4,768,740.060	
	POLAND 2.75 04/25/28	2,960,000.000	2,766,164.400	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,807,470.000	
	POLAND 3.75 05/25/27	2,620,000.000	2,557,449.460	
	POLAND 4.75 07/25/29	1,800,000.000	1,783,980.360	
	POLAND 5.0 10/25/34	850,000.000	833,462.580	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,190,000.000	3,297,356.260	
POLAND 6.0 10/25/33	890,000.000	941,580.390		
POLAND 7.5 07/25/28	3,400,000.000	3,712,259.400		

ポーランド・ズロチ 小計		38,940,000.000 (1,425,079,392)	36,252,572.860 (1,326,728,158)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,879,074.950	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,250,000.000	1,255,792.250	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,386,592.740	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,020,832.600	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,400,000.000	1,367,524.310	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,270,000.000	2,289,877.020	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,670,477.580	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,100,000.000	1,120,167.840	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,014,036.900	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	2,030,000.000	2,062,500.900	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,682,636.910	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,220,000.000	1,234,375.260	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,650,000.000	1,662,443.310	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,682,074.740	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	691,912.740	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,400,000.000	1,457,561.700	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,068,570.190	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,720,000.000	1,801,890.740	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,255,556.160	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,590,000.000	1,659,771.580	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,160,000.000	1,262,305.610	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	328,230.120	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,900,000.000	2,063,288.280	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,000,000.000	1,103,467.600	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,229,360.380		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,789,874.560		
マレーシア・リングgit 小計		37,920,000.000 (1,241,891,376)	39,040,196.970 (1,278,578,163)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	17,500,000.000	17,021,900.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	28,080,000.000	25,842,439.850	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,290,000.000	17,287,119.300	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	20,290,000.000	17,209,152.790	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	16,850,000.000	16,072,035.500	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	4,805,000.000	5,072,409.060	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	31,672,000.000	29,923,314.430	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	19,146,000.000	18,392,208.940	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,148,000.000	27,989,347.100	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	19,707,000.000	16,607,604.600	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	13,035,000.000	11,774,200.430	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	17,461,000.000	14,937,396.200	

	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	18,419,000.000	17,923,919.920	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	21,642,000.000	20,048,097.420	
	メキシコ・ペソ 小計	278,045,000.000 (2,034,816,724)	256,101,145.540 (1,874,225,013)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,280,000.000	1,125,978.230	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,360,000.000	1,163,582.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	770,000.000	484,715.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	640,000.000	474,880.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,406,200.640	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,190,000.000	1,138,446.210	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	360,000.000	171,907.200	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,055,000.000	1,002,909.370	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	355,951.130	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,330,000.000	1,288,893.020	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	146,828.450	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	600,000.000	535,515.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	310,000.000	305,520.810	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	330,000.000	251,521.870	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	118,199.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	460,000.000	371,128.000	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	457,374.550	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	309,314.630	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	670,000.000	658,130.950	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,150,000.000	1,177,734.320	
	AUSTRIA 2.9 02/20/34	450,000.000	460,395.000	
	AUSTRIA 2.9 05/23/29	400,000.000	410,394.200	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	565,353.250	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	420,000.000	431,445.920	
	AUSTRIA 3.2 07/15/39	150,000.000	155,205.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	480,000.000	568,922.950	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,153,022.060	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,010,000.000	1,044,766.220	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	681,689.050	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	1,030,000.000	961,265.510	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	874,440.570	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	1,100,000.000	965,855.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	1,050,000.000	888,615.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	780,000.000	522,778.620	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	382,824.590	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	960,000.000	923,208.710	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	887,830.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,240,000.000	1,162,085.840	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,340,000.000	1,309,870.100	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,440,000.000	1,311,816.960	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	860,000.000	775,436.200	
	BELGIUM 1.4 06/22/53	1,540,000.000	1,006,074.300	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	560,000.000	474,225.920	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	683,944.090	

BELGIUM 1. 7 06/22/50	1, 020, 000. 000	747, 077. 060	
BELGIUM 2. 15 06/22/66	450, 000. 000	341, 370. 000	
BELGIUM 2. 25 06/22/57	390, 000. 000	308, 564. 880	
BELGIUM 2. 75 04/22/39	320, 000. 000	311, 559. 590	
BELGIUM 2. 85 10/22/34	1, 520, 000. 000	1, 538, 447. 020	
BELGIUM 3. 0 06/22/33	1, 200, 000. 000	1, 237, 005. 000	
BELGIUM 3. 0 06/22/34	180, 000. 000	185, 262. 300	
BELGIUM 3. 3 06/22/54	420, 000. 000	417, 737. 460	
BELGIUM 3. 45 06/22/43	240, 000. 000	250, 213. 920	
BELGIUM 3. 75 06/22/45	640, 000. 000	695, 393. 590	
BELGIUM 4. 0 03/28/32	740, 000. 000	813, 627. 410	
BELGIUM 4. 25 03/28/41	1, 180, 000. 000	1, 357, 800. 610	
BELGIUM 4. 5 03/28/26	870, 000. 000	896, 999. 300	
BELGIUM 5. 0 03/28/35	1, 370, 000. 000	1, 647, 381. 160	
BELGIUM 5. 5 03/28/28	1, 600, 000. 000	1, 773, 776. 000	
BUNDESOBL 0. 0 04/10/26	3, 310, 000. 000	3, 198, 122. 000	
BUNDESOBL 0. 0 04/16/27	2, 460, 000. 000	2, 335, 878. 240	
BUNDESOBL 0. 0 10/09/26	2, 760, 000. 000	2, 643, 942. 000	
BUNDESOBL 1. 3 10/15/27	2, 580, 000. 000	2, 528, 529. 000	
BUNDESOBL 1. 3 10/15/27	1, 050, 000. 000	1, 029, 105. 000	
BUNDESOBL 2. 2 04/13/28	1, 700, 000. 000	1, 711, 645. 000	
BUNDESOBL 2. 4 10/19/28	2, 000, 000. 000	2, 030, 720. 000	
BUNDESSCHAT 2. 5 03/19/26	800, 000. 000	801, 880. 000	
BUNDESSCHAT 2. 7 09/17/26	2, 100, 000. 000	2, 120, 790. 000	
DEUTSCHLAND 0. 0 02/15/30	2, 020, 000. 000	1, 820, 727. 000	
DEUTSCHLAND 0. 0 02/15/31	1, 040, 000. 000	919, 068. 800	
DEUTSCHLAND 0. 0 02/15/32	2, 050, 000. 000	1, 773, 291. 000	
DEUTSCHLAND 0. 0 05/15/35	1, 460, 000. 000	1, 160, 218. 200	
DEUTSCHLAND 0. 0 05/15/36	2, 380, 000. 000	1, 838, 621. 400	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/30	1, 530, 000. 000	1, 366, 182. 900	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/30	1, 390, 000. 000	1, 239, 282. 300	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/31	2, 490, 000. 000	2, 177, 455. 200	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/31	1, 400, 000. 000	1, 224, 888. 690	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/50	2, 540, 000. 000	1, 382, 683. 280	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/50	1, 140, 000. 000	619, 099. 800	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/52	1, 290, 000. 000	670, 658. 100	
DEUTSCHLAND 0. 0 11/15/27	1, 620, 000. 000	1, 522, 054. 800	
DEUTSCHLAND 0. 0 11/15/28	1, 660, 000. 000	1, 533, 255. 680	
DEUTSCHLAND 0. 25 02/15/27	2, 970, 000. 000	2, 847, 487. 500	
DEUTSCHLAND 0. 25 02/15/29	1, 630, 000. 000	1, 515, 688. 100	
DEUTSCHLAND 0. 25 08/15/28	1, 770, 000. 000	1, 658, 525. 400	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/26	3, 860, 000. 000	3, 765, 044. 000	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/28	2, 120, 000. 000	2, 019, 596. 800	
DEUTSCHLAND 0. 5 08/15/27	2, 610, 000. 000	2, 503, 268. 600	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2, 290, 000. 000	2, 200, 919. 000	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2, 690, 000. 000	2, 448, 027. 770	
DEUTSCHLAND 1. 0 05/15/38	2, 160, 000. 000	1, 828, 699. 200	

