【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年2月8日提出
【発行者名】	アセットマネジメントＯｎｅ株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	コア資産形成ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

コア資産形成ファンド(以下「当ファンド」といいます。)

ただし、愛称として「ビギナーズ ラップ」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」と称することがあります。）です。

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ることとし、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。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社は、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。

また、当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付けまたは信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

（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】

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

※　「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除して求めた金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上１万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。

基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号※
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

注：電話番号はコールセンターのものです（以下同じ）。

※　電話によるお問い合わせは、営業日の午前９時～午後５時までとさせていただきます。（以下同じ。）

（５）【申込手数料】

①　申込手数料（受益権１口当たり）は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜２%）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。なお、申込手数料には、消費税ならびに地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が課せられます。

②　申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

③　「分配金再投資コース」を選択された場合の収益分配金は、毎計算期末の翌営業日に原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

（６）【申込単位】

①　申込単位は各販売会社が定める単位とします。

②　「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」による取得申込が可能です。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。なお、「分配金再投資コース」を選択されたお申込者は、収益分配金の再投資に際し、1口の整数倍をもって取得することができます。

③　申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

2021年2月9日から2021年8月10日まで

※　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】

当ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

（９）【払込期日】

取得申込代金は、販売会社が定める期日までに、販売会社にお支払いいただきます。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、アセットマネジメントOne株式会社（「委託者」または「委託会社」といいます。）の指定する口座を経由して、みずほ信託銀行株式会社（「受託者」または「受託会社」といいます。）の指定するファンド口座（受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座）に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

取得申込代金は、お申込みの販売会社にお支払いください。なお、払込取扱場所については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

（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】

○　投資信託振替制度における振替受益権について

当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。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、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。

投資信託振替制度（以下「振替制度」といいます。）においては、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します。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。

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 MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券＊、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券＊およびMHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券（以下、各々を「主要投資対象マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＊マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。また「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」は2021年7月2日に「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更する予定です。

＜ファンドの特色＞

国内外の公社債・株式へ分散投資を行い、安定した収益の獲得を目指します。

◆ 国内債券、外国債券、国内株式および外国株式を主要投資対象とし、各資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析を勘案して配分比率を決定します。

■ 資産配分比率は、リスク均等配分を基本としつつ、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、安定した収益の獲得を目指します。

＊ ファンドの特色における「リスク」とは、各資産の価格変動やファンドの基準価額の振れ幅の大きさのことをいいます。

◆ 各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理し、配分比率を調整することにより、基準価額の変動を抑制することを目指します。

■ 各資産のリスク水準の変化に応じて、各資産への配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券（以下、各主要投資対象マザーファンド受益証券を含め「マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて国内短期債券に投資することや、短期金融商品に直接投資することがあります。

◆ 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。

② 5,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

③ 一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

＜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 追加型	国　　内 海　　外 内　　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

追加型	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	目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書又は投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」及び「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
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券）※1 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ ファンズ 為替ヘッジ※2 あり （　　） なし

※1　当ファンドが投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「資産複合（株式・債券）／資産配分変更型」です。

※2　「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

その他資産 （投資信託証券）	目論見書又は投資信託約款において、主として「株式」、「債券」及び「不動産投信」以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載はその該当資産を表す。
資産複合 （株式・債券） 資産配分変更型	目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、括弧内の記載はその該当複数資産を表す。 ※当ファンドは、主として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、株式および債券に投資を行います。
年１回	目論見書又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）	目論見書又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	目論見書又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	目論見書又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又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

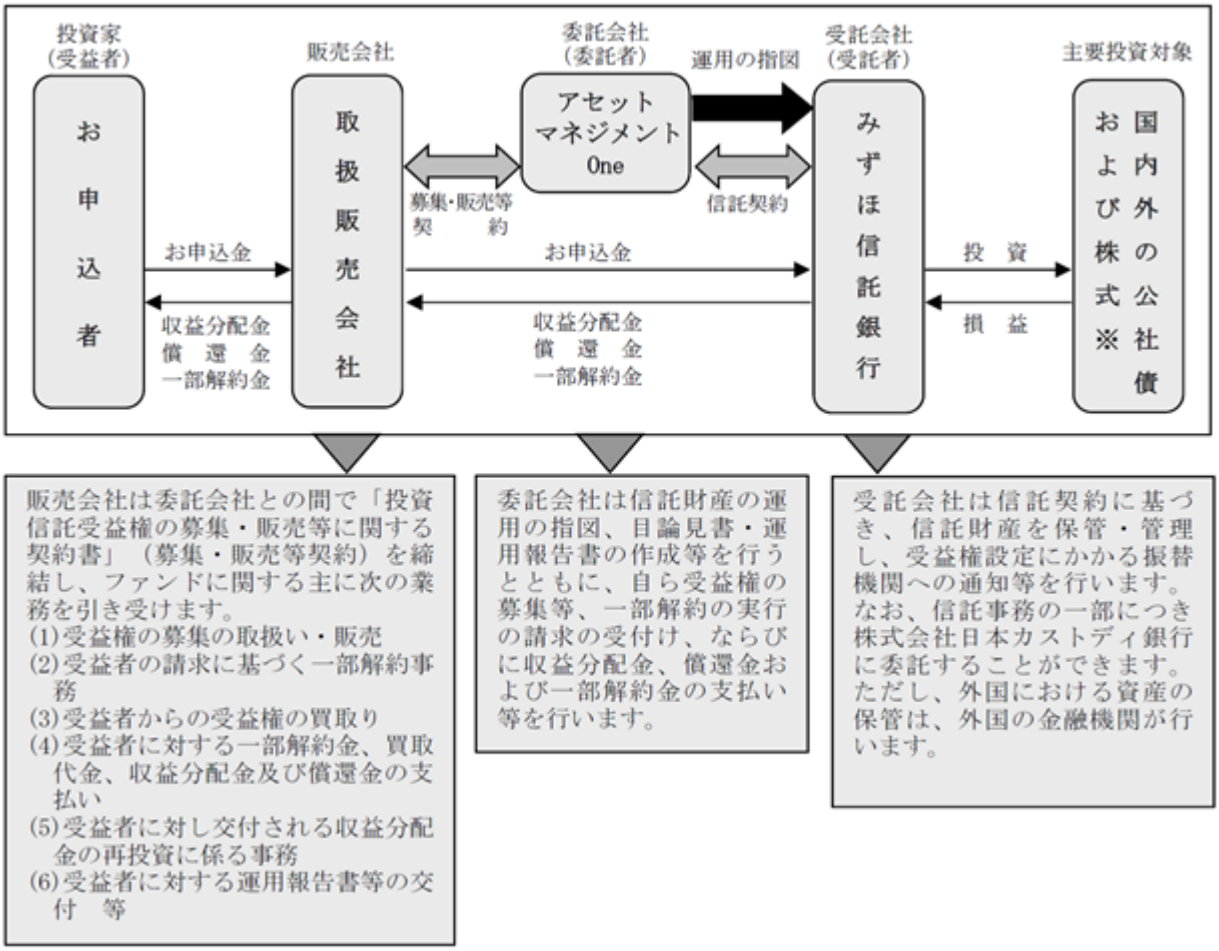
（注１）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。
（注２）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。
（注３）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（２）【ファンドの沿革】

2015年４月20日	信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始
2016年10月１日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2021年7月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を追加し、「ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド」を「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更（予定）
2021年12月17日	ファンドの主要投資対象から「ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド」を削除（予定）

（３）【ファンドの仕組み】

①　当ファンドの運営の仕組み

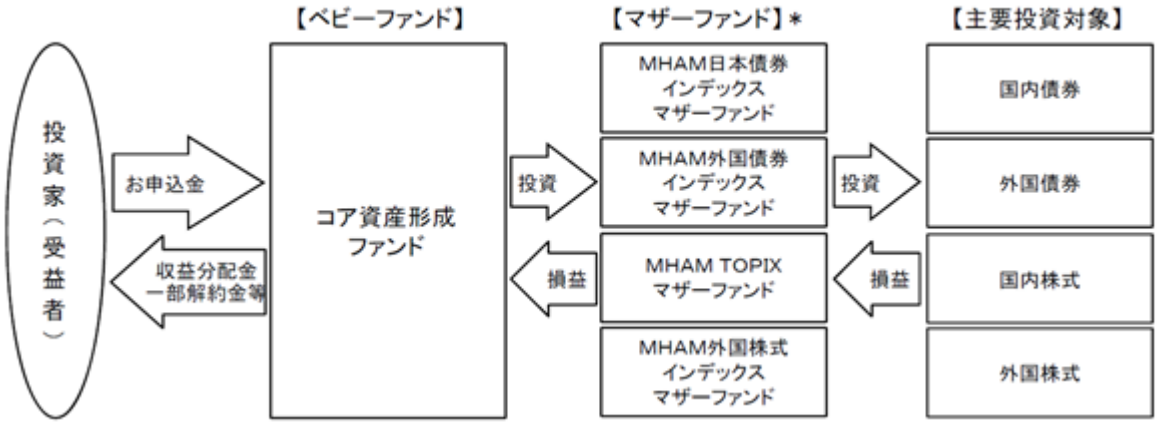


※ 主要投資対象である国内外の公社債および株式には、主として、各マザーファンドを通じて投資を行います。

②　ファミリーファンド方式の仕組み

当ファンドは、下図のマザーファンドを通じて各資産への投資を行う「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

≪ファミリーファンド方式≫



※　ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資することにより、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。
※　資産配分の決定の際、一部のマザーファンド受益証券への投資を行わない場合があります。また、ファンド全体のリスクの状況によっては、上記のマザーファンドを通じた投資のほか、ＭＨＡＭ国内短期債券マザーファンドを通じて国内短期債券に投資する場合や、信託財産の純資産総額の50%を上限に短期金融商品等へ直接投資する場合があります。
※　マザーファンドのほかに、株式、公社債等に直接投資する場合があります。

＊マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。また「ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド」は2021年7月2日に「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更する予定です。

③　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（2020年11月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

(2020年11月30日現在)

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。
※2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①　基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

②　運用方法

1．主要投資対象

MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券＊、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券＊およびMHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

＊マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。また「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」は2021年7月2日に「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更する予定です。

2．投資態度

ａ．主として、各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行います。

ｂ．各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資割合については、各マザーファンドが主要投資対象とする資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析等を勘案のうえ配分比率を決定します。ただし、ファンドの価格変動リスクを勘案し、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券への投資を行う場合、および信託財産の純資産総額の50%を上限に預金等の短期金融商品への直接投資を行う場合があります。

ｃ．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。

※「実質組入」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額をいいます。(以下同じ。)

ｄ．マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

ｅ．市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

③　ファンドの投資プロセス

1．当ファンドの投資プロセス

当ファンドは、以下の投資プロセスにより、各資産への投資割合を決定し、当ファンドを管理します。

各資産への配分比率は、特定の資産へのリスク集中回避を意図した「リスク均等配分」をベースに、投資環境分析やリスクの状況を踏まえて機動的に変更します。

STEP1　各資産のリスクを計測

「国内債券」、「外国債券」、「国内株式」および「外国株式」の各資産について、リスクを計測し、ポートフォリオに対するリスク寄与度が均等（リスク均等配分）となるよう、ベース配分比率を決定します。

☞ 下記「リスク均等配分とは」をご参照ください。

STEP2　投資環境分析を実施

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ベース配分比率から機動的に変更します。

STEP3　リスクの管理

各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理します。
資産別のリスク水準の変化に応じて、配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、各資産への配分比率を引き下げます※。

STEP4　ポートフォリオの構築

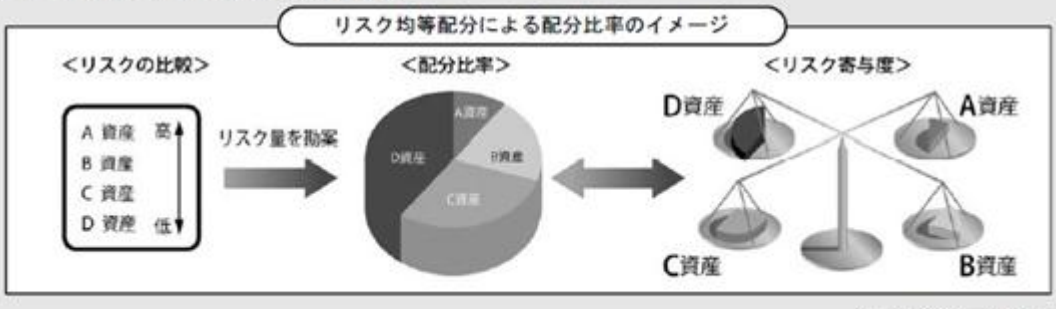
STEP1～3で決定した配分比率に従って、各資産への投資を行います。

※STEP3において各資産への配分比率の引き下げを行った場合、国内短期債券や短期金融商品への投資を行います。

※　上記のプロセスは、今後変更される場合があります。

リスク均等配分とは

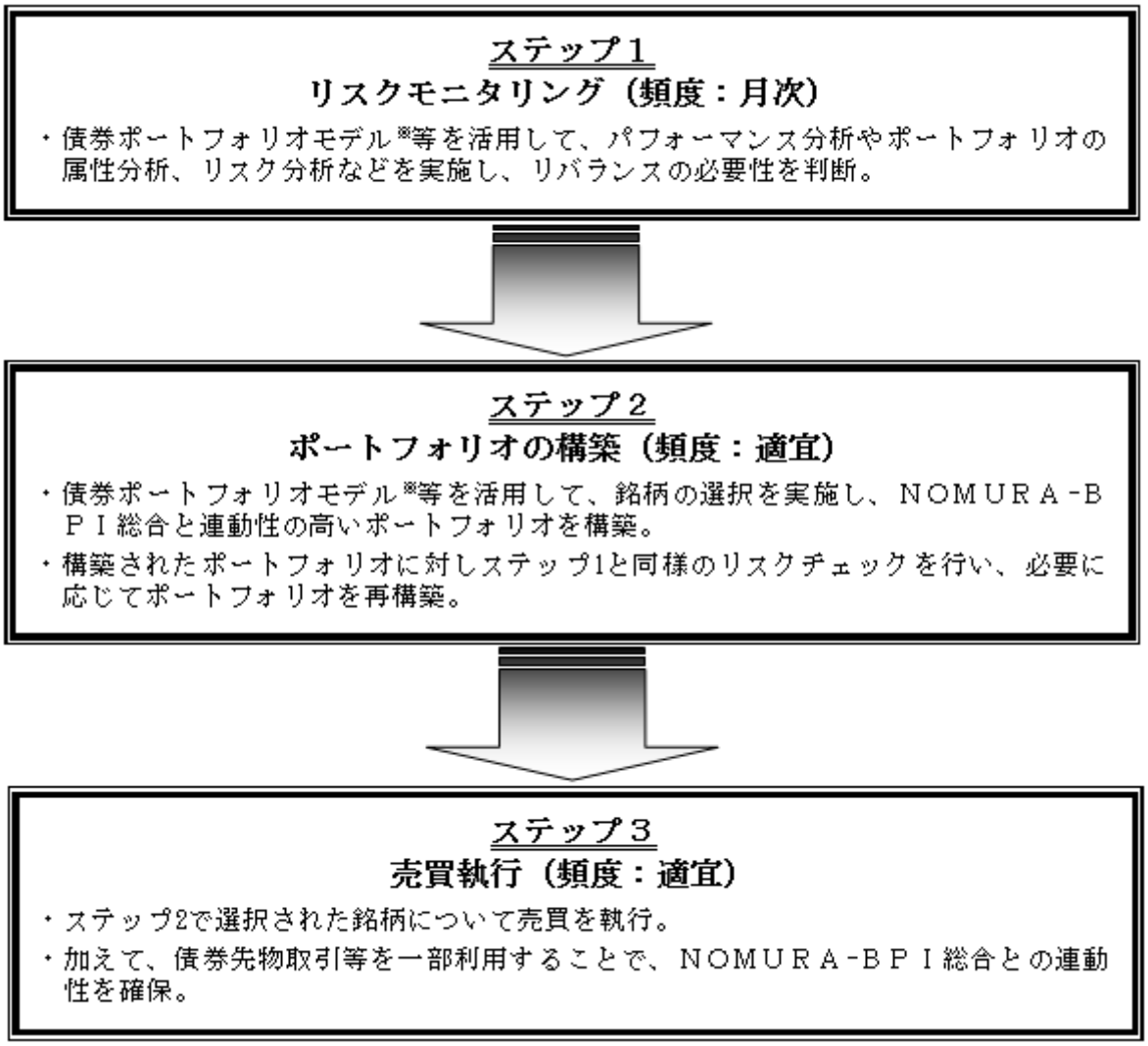
「リスク均等配分」とは、各資産のリスク（価格変動性）の大きさに着目した分散投資の方法で、リスクが相対的に高い資産の配分比率を低くし、リスクが相対的に低い資産の配分比率を高くすることにより、ファンドに対する各資産のリスク寄与度を均等にすることを目指す投資手法です。これにより、リスクが高い資産の値動きがファンド全体の値動きに与える影響を抑える効果が期待されます。