DEUTSCHLAND 1. 25 08/15/48	2, 420, 000. 000	1, 915, 614. 500	
DEUTSCHLAND 1. 7 08/15/32	1, 580, 000. 000	1, 545, 603. 400	
DEUTSCHLAND 1. 8 08/15/53	2, 400, 000. 000	2, 103, 216. 000	
DEUTSCHLAND 1. 8 08/15/53	900, 000. 000	788, 985. 000	
DEUTSCHLAND 2. 1 11/15/29	1, 800, 000. 000	1, 807, 938. 000	
DEUTSCHLAND 2. 2 02/15/34	900, 000. 000	908, 370. 000	
DEUTSCHLAND 2. 3 02/15/33	1, 950, 000. 000	1, 989, 604. 500	
DEUTSCHLAND 2. 3 02/15/33	2, 000, 000. 000	2, 039, 840. 000	
DEUTSCHLAND 2. 4 11/15/30	1, 300, 000. 000	1, 328, 548. 000	
DEUTSCHLAND 2. 5 07/04/44	2, 220, 000. 000	2, 244, 508. 800	
DEUTSCHLAND 2. 5 08/15/46	2, 240, 000. 000	2, 269, 915. 200	
DEUTSCHLAND 2. 5 08/15/54	1, 460, 000. 000	1, 490, 543. 200	
DEUTSCHLAND 2. 6 08/15/33	1, 900, 000. 000	1, 983, 201. 000	
DEUTSCHLAND 3. 25 07/04/42	1, 080, 000. 000	1, 209, 427. 200	
DEUTSCHLAND 4. 0 01/04/37	1, 730, 000. 000	2, 049, 306. 100	
DEUTSCHLAND 4. 25 07/04/39	1, 280, 000. 000	1, 578, 816. 000	
DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/28	1, 180, 000. 000	1, 296, 407. 000	
DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/34	1, 720, 000. 000	2, 114, 516. 400	
DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/40	1, 610, 000. 000	2, 108, 906. 800	
DEUTSCHLAND 5. 5 01/04/31	1, 720, 000. 000	2, 066, 838. 000	
DEUTSCHLAND 5. 625 01/04/28	1, 140, 000. 000	1, 267, 885. 200	
DEUTSCHLAND 6. 25 01/04/30	840, 000. 000	1, 015, 518. 000	
DEUTSCHLAND 6. 5 07/04/27	1, 250, 000. 000	1, 399, 125. 000	
FINLAND 0. 0 09/15/26	100, 000. 000	95, 510. 000	
FINLAND 0. 0 09/15/30	110, 000. 000	95, 379. 240	
FINLAND 0. 125 04/15/36	180, 000. 000	133, 448. 400	
FINLAND 0. 125 04/15/52	640, 000. 000	311, 936. 000	
FINLAND 0. 125 09/15/31	700, 000. 000	596, 011. 500	
FINLAND 0. 25 09/15/40	290, 000. 000	192, 835. 850	
FINLAND 0. 5 04/15/26	460, 000. 000	446, 973. 020	
FINLAND 0. 5 04/15/43	380, 000. 000	249, 406. 980	
FINLAND 0. 5 09/15/27	400, 000. 000	380, 257. 600	
FINLAND 0. 5 09/15/28	650, 000. 000	606, 127. 600	
FINLAND 0. 5 09/15/29	770, 000. 000	703, 194. 800	
FINLAND 0. 75 04/15/31	700, 000. 000	628, 784. 440	
FINLAND 0. 875 09/15/25	410, 000. 000	403, 082. 780	
FINLAND 1. 125 04/15/34	480, 000. 000	420, 163. 200	
FINLAND 1. 375 04/15/27	210, 000. 000	205, 381. 260	
FINLAND 1. 375 04/15/47	280, 000. 000	209, 797. 000	
FINLAND 1. 5 09/15/32	450, 000. 000	416, 995. 200	
FINLAND 2. 625 07/04/42	400, 000. 000	384, 789. 480	
FINLAND 2. 75 04/15/38	370, 000. 000	365, 872. 910	

FINLAND 2.75 07/04/28	320,000.000	325,664.000	
FINLAND 2.875 04/15/29	400,000.000	409,240.000	
FINLAND 2.95 04/15/55	60,000.000	59,364.000	
FINLAND 3.0 09/15/33	600,000.000	619,957.500	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	1,830,000.000	1,767,198.970	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	3,700,000.000	3,494,873.840	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,790,000.000	3,107,421.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,610,000.000	3,182,557.030	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,980,000.000	3,414,083.800	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	5,770,000.000	4,806,611.950	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,120,000.000	2,980,695.120	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	4,660,000.000	4,514,719.840	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,390,000.000	3,101,090.640	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,950,000.000	1,320,576.070	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	302,155.250	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,490,000.000	905,967.680	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,780,000.000	3,579,012.670	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,690,000.000	4,422,707.520	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,250,000.000	1,217,985.750	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,460,000.000	1,298,867.060	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,800,000.000	3,551,411.600	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,960,000.000	3,821,536.610	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,560,000.000	3,102,760.720	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,590,000.000	2,998,009.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,400,000.000	1,118,040.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,080,000.000	4,760,953.140	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,420,000.000	1,670,108.540	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	940,000.000	618,819.150	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,450,000.000	2,072,659.570	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,540,090.500	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	3,550,000.000	3,378,358.350	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,650,000.000	3,652,687.120	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,450,000.000	1,302,422.980	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,320,000.000	4,329,496.220	
FRANCE OAT 2.5 09/24/27	1,300,000.000	1,304,611.100	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,710,000.000	3,755,976.170	
FRANCE OAT 2.75 02/25/30	1,000,000.000	1,011,614.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,240,000.000	4,287,700.000	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	2,700,000.000	2,761,006.500	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	900,000.000	834,825.020	
FRANCE OAT 3.0 06/25/49	500,000.000	475,915.750	
FRANCE OAT 3.0 11/25/34	1,000,000.000	1,014,695.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,340,000.000	2,343,080.600	
FRANCE OAT 3.25 05/25/55	1,300,000.000	1,259,329.500	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,850,000.000	3,913,419.120	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	400,000.000	424,273.200	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,703,970.940	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,643,073.780	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,540,000.000	1,706,619.820	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,490,000.000	2,923,543.080	

FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,732,368.860	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,800,000.000	3,164,434.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,210,000.000	3,924,786.750	
IRISH 0.0 10/18/31	670,000.000	570,042.700	
IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	399,066.980	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	310,079.900	
IRISH 0.4 05/15/35	520,000.000	416,817.170	
IRISH 0.55 04/22/41	290,000.000	205,491.100	
IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	679,399.340	
IRISH 1.0 05/15/26	890,000.000	870,978.450	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	694,647.900	
IRISH 1.3 05/15/33	290,000.000	265,849.520	
IRISH 1.35 03/18/31	540,000.000	510,161.760	
IRISH 1.5 05/15/50	550,000.000	418,460.610	
IRISH 1.7 05/15/37	780,000.000	699,805.860	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	734,947.920	
IRISH 2.4 05/15/30	670,000.000	675,284.610	
IRISH 3.0 10/18/43	280,000.000	288,647.090	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,945,260.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,850,000.000	1,765,085.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,345,974.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,900,000.000	1,722,635.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,563,912.140	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,420,000.000	1,208,734.880	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,646,901.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,510,000.000	1,324,141.650	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,180,000.000	871,312.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,680,000.000	1,433,880.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,208,115.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,603,056.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,470,679.350	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,900,000.000	1,834,355.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,980,000.000	1,928,133.900	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,708,456.500	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,320,000.000	1,066,692.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	510,000.000	339,966.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,290,000.000	1,169,520.450	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,340,000.000	2,166,152.040	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,170,000.000	743,800.000	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	869,515.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,160,000.000	1,138,888.570	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	350,000.000	347,274.060	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,678,174.970	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,840,000.000	1,826,165.040	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	227,448.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	960,000.000	666,336.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,577,280.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	750,000.000	656,925.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,080,000.000	1,015,170.290	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,480,000.000	1,119,768.000	

ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,277,690.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,520,000.000	1,524,712.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,270,000.000	1,041,019.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	500,000.000	380,900.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,800,000.000	1,802,880.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,951,310.200	
ITALY BTPS 2.95 02/15/27	1,300,000.000	1,310,530.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	220,000.000	200,882.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,210,000.000	2,233,853.630	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	560,000.000	515,677.680	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	572,760.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,244,934.210	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,420,000.000	1,411,153.400	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,150,000.000	1,179,325.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,140,000.000	1,053,350.300	
ITALY BTPS 3.45 07/15/27	1,500,000.000	1,535,400.000	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,310,000.000	1,323,231.000	
ITALY BTPS 3.5 02/15/31	900,000.000	923,940.000	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,000,000.000	1,040,500.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,526,942.250	
ITALY BTPS 3.85 07/01/34	880,000.000	914,496.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.000	1,076,080.500	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	1,600,000.000	1,639,520.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,783,300.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,040,000.000	2,137,920.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,560,000.000	1,643,460.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,500,000.000	1,595,100.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	1,055,900.000	
ITALY BTPS 4.05 10/30/37	1,300,000.000	1,356,550.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	560,000.000	583,352.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	720,000.000	769,824.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	2,200,000.000	2,383,480.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,400,000.000	1,523,620.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,500,000.000	1,601,850.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,165,071.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	770,000.000	823,438.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,180,000.000	2,348,813.750	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,460,000.000	1,625,031.100	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,360,000.000	2,684,500.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,890,000.000	2,153,277.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,650,000.000	1,878,360.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,950,728.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,160,000.000	2,557,224.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,260,000.000	2,670,416.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,247,783.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,250,000.000	1,372,000.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,280,000.000	1,219,020.800	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,240,000.000	1,130,532.170	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,240,000.000	881,817.320	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,330,000.000	670,564.370	

NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,200,000.000	1,056,934.480	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,900,000.000	1,633,407.030	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	760,000.000	694,022.120	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	760,000.000	560,820.330	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,560,000.000	1,513,402.800	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,400,000.000	1,222,489.380	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	963,053.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	630,000.000	598,160.430	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	578,056.040	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	380,000.000	385,593.980	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,310,000.000	1,327,365.600	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	350,000.000	354,040.400	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	500,000.000	504,000.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,290,000.000	1,319,847.360	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	590,000.000	644,696.770	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,490,000.000	1,721,581.760	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,020,000.000	1,176,774.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,290,000.000	1,429,191.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,584,003.840	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,010,000.000	1,900,053.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,880,000.000	1,733,736.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,830,000.000	1,553,304.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,614,609.900	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,540,000.000	1,331,106.700	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,130,000.000	1,029,955.450	
SPAIN 0.7 04/30/32	2,850,000.000	2,470,260.300	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,000,000.000	955,900.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,567,315.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,600,000.000	1,214,077.970	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,440,000.000	987,120.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,590,000.000	917,171.620	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,020,000.000	751,206.270	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,150,000.000	1,993,050.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,130,000.000	2,083,592.620	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,470,000.000	1,421,039.810	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,470,000.000	1,416,712.500	
SPAIN 1.45 04/30/29	2,050,000.000	1,963,664.250	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,809,707.460	
SPAIN 1.45 10/31/71	660,000.000	345,732.220	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,660,000.000	1,623,812.000	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,640,000.000	1,473,100.480	
SPAIN 1.9 10/31/52	1,370,000.000	969,130.100	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,518,042.140	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,070,000.000	2,008,262.250	

	SPAIN 2.35 07/30/33	1,570,000.000	1,513,637.000	
	SPAIN 2.5 05/31/27	1,500,000.000	1,503,675.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,700,155.500	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,560,000.000	1,359,348.890	
	SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,809,018.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,188,294.240	
	SPAIN 3.1 07/30/31	1,200,000.000	1,241,409.600	
	SPAIN 3.15 04/30/33	1,570,000.000	1,615,898.950	
	SPAIN 3.25 04/30/34	1,270,000.000	1,310,012.620	
	SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	739,731.380	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	1,070,745.760	
	SPAIN 3.45 10/31/34	1,050,000.000	1,098,378.750	
	SPAIN 3.5 05/31/29	1,300,000.000	1,359,504.250	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,020,000.000	1,079,058.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	260,000.000	278,882.500	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,660,000.000	1,850,879.250	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,080,000.000	1,268,939.730	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,273,664.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,660,000.000	1,834,383.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,509,645.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,635,000.000	1,989,004.470	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,330,000.000	2,475,665.070	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,250,129.000	
	ユーロ 小計	510,125,000.000 (79,860,068,750)	484,468,262.190 (75,843,506,446)	
国債証券 合計		263,096,916,424.500 (263,096,916,425)	249,709,830,315 (249,709,830,315)	
合計			249,709,830,315 (249,709,830,315)	