※上記はイメージ図です。

２．各マザーファンドの投資プロセス

＜MHAM日本債券インデックスマザーファンド＊の投資プロセス＞



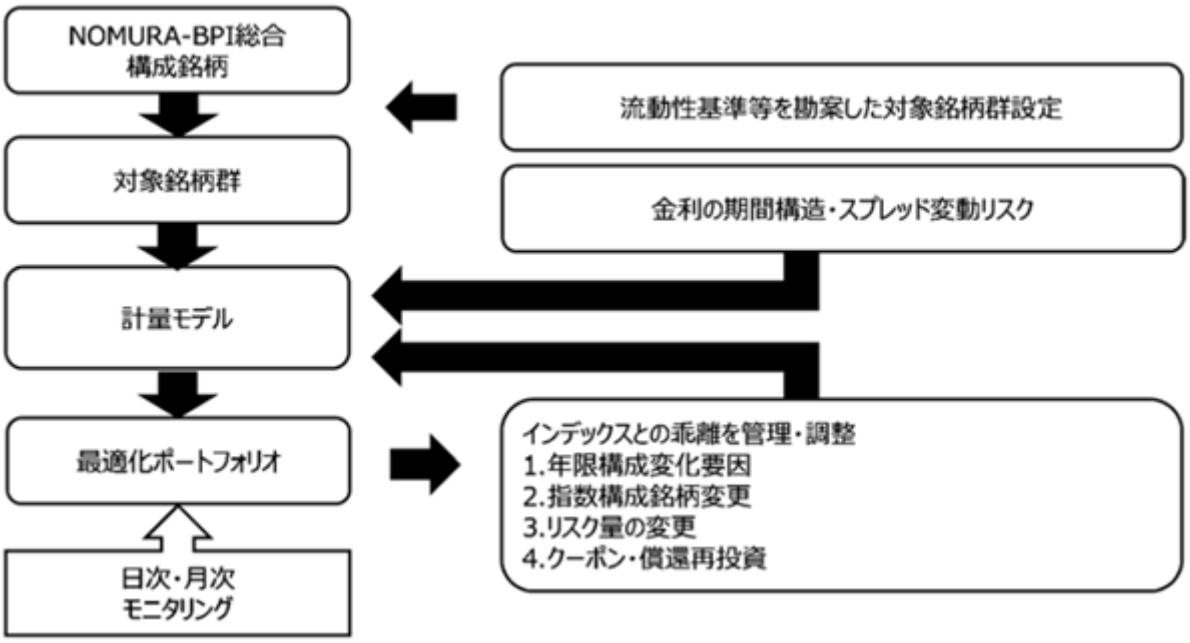
市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、モデルおよび使用するファクターについては、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

＜※ 債券ポートフォリオモデルとは…＞

デュレーション、残存期間構成、コンベクシティ等の属性をコントロールしながら、対象指数に連動する銘柄群を効率的に選びだします。

＊マザーファンドの入替えのため、「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」は2021年7月2日に「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更する予定です。

＜国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス＞



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。

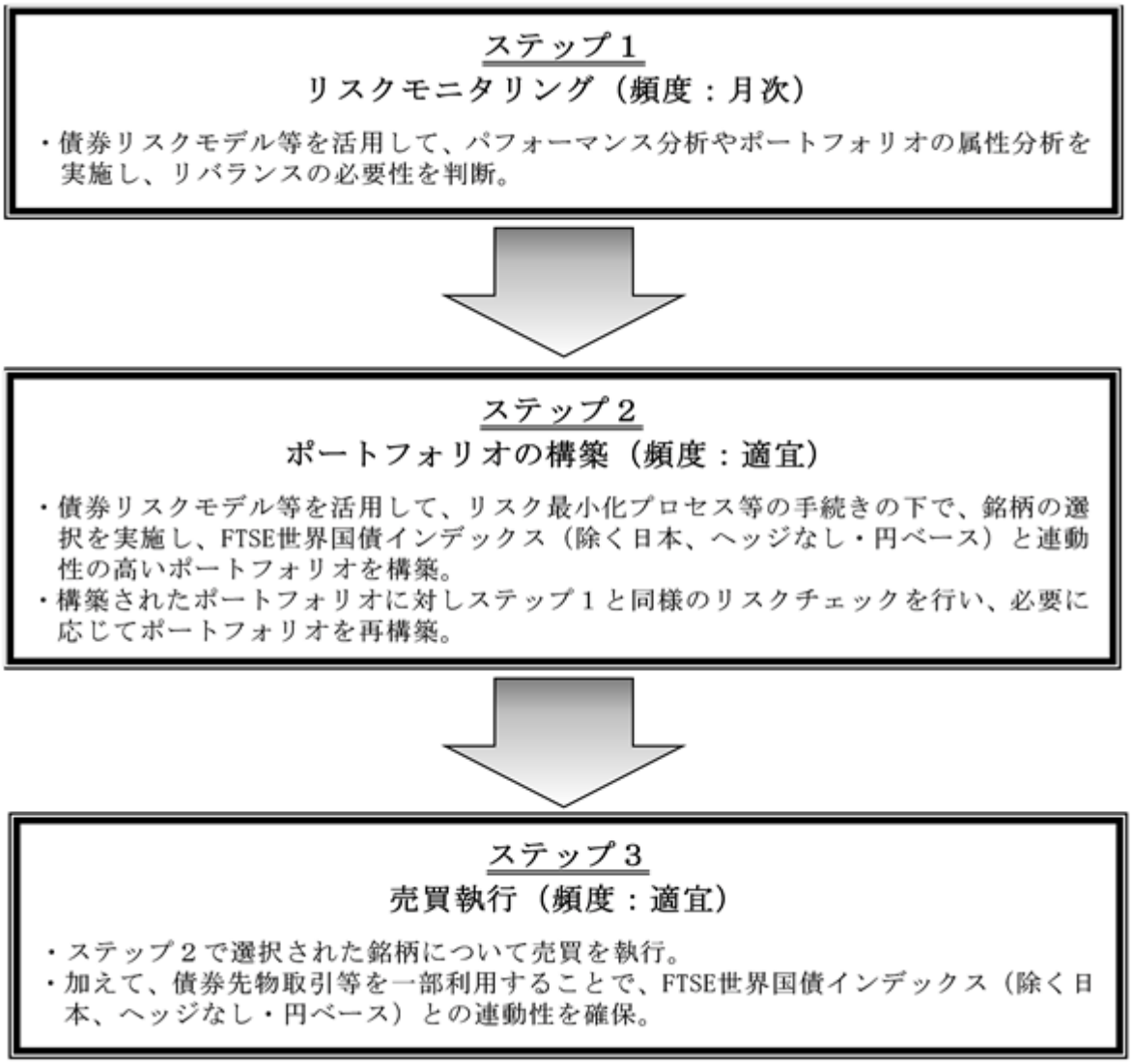
・年限構成変化要因

・指数構成銘柄変更

・リスク量の変更

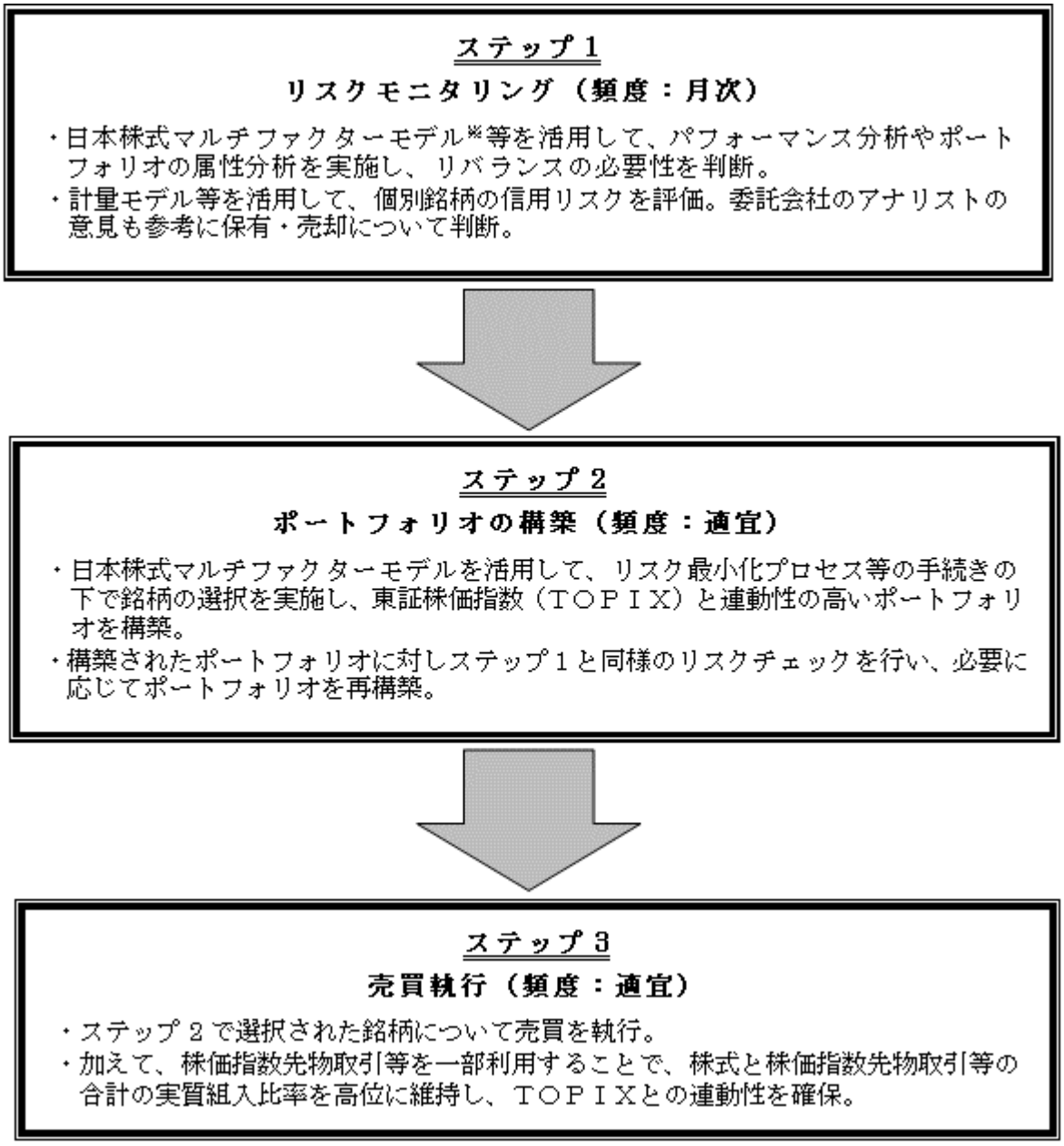
・クーポン、償還再投資

＜MHAM外国債券インデックスマザーファンドの投資プロセス＞



市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

＜MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンド＊の投資プロセス＞



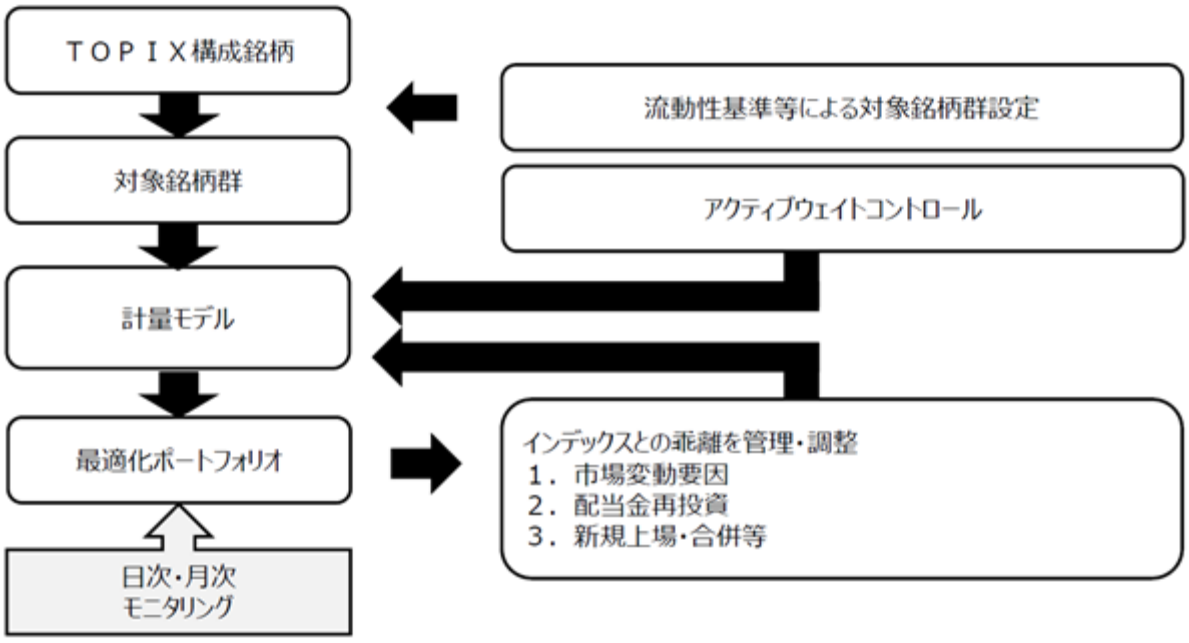
市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

＜※日本株式マルチファクターモデルとは…＞

日本株式マルチファクターモデルとは、複数のリスクファクターによって株式のリターンを分解・説明するモデルです。このモデルを活用し、ＴＯＰＩＸに連動する銘柄群を効率的に選びます。

＊マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。

＜国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資プロセス＞



1.流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

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

3.インデックスとの乖離を管理

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

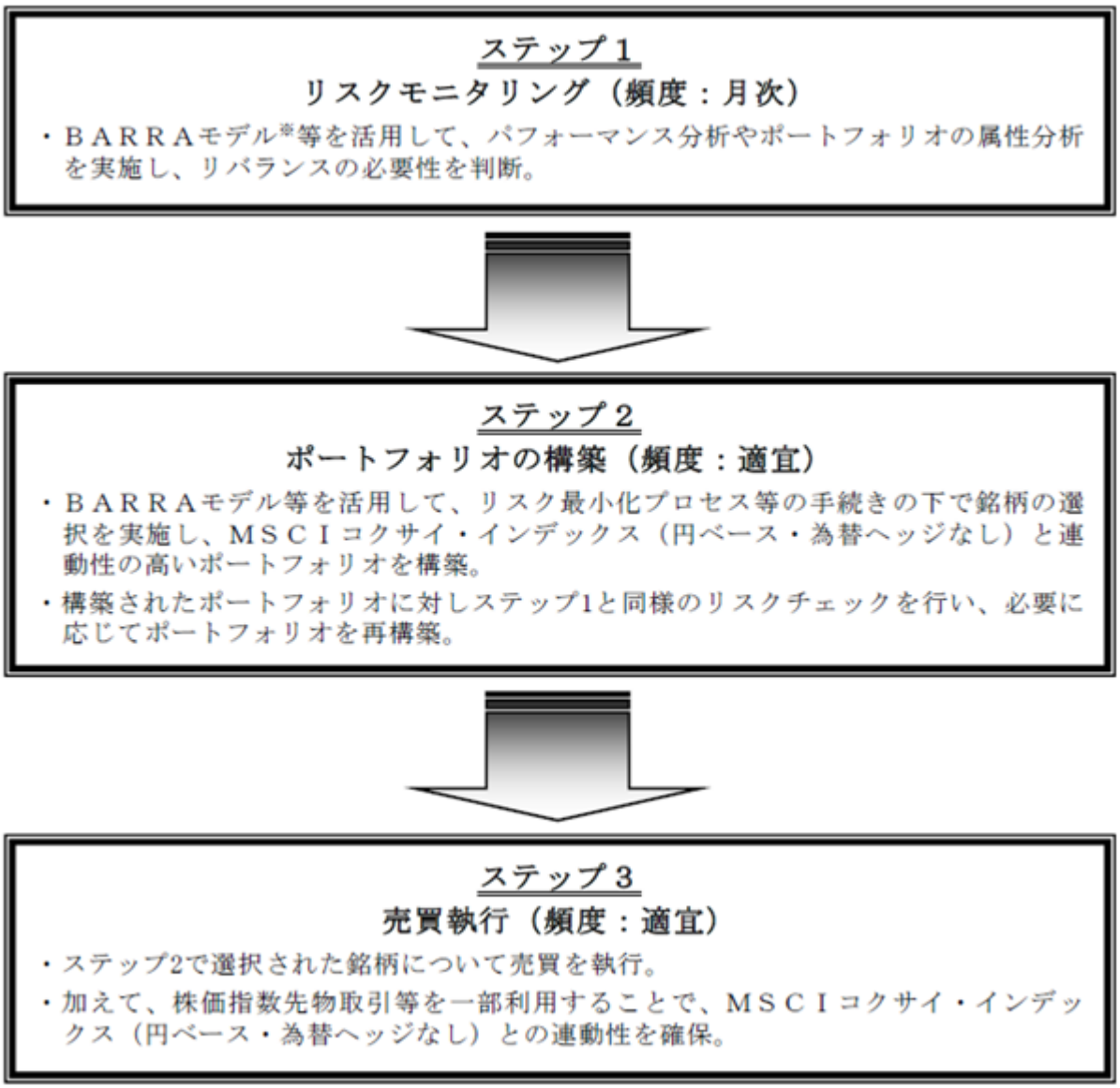
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施