(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 249銘柄	46.02	46.68
イギリス・ポンド	国債証券 61銘柄	5.42	5.50
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	0.30	0.30
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	1.29	1.31
オフショア・人民元	国債証券 63銘柄	10.63	10.78
カナダ・ドル	国債証券 37銘柄	1.97	2.00
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.41	0.41
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.16	0.16
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.26	0.26
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	0.26	0.26
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.15	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.52	0.53
マレーシア・リンギット	国債証券 26銘柄	0.50	0.51

メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.74	0.75
ユーロ	国債証券	350銘柄	29.94	30.37

(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。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間（2024年9月18日から2025年3月17日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2025年5月23日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOneグローバルバランスの2024年9月18日から2025年3月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、Oneグローバルバランスの2025年3月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年9月18日から2025年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的な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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

【中間財務諸表】

【Oneグローバルバランス】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2024年9月17日現在	第4期中間計算期間末 2025年3月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,789,824	49,168,943
親投資信託受益証券	1,371,945,209	1,818,154,567
未収入金	5,500,000	—
流動資産合計	1,402,235,033	1,867,323,510
資産合計	1,402,235,033	1,867,323,510
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,802,702	8,578,796
未払受託者報酬	187,658	275,784
未払委託者報酬	6,256,650	9,194,327
その他未払費用	22,183	32,643
流動負債合計	11,269,193	18,081,550
負債合計	11,269,193	18,081,550
純資産の部		
元本等		
元本	1,200,490,553	1,538,876,746
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	190,475,287	310,365,214
(分配準備積立金)	14,067,173	10,748,825
元本等合計	1,390,965,840	1,849,241,960
純資産合計	1,390,965,840	1,849,241,960
負債純資産合計	1,402,235,033	1,867,323,510

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期中間計算期間 自 2023年9月20日 至 2024年3月19日	第4期中間計算期間 自 2024年9月18日 至 2025年3月17日
営業収益		
受取利息	38	75,631
有価証券売買等損益	60,595,870	53,109,358
営業収益合計	60,595,908	53,184,989
営業費用		
支払利息	1,756	—
受託者報酬	90,844	275,784
委託者報酬	3,029,417	9,194,327
その他費用	10,699	32,643
営業費用合計	3,132,716	9,502,754
営業利益又は営業損失(△)	57,463,192	43,682,235
経常利益又は経常損失(△)	57,463,192	43,682,235
中間純利益又は中間純損失(△)	57,463,192	43,682,235
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	8,097,331	19,519,287
期首剰余金又は期首欠損金(△)	30,196,961	190,475,287
剰余金増加額又は欠損金減少額	67,644,027	159,296,025
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	67,644,027	159,296,025
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,807,584	63,569,046
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,807,584	63,569,046
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	122,399,265	310,365,214

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期中間計算期間	
	自 2024年9月18日	至 2025年3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年9月16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2024年9月17日、当中間計算期間末日を2025年3月17日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期中間計算期間末
	2024年9月17日現在	2025年3月17日現在
1. 期首元本額	395,993,814円	1,200,490,553円
期中追加設定元本額	1,424,544,061円	706,153,400円
期中一部解約元本額	620,047,322円	367,767,207円
2. 受益権の総数	1,200,490,553口	1,538,876,746口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期中間計算期間末
	2024年9月17日現在	2025年3月17日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった	同左

場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 2024年9月17日現在	第4期中間計算期間末 2025年3月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1587円 (11,587円)	1,2017円 (12,017円)

(参考)

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2025年3月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,011,458,210
株式	594,226,576,900
派生商品評価勘定	256,295,010
未収入金	6,072,035,091
未収配当金	915,011,335
差入委託証拠金	438,869,601
流動資産合計	619,920,246,147
資産合計	619,920,246,147
負債の部	
流動負債	
前受金	151,890,000
未払解約金	16,836,708,000
流動負債合計	16,988,598,000
負債合計	16,988,598,000
純資産の部	
元本等	
元本	122,815,492,684
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	480,116,155,463
元本等合計	602,931,648,147
純資産合計	602,931,648,147
負債純資産合計	619,920,246,147

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年9月18日 至 2025年3月17日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年3月17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	121,209,440,968円
同期中追加設定元本額	16,733,891,673円
同期中一部解約元本額	15,127,839,957円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,296,042,692円
たわらノーロード 国内株式くらっ専用	4,266,903,974円
One DC 国内株式インデックスファンド	35,152,266,208円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,649,839,316円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,766,612円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	7,288,766円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	17,419,063円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,614,045円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	20,539,997円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	8,814,406円
たわらノーロード TOPIX	3,777,127,632円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,132,480,569円
たわらノーロード バランス (堅実型)	50,855,695円
たわらノーロード バランス (標準型)	423,994,086円
たわらノーロード バランス (積極型)	800,693,235円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	2,847,222円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	210,614,194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)	593,974,028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)	524,953,170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)	720,325,511円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	507,048円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,325,371円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	42,648,549円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	13,858,691円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	23,401,711円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (安定型)	26,773円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (バランス型)	1,019,741円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (積極型)	1,024,575円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	32,443,975,538円
O n eグローバルバランス	111,630,793円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	907,867,924円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,292,222,190円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	4,084,240,016円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	248,924,693円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	856,827,602円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,052,536,327円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,939,298円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	967,311,894円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,368,768円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	254,845,664円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	327,463,394円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	592,083,167円
投資のソムリエ	5,014,478,497円
クルーズコントロール	51,389,611円
投資のソムリエ<DC年金>	705,630,533円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	372,546,296円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,422,602,498円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	189,572,211円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	462,657,095円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	104,378,709円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	56,480,648円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	1,986,392円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	236,975,747円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	673,988,290円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	79,351,392円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	232,638,549円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	87,087,931円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	61,207,706円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	37,184,865円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	781,130,547円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	10,884,754円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,511,952円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	35,930,164円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2070)	62,281円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	18,775,847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)	18,762,745円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	16,228,017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)	11,233,335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)	17,668,001円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	47,642,297円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き） 2021-05（適格機関投資家限定）	13,894,671円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き） 2021-06（適格機関投資家限定）	98,288,183円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き） 2021-07（適格機関投資家限定）	22,883,654円
日本株40・外債60配分戦略ファンド2021-07（適格機関投資家限定）	359,089,128円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き） 2021-08（適格機関投資家限定）	16,142,258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）	12,595,545円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き） 2021-09（適格機関投資家限定）	15,937,683円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き） 2021-12（適格機関投資家限定）	23,089,594円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き） 2022-05（適格機関投資家限定）	76,439,616円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き） 2022-10（適格機関投資家限定）	350,695,153円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01（適格機関投資家限定）	30,609,808円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き） 2024-05（適格機関投資家限定）	354,638,993円
AMONE TOPIXインデックスファンド2025-01（適格機関投資家限定）	844,662,759円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	102,614,275円
AMONEマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	5,862,690円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	19,338,797円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	92,930,188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）	31,277,581円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	2,533,565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）	27,168,202円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	59,348,325円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,024,315円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	8,895,910円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,654,195円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	77,514円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	41,153円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	959,604円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	194,827,812円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	334,786,038円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,060,333,574円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	8,741,960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）	11,577,839円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	103,936,202円

D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	20,316,429円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	51,110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)	92,855,986円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	6,823,862円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	20,260,499円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	42,829,929円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	53,178,013円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	14,184,962円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	5,144,296円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,619,100円
コア資産形成ファンド	10,266,395円
MHAMトピックファンド	731,544,855円
MHAM T O P I XファンドV A (適格機関投資家専用)	41,420,288円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	2,736,954,406円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2,797,813,080円
計	122,815,492,684円
2. 受益権の総数	122,815,492,684口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年3月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2025年3月17日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買建	8,012,475,000	—	8,268,870,000	256,395,000
合計	8,012,475,000	—	8,268,870,000	256,395,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2025年3月17日現在
1口当たり純資産額	4,9092円
(1万口当たり純資産額)	(49,092円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2025年3月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,421,462,863
コール・ローン	22,070,136,694
株式	1,674,990,886,219
投資信託受益証券	2,203,990,739
投資証券	29,692,706,277
派生商品評価勘定	3,666,078
未収入金	12,388,831
未収配当金	2,328,233,665
差入委託証拠金	14,457,726,125
流動資産合計	1,753,181,197,491
資産合計	1,753,181,197,491
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,057,791,530
未払解約金	21,970,616,000
流動負債合計	23,028,407,530
負債合計	23,028,407,530
純資産の部	
元本等	
元本	182,572,791,075
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,547,579,998,886
元本等合計	1,730,152,789,961
純資産合計	1,730,152,789,961
負債純資産合計	1,753,181,197,491

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年9月18日 至 2025年3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年3月17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	172, 295, 819, 280円
同期中追加設定元本額	24, 118, 160, 590円
同期中一部解約元本額	13, 841, 188, 795円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,926,068,450円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	1,127,962円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	5,575,963円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	13,813,163円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	13,805,778円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	15,723,764円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	6,991,287円
たわらノーロード 先進国株式	75,936,374,168円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,998,896,105円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,079,471,815円
たわらノーロード バランス (堅実型)	71,906,390円
たわらノーロード バランス (標準型)	814,095,342円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,233,807,932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)	41,230,619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)	289,974,060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)	346,440,405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)	572,679,864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)	504,916円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	19,130,868円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	7,979,030円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	17,453,490円
たわらノーロード 全世界株式	9,231,385,330円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (安定型)	9,019円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (バランス型)	286,249円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (積極型)	241,127円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	58,858,048,139円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3,942,831,779円
O n e グローバルバランス	55,875,675円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	115,905,642円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	644,198,928円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	949,128,078円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	61,908,507円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	181,102,232円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	205,805,911円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	15,485,551円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	600,069,666円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	108,251,992円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	126,309,963円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	161,839,132円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	290,593,833円
投資のソムリエ	5,163,123,608円
クルーズコントロール	12,087,277円
投資のソムリエ<DC年金>	726,351,686円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	183,717,721円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	330,039,377円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	448,579,657円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,096,296,935円
ワールドアセットバランス (基本コース)	112,249,588円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	202,829,314円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	86,982,097円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	47,089,506円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	4,702,008円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	236,897,574円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	167,604,296円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	329,981,802円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	115,400,239円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	99,154,600円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	51,188,866円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	31,094,664円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	191,883,525円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	9,042,065円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	26,787,858円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070）	50,483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）	729,745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）	761,910円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08（適格機関投資家限定）	2,052,808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）	489,458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）	189,810円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04（適格機関投資家限定）	1,934,580円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	10,043,565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）	508,236円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	13,468,060円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01（適格機関投資家限定）	1,286,565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）	372,578,946円
DIAM外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	13,300,281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）	966,466,896円
外国株式パッシブ・ファンド2（適格機関投資家限定）	1,019,453,449円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	105,615,213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）	1,652,452円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	4,051,058円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,271,143円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	2,606,999円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	13,296,132円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	29,039,895円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	989,588円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	6,532,408円

D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	648,581円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	25,325円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	20,149円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	704,606円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	63,528,854円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	143,317,870円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	518,820,228円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	21,270,361円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	16,754,923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)	102,452,889円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	3,299,260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)	112,042円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	30,280,017円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,339,416円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	9,915,280円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	13,971,225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)	26,017,963円
動的パッケージファンド<DC年金>	12,993,570円
コア資産形成ファンド	5,195,588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>	2,526,724,846円
MHAM外国株式インデックスファンド	126,433,036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>	766,336,805円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,372,022,254円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,604,821,138円
計	182,572,791,075円
2. 受益権の総数	182,572,791,075口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年3月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2025年3月17日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	327,360,000	—	—	327,372,760	12,760
合計	327,360,000	—	—	327,372,760	12,760

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2025年3月17日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	24,389,825,239	—	—	23,335,687,027	△1,054,138,212
合計	24,389,825,239	—	—	23,335,687,027	△1,054,138,212

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2025年3月17日現在	
1口当たり純資産額	9.4765円
(1万口当たり純資産額)	(94,765円)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2025年3月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,598,629,243
国債証券	386,001,548,450
地方債証券	25,218,467,761
特殊債券	22,997,052,033
社債券	20,306,673,800
未収入金	1,212,957,000
未収利息	1,214,093,941
前払費用	210,250,549
流動資産合計	460,759,672,777
資産合計	460,759,672,777
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,077,809,000
流動負債合計	3,077,809,000
負債合計	3,077,809,000
純資産の部	
元本等	
元本	389,948,619,314
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	67,733,244,463
元本等合計	457,681,863,777
純資産合計	457,681,863,777
負債純資産合計	460,759,672,777