・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定

＜MHAM外国株式インデックスマザーファンドの投資プロセス＞

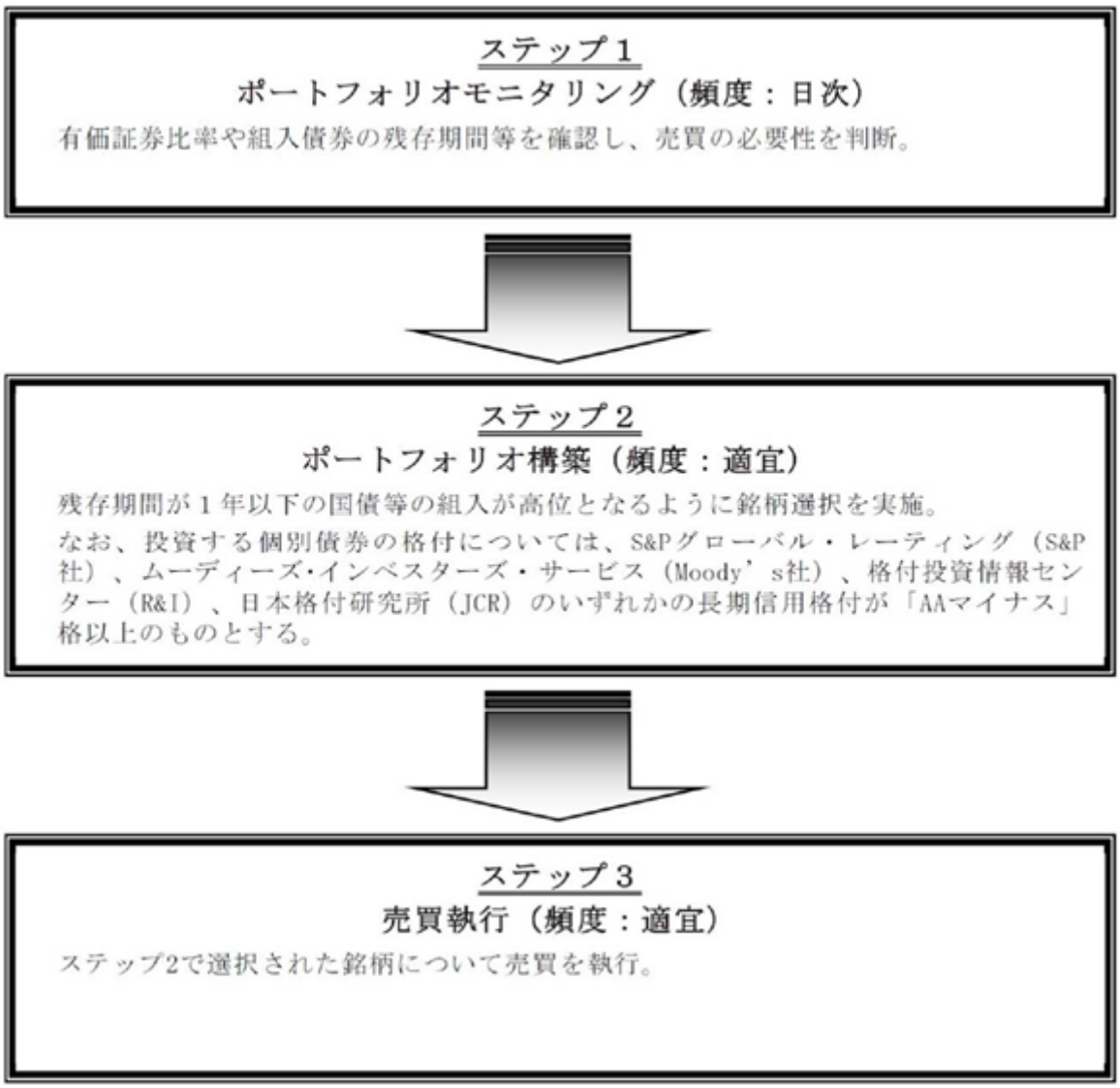


市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

＜※ＢＡＲＲＡモデルとは…＞

米国バーラ社（現MSCI Inc.）が開発した、株価・債券価格の変動要因を説明する統計的モデルにより、ポートフォリオのリスク管理やパフォーマンス分析を行う投資分析ツールです。

＜MHAM国内短期債券マザーファンドの投資プロセス＞



市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

（２）【投資対象】

①　投資の対象とする資産の種類

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項で定めるものをいいます。以下同じ。）

ａ．有価証券

ｂ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第25条、第26条および第27条に定めるものに限ります。）

ｃ．金銭債権

ｄ．約束手形（ａ.に掲げるものに該当するものを除きます。）

２．次に掲げる特定資産以外の資産

ａ．為替手形

②　有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として下記１．から下記５．までの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の受益証券を含む下記６．から下記27.までの有価証券（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．ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド受益証券＊

２．ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド受益証券

３．ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券＊

４．ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド受益証券

５．ＭＨＡＭ国内短期債券マザーファンド受益証券

６．株券または新株引受権証書

７．国債証券

８．地方債証券

９．特別の法律により法人が発行する債券

10. 社債券（新株引受権証券と社債券と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。）

11. 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。）

12. 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。）

13. 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。）

14. 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。）

15. コマーシャル・ペーパー

16. 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

17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記１．から前記16.の証券または証書の性質を有するもの（外国の者の発行する証券または証書で、前記６．から前記11.の証券または証書の性質を有するプリファードセキュリティーズ（ハイブリッド型のプリファードセキュリティーズを含みます。）およびこれらに類するものを含みます。）

18. 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。）

19. 投資証券、投資法人債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、プリファードセキュリティーズ（投資証券および投資法人債券のハイブリッド型のものを含みます。）に該当するものを含みます。）

20. 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。）

21. 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、有価証券に係るものに限ります。）

22. 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。）

23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

24. 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。）

25. 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。）

26. 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

27. 外国の者に対する権利で前記26.の有価証券の性質を有するもの

なお、前記６．の証券または証書、前記17．および前記22．の証券または証書のうち前記６．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、前記７．から前記11．までの証券および前記17．ならびに前記22．の証券または証書のうち前記７．から前記11．までの証券の性質を有するものならびに前記19．の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、前記18．の証券および前記19．の証券（投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

＊マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「ＭＨＡＭ ＴＯＰＩＸマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。また「ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド」は2021年7月2日に「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更する予定です。

③ 金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。また、②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、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、下記１．から下記４．まで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。

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記５．の権利の性質を有するもの

７．金銭債権（ただし、流動性のあるプリファードセキュリティーズに該当するものに限り、前記１．から前記６．で該当するものならびに「②　有価証券の指図範囲」の17．および19．に定める証券または証書を除きます。）

８．投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第２条第２項第５号に定めるものをいいます。）

９．外国の法律に基づく権利であって前記８．に掲げる権利に類するもの（リミテッド・パートナーシップ（LP）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含みます。）を含みます。）

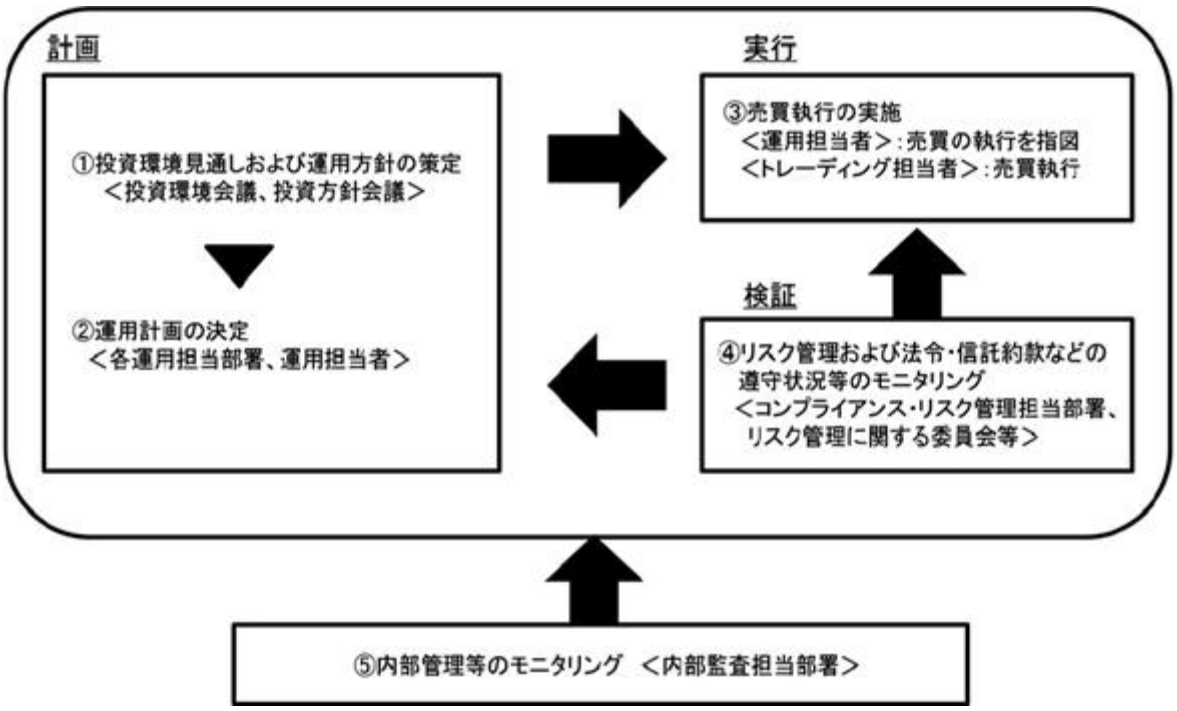
10．合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第２条第２項第３号で定めるものをいいます。）

11．外国法人の社員権で前記10．に掲げる権利の性質を有するもの（リミテッド・ライアビリティー・カンパニー（LLC）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含みます。）を含みます。）

なお、前記５．、前記６．および前記８．から前記11.までの権利等を以下「みなし有価証券」といいます。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（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2020年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。
※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①　収益分配方針

毎計算期末(原則として５月８日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

１．分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（繰越分および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の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。

３．収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

※　将来の収益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。

②　収益分配金の支払い

１．収益分配金は、原則として毎計算期間終了日から起算して５営業日までに販売会社において支払いが開始されます。

２．収益分配金の再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資すること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。

※　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、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し、お支払いします。

（５）【投資制限】

ａ．約款で定める投資制限

①　株式、新株引受権証券および新株予約権証券（約款 運用の基本方針 運用方法(3) 投資制限、約款第17条および約款第20条）

１．株式への実質投資割合※には制限を設けません。

※　「実質投資割合」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の当ファンドの信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。（以下同じ。）

２．委託会社は、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

３．同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。

４．同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合には制限を設けません。

５．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、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。）に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび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。なお、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。

②　みなし有価証券（約款第17条）

委託会社は、みなし有価証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。

③　投資信託証券（約款第17条）

委託会社は、投資信託証券（マザーファンド受益証券および取引所金融商品市場（金融商品取引法第２条第17項に規定する金融商品市場をいいます。）または外国金融商品市場に上場等（不動産投資信託証券については、予定を含みます。以下同じ。）され、かつこれらの市場において常時売却可能（市場の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（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

④　転換社債等（約款第21条）

委託会社は、同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤　外貨建資産（約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限および約款第31条）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、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。

⑥　外国為替予約（約款第32条）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑦　信用リスク集中回避のための投資制限（約款第22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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑧　デリバティブ取引等(約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限、約款第23条)

委託会社は、デリバティブ取引等（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第３条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。（ただし、この信託において取引可能なものに限ります。以下同じ。）。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

⑨　信用取引（約款第24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り付けることの指図をすることができます。なお当該売り付けの決済については、株券の引き渡し又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．信用取引の指図は、次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、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

ａ．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ｂ．株式分割により取得する株券

ｃ．有償増資により取得する株券

ｄ．売り出しにより取得する株券

ｅ．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

ｆ．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（前記ｅ．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　有価証券先物取引等（約款第25条）

１．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの

指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

２．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

３．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

⑪　スワップ取引（約款第26条）

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

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

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

４．委託会社は、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、担保の提供または担保の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（約款第27条）

１．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

２．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

⑬　有価証券の貸付（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、信託財産に属する株式および公社債を以下の範囲内で貸付の指図をすることができます。

ａ．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。

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

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

⑭　公社債の空売り（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、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とします。

３．信託財産の一部解約等の事由により、前記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。

⑮　公社債の借入れ（約款第30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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。

２．前記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、前記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．前記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。

⑯　資金の借入れ（約款第38条）

１．委託会社は、信託財産の効率的な運用および運用の安定性に資するため、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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金等および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を上回らない範囲内とします。

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。

ｂ．法令で定める投資制限

○　同一の法人の発行する株式の取得割合（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を、運用の指図を行うすべ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の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

＜各マザーファンドの投資方針および主な投資制限＞

Ⅰ「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」＊

１．基本方針

この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合※の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

※　ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合とは、野村證券株式会社が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合は、銘柄種類別・残存年数別に分類した各セクターポートフォリオに対して、それぞれの投資収益指数が用意され、一定の組入基準にもとづいて構成されたインデックス・ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算され、機関投資家に広く認知されています。ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。

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を行い、ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目指します。

②　公社債の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

③　運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、公社債の組入時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④　市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 投資制限

①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（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、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り行えるものとし、そ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５%以下とします。

③　同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

⑤　外貨建資産への投資は行いません。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

＊マザーファンドの入替えのため、「ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド」は2021年7月2日に「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更する予定です。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」

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。

※ NOMURA－BPI総合とは、野村證券株式会社が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。NOMURA－BPI総合は、銘柄種類別・残存年数別に分類した各セクターポートフォリオに対して、それぞれの投資収益指数が用意され、一定の組入基準にもとづいて構成されたインデックス・ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算され、機関投資家に広く認知されています。NOMURA－BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。

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。

(3) 投資制限

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

② 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③ 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1 項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤ 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥ 有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。

⑦ スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。

⑧ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。

⑨ 外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行ないます。

⑩ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑪ 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

⑫　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

Ⅱ「ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド」

１．基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）※の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

※　FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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。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。

２．運用方法

(1) 投資対象

FTSE世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域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、FTSE世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。

②　公社債の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

③　運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、公社債の組入時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④　外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

⑤　市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 投資制限

①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（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、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り行えるものとし、そ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５%以下とします。

③　同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑥　外国為替の売買の予約取引は、約款第30条の範囲で行います。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

Ⅲ「MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンド」*

１．基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）※と連動する投資成果を目標として運用を行います。

※　東証株価指数(TOPIX＝Tokyo Stock Price Index)とは、東京証券取引所第一部全銘柄を対象とした株価指数で、基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

＊1 ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウおよびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

＊2 ㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

＊3 ㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の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。

＊4 ㈱東京証券取引所は、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、㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

＊5 MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドおよびMHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

＊6 ㈱東京証券取引所は、MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドおよびMHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドおよびMHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

＊7 ㈱東京証券取引所は、委託会社またはMHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドおよびMHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、ＴＯＰＩＸの指数値を算出する銘柄構成、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、㈱東京証券取引所はMHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドおよびMHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

２．運用方法

(1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 現物株への投資よりＴＯＰＩＸ先物等を活用する方が有利と認められるときは、ＴＯＰＩＸ先物等を活用することがあります。

② 株価指数等の先物取引を含む株式の実質組入比率は、原則信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行いますが、一時的に株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ 組入対象銘柄は、東京証券取引所第一部上場株式とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。

④ 上記①から③について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

(3) 投資制限

① 株式の組入比率には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は、行いません。

③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

④ 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤ 有価証券先物取引等は約款第15条の範囲で行います。

⑥ スワップ取引は約款第16条の範囲で行います。

⑦ 金利先渡取引は約款第17条の範囲で行います。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

＊マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」

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（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。