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年9月18日 至 2025年3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年3月17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	439,336,848,356円
同期中追加設定元本額	157,751,734,723円
同期中一部解約元本額	207,139,963,765円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	31,744,571,727円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	44,590,897円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	84,885,076円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	47,435,883円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	545,814,761円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	239,210,884円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	24,001,332円
たわらノーロード 国内債券	20,594,752,272円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	8,451,427,723円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,840,694,477円
たわらノーロード バランス（標準型）	4,097,320,824円
たわらノーロード バランス（積極型）	631,247,525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）	188,118,315円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	2,587,321,247円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	3,160,946,455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）	826,638,402円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	58,288,713円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	23,403,753円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	193,233,289円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	11,491,056円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	16,586円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	151,981円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,523,341,281円
O n e グローバルバランス	303,683,389円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	12,700,260,294円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	19,287,486,982円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	9,196,968,137円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,641,077,519円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	3,010,217,894円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	608,872,494円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	89,984,128円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,493,217,908円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,772,050円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	5,948,354,506円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,772,988,169円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	600,160,258円
投資のソムリエ	37,593,141,904円
クルーズコントロール	204,596,615円
投資のソムリエ<DC年金>	5,297,573,972円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	8,635,547,139円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	3,222,249,641円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	11,811,969,337円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	29,097,050,723円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	368,104,232円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	199,183,177円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	123,573,267円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,315,137,647円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,103,922,519円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	9,902,267,162円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,118,831,339円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	537,260,714円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	218,749,979円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	131,408,983円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,954,190,416円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	38,385,428円
O n e グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	171,336,010円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	219,890円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,205,881,316円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,210,725,675円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	797,819,560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)	728,330,287円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,203,589,965円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	3,075,781,752円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	2,063,342,476円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	821,396,176円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	2,096,602,145円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	1,981,828,328円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,977,553,663円
O n e コアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	42,158,175円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	769,526,385円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	202,921,355円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	256,162,893円
O n e 収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	82,625,295円

One 収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ (適格機関投資家限定)	85,373,971円
One 収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ (適格機関投資家限定)	82,365,873円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	2,020,014,842円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s 用) (適格機関投資家専用)	18,932,652円
AMOne コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	16,647,602円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	131,462,790円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	95,659,233円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	19,018,623円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	53,817,755円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	26,716,716円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	417,911円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	250,337円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	5,806,203円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,093,275,061円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,024,341,647円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,270,078,088円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	52,953,840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)	116,649,080円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,276,256,540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)	81,824,347円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	620,593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)	998,526,690円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	27,481,435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)	163,476,898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)	230,000,685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)	357,046,909円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	189,024,566円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	48,351,094円
コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,250,989円
動的パッケージファンド<DC年金>	333,943,390円
コア資産形成ファンド	134,675,492円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	13,376,552,451円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	35,781,500,176円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	24,524,227,389円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	170,877,688円
計	389,948,619,314円
2. 受益権の総数	389,948,619,314口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年3月17日現在

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

(デリバティブ取引等に関する注記)
該当事項はありませぬ。

(1口当たり情報に関する注記)

	2025年3月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1737円 (11,737円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2025年3月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	889,066,595
コール・ローン	2,787,982,843
国債証券	256,015,030,348
派生商品評価勘定	9,014,189
未収入金	13,504,351,711
未収利息	2,214,936,457
前払費用	231,174,505
流動資産合計	275,651,556,648
資産合計	275,651,556,648
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	720,665
未払金	2,095,223,281
未払解約金	286,637,000
流動負債合計	2,382,580,946
負債合計	2,382,580,946
純資産の部	
元本等	
元本	114,672,796,657
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	158,596,179,045
元本等合計	273,268,975,702
純資産合計	273,268,975,702
負債純資産合計	275,651,556,648

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年9月18日 至 2025年3月17日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年3月17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	109,119,510,468円
同期中追加設定元本額	21,961,230,739円
同期中一部解約元本額	16,407,944,550円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,736,295,684円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	1,342,501円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	9,289,813円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	27,784,844円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	16,425,401円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	26,178,264円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	14,062,757円
たわらノーロード 先進国債券	23,669,449,408円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	4,359,099,597円
たわらノーロード バランス（堅実型）	77,443,666円
たわらノーロード バランス（標準型）	491,112,260円
たわらノーロード バランス（積極型）	124,845,710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）	17,263,824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）	975,614,239円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	1,873,043,962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）	992,607,796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）	758,632,237円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,703,114円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	12,483,097円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	171,789,166円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	36,118,085円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	28,047,508円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	66,500円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	77,811円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	38,895円

D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	7,014,195,960円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	3,020,503,056円
O n e グローバルバランス	161,224,361円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1 安定型	772,852,058円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	2,676,159,074円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3 成長型	3,303,667,861円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	379,943,218円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	846,031,452円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	858,606,772円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,571,338円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	952,077,302円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,134,851円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	156,797,134円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	176,543,663円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	296,942,647円
クルーズコントロール	151,789,072円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	225,130,824円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,168,020,736円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	1,014,083,225円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	189,008,874円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	796,161,739円
O n e グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	5,018,564円
O n e グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	43,094,655円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	821,364,544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)	444,252,315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)	445,615,390円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	164,204,341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)	268,375,167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)	85,337,073円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	1,132,530,809円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	167,628,472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)	300,452,929円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	203,753,272円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	720,537,351円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,907,817,138円
D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,344,747,856円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,507,097,277円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	21,919,645円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	38,921,254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)	743,940,792円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限	263,044,380円

定)	
D I A M グローバル・バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	191, 437, 940円
D I A M 国際分散バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	9, 514, 554円
D I A M 国際分散バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	17, 934, 046円
D I A M 国内重視バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	5, 343, 747円
D I A M 国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	52, 200円
D I A M 世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	125, 070円
D I A M 世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	1, 934, 982円
D I A M バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	915, 305, 431円
D I A M バランスファンド3 7. 5 V A (適格機関投資家限定)	1, 095, 594, 234円
D I A M バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2, 133, 961, 394円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	44, 129, 270円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	81, 605, 769円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	842, 137, 281円
D I A M 世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	149, 210, 451円
D I A M 世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	154, 700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)	124, 746, 646円
D I A M 世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	114, 946, 377円
D I A M 世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	142, 730, 023円
D I A M 世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	28, 637, 102円
動的パッケージファンド<DC年金>	56, 806, 041円
コア資産形成ファンド	22, 352, 187円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジなし)<ラップ専用>	1, 059, 651, 183円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジあり)<ラップ専用>	15, 501, 702, 179円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5, 895, 370, 274円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	5, 985, 498, 996円
計	114, 672, 796, 657円
2. 受益権の総数	114, 672, 796, 657口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年3月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引