※ 東証株価指数(TOPIX＝Tokyo Stock Price Index)とは、東京証券取引所第一部全銘柄を対象とした株価指数で、基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

＊1 ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウおよびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

＊2 ㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

＊3 ㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の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。

＊4 ㈱東京証券取引所は、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、㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

＊5 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

＊6 ㈱東京証券取引所は、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

＊7 ㈱東京証券取引所は、委託会社または国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、ＴＯＰＩＸの指数値を算出する銘柄構成、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、㈱東京証券取引所は国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

2.運用方法

(1) 投資対象

東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、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。

(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。

Ⅳ「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」

1．基本方針

この投資信託は、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）※1、2の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

※1 MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）とは、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。
本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いませ

ん。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いかなるMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行うものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する特定目的に対する市場性および適合性に係る一切の保証を明示的に否認します。前記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害（逸失利益を含む。）については、その可能性について告知されていたとしても、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負いません。
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

※2　税引き前配当再投資ベースとします（以下同じ。）。

２．運用方法

(1) 投資対象

ＭＳＣＩコクサイ・インデックスを構成している国（地域を含みます。）の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として、ＭＳＣＩコクサイ・インデックスを構成している国（地域を含みます。）の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）の動きに連動する投資成果を目指します。
② 株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。
③ 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入時価総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
④ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
⑤ 市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。
② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
④ 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。（ただし、ＭＳＣＩコクサイ・インデックスを構成している株式を除きます。）
⑤ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑥ 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑦ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑧ 外国為替の売買の予約取引は、約款第29条の範囲で行います。
⑨ みなし有価証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。
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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

Ⅴ「MHAM国内短期債券マザーファンド」

1．基本方針

この投資信託は、主としてわが国の短期の国債、地方債、政府保証債、金融債等（以下「国債等」といいます。）に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

(1) 投資対象

この投資信託は、わが国の短期の国債等を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① わが国の短期の国債等を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。

② 投資する個別債券の格付については、S&Pグローバル・レーティング（S&P社）、ムーディーズ・インベスターズ・サービス（Moody's社）、格付投資情報センター（R&I）、日本格付研究所（JCR）のいずれかの長期信用格付が「AAマイナス」格以上のものとします。

③ 投資する個別債券の残存期間については、原則として１年以下とします。

④ 市場動向および資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

⑤ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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を行うことができます。

(3) 投資制限

① 株式（新株引受権証券を含みます。）への投資は行いません。

② 同一発行体が発行する有価証券への投資割合は、国債、地方債、特別の法律により法人の発行する債券を除き、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等への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資は行いません。

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 金利先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

(1) 当ファンドにおける主として想定されるリスクと収益性に与える影響度合い

・当ファンドは、主として各マザーファンド受益証券への投資を通じて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。し

たがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。

・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。

・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。

・登録金融機関およびアセットマネジメントOne株式会社が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。

・投資信託は預貯金とは異なります。

・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。

当ファンドにおいて主として想定されるリスクは以下の通りですが、基準価額の変動要因はこれらに限定されるものではありません。

なお、以下のリスクは、主にマザーファンドを通じて当ファンドが行う有価証券等への投資により発生します。

① 資産配分リスク

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

資産配分リスクとは、複数資産への投資（資産配分）を行った場合に、投資成果の悪い資産への配分が大きかったため、投資全体の成果も悪くなってしまうリスクをいいます。

一般に、投資に際して資産配分を行う場合には、そのうちの１資産の価値変動が投資全体の成果に及ぼす影響度合いを小さくする効果が期待されますが、その場合にも、それぞれの資産の価値変動は、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及ぼします。当ファンドは、国内外の公社債および株式に資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数の資産の価値が同時に下落した場合等には、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

② 金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスクとは、金利変動により公社債の価格が下落するリスクをいいます。

一般に金利が上昇した場合には、既に発行されて流通している公社債の価格は下落します。金利上昇は、当ファンドが投資する公社債の価格に影響を及ぼし、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。また、金利変動により株式市場と公社債市場の間で資金シフトが起こる場合があり、その場合、金利変動の影響は株式市場にも及びます。

③ 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。

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。

当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることがあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

④　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。

為替変動リスクとは、為替変動により外貨建資産の円換算価格が下落するリスクをいいます。当ファンドでは、外貨建資産への投資にあたり、原則として為替ヘッジを行わないため、投資対象通貨と円との外国為替相場が円高となった場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

⑤　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。

信用リスクとは、公社債等の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）リスクをいいます。

一般に債務不履行が生じた場合、またはその可能性が高まった場合には、当該発行体が発行する公社債および短期金融商品（コマーシャル・ペーパー等）の価格は下落します。また、当該発行体が企業の場合には、一般にその企業の株価が下落する要因となります。当ファンドが投資する公社債等の発行体や株式の発行企業がこうした状況に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

⑥　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。

流動性リスクとは、有価証券を売却（または購入）しようとする際に、需要（または供給）がないため、有価証券を希望する時期に、希望する価格で売却（または購入）することができなくなるリスクをいいます。

一般に規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあたっては、流動性リスクへの留意が特に必要とされます。また、一般に市場を取り巻く外部環境の急変があった場合には、市場実勢価格での売買ができなくなる可能性が高まります。当ファンドが投資する株式・公社債等の流動性が損なわれた場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

⑦　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。

カントリーリスクとは、投資先となっている国（地域）の政治・経済・社会・国際関係等が不安定な状態、あるいは混乱した状態等に陥った場合に、当該国における資産価値や当該国通貨の価値が下落するリスクをいいます。

当ファンドの投資先となっている国（地域）がこうした状態に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

＜その他＞

- **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。**
- **投資対象国において、税制、決済ルールの変更などにより税金や費用が新たに発生した場合や、外国為替取引規制や外国からの投資規制の実施などがあった場合は、当ファンドの基準価額に影響を与える場合があります。**

・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が影響を受ける場合があります。

・当ファンドは、一部解約の実行の請求金額が多額な場合や取引所等における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことがあります。

＜収益分配金に関する留意点＞

・投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

・分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、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。また、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。

・投資家（受益者）のファンドの取得価額によっては、分配金の一部または全部が、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。ファンド取得後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

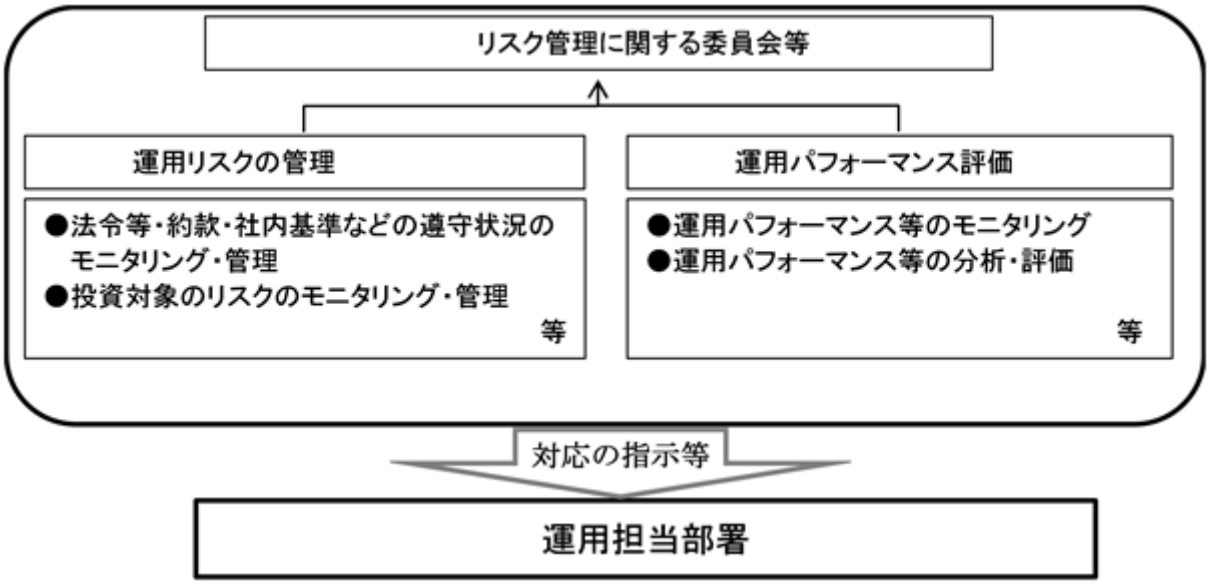
(2) リスク管理体制

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。

・リスク管理に関する委員会等：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、リスク管理に関する委員会等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。



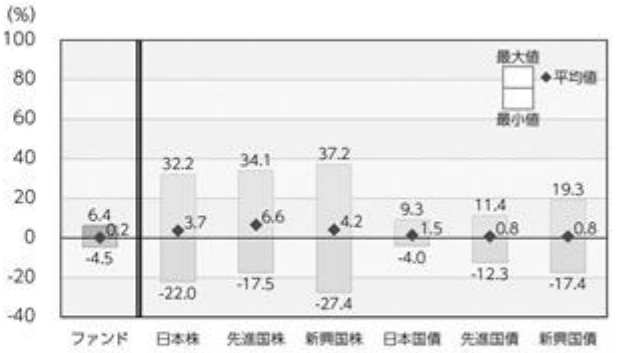
※リスク管理体制は2020年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2016年4月～2020年11月
代表的な資産クラス:2015年12月～2020年11月

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(㈱東京証券取引所)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は、㈱東京証券取引所が有しています。
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、野村證券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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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】

① 申込手数料(受益権１口当たり)は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜２%）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。なお、申込手数料には消費税等相当額が課せられます。

② 申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

③ 「分配金再投資コース」における収益分配金は、毎計算期末の翌営業日に原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

＜申込手数料を対価とする役務の内容＞

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

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.99%（税抜0.9%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分（税抜）については、以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
0.53%	0.33%	0.04%

② 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ます。なお、信託報酬にかかる消費税等相当額を信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

＜信託報酬等を対価とする役務の内容＞

委託会社	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	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	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

（４）【その他の手数料等】

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係る消費税等相当額、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係る消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、当該費用に係る消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の６ヵ月終了日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。

②　当ファンドの組入有価証券の売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用およびこれら手数料ならびに費用にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③　上記①、②の手数料等（借入金の利息および財務諸表の監査に要する費用を除きます。）については、当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおいて発生する場合、マザーファンドの信託財産中から支弁されます。これらはマザーファンドの基準価額に反映されるため、結果として当ファンドの受益者が間接的に負担することとなります。

（５）【課税上の取扱い】

◇ 当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○ 個人の受益者に対する課税

①　収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②　解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③　損益通算について

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

ます。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

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

○ 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、2020年11月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇ 個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

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

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

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

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2020年11月30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		469,489,996	97.49
	内　日本	469,489,996	97.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		12,070,808	2.51
純資産総額		481,560,804	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）
MHAM日本債券インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		110,510,400,550	84.81
	内　日本	110,510,400,550	84.81
地方債証券		7,059,001,309	5.42
	内　日本	7,059,001,309	5.42
特殊債券		7,706,888,960	5.91
	内　日本	7,706,888,960	5.91
社債券		4,347,268,800	3.34
	内　日本	4,049,316,800	3.11
	内　フランス	297,952,000	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		685,789,160	0.53
純資産総額		130,309,348,779	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。

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		23,009,251,792	98.06
	内　アメリカ	9,961,533,039	42.45
	内　フランス	2,447,747,340	10.43
	内　イタリア	2,225,491,766	9.48
	内　ドイツ	1,817,746,000	7.75
	内　イギリス	1,509,777,082	6.43
	内　スペイン	1,396,854,770	5.95
	内　オーストラリア	619,326,798	2.64
	内　ベルギー	566,810,810	2.42
	内　オランダ	476,221,304	2.03
	内　カナダ	458,033,250	1.95
	内　オーストリア	351,799,366	1.50
	内　アイルランド	189,938,634	0.81
	内　メキシコ	178,430,323	0.76
	内　フィンランド	144,904,342	0.62
	内　ポーランド	139,299,157	0.59
	内　デンマーク	124,638,253	0.53
	内　マレーシア	98,221,801	0.42

	内　シンガポール	98,213,100	0.42
	内　イスラエル	88,410,515	0.38
	内　スウェーデン	69,310,217	0.30
	内　ノルウェー	46,543,925	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		455,859,114	1.94
純資産総額		23,465,110,906	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。

MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		42,579,116,440	95.93
	内　日本	42,579,116,440	95.93
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,804,802,482	4.07
純資産総額		44,383,918,922	100.00

その他資産の投資状況

2020年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		1,755,500,000	3.96
	内　日本	1,755,500,000	3.96

（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。

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		34,656,930,319	92.52
	内　アメリカ	23,814,502,555	63.57
	内　イギリス	1,495,738,540	3.99
	内　スイス	1,250,211,086	3.34
	内　フランス	1,229,758,799	3.28
	内　カナダ	1,208,137,820	3.23
	内　ドイツ	1,068,826,392	2.85
	内　オーストラリア	759,471,629	2.03
	内　オランダ	713,993,370	1.91
	内　アイルランド	648,316,330	1.73
	内　スウェーデン	377,656,117	1.01
	内　スペイン	302,077,726	0.81
	内　香港	292,214,278	0.78
	内　デンマーク	286,149,107	0.76
	内　イタリア	226,485,512	0.60
	内　フィンランド	145,536,464	0.39
	内　バミューダ	118,525,240	0.32
	内　ジャージィー	117,379,970	0.31
	内　シンガポール	115,070,530	0.31
	内　ベルギー	111,885,175	0.30
	内　ノルウェー	72,184,130	0.19

	内　ケイマン諸島	71,179,898	0.19
	内　イスラエル	68,585,917	0.18
	内　ニュージーランド	35,969,145	0.10
	内　ルクセンブルグ	31,834,260	0.08
	内　オランダ領キュラソー	25,556,611	0.07
	内　オーストリア	20,833,444	0.06
	内　ポルトガル	20,111,610	0.05
	内　リベリア	10,742,030	0.03
	内　マン島	7,184,364	0.02
	内　パナマ	6,743,774	0.02
	内　パプアニューギニア	4,068,496	0.01
新株予約権証券		195,062	0.00
	内　スイス	195,062	0.00
投資信託受益証券		69,878,987	0.19
	内　オーストラリア	51,731,511	0.14
	内　シンガポール	18,147,476	0.05
投資証券		733,737,970	1.96
	内　アメリカ	670,065,671	1.79
	内　イギリス	21,006,092	0.06
	内　香港	13,783,186	0.04
	内　フランス	13,670,733	0.04
	内　オランダ	7,824,417	0.02
	内　カナダ	7,387,871	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,998,497,664	5.34
純資産総額		37,459,240,002	100.00

その他資産の投資状況

2020年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		1,947,073,236	5.20
	内　アメリカ	1,416,734,943	3.78
	内　ドイツ	325,089,518	0.87
	内　イギリス	88,138,582	0.24
	内　カナダ	66,326,520	0.18
	内　オーストラリア	50,783,673	0.14

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2020年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	MHAM日本債券インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	241,818,090	1.2533 303,083,752	1.2489 302,006,612	－ －	62.71

2	MHAM外国債券インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	60,113,552	1.3299 79,945,774	1.3707 82,397,645	－ －	17.11
3	MHAM　ＴＯＰＩＸマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	23,612,959	1.9946 47,099,610	2.1587 50,973,294	－ －	10.59
4	MHAM外国株式インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	15,085,992	2.0857 31,465,326	2.2612 34,112,445	－ －	7.08

（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

2020年11月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.49
合計	97.49

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	３２９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	1,480,000,000	103.03 1,524,873,600	102.38 1,515,224,000	0.8 2023/6/20	1.16
2	３３２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	1,420,000,000	102.77 1,459,447,600	102.25 1,451,978,400	0.6 2023/12/20	1.11
3	１３４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	1,390,000,000	100.73 1,400,202,600	100.49 1,396,852,700	0.1 2022/12/20	1.07
4	３３４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	1,310,000,000	102.79 1,346,605,500	102.60 1,344,112,400	0.6 2024/6/20	1.03
5	３３５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	1,310,000,000	102.85 1,347,374,300	102.40 1,341,531,700	0.5 2024/9/20	1.03
6	１３３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	1,310,000,000	100.64 1,318,464,500	100.43 1,315,672,300	0.1 2022/9/20	1.01
7	３３８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	1,200,000,000	102.66 1,231,992,000	102.29 1,227,492,000	0.4 2025/3/20	0.94
8	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	1,210,000,000	101.62 1,229,613,200	101.39 1,226,879,500	0.1 2028/3/20	0.94

9	３４３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,170,000,000	101.44 1,186,848,000	101.11 1,183,057,200	0.1 2026/6/20	0.91
10	１３２回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,160,000,000	100.59 1,166,867,200	100.34 1,164,048,400	0.1 2022/6/20	0.89
11	３２８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,140,000,000	102.22 1,165,338,000	101.68 1,159,186,200	0.6 2023/3/20	0.89
12	３４１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,110,000,000	102.48 1,137,528,000	102.05 1,132,821,600	0.3 2025/12/20	0.87
13	１３６回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,100,000,000	100.85 1,109,449,000	100.60 1,106,611,000	0.1 2023/6/20	0.85
14	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,080,000,000	101.53 1,096,539,000	101.21 1,093,143,600	0.1 2026/12/20	0.84
15	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,060,000,000	102.91 1,090,874,000	102.46 1,086,097,200	0.4 2025/9/20	0.83
16	１４４回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,050,000,000	100.88 1,059,292,500	101.00 1,060,563,000	0.1 2025/6/20	0.81
17	１４１回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,050,000,000	101.09 1,061,518,500	100.91 1,059,628,500	0.1 2024/9/20	0.81
18	３５９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,050,000,000	100.62 1,056,532,500	100.85 1,059,009,000	0.1 2030/6/20	0.81
19	１３１回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,050,000,000	100.52 1,055,470,500	100.28 1,053,003,000	0.1 2022/3/20	0.81
20	３３９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,020,000,000	102.77 1,048,254,000	102.37 1,044,265,800	0.4 2025/6/20	0.80
21	３４４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,010,000,000	101.47 1,024,862,000	101.16 1,021,786,700	0.1 2026/9/20	0.78
22	１３７回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,010,000,000	100.91 1,019,211,200	100.67 1,016,817,500	0.1 2023/9/20	0.78
23	３４９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,000,000,000	101.64 1,016,400,000	101.38 1,013,840,000	0.1 2027/12/20	0.78
24	３４２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,000,000,000	101.38 1,013,800,000	101.06 1,010,650,000	0.1 2026/3/20	0.78
25	３３３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	980,000,000	102.96 1,009,053,000	102.43 1,003,863,000	0.6 2024/3/20	0.77

26	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	970,000,000	101.39 983,540,000	101.26 982,289,900	0.1 2027/3/20	0.75
27	３５１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	940,000,000	101.53 954,431,000	101.36 952,849,800	0.1 2028/6/20	0.73
28	３５５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	940,000,000	101.32 952,435,600	101.20 951,289,400	0.1 2029/6/20	0.73
29	３３０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	910,000,000	103.27 939,838,900	102.63 933,933,000	0.8 2023/9/20	0.72
30	３５２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	920,000,000	101.55 934,260,000	101.33 932,263,600	0.1 2028/9/20	0.72

（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

2020年11月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	84.81
地方債証券	5.42
特殊債券	5.91
社債券	3.34
合計	99.47

（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。

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	151,679,400	105.01 159,289,218	104.08 157,876,923	2.125 2022/12/31	0.67
2	ITALY BTPS 4.5 05/01/23 イタリア	国債証券	135,574,200	111.59 151,289,554	111.89 151,697,632	4.5 2023/5/1	0.65
3	US T N/B 0.375 03/31/22 アメリカ	国債証券	139,212,600	100.37 139,729,078	100.33 139,680,256	0.375 2022/3/31	0.60
4	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	134,018,100	104.97 140,690,272	104.04 139,441,644	2 2023/2/15	0.59
5	US T N/B 1.5 03/31/23 アメリカ	国債証券	118,434,600	103.73 122,856,340	103.11 122,126,426	1.5 2023/3/31	0.52
6	US T N/B 0.125 10/15/23 アメリカ	国債証券	121,551,300	99.80 121,319,137	99.80 121,318,641	0.125 2023/10/15	0.52
7	US T N/B 0.125 09/15/23 アメリカ	国債証券	118,434,600	99.81 118,221,417	99.83 118,235,666	0.125 2023/9/15	0.50
8	US T N/B 1.75 06/15/22 アメリカ	国債証券	111,162,300	103.20 114,728,386	102.43 113,867,537	1.75 2022/6/15	0.49

9	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	93,501,000	118.45 110,759,710	116.60 109,023,625	2.875 2028/8/15	0.46
10	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証券	100,773,300	107.75 108,590,885	106.38 107,205,468	1.5 2030/2/15	0.46
11	US T N/B 1.5 11/30/21 アメリカ	国債証券	97,656,600	101.97 99,581,411	101.39 99,018,451	1.5 2021/11/30	0.42
12	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	85,189,800	117.31 99,939,413	115.31 98,234,488	2.625 2029/2/15	0.42
13	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	84,150,900	117.88 99,197,394	116.28 97,858,291	2.875 2028/5/15	0.42
14	US T N/B 0.125 09/30/22 アメリカ	国債証券	94,539,900	99.91 94,459,541	99.94 94,484,504	0.125 2022/9/30	0.40
15	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	84,150,900	112.80 94,923,657	111.71 94,005,757	2.375 2027/5/15	0.40
16	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	73,384,200	125.41 92,033,569	128.09 94,001,784	2.5 2030/5/25	0.40
17	US T N/B 1.5 10/31/24 アメリカ	国債証券	89,345,400	105.19 93,983,319	104.76 93,603,266	1.5 2024/10/31	0.40
18	US T N/B 0.125 08/15/23 アメリカ	国債証券	93,501,000	99.91 93,423,394	99.86 93,373,165	0.125 2023/8/15	0.40
19	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	92,462,100	98.01 90,626,872	98.10 90,706,763	0.625 2030/8/15	0.39
20	US T N/B 1.5 02/28/23 アメリカ	国債証券	87,267,600	103.61 90,425,128	102.98 89,871,992	1.5 2023/2/28	0.38
21	US T N/B 2.5 02/15/22 アメリカ	国債証券	87,267,600	104.17 90,911,703	102.84 89,752,681	2.5 2022/2/15	0.38
22	US T N/B 1.125 02/28/25 アメリカ	国債証券	84,150,900	103.76 87,315,731	103.46 87,069,883	1.125 2025/2/28	0.37
23	FRANCE OAT 05/25/22 フランス	国債証券	85,822,200	101.10 86,768,818	101.06 86,739,827	－ 2022/5/25	0.37
24	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	44,776,800	180.83 80,971,006	190.40 85,259,325	4.5 2041/4/25	0.36
25	FRANCE OAT 0.5 05/25/25 フランス	国債証券	80,847,000	105.09 84,970,152	105.35 85,180,399	0.5 2025/5/25	0.36
26	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	73,761,900	116.66 86,051,079	115.05 84,866,522	2.75 2028/2/15	0.36
27	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	77,115,600	109.13 84,160,332	109.71 84,607,380	0.75 2028/5/25	0.36
28	US T N/B 1.625 08/31/22 アメリカ	国債証券	82,073,100	103.39 84,855,890	102.57 84,189,046	1.625 2022/8/31	0.36
29	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	76,878,600	108.07 83,088,948	107.12 82,356,200	2 2025/2/15	0.35
30	US T N/B 1.375 08/15/50 アメリカ	国債証券	86,228,700	95.00 81,918,498	95.23 82,119,363	1.375 2050/8/15	0.35

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.06
合計	98.06

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド

2020年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	193,900	6,721.73 1,303,345,196	6,999.00 1,357,106,100	－ －	3.06
2	ソニー 日本	株式 電気機器	108,800	6,890.12 749,646,093	9,704.00 1,055,795,200	－ －	2.38
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	135,900	4,902.43 666,240,564	7,272.00 988,264,800	－ －	2.23
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	15,800	36,746.02 580,587,230	53,290.00 841,982,000	－ －	1.90
5	任天堂 日本	株式 その他製品	10,800	41,622.93 449,527,694	59,260.00 640,008,000	－ －	1.44
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	228,900	2,426.33 555,389,036	2,465.00 564,238,500	－ －	1.27
7	日本電産 日本	株式 電気機器	41,900	7,032.33 294,654,826	13,305.00 557,479,500	－ －	1.26
8	第一三共 日本	株式 医薬品	149,200	2,418.01 360,768,108	3,694.00 551,144,800	－ －	1.24
9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	145,000	3,774.17 547,255,938	3,745.00 543,025,000	－ －	1.22
10	ダイキン工業 日本	株式 機械	22,400	14,994.23 335,870,898	23,665.00 530,096,000	－ －	1.19
11	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,173,300	439.39 515,537,297	448.50 526,225,050	－ －	1.19
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	119,500	3,614.67 431,953,757	4,400.00 525,800,000	－ －	1.18
13	信越化学工業 日本	株式 化学	29,500	11,871.47 350,208,516	17,135.00 505,482,500	－ －	1.14
14	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	34,700	9,822.39 340,837,119	13,910.00 482,677,000	－ －	1.09
15	村田製作所 日本	株式 電気機器	51,000	5,842.39 297,962,015	9,129.00 465,579,000	－ －	1.05
16	ファナック 日本	株式 電気機器	16,400	17,234.45 282,645,081	25,365.00 415,986,000	－ －	0.94
17	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	11,300	23,416.50 264,606,523	35,470.00 400,811,000	－ －	0.90

18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	137,200	2,607.56 357,758,012	2,871.50 393,969,800	－ －	0.89
19	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	124,400	3,164.76 393,696,988	2,982.50 371,023,000	－ －	0.84
20	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	118,700	2,991.53 355,094,666	3,032.00 359,898,400	－ －	0.81
21	エムスリー 日本	株式 サービス業	36,900	3,878.02 143,098,939	9,622.00 355,051,800	－ －	0.80
22	ＳＭＣ 日本	株式 機械	5,300	45,215.38 239,641,563	66,320.00 351,496,000	－ －	0.79
23	日立製作所 日本	株式 電気機器	84,000	3,416.24 286,964,858	3,966.00 333,144,000	－ －	0.75
24	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	120,500	2,359.98 284,378,490	2,758.50 332,399,250	－ －	0.75
25	花王 日本	株式 化学	41,800	8,153.55 340,818,589	7,808.00 326,374,400	－ －	0.74
26	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	17,700	13,849.99 245,144,930	17,765.00 314,440,500	－ －	0.71
27	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	60,500	5,036.71 304,721,515	5,190.00 313,995,000	－ －	0.71
28	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	233,700	1,270.95 297,021,238	1,327.50 310,236,750	－ －	0.70
29	中外製薬 日本	株式 医薬品	54,200	4,101.94 222,325,360	5,044.00 273,384,800	－ －	0.62
30	三菱商事 日本	株式 卸売業	112,300	2,457.30 275,955,608	2,433.00 273,225,900	－ －	0.62

（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

2020年11月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.93
合計	95.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2020年11月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	16.26
情報・通信業		9.01
化学		7.30
輸送用機器		6.70
医薬品		5.82
サービス業		5.80
機械		5.51

小売業	4.65
銀行業	4.37
卸売業	4.37
食料品	3.39
陸運業	3.36
精密機器	2.68
その他製品	2.60
建設業	2.26
不動産業	1.96
保険業	1.85
電気・ガス業	1.27
その他金融業	1.07
ガラス・土石製品	0.76
証券、商品先物取引業	0.75
非鉄金属	0.64
鉄鋼	0.59
金属製品	0.59
ゴム製品	0.52
繊維製品	0.45
石油・石炭製品	0.34
空運業	0.33
パルプ・紙	0.19
海運業	0.17
倉庫・運輸関連業	0.16
鉱業	0.14
水産・農林業	0.08
合計	95.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	130,011	8,758.04 1,138,642,133	12,112.53 1,574,762,800	－ －	4.20
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	54,026	19,840.57 1,071,907,099	22,360.24 1,208,034,580	－ －	3.22
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	3,181	265,849.97 845,668,775	331,963.87 1,055,977,078	－ －	2.82

4	FACEBOOK 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	18,020	23,364.13 421,021,754	28,861.68 520,087,489	－ －	1.39
5	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	2,262	148,044.68 334,877,081	186,294.50 421,398,179	－ －	1.12
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	2,241	147,501.19 330,550,172	185,653.50 416,049,510	－ －	1.11
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	5,556	21,514.10 119,532,380	60,854.60 338,108,193	－ －	0.90
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	19,670	15,399.65 302,911,123	14,960.15 294,266,347	－ －	0.79
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	22,858	9,664.68 220,915,327	12,593.54 287,863,269	－ －	0.77
10	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	12,662	19,444.21 246,202,676	21,920.78 277,561,042	－ －	0.74
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	18,563	12,225.78 226,947,286	14,400.19 267,310,780	－ －	0.71
12	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	22,375	12,031.95 269,214,884	11,761.43 263,162,018	－ －	0.70
13	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	4,606	37,050.47 170,654,488	55,108.45 253,829,523	－ －	0.68
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	10,446	18,868.12 197,096,443	24,055.72 251,286,150	－ －	0.67
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	7,116	30,401.07 216,334,068	35,108.58 249,832,702	－ －	0.67

16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	6,704	30,279.74 202,995,405	35,225.98 236,154,985	－ －	0.63
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	8,065	24,888.85 200,728,611	28,672.60 231,244,527	－ －	0.62
18	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	13,541	11,489.87 155,584,421	15,285.33 206,978,730	－ －	0.55
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	31,104	5,842.74 181,732,840	6,293.65 195,757,882	－ －	0.52
20	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	34,146	3,884.69 132,646,893	5,376.30 183,579,395	－ －	0.49
21	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	5,272	38,826.19 204,691,710	34,778.42 183,351,856	－ －	0.49
22	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術サービス	8,332	16,400.62 136,649,975	21,961.30 182,981,610	－ －	0.49
23	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	3,596	41,067.26 147,677,896	49,558.64 178,212,893	－ －	0.48
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	58,545	2,412.95 141,266,495	3,011.77 176,324,139	－ －	0.47
25	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア	6,725	20,187.96 135,764,052	25,726.28 173,009,237	－ －	0.46
26	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	3,293	47,394.66 156,070,618	51,047.39 168,099,056	－ －	0.45
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	30,677	4,748.55 145,671,464	5,475.00 167,956,667	－ －	0.45
28	WALMART INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	10,608	13,115.11 139,125,123	15,749.72 167,073,072	－ －	0.45
29	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	53,565	2,999.56 160,671,718	3,015.92 161,548,113	－ －	0.43
30	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	41,742	3,647.23 152,243,057	3,867.82 161,450,738	－ －	0.43

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	92.52
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.19
投資証券	1.96

合計	94.66

（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

2020年11月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	6.79
銀行		5.42
医薬品		4.64
情報技術サービス		4.54
コンピュータ・周辺機器		4.45
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.04
半導体・半導体製造装置		3.93
インターネット販売・通信販売		3.50
保険		3.01
ヘルスケア機器・用品		2.92
資本市場		2.85
石油・ガス・消耗燃料		2.78
化学		2.13
電力		1.96
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.88
バイオテクノロジー		1.83
食品		1.68
飲料		1.68
機械		1.67
専門小売り		1.59
各種電気通信サービス		1.58
自動車		1.55
ホテル・レストラン・レジャー		1.51
航空宇宙・防衛		1.48
繊維・アパレル・贅沢品		1.45
食品・生活必需品小売り		1.43
娯楽		1.42
金属・鉱業		1.42
家庭用品		1.28
コングロマリット		1.15
メディア		1.12
陸運・鉄道		1.07
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.94
各種金融サービス		0.91
総合公益事業		0.90
電気設備		0.82
専門サービス		0.70
パーソナル用品		0.67
航空貨物・物流サービス		0.64
タバコ		0.64
通信機器		0.63
建設関連製品		0.53
電子装置・機器・部品		0.53
複合小売り		0.50

不動産管理・開発	0.43
商業サービス・用品	0.42
消費者金融	0.36
家庭用耐久財	0.35
商社・流通業	0.30
容器・包装	0.30
無線通信サービス	0.29
自動車部品	0.26
建設・土木	0.26
建設資材	0.25
ヘルスケア・テクノロジー	0.16
運送インフラ	0.16
ガス	0.15
エネルギー設備・サービス	0.14
水道	0.11
紙製品・林産品	0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
レジャー用品	0.07
海運業	0.06
販売	0.05
旅客航空輸送業	0.05
合計	92.52

（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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド

該当事項はありません。

ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド

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）

ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド

2020年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０２１２月	買建	100	1,707,918,000	1,755,500,000	3.96

（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。

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Dec20	買建	75	1,369,042,940	1,416,734,943	3.78
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec20	買建	74	309,997,249	325,089,518	0.87
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec20	買建	10	84,793,985	88,138,582	0.24
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec20	買建	4	62,068,383	66,326,520	0.18
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec20	買建	4	48,926,296	50,783,673	0.14