における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2025年3月17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				
アメリカ・ドル	13,151,094,000	—	13,151,721,912	△627,912
イギリス・ポンド	6,290,867,000	—	6,291,112,208	△245,208
イスラエル・シェケル	697,117,000	—	697,141,634	△24,634
オーストラリア・ドル	35,678,000	—	35,835,407	△157,407
オフショア・人民元	163,583,000	—	163,572,581	10,419
カナダ・ドル	1,483,980,000	—	1,483,900,665	79,335
シンガポール・ドル	258,706,000	—	258,703,001	2,999
ニュージーランド・ドル	38,663,000	—	38,667,676	△4,676
ニュージーランド・ドル	30,717,000	—	30,718,507	△1,507
ノルウェー・クローネ	40,139,000	—	40,144,162	△5,162
ポーランド・ズロチ	65,027,000	—	65,070,750	△43,750
メキシコ・ペソ	107,860,000	—	107,966,920	△106,920
ユーロ	3,938,757,000	—	3,938,888,401	△131,401
買建	1,900,001,000	—	1,908,922,436	8,921,436
アメリカ・ドル	896,122,000	—	899,349,611	3,227,611
イギリス・ポンド	100,416,000	—	100,576,645	160,645
オーストラリア・ドル	29,146,000	—	29,449,592	303,592
オフショア・人民元	213,290,000	—	214,563,902	1,273,902
カナダ・ドル	46,040,000	—	46,381,525	341,525
メキシコ・ペソ	46,040,000	—	46,381,525	341,525
ユーロ	32,042,000	—	32,424,362	382,362
ユーロ	582,945,000	—	586,176,799	3,231,799
合計	15,051,095,000	—	15,060,644,348	8,293,524

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2025年3月17日現在
1口当たり純資産額	2.3830円

(1万口当たり純資産額)

(23,830円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2025年3月31日現在

I 資産総額	1,860,408,405円
II 負債総額	10,280,432円
III 純資産総額 (I - II)	1,850,127,973円
IV 発行済数量	1,548,081,978口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.1951円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

2025年3月31日現在

I 資産総額	597,906,666,841円
II 負債総額	1,370,746,813円
III 純資産総額 (I - II)	596,535,920,028円
IV 発行済数量	124,254,150,618口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	4.8009円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年3月31日現在

I 資産総額	1,761,203,954,852円
II 負債総額	2,310,984,701円
III 純資産総額 (I - II)	1,758,892,970,151円
IV 発行済数量	186,359,589,830口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	9.4382円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年3月31日現在

I 資産総額	473,596,369,645円
II 負債総額	7,175,718,000円
III 純資産総額 (I - II)	466,420,651,645円
IV 発行済数量	395,960,265,180口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.1779円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2025年3月31日現在

I 資産総額	276,717,142,541円
II 負債総額	1,776,079,252円
III 純資産総額 (I - II)	274,941,063,289円
IV 発行済数量	114,435,873,953口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.4026円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2025年3月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2025年4月1日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は原則として月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用担当部署の部長等で構成されます。

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年3月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,485,279,038,668
追加型株式投資信託	762	16,677,329,011,040
単位型公社債投資信託	22	30,146,192,297
単位型株式投資信託	189	995,677,070,890
合計	999	19,188,431,312,895

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第39期事業年度（自2023年4月1日至2024年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第40期中間会計期間（自2024年4月1日至2024年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年5月23日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長 谷 川 敬

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲 葉 宏 和

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 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	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

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

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

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p>	<p>時価法</p>
<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<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>
<p>4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>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。</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p>	<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。</p> <p>①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</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>
<p>6. 収益及び費用の計上基準</p>	<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>

(1) 委託者報酬

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

(2) 運用受託報酬

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

(3) 投資助言報酬

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

(4) 成功報酬

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

注記事項

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

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

(損益計算書関係)

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

(百万円)

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

※2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

(百万円)

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

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

(株主資本等変動計算書関係)

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

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

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

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

(百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第38期（2023年3月31日現在）

(百万円)

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

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

第39期（2024年3月31日現在）

(百万円)

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

該当はありません。

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)	
	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	△191	△246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

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

	(百万円)	
	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,698	2,760
未積立退職給付債務	2,698	2,760
未認識数理計算上の差異	△44	△40
未認識過去勤務費用	0	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719
退職給付引当金	2,654	2,719
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

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

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

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

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(持分法損益等)

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	7,474	未払 手数料	1,579
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	13,932	未払 手数料	2,404

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	8,140	未払 手数料	1,870
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	16,655	未払 手数料	3,137

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

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

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

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

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：百万円）

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

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

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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)</p> <p>市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
<p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p>	<p>時価法</p>
<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 … 8～18年 器具備品 … 3～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>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。</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p>	<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>①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
<p>6. 収益及び費用の計上基準</p>	<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</p>

場合があります。

(1) 委託者報酬

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

(2) 運用受託報酬

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

(3) 投資助言報酬

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

(4) 成功報酬

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第40期中間会計期間末 (2024年9月30日現在)												
※1. 有形固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%;">建物</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">…</td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 15%; text-align: right;">685百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: center;">…</td> <td></td> <td style="text-align: right;">609百万円</td> </tr> <tr> <td>リース資産</td> <td style="text-align: center;">…</td> <td></td> <td style="text-align: right;">4百万円</td> </tr> </table>	建物	…		685百万円	器具備品	…		609百万円	リース資産	…		4百万円
建物	…		685百万円										
器具備品	…		609百万円										
リース資産	…		4百万円										
※2. 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。												

(中間損益計算書関係)

項目	第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)								
※1. 減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">…</td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 15%; text-align: right;">76百万円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: center;">…</td> <td></td> <td style="text-align: right;">713百万円</td> </tr> </table>	有形固定資産	…		76百万円	無形固定資産	…		713百万円
有形固定資産	…		76百万円						
無形固定資産	…		713百万円						

(中間株主資本等変動計算書関係)

第40期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

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

(金融商品関係)

第40期中間会計期間末 (2024年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券

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

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

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

(有価証券関係)

第40期中間会計期間末
(2024年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

(持分法損益等)

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2024年4月1日から2024年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第40期中間会計期間
(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

委託者報酬	55,266百万円
運用受託報酬	8,186百万円
投資助言報酬	1,200百万円
成功報酬	－百万円
その他営業収益	13百万円
合計	64,667百万円

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
中間純利益金額	7,522百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,522百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	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) 通常の実行の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

約 款

追加型証券投資信託
One グローバルバランス
約款

運用の基本方針

約款第19条に基づき委託者の別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、D I AMマネーマザーファンド受益証券や短期金融資産にも投資を行います。

(2) 投資態度

①以下のマザーファンド（主要投資対象マザーファンドといいます。）受益証券への投資を通じて、国内外の株式および公社債に実質的に投資を行います。

- ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

なお、D I AMマネーマザーファンド受益証券や短期金融資産にも投資を行います。

（上記のマザーファンドを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

- ②主要投資対象マザーファンド受益証券の投資割合については、公的年金が基本ポートフォリオで定める資産構成割合や、投資環境分析等を勘案のうえ決定します。
- ③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ④ファンドの資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ①各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ④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。
- ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

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

追加型証券投資信託
Oneグローバルバランス
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

<信託の目的および金額>

第3条 委託者は、金100万円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

<信託金の限度額>

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として、信託金を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2051年9月15日までとします。

<受益権の取得申込みの勧誘の種類>

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

<当初の受益者>

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

<受益権の分割および再分割>

第8条 委託者は、第3条の規定によって生じた受益権については100万口を上限に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところにしたがい、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第29条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」とい