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

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2020年11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(2016年 5月 9日)	93	93	0.9889	0.9889
第2計算期間末(2017年 5月 8日)	219	219	1.0052	1.0052
第3計算期間末(2018年 5月 8日)	276	276	1.0243	1.0243
第4計算期間末(2019年 5月 8日)	382	382	1.0152	1.0152
第5計算期間末(2020年5月8日)	433	433	0.9884	0.9884
2019年11月末日	423	－	1.0375	－
12月末日	422	－	1.0404	－
2020年1月末日	434	－	1.0394	－
2月末日	430	－	1.0204	－
3月末日	425	－	0.9912	－
4月末日	433	－	0.9919	－

5月末日	445	－	0.9916	－
6月末日	451	－	0.9910	－
7月末日	463	－	0.9931	－
8月末日	468	－	0.9980	－
9月末日	475	－	0.9975	－
10月末日	471	－	0.9881	－
11月末日	481	－	1.0041	－

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
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2020年5月9日～2020年11月8日	－

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	△1.11
第2計算期間	1.65
第3計算期間	1.90
第4計算期間	△0.89
第5計算期間	△2.6
2020年5月9日～2020年11月8日	0.8

（注1）収益率は期間騰落率です。
（注2）計算期間末が2019年8月29日以前の収益率については、小数点第2位で表示しています。

（４）【設定及び解約の実績】

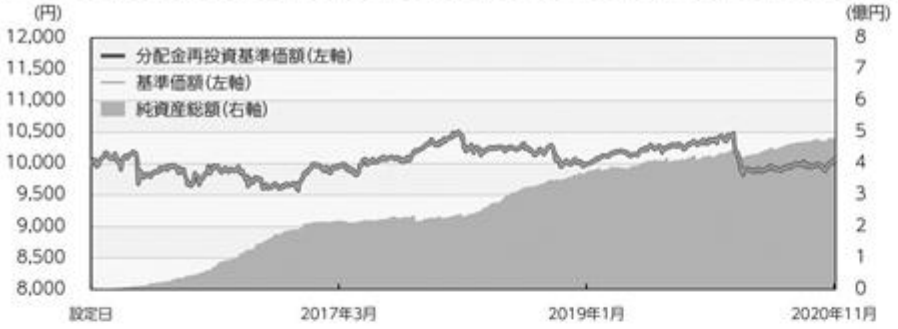
	設定口数	解約口数
第1計算期間	97,026,713	2,647,305
第2計算期間	146,988,315	23,166,841
第3計算期間	135,796,963	84,429,344
第4計算期間	180,925,539	73,460,775
第5計算期間	184,043,588	122,719,064
2020年5月9日～ 2020年11月8日	85,862,687	46,319,530

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

≪参考情報≫

データの基準日:2020年11月30日

基準価額・純資産の推移 《2015年4月20日～2020年11月30日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2015年4月20日)

分配の推移(税引前)

2016年 5月	0円
2017年 5月	0円
2018年 5月	0円
2019年 5月	0円
2020年 5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	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	62.71
2	MHAM外国債券インデックスマザーファンド	17.11
3	MHAM TOPIXマザーファンド	10.59
4	MHAM外国株式インデックスマザーファンド	7.08

■MHAM日本債券インデックスマザーファンド

※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	329回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2023/6/20	1.16
2	332回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2023/12/20	1.11
3	134回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2022/12/20	1.07
4	334回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/6/20	1.03
5	335回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2024/9/20	1.03

■MHAM外国債券インデックスマザーファンド

※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 2.125 12/31/22	国債証券	アメリカ	2.125	2022/12/31	0.67
2	ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	イタリア	4.5	2023/5/1	0.65
3	US T N/B 0.375 03/31/22	国債証券	アメリカ	0.375	2022/3/31	0.60
4	US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	アメリカ	2	2023/2/15	0.59
5	US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	アメリカ	1.5	2023/3/31	0.52

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

データの基準日:2020年11月30日

■MHAM TOPIX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	3.06
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.38
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.23
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.90
5	任天堂	株式	日本	その他製品	1.44

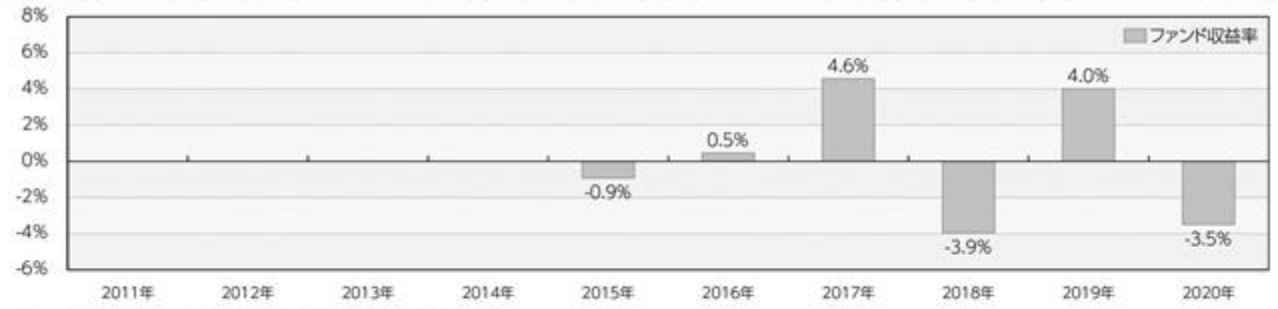
■MHAM外国株式インデックスマザーファンド

※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	4.20
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.22
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.82
4	FACEBOOK 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	1.39
5	ALPHABET INC-CL C	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	1.12

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。
※2015年は設定日から年末までの収益率、および2020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】

(1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後３時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付け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分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。ただし、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あたる場合には、お申込みの受付けはいたしません。

(2) 取得申込者は販売会社に、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、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。

(3) お申込みには、収益の分配がなされた場合に分配金を受領する「分配金受取コース」と、分配金は原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資される「分配金再投資コース」の２つのお申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみのお取扱いと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。

(4) 申込単位は、各販売会社が定める単位とします。申込単位については、販売会社にお問い合わせください。

(5) 取得申込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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(6) 取得申込みにかかる受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、販売会社が別に定める申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

(7) 販売会社において金額買付（申込単位が金額にて表示されている場合）によるお申込みをされた場合、申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額はお申込代金の中から差し引かれます。

(8) 収益分配金の再投資に関する契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、１口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。

(9) 信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、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、販売会社は、受益権の取得申込みの受付けを中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

２【換金（解約）手続等】

(1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社が定める単位をもって解約を請求することができます。

※　解約単位は、販売会社にお問い合わせください。

(2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる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換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

(3) 解約請求の受付けについては、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後３時までに解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付け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分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。ただし、解約請求受付日が、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あたる場合には、解約請求の受付けはいたしません。

(4) 解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号※
アセットマネジメントOne株式会社	0120-104-694

※電話によるお問い合わせは、営業日の午前９時～午後５時までとさせていただきます。（以下同じ。）

(5) 解約代金は、受益者の解約請求を受付けた日から起算して、原則として、６営業日目から販売会社において受益者に支払われます。

(6) 信託財産の資金管理を円滑に行うために、大口の解約請求には制限を設ける場合があります。

(7) 委託会社は、信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合（一部解約の実行の請求金額が多額な場合を含みます。）、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、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。この場合、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（この日が前記(3)に規定する一部解約の実行の請求を受付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、前記(4)の規定に準じて算出した価額とします。

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

① 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従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（「純資産総額」といいます。）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※における取引所の最終相場
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

※ 外国で取引されているものについては、計算日の直近の日とします。

② 当ファンドの基準価額は、委託会社の毎営業日（土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、１月２日および１月３日以外の日とします。）に計算されます。基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。基準価額は１万口単位で表示されたものが発表されます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2015年４月20日から2028年５月８日までとします。

ただし、委託会社が、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

原則として毎年５月９日から翌年５月８日までとします。ただし、第１計算期間は2015年４月20日から2016年５月８日までとします。

上記の規定にかかわらず、計算期間終了日に該当する日（以下「当該日」といいます。）が休業日のとき、計算期間終了日は、当該日の翌日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（５）【その他】

① 信託契約の解約

１．委託会社は、次のいずれかに該当する場合、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）させることがあります。この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。ただし、当該信託契約の解約についての委託会社による提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合にも書面決議は行いません。

ａ．信託終了前に、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき。

ｂ．やむを得ない事情が発生したとき。

ｃ．信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることとなるとき。

２．前記１．により信託契約を解約する場合には、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。

３．委託会社は、次の事象が起きた場合、信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）させます。

ａ．委託会社が監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき。

ｂ．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。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「②信託約款の変更等」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。

ｃ．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において、委託会社が新受託会社を選任できないとき。

②　信託約款の変更等

１．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、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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「②信託約款の変更等」および「③書面決議」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．委託会社は、前記１.の事項（前記１.の変更事項にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前記１.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及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。ただし、当該重大な約款の変更等についての委託会社による提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。

３．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も、当該併合にかかる一又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。

４．委託会社は、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、上記の規定にしたがいます。

③　書面決議

１．委託会社は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に係る書面決議を行う場合には、あらかじめ、書面決議の日および当該決議の内容に応じて次の事項をそれぞれ定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託契約または信託約款に係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。

ａ．信託契約の解約の場合　信託契約の解約の理由など

ｂ．重大な約款の変更等の場合　重大な約款の変更等の内容およびその理由など

２．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係る受益者としての受託会社を除きます。以下この２．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。

３．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。

４．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。

５．この信託は、受益者が一部解約の実行の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、信託契約の解約または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の買取請求の規定の適用を受けません。

④　償還金の支払い

償還金は、原則として償還日（償還日が休業日の場合には当該償還日の翌営業日）から起算して５営業日までに、販売会社において支払いが開始されます。

※　償還金は、償還日に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販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し、お支払いします。

⑤　委託会社の事業の譲渡および承継に伴なう取扱い

１．委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、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．委託会社は、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、これに伴ない、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。

⑥　関係法人との契約の更改ならびに受託会社の辞任または解任に伴なう取扱い

１．委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則１年間とし、期間終了の３ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。

２．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。また、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「② 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、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

⑦　信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について、株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

⑧　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、次のアドレスに掲載します。

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

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

⑨　運用報告書

委託会社は、決算時および信託終了時に期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。

・交付運用報告書は、販売会社を通じて交付いたします。

・運用報告書（全体版）は、次のアドレスに掲載します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、交付いたします。

http://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、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5期計算期間（令和1年5月9日から令和2年5月8日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【コア資産形成ファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 令和1年5月8日現在	第5期 令和2年5月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,376,961	25,206,102
親投資信託受益証券	378,376,503	410,580,829
未収利息	6	－
流動資産合計	389,753,470	435,786,931
資産合計	389,753,470	435,786,931
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,151,076	405,974
未払受託者報酬	80,671	93,526
未払委託者報酬	1,734,340	2,011,614
その他未払費用	7,602	8,505
流動負債合計	6,973,689	2,519,619
負債合計	6,973,689	2,519,619
純資産の部		
元本等		
元本	377,033,265	438,357,789
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,746,516	△5,090,477
（分配準備積立金）	6,005,851	5,343,733
元本等合計	382,779,781	433,267,312
純資産合計	382,779,781	433,267,312
負債純資産合計	389,753,470	435,786,931

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自　平成30年5月9日 至　令和1年5月8日	第5期 自　令和1年5月9日 至　令和2年5月8日
営業収益		
受取利息	29	6
有価証券売買等損益	865,424	△7,795,674
営業収益合計	865,453	△7,795,668
営業費用		
支払利息	7,035	6,937
受託者報酬	151,227	182,511
委託者報酬	3,251,308	3,924,911
その他費用	14,511	16,891
営業費用合計	3,424,081	4,131,250
営業利益又は営業損失（△）	△2,558,628	△11,926,918
経常利益又は経常損失（△）	△2,558,628	△11,926,918
当期純利益又は当期純損失（△）	△2,558,628	△11,926,918
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（△）	△497,222	1,064,848
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,548,910	5,746,516
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,889,948	4,284,570
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,889,948	4,284,570
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,630,936	2,129,797
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,630,936	2,129,797
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	－
分配金	-	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,746,516	△5,090,477

（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5期 自　令和1年5月9日 至　令和2年5月8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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第4期 令和1年5月8日現在	第5期 令和2年5月8日現在
１．　期首元本額	269,568,501円	377,033,265円
期中追加設定元本額	180,925,539円	184,043,588円
期中一部解約元本額	73,460,775円	122,719,064円
２．　受益権の総数	377,033,265口	438,357,789口
３．　元本の欠損	－	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,090,477円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第4期 自　平成30年5月9日 至　令和1年5月8日	第5期 自　令和1年5月9日 至　令和2年5月8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（942,184円）、有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（8,712,929円）、分配準備積立金（5,063,667円）より、分配対象収益は14,718,780円（1万口当たり390円）でありますが、当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（898,544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（12,836,807円）及び分配準備積立金（4,445,189円）より分配対象収益は18,180,540円（1万口当たり414.74円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第4期 自　平成30年5月9日 至　令和1年5月8日	第5期 自　令和1年5月9日 至　令和2年5月8日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。	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。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。 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。	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。 リスク管理に関する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。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 ①市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ②信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ③流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	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。リスク管理に関する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	第4期 令和1年5月8日現在	第5期 令和2年5月8日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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 親投資信託受益証券 原則として、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (２)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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、時価は帳簿価額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。	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	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	第4期 令和1年5月8日現在	第5期 令和2年5月8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	6,008,537	△1,729,765
合計	6,008,537	△1,729,765

（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4期 令和1年5月8日現在	第5期 令和2年5月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0152円 (10,152円)	0.9884円 (9,884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

令和2年5月8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	ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド	282,593,795	354,457,397	
	ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド	2,719,976	4,873,380	
	ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド	33,367,045	43,720,839	
	ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド	4,240,616	7,529,213	
親投資信託受益証券　合計		322,921,432	410,580,829	
合計			410,580,829	

（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、「ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド」受益証券及び「ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド」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。

ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和2年5月8日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	837,974,952
国債証券	137,044,197,550
地方債証券	7,147,889,398
特殊債券	8,109,875,756
社債券	4,749,522,900
未収利息	252,464,741
前払費用	32,319,919
流動資産合計	158,174,245,216
資産合計	158,174,245,216
負債の部	
流動負債	
未払解約金	85,420,000
流動負債合計	85,420,000
負債合計	85,420,000
純資産の部	
元本等	
元本	126,035,115,497
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	32,053,709,719
元本等合計	158,088,825,216
純資産合計	158,088,825,216
負債純資産合計	158,174,245,216

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年5月9日 至　令和2年5月8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	令和2年5月8日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	122,368,202,545円
同期中追加設定元本額	53,145,336,589円
同期中一部解約元本額	49,478,423,637円
元本の内訳	
ファンド名	
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	320,665,733円
コア資産形成ファンド	282,593,795円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	49,527,340,984円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	59,079,266,829円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	10,006,058,043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］	6,819,190,113円
計	126,035,115,497円
２．　受益権の総数	126,035,115,497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　令和1年5月9日 至　令和2年5月8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。リスク管理に関する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	令和2年5月8日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	令和2年5月8日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,309,568,050
地方債証券	△53,193,037
特殊債券	△43,934,824
社債券	△53,990,300
合計	△1,460,686,211

（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）

	令和2年5月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2543円 (12,543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

令和2年5月8日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４０２回　利付国庫債券（２年）	250,000,000	250,797,500	
	４０３回　利付国庫債券（２年）	400,000,000	401,372,000	
	４０５回　利付国庫債券（２年）	500,000,000	502,090,000	
	４０６回　利付国庫債券（２年）	700,000,000	703,003,000	
	４０７回　利付国庫債券（２年）	500,000,000	502,225,000	
	４０８回　利付国庫債券（２年）	200,000,000	200,922,000	
	４０９回　利付国庫債券（２年）	350,000,000	351,697,500	
	４１０回　利付国庫債券（２年）	700,000,000	703,549,000	
	１２８回　利付国庫債券（５年）	680,000,000	682,114,800	
	１２９回　利付国庫債券（５年）	1,160,000,000	1,164,350,000	

１３０回　利付国庫債券（５年）	1,050,000,000	1,054,662,000	
１３１回　利付国庫債券（５年）	1,050,000,000	1,055,470,500	
１３２回　利付国庫債券（５年）	1,160,000,000	1,166,867,200	
１３３回　利付国庫債券（５年）	1,660,000,000	1,671,022,400	
１３４回　利付国庫債券（５年）	1,390,000,000	1,400,202,600	
１３５回　利付国庫債券（５年）	1,500,000,000	1,511,835,000	
１３６回　利付国庫債券（５年）	1,100,000,000	1,109,449,000	
１３７回　利付国庫債券（５年）	1,010,000,000	1,019,211,200	
１３８回　利付国庫債券（５年）	1,350,000,000	1,362,987,000	
１３９回　利付国庫債券（５年）	1,530,000,000	1,545,728,400	
１４０回　利付国庫債券（５年）	1,350,000,000	1,364,512,500	
１４１回　利付国庫債券（５年）	1,050,000,000	1,061,518,500	
１４２回　利付国庫債券（５年）	1,310,000,000	1,324,580,300	
１４３回　利付国庫債券（５年）	250,000,000	252,872,500	
１回　利付国債（４０年）	110,000,000	166,182,500	
２回　利付国庫債券（４０年）	150,000,000	220,708,500	
３回　利付国庫債券（４０年）	210,000,000	312,068,400	
４回　利付国庫債券（４０年）	340,000,000	510,200,600	
５回　利付国庫債券（４０年）	330,000,000	480,552,600	
６回　利付国庫債券（４０年）	300,000,000	431,937,000	
７回　利付国庫債券（４０年）	360,000,000	499,550,400	
８回　利付国庫債券（４０年）	390,000,000	506,980,500	
９回　利付国庫債券（４０年）	570,000,000	557,750,700	
１０回　利付国庫債券（４０年）	520,000,000	595,857,600	
１１回　利付国庫債券（４０年）	440,000,000	490,604,400	
１２回　利付国庫債券（４０年）	400,000,000	404,604,000	
３１５回　利付国庫債券（１０年）	830,000,000	842,682,400	
３１６回　利付国庫債券（１０年）	480,000,000	486,801,600	
３１７回　利付国庫債券（１０年）	410,000,000	417,134,000	
３１８回　利付国庫債券（１０年）	850,000,000	863,625,500	

３１９回　利付国庫債券（１０年）	480,000,000	489,926,400	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	1,260,000,000	1,284,015,600	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	840,000,000	858,471,600	
３２２回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	510,060,000	
３２３回　利付国庫債券（１０年）	560,000,000	572,863,200	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	750,000,000	765,645,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	2,100,000,000	2,148,804,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	520,000,000	531,934,000	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	1,170,000,000	1,199,916,900	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	1,790,000,000	1,829,827,500	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	1,480,000,000	1,524,873,600	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	910,000,000	939,838,900	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	513,015,000	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	1,420,000,000	1,459,447,600	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	1,580,000,000	1,626,910,200	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	1,460,000,000	1,505,887,800	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	1,310,000,000	1,347,374,300	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	440,000,000	453,173,600	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,170,000,000	1,193,891,400	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	1,200,000,000	1,231,992,000	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	1,320,000,000	1,356,682,800	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	1,660,000,000	1,708,422,200	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	1,260,000,000	1,291,348,800	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	1,350,000,000	1,368,724,500	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	1,670,000,000	1,694,164,900	

３４４回　利付国庫債券（１０年）	1,360,000,000	1,380,060,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	1,330,000,000	1,350,388,900	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	1,370,000,000	1,391,317,200	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	1,270,000,000	1,290,497,800	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	1,160,000,000	1,178,942,800	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	1,300,000,000	1,321,450,000	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	1,660,000,000	1,686,958,400	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	1,140,000,000	1,158,160,200	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	1,170,000,000	1,188,216,900	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	1,370,000,000	1,390,769,200	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	1,040,000,000	1,054,809,600	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	1,190,000,000	1,205,779,400	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	1,110,000,000	1,123,542,000	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	1,100,000,000	1,112,166,000	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	200,000,000	202,070,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,644,900	
１１回　利付国庫債券（３０年）	50,000,000	60,118,500	
１２回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	37,737,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	50,000,000	62,379,500	
１４回　利付国庫債券（３０年）	50,000,000	65,227,500	
１５回　利付国庫債券（３０年）	60,000,000	79,372,200	
１６回　利付国庫債券（３０年）	90,000,000	119,482,200	
１７回　利付国庫債券（３０年）	70,000,000	92,188,600	
１８回　利付国庫債券（３０年）	80,000,000	104,466,400	
１９回　利付国庫債券（３０年）	80,000,000	104,792,800	
２０回　利付国庫債券（３０年）	130,000,000	174,691,400	

２１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	144,859,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	70,000,000	94,600,100	
２３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	203,367,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	80,000,000	108,720,800	
２５回　利付国庫債券（３０年）	130,000,000	172,915,600	
２６回　利付国庫債券（３０年）	220,000,000	296,751,400	
２７回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	274,420,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	400,171,000	
２９回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	411,069,000	
３０回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	421,782,900	
３１回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	351,036,400	
３２回　利付国庫債券（３０年）	420,000,000	577,966,200	
３３回　利付国庫債券（３０年）	650,000,000	861,211,000	
３４回　利付国庫債券（３０年）	480,000,000	658,372,800	
３５回　利付国庫債券（３０年）	560,000,000	748,860,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	832,784,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	756,361,500	
３８回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	458,377,500	
３９回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	413,614,400	
４０回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	446,947,000	
４１回　利付国庫債券（３０年）	380,000,000	491,875,800	
４２回　利付国庫債券（３０年）	360,000,000	466,495,200	
４３回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	428,571,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	403,037,200	
４５回　利付国庫債券（３０年）	390,000,000	489,407,100	

４６回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	502,892,000	
４７回　利付国庫債券（３０年）	450,000,000	577,165,500	
４８回　利付国庫債券（３０年）	480,000,000	593,251,200	
４９回　利付国庫債券（３０年）	380,000,000	469,911,800	
５０回　利付国庫債券（３０年）	370,000,000	403,732,900	
５１回　利付国庫債券（３０年）	380,000,000	367,969,200	
５２回　利付国庫債券（３０年）	410,000,000	416,793,700	
５３回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	416,732,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	436,684,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	390,000,000	425,548,500	
５６回　利付国庫債券（３０年）	410,000,000	447,683,100	
５７回　利付国庫債券（３０年）	390,000,000	425,610,900	
５８回　利付国庫債券（３０年）	490,000,000	535,099,600	
５９回　利付国庫債券（３０年）	390,000,000	415,884,300	
６０回　利付国庫債券（３０年）	370,000,000	413,959,700	
６１回　利付国庫債券（３０年）	360,000,000	383,785,200	
６２回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	334,214,100	
６３回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	394,344,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	360,000,000	354,870,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	370,000,000	364,686,800	
６６回　利付国庫債券（３０年）	70,000,000	68,987,800	
５９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,493,100	
６４回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,094,000	
６５回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	64,488,600	
６７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	53,997,500	

７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	55,283,500	
７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	43,896,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	120,839,400	
７３回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	43,972,400	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	44,158,000	
７５回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	44,382,000	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	76,983,900	
７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	44,186,400	
７８回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	66,282,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	55,492,000	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	100,349,100	
８１回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	178,448,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	156,898,000	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	78,845,200	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	190,519,000	
８５回　利付国庫債券（２０年）	150,000,000	169,743,000	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	137,211,600	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	136,502,400	
８８回　利付国庫債券（２０年）	240,000,000	275,916,000	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,434,900	
９０回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	195,345,300	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	127,105,000	
９２回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	333,009,900	
９３回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	137,589,600	
９４回　利付国庫債券（２０年）	220,000,000	253,770,000	

９５回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	234,706,000	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	139,102,800	
９７回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	187,499,200	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	186,312,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	350,886,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	271,894,500	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	155,738,700	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	168,477,400	
１０３回　利付国債（２０年）	160,000,000	191,238,400	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	129,679,000	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	240,000,000	284,042,400	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	150,000,000	178,788,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	237,598,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	339,491,400	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	152,621,300	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	131,099,100	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	204,909,500	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	190,000,000	227,278,000	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	479,984,000	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	270,000,000	324,961,200	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	194,110,400	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	210,000,000	255,666,600	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	627,952,000	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	245,000,000	294,237,650	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	270,000,000	318,807,900	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	420,000,000	487,443,600	

１２１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	477,756,000	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	438,098,500	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	670,417,000	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	435,013,200	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	240,000,000	296,040,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	302,970,000	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	220,000,000	264,235,400	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	517,887,700	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	320,000,000	381,868,800	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	610,138,500	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	343,667,400	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	310,000,000	368,196,300	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	623,610,000	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	480,812,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	190,000,000	226,153,200	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	220,000,000	259,278,800	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	298,215,000	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	260,000,000	303,914,000	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	270,000,000	318,837,600	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	896,527,500	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	562,951,900	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	330,000,000	399,366,000	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	617,448,000	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	505,133,900	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	769,516,800	

１４６回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	722,766,000	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	895,057,500	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	708,996,000	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	720,000,000	852,530,400	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	730,000,000	855,275,300	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	730,000,000	835,404,700	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	680,000,000	778,674,800	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	812,931,000	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	757,231,200	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	827,112,800	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	610,000,000	624,908,400	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	580,000,000	575,505,000	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	685,396,800	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	580,000,000	611,395,400	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	566,744,900	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	620,821,600	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	546,644,800	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	630,636,000	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	795,425,400	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	588,564,900	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	480,000,000	512,520,000	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	649,914,300	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	560,000,000	567,459,200	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	497,300,000	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	517,160,800	

	１７１回　利付国庫債券（２０年）	480,000,000	476,904,000	
国債証券　合計		126,395,000,000	137,044,197,550	
地方債証券	７１９回　東京都公募公債	200,000,000	204,870,000	
	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,779,000	
	１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	104,771,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	111,292,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	118,568,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	119,627,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,787,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	100,000,000	100,555,000	
	２９回１号　宮城県公募公債　１０年	100,000,000	102,296,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	102,496,000	
	３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	136,158,000	
	３６８回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	102,211,000	
	４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,524,000	
	４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	100,699,000	
	１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	112,458,000	
	２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	110,266,958	
	２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	136,730,000	
	５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	104,138,000	
	２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	109,323,000	
	４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	109,933,000	
	２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	134,197,000	
	２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	102,332,000	
	３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	101,238,000	
	２５年度８回　埼玉県公募公債	100,000,000	102,479,000	
	１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	116,660,000	
	１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	111,780,000	
	２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	101,081,000	
	２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	109,304,000	
	２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	120,251,000	
	２５年度６回　千葉県公募公債	100,000,000	102,653,000	
	２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	100,263,000	

２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	100,602,000	
２５年度２回　新潟県公募公債	100,000,000	102,474,000	
１００回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,431,000	
１０５回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,711,000	
１１５回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,947,000	
１１８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,255,000	
１２７回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,296,000	
１３２回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,480,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,056,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,353,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,213,600	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,934,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,403,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,072,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,898,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,516,000	
２３年度２回　堺市公募公債	100,000,000	101,641,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	102,345,000	
２５年度２回　島根県公募公債	106,000,000	108,452,840	
２３年度１回　新潟市公募公債　１０年	100,000,000	101,689,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	102,250,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	101,482,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	235,954,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	116,481,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	102,455,000	
２３年度５回　横浜市公募公債	100,000,000	101,713,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	116,534,000	
２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	102,139,000	
６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	116,192,000	
２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	101,962,000	

	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	102,221,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	102,017,000	
地方債証券　合計		6,735,330,000	7,147,889,398	
特殊債券	７８回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,825,000	
	１９回　政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,948,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	119,559,000	
	１０１回　日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	204,140,000	
	１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,557,000	
	１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,050,000	
	１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,967,000	
	１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	123,879,000	
	１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	135,234,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	119,383,000	
	１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	126,671,000	
	１４２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,361,000	
	１４７回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,532,000	
	１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	118,731,000	
	１７０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,886,000	
	１７７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,102,000	
	１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,882,000	
	１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,985,000	
	２０２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	107,583,000	
	２１１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,533,000	
	２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,700,000	
	２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,370,000	
	２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,414,000	
	２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,281,000	

２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,773,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,536,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,417,000	
２８回　日本道路・機構承継債	100,000,000	133,287,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	119,181,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	120,607,000	
２９回　地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,499,000	
３６回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,851,000	
３８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,860,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	117,169,000	
４０回　地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,989,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	216,160,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,156,000	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	116,700,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,965,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,329,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	104,523,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,896,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,910,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,463,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,059,740	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	111,298,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	108,659,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	102,209,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,915,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,302,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,376,000	

２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,063,000	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,141,000	13,689,242	
４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,623,000	14,180,998	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,917,000	24,575,732	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,547,000	33,341,077	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,589,000	31,425,293	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,499,000	37,538,772	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,087,000	39,220,244	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,829,000	46,257,126	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,090,000	99,728,490	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,566,000	43,596,499	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,185,000	51,224,210	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,443,000	51,535,427	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,606,000	55,870,317	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,395,000	58,415,632	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,493,000	62,820,633	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,531,000	71,595,375	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,319,000	74,016,997	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,903,000	87,119,386	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,010,000	87,288,968	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,072,000	87,294,222	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,314,000	183,400,924	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,280,000	190,040,507	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,506,000	95,825,945	
３２６回　利附信金中金債（５年）	100,000,000	100,003,000	

	３３１回　利附信金中金債（５年）	100,000,000	100,033,000	
	３４２回　利附信金中金債（５年）	100,000,000	100,063,000	
	７回　広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	102,157,000	
	１８回　国際協力機構債券	100,000,000	102,693,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,199,000	
特殊債券　合計		7,604,945,000	8,109,875,756	
社債券	２６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１８）	100,000,000	99,438,000	
	２回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,304,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	99,287,000	
	３４４回　東京交通債券	100,000,000	104,266,000	
	１６回　成田国際空港社債	100,000,000	102,412,000	
	３７回　東日本高速道路社債	200,000,000	200,032,000	
	５６回　中日本高速道路社債	100,000,000	102,635,000	
	２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	102,473,000	
	１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	101,364,000	
	９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	100,783,000	
	４９回　住友化学社債	100,000,000	102,623,000	
	１４回　ブリヂストン社債	100,000,000	99,664,000	
	３６回　富士通社債	100,000,000	100,427,000	
	１７回　パナソニック社債	100,000,000	100,128,000	
	２９回　三菱重工業社債	100,000,000	101,415,000	
	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	99,154,000	
	２６回　豊田通商社債	100,000,000	99,741,000	
	７９回　三菱商事社債	100,000,000	101,497,000	
	５３回　クレディセゾン社債	100,000,000	100,288,000	
	５７回　東京三菱銀行社債	100,000,000	105,199,000	
	８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	114,550,000	
	１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	111,322,000	
	３１回　ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,290,000	
	８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,274,000	
	５６回　三菱ＵＦＪリース社債	100,000,000	100,007,000	
	５０回　野村ホールディングス社債	100,000,000	99,952,000	
	１０６回　住友不動産社債	100,000,000	99,826,000	
	６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	117,127,000	

	１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	116,405,000	
	２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,917,000	
	７回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,192,000	
	９回　東海旅客鉄道社債	110,000,000	114,222,900	
	３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	114,681,000	
	６２回　日本電信電話債券	100,000,000	101,189,000	
	５２７回　中部電力社債	100,000,000	102,282,000	
	４９７回　関西電力社債	100,000,000	103,122,000	
	３１１回　北陸電力社債	100,000,000	103,352,000	
	４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,526,000	
	４２８回　九州電力社債	100,000,000	102,817,000	
	３２１回　北海道電力社債	100,000,000	102,490,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	99,389,000	
	３４回　東京瓦斯社債	100,000,000	101,338,000	
	３０回　大阪瓦斯社債	100,000,000	101,631,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	100,000,000	102,029,000	
	５回　ファーストリテイリング社債	100,000,000	99,462,000	
社債券　合計		4,610,000,000	4,749,522,900	
合計			157,051,485,604	

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。

ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和2年5月8日現在
資産の部	
流動資産	
預金	312,569,843
コール・ローン	10,629,289
国債証券	15,005,413,244
未収利息	89,155,011
前払費用	17,539,340
差入委託証拠金	45,565,663
流動資産合計	15,480,872,390
資産合計	15,480,872,390
負債の部	
流動負債	
未払金	38,609,014
未払解約金	330,500
流動負債合計	38,939,514
負債合計	38,939,514
純資産の部	
元本等	
元本	11,785,412,583
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,656,520,293
元本等合計	15,441,932,876
純資産合計	15,441,932,876
負債純資産合計	15,480,872,390

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年5月9日 至　令和2年5月8日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年5月8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	18,254,512,323円
同期中追加設定元本額	12,274,416,063円
同期中一部解約元本額	18,743,515,803円
元本の内訳	
ファンド名	
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	39,087,251円
コア資産形成ファンド	33,367,045円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	576,006,932円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	1,007,380,708円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	6,849,775,170円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,279,795,477円
計	11,785,412,583円
２．　受益権の総数	11,785,412,583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　令和1年5月9日 至　令和2年5月8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。リスク管理に関する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	令和2年5月8日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	令和2年5月8日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	662,679,400
合計	662,679,400