ます。)を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

- ③外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④第31条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時異なる受益権の内容>

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

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

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

- ②委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。
- ③委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

<受益権の設定にかかる受託者の通知>

第12条 受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

<受益権の申込単位および取得価額等>

第13条 委託者は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、委託者が定める申込単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。ただし、委託者に対し、取得申込みにかかる受益権について、第46条第3項に規定する収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みをした取得申込者に対しては、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

- ②販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、販売会社が定める申込単位をもって取得申込みに応ずることができます。ただし、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。
- ③前2項の場合の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に委託者または販売会社がそれぞれ別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる価額は、1口につき1円に、委託者または販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当

該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

- ④第1項および第2項の規定にかかわらず、取得申込日がニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」といいます。）には、受益権の取得申込みに応じません。ただし、第46条第3項の規定または別に定める契約に基づく収益分配金の再投資にかかる場合は除きます。
- ⑤第3項の規定にかかわらず、受益者が第46条第3項の規定または別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第40条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥第1項および第2項の取得申込者は委託者または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者（第48条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）または販売会社は、当該取得申込みの代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

<受益権の譲渡にかかる記載または記録>

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとし、

- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとし、ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとし、
- ③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

<受益権の譲渡の対抗要件>

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

<投資の対象とする資産の種類>

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

- 1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限り、）
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第17条 委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、D I AMマネーマザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）を含む次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、前各号の証券または証券の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、次号で定めるものを除きます。）
15. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
17. オプションを表示する証券または証券（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. 預託証券または預託証券（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券
20. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
21. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号および第18号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第15号の証券ならびに第12号および第18号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ②委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図をすることができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- ④委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等（不動産投資信託証券については、予定を含みます。）され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑤前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<利害関係人等との取引等>

- 第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第32条において同じ。）、第32条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第22条から第25条、第27条から第29条、第31条、第35条から第37条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第22条から第25条、第27条から第29条、第31条、第35条から第37条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことのできる指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等および当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

<運用の基本方針>

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

<投資する株式等の範囲>

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

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

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第21条 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に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。

<信用取引の指図範囲>

第22条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

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

<先物取引等の運用指図>

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）、ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が

限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条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委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条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委託者は、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第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建て、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、かつ本条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>

第24条 委託者は、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、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③スワップ取引の指図にあたっては、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。以下本項において同じ。）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、委託者は速やかに、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前項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委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図>

第25条 委託者は、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、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③金利先渡取引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。以下本項において同じ。）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。以下本項において同じ。）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、委託者は、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前項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。以下本項において同じ。）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。以下本項において同じ。）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。以下本項において同じ。）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、委託者は、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前項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委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、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>

第26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>

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 - ③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

<公社債の空売りの指図および範囲>

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

<公社債の借入れの指図および範囲>

第29条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ②前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④第1項の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

<特別な場合の外貨建有価証券への投資制限>

第30条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる

場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約取引の指図>

第31条 委託者は、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前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③前項においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ④第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- ⑤委託者は、外国為替の売買の予約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。

<信託業務の委託等>

第32条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該

金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

- 第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
- ②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、信託財産に属する旨の記載または記録に代えてその計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

- 第35条 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

- 第36条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

- 第37条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ②一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ③収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

- 第38条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

- 第39条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。
- ②信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものと

きは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

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

<信託の計算期間>

第40条 この信託の計算期間は、原則として毎年9月17日から翌年9月16日までとします。ただし、第1計算期間は、信託契約締結日から2022年9月16日までとします。

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

<信託財産に関する報告等>

第41条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

<信託事務の諸費用および監査費用>

第42条 信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額および受託者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ②前項の信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日とします。)および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

<信託報酬等の額および支弁の方法>

第43条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の103の率を乗じて得た額とします。

- ②前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日とします。)および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者の間の配分は別に定めます。
- ③第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第44条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、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、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ②前項各号におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるこの信託の信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ③毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

<収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

- 第45条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。)については第46条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金(第49条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。)については第46条第5項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。
- ②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金、償還金および一部解約金の支払い>

- 第46条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託者または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払います。
- ②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
 - ③委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金(受益者が自己に帰属する受益権の全部または一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申し出を受付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。)をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みに応じたものとして、当該受益権の取得申込みに応じたことにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
 - ④償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託者または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
 - ⑤一部解約金は、第49条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として6営業日目から受益者に支払います。

- ⑥前各項（第2項および第3項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行うものとします。
- ⑦収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- ⑧前項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、前項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<収益分配金および償還金の時効>

第47条 受益者が、収益分配金について第46条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、信託終了による償還金については第46条第4項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<委託者の自らの募集にかかる受益権の口座管理機関>

第48条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

<信託契約の一部解約>

- 第49条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に委託者または販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求受付日が海外休業日の場合は、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。
- ②委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ④受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者または販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑤委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。

<信託契約の解約>

- 第50条 委託者は、信託期間中において、この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、信託財産の純資産総額が30億円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、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ②委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この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。

- ③前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第51条 委託者は、監督官庁よりこの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、この信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第55条の規定にしたがいます。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第52条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第55条第2項の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第53条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第54条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第55条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

<信託約款の変更等>

第55条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この

場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

- ③前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

<反対受益者の受益権買取請求の不適用>

第56条 この信託は、受益者が第49条の規定による一部解約請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第50条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

<信託期間の延長>

第57条 委託者は、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、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

<他の受益者の氏名等の開示の請求の制限>

第58条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

- 1. 他の受益者の氏名または名称および住所
- 2. 他の受益者が有する受益権の内容

<公告>

第59条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
<https://www.am-one.co.jp/>

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

<運用状況にかかる情報の提供>

第60条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める事項にかかる情報を電磁的方法により提供します。

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

<質権口記載または記録の受益権の取扱い>

第61条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この信託約

款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第62条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(附則)

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

第2条 第25条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第3条 第25条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

2021年9月16日

委託者 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
アセットマネジメントOne株式会社

受託者 東京都中央区八重洲一丁目2番1号
みずほ信託銀行株式会社

親投資信託
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
- 6) 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- 4) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 5) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

親投資信託
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- 5) 有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。
- 8) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為

替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

9) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

親投資信託
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
- 2) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 5) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 6) 有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。
- 7) スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。
- 8) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。
- 9) 外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行いません。
- 10) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 11) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

親投資信託
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第15条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- 5) 有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

- 8) 外国為替予約取引は約款24条の範囲で行ないます。
- 9) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 10) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

親投資信託
D I A Mマネーマザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（*）の長期発行体格付け（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。

（*）主要格付機関とは、R&I、JCR、Moody's、S&Pとします。

②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。

③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。

④資金動向、市況動向に急激な変化が生じた場合、残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合等やむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

①株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。

②同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑤投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑥有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引は約款の範囲で行う事ができます。

⑦外貨建て資産への投資は行いません。

⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。