（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）

	令和2年5月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3103円 (13,103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

令和2年5月8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 1.125 07/31/21	140,000.000	141,684.370	
		US T N/B 1.125 08/31/21	380,000.000	384,913.270	
		US T N/B 1.125 09/30/21	40,000.000	40,550.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	150,000.000	155,039.060	
		US T N/B 1.25 08/31/24	530,000.000	552,235.150	
		US T N/B 1.25 10/31/21	300,000.000	304,921.870	
		US T N/B 1.375 01/31/25	590,000.000	620,007.020	
		US T N/B 1.375 06/30/23	370,000.000	383,614.840	
		US T N/B 1.375 08/31/23	170,000.000	176,507.810	
		US T N/B 1.375 09/30/23	230,000.000	239,002.340	
		US T N/B 1.5 01/31/22	210,000.000	214,938.280	
		US T N/B 1.5 02/15/30	160,000.000	173,175.000	
		US T N/B 1.5 02/28/23	240,000.000	248,925.000	
		US T N/B 1.5 03/31/23	440,000.000	456,843.750	
		US T N/B 1.5 08/15/22	420,000.000	432,878.900	
		US T N/B 1.5 08/15/26	640,000.000	681,900.000	
		US T N/B 1.5 09/30/21	790,000.000	805,028.500	
		US T N/B 1.5 10/31/21	200,000.000	204,023.430	
		US T N/B 1.5 11/30/24	620,000.000	654,439.050	
		US T N/B 1.625 02/15/26	610,000.000	652,652.340	
		US T N/B 1.625 04/30/23	320,000.000	333,650.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	580,000.000	621,778.120	
		US T N/B 1.625 05/31/23	230,000.000	239,990.620	
		US T N/B 1.625 08/15/22	150,000.000	154,916.010	
		US T N/B 1.625 08/15/29	380,000.000	414,971.870	
		US T N/B 1.625 08/31/22	790,000.000	816,785.930	
		US T N/B 1.625 09/30/26	90,000.000	96,700.780	
		US T N/B 1.625 10/31/23	300,000.000	314,601.560	
		US T N/B 1.625 10/31/26	160,000.000	171,912.490	
		US T N/B 1.625 11/15/22	730,000.000	756,662.090	
		US T N/B 1.75 02/28/22	200,000.000	205,812.500	
		US T N/B 1.75 04/30/22	180,000.000	185,737.500	
		US T N/B 1.75 05/15/22	250,000.000	258,095.700	
		US T N/B 1.75 05/15/23	390,000.000	408,281.250	
		US T N/B 1.75 05/31/22	290,000.000	299,538.270	
		US T N/B 1.75 06/30/22	260,000.000	268,917.180	
		US T N/B 1.75 07/31/21	450,000.000	458,929.680	
		US T N/B 1.75 09/30/22	210,000.000	217,973.430	
		US T N/B 1.75 11/15/29	510,000.000	563,510.140	
		US T N/B 1.75 11/30/21	160,000.000	163,987.490	
		US T N/B 1.75 12/31/24	290,000.000	309,597.650	
		US T N/B 1.75 12/31/26	370,000.000	401,016.400	
		US T N/B 1.875 01/31/22	370,000.000	381,071.090	
		US T N/B 1.875 02/28/22	320,000.000	330,024.990	
		US T N/B 1.875 04/30/22	200,000.000	206,812.500	
		US T N/B 1.875 05/31/22	100,000.000	103,562.500	

		US T N/B 1.875 06/30/26	30,000.000	32,629.680	
		US T N/B 1.875 07/31/22	290,000.000	301,124.210	
		US T N/B 1.875 07/31/26	410,000.000	446,195.310	
		US T N/B 1.875 08/31/22	210,000.000	218,383.590	
		US T N/B 1.875 08/31/24	120,000.000	128,250.000	
		US T N/B 1.875 09/30/22	720,000.000	749,531.240	
		US T N/B 1.875 11/30/21	250,000.000	256,806.640	
		US T N/B 2.0 02/15/22	250,000.000	258,232.420	
		US T N/B 2.0 02/15/23	690,000.000	724,823.430	
		US T N/B 2.0 02/15/25	740,000.000	799,778.120	
		US T N/B 2.0 02/15/50	70,000.000	81,675.770	
		US T N/B 2.0 04/30/24	160,000.000	171,075.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	660,000.000	706,509.360	
		US T N/B 2.0 06/30/24	90,000.000	96,454.680	
		US T N/B 2.0 07/31/22	250,000.000	260,292.960	
		US T N/B 2.0 08/15/25	700,000.000	760,648.430	
		US T N/B 2.0 08/31/21	210,000.000	215,110.540	
		US T N/B 2.0 10/31/21	210,000.000	215,709.370	
		US T N/B 2.0 10/31/22	320,000.000	334,500.000	
		US T N/B 2.0 11/15/21	360,000.000	370,265.620	
		US T N/B 2.0 11/15/26	690,000.000	758,245.300	
		US T N/B 2.0 11/30/22	530,000.000	554,760.930	
		US T N/B 2.0 12/31/21	190,000.000	195,789.060	
		US T N/B 2.125 02/29/24	150,000.000	160,687.500	
		US T N/B 2.125 03/31/24	760,000.000	815,396.860	
		US T N/B 2.125 05/15/22	410,000.000	426,319.910	
		US T N/B 2.125 05/15/25	630,000.000	686,896.870	
		US T N/B 2.125 06/30/22	220,000.000	229,350.000	
		US T N/B 2.125 07/31/24	180,000.000	194,076.560	
		US T N/B 2.125 08/15/21	280,000.000	286,923.430	
		US T N/B 2.125 09/30/21	250,000.000	256,933.590	
		US T N/B 2.125 09/30/24	180,000.000	194,568.750	
		US T N/B 2.125 11/30/23	260,000.000	277,448.430	
		US T N/B 2.125 11/30/24	180,000.000	195,060.930	
		US T N/B 2.125 12/31/21	250,000.000	258,203.120	
		US T N/B 2.125 12/31/22	20,000.000	21,032.810	
		US T N/B 2.25 01/31/24	160,000.000	172,025.000	
		US T N/B 2.25 02/15/27	560,000.000	626,325.000	
		US T N/B 2.25 03/31/26	280,000.000	310,100.000	
		US T N/B 2.25 04/15/22	360,000.000	374,639.060	
		US T N/B 2.25 04/30/24	670,000.000	723,024.210	
		US T N/B 2.25 07/31/21	300,000.000	307,757.810	
		US T N/B 2.25 08/15/27	690,000.000	776,681.250	
		US T N/B 2.25 08/15/46	320,000.000	385,524.990	
		US T N/B 2.25 08/15/49	380,000.000	465,054.670	
		US T N/B 2.25 10/31/24	250,000.000	271,914.060	
		US T N/B 2.25 11/15/24	700,000.000	761,851.550	
		US T N/B 2.25 11/15/25	260,000.000	286,629.680	
		US T N/B 2.25 11/15/27	500,000.000	564,140.620	

		US T N/B 2.25 12/31/23	280,000.000	300,584.370	
		US T N/B 2.375 01/31/23	340,000.000	360,373.430	
		US T N/B 2.375 04/30/26	300,000.000	334,757.810	
		US T N/B 2.375 05/15/27	320,000.000	361,874.990	
		US T N/B 2.375 05/15/29	560,000.000	647,500.000	
		US T N/B 2.375 08/15/24	140,000.000	152,556.250	
		US T N/B 2.375 11/15/49	380,000.000	477,582.800	
		US T N/B 2.5 01/15/22	560,000.000	582,290.620	
		US T N/B 2.5 01/31/24	360,000.000	390,290.620	
		US T N/B 2.5 01/31/25	220,000.000	242,825.000	
		US T N/B 2.5 02/15/22	840,000.000	875,076.560	
		US T N/B 2.5 02/15/45	340,000.000	425,371.870	
		US T N/B 2.5 02/15/46	380,000.000	478,265.620	
		US T N/B 2.5 02/28/26	170,000.000	190,532.810	
		US T N/B 2.5 03/31/23	330,000.000	352,068.750	
		US T N/B 2.5 05/15/24	650,000.000	708,398.430	
		US T N/B 2.5 05/15/46	160,000.000	201,600.000	
		US T N/B 2.5 08/15/23	300,000.000	322,382.810	
		US T N/B 2.625 01/31/26	280,000.000	315,481.250	
		US T N/B 2.625 02/15/29	620,000.000	728,209.370	
		US T N/B 2.625 02/28/23	250,000.000	267,128.900	
		US T N/B 2.625 03/31/25	240,000.000	267,000.000	
		US T N/B 2.625 06/30/23	230,000.000	247,501.560	
		US T N/B 2.625 07/15/21	230,000.000	236,765.230	
		US T N/B 2.625 12/15/21	600,000.000	623,882.800	
		US T N/B 2.625 12/31/23	470,000.000	511,014.840	
		US T N/B 2.75 02/15/24	710,000.000	777,006.250	
		US T N/B 2.75 02/15/28	300,000.000	350,812.500	
		US T N/B 2.75 04/30/23	230,000.000	247,447.650	
		US T N/B 2.75 05/31/23	530,000.000	571,323.430	
		US T N/B 2.75 06/30/25	250,000.000	280,878.900	
		US T N/B 2.75 08/15/21	200,000.000	206,539.060	
		US T N/B 2.75 08/15/42	250,000.000	323,535.150	
		US T N/B 2.75 08/15/47	360,000.000	477,534.370	
		US T N/B 2.75 08/31/25	190,000.000	214,076.560	
		US T N/B 2.75 09/15/21	910,000.000	942,098.820	
		US T N/B 2.75 11/15/23	740,000.000	805,617.180	
		US T N/B 2.75 11/15/42	256,000.000	331,400.000	
		US T N/B 2.75 11/15/47	110,000.000	146,119.530	
		US T N/B 2.875 04/30/25	170,000.000	191,528.900	
		US T N/B 2.875 05/15/28	530,000.000	627,056.250	
		US T N/B 2.875 05/15/43	260,000.000	343,301.560	
		US T N/B 2.875 05/15/49	470,000.000	645,882.800	
		US T N/B 2.875 07/31/25	240,000.000	271,593.740	
		US T N/B 2.875 08/15/28	600,000.000	712,500.000	
		US T N/B 2.875 08/15/45	170,000.000	227,321.870	
		US T N/B 2.875 09/30/23	80,000.000	87,181.240	
		US T N/B 2.875 10/15/21	220,000.000	228,619.520	
		US T N/B 2.875 11/15/21	340,000.000	354,091.400	

	US T N/B 2.875 11/15/46	410,000.000	553,660.140	
	US T N/B 2.875 11/30/23	600,000.000	656,484.370	
	US T N/B 2.875 11/30/25	360,000.000	409,556.250	
	US T N/B 3.0 02/15/47	190,000.000	262,942.180	
	US T N/B 3.0 02/15/48	340,000.000	472,520.300	
	US T N/B 3.0 02/15/49	330,000.000	462,644.520	
	US T N/B 3.0 05/15/45	250,000.000	340,546.870	
	US T N/B 3.0 05/15/47	330,000.000	456,946.870	
	US T N/B 3.0 08/15/48	460,000.000	641,987.500	
	US T N/B 3.0 10/31/25	350,000.000	399,984.370	
	US T N/B 3.0 11/15/44	270,000.000	366,356.250	
	US T N/B 3.0 11/15/45	210,000.000	287,273.430	
	US T N/B 3.125 02/15/42	180,000.000	246,754.680	
	US T N/B 3.125 02/15/43	250,000.000	342,578.120	
	US T N/B 3.125 05/15/48	160,000.000	227,625.000	
	US T N/B 3.125 08/15/44	250,000.000	345,253.900	
	US T N/B 3.125 11/15/28	660,000.000	800,198.420	
	US T N/B 3.375 05/15/44	190,000.000	272,175.000	
	US T N/B 3.375 11/15/48	440,000.000	656,287.500	
	US T N/B 3.5 02/15/39	110,000.000	157,721.090	
	US T N/B 3.625 02/15/44	240,000.000	355,743.740	
	US T N/B 3.625 08/15/43	130,000.000	191,983.590	
	US T N/B 3.75 08/15/41	110,000.000	163,633.590	
	US T N/B 3.75 11/15/43	180,000.000	271,026.560	
	US T N/B 3.875 08/15/40	120,000.000	180,590.620	
	US T N/B 4.25 05/15/39	140,000.000	219,001.560	
	US T N/B 4.25 11/15/40	80,000.000	126,125.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	50,000.000	78,460.930	
	US T N/B 4.375 05/15/40	100,000.000	159,687.500	
	US T N/B 4.375 05/15/41	20,000.000	32,129.680	
	US T N/B 4.375 11/15/39	140,000.000	222,796.870	
	US T N/B 4.5 02/15/36	100,000.000	154,562.500	
	US T N/B 4.5 05/15/38	60,000.000	95,587.500	
	US T N/B 4.625 02/15/40	90,000.000	147,522.650	
	US T N/B 4.75 02/15/41	160,000.000	267,687.490	
	US T N/B 5.0 05/15/37	55,000.000	91,037.890	
	US T N/B 5.25 02/15/29	120,000.000	168,243.750	
	US T N/B 5.375 02/15/31	160,000.000	239,412.490	
	US T N/B 6.0 02/15/26	60,000.000	79,279.680	
	US T N/B 6.25 05/15/30	49,000.000	75,957.650	
	US T N/B 8.0 11/15/21	35,000.000	39,198.630	
アメリカ・ドル　小計		59,065,000.000 (6,282,153,400)	66,557,426.040 (7,079,047,834)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	240,000.000	242,690.400	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	100,000.000	102,809.000	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	220,000.000	233,980.420	

	UK TREASURY 1.0 04/22/24	170,000.000	176,412.400	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	120,000.000	129,889.200	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	170,000.000	185,327.200	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	210,000.000	260,211.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	250,000.000	281,338.120	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	90,000.000	144,099.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	60,000.000	79,014.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	150,000.000	215,865.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	330,000.000	343,374.900	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	250,000.000	301,250.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	160,000.000	177,044.800	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	300,000.000	322,288.800	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	160,000.000	296,133.760	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	150,000.000	238,830.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	180,000.000	301,266.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	140,000.000	329,056.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	110,000.000	216,040.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	70,000.000	160,790.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	180,000.000	284,130.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	50,000.000	73,025.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	140,000.000	236,040.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	130,000.000	223,990.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	90,000.000	171,747.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	167,000.000	335,519.700	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	162,000.000	361,454.400	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	110,000.000	172,513.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	175,000.000	321,562.500	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	115,000.000	169,188.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	80,000.000	140,432.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	165,000.000	204,141.300	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	120,000.000	179,701.200	

イギリス・ポンド　小計		5,314,000.000 (700,066,360)	7,611,154.100 (1,002,693,441)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	270,000.000	287,294.040	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	340,000.000	370,201.520	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	90,000.000	127,377.000	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	240,000.000	411,729.840	
イスラエル・シュケル　小計		940,000.000 (28,491,400)	1,196,602.400 (36,269,019)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	100,000.000	105,305.090	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	280,000.000	322,104.180	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	170,000.000	186,233.990	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	30,000.000	35,842.410	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	290,000.000	332,949.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	240,000.000	278,262.790	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	190,000.000	222,034.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	100,000.000	127,012.900	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	215,000.000	244,986.220	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	240,000.000	289,483.260	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	60,000.000	76,722.750	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	170,000.000	229,294.430	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	370,000.000	450,772.140	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	180,000.000	254,223.840	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	330,000.000	422,365.740	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	350,000.000	403,946.200	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	240,000.000	268,825.320	
オーストラリア・ドル　小計		3,555,000.000 (246,788,100)	4,250,364.260 (295,060,287)	
カナダ・ドル	CANADA 0.5 03/01/22	110,000.000	110,521.400	
	CANADA 0.75 09/01/21	240,000.000	241,591.200	
	CANADA 1.0 06/01/27	250,000.000	259,805.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	150,000.000	152,596.500	
	CANADA 1.25 03/01/25	70,000.000	72,986.200	
	CANADA 1.25 06/01/30	50,000.000	53,471.000	
	CANADA 1.25 11/01/21	360,000.000	365,385.600	
	CANADA 1.5 06/01/23	100,000.000	103,850.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	140,000.000	149,415.000	
	CANADA 1.5 09/01/24	150,000.000	157,485.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	160,000.000	166,838.400	
	CANADA 2.0 06/01/28	60,000.000	67,315.200	
	CANADA 2.0 12/01/51	100,000.000	123,815.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	190,000.000	203,991.600	
	CANADA 2.25 06/01/25	110,000.000	120,439.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	120,000.000	138,818.400	
	CANADA 2.5 06/01/24	120,000.000	130,579.200	

	CANADA 2.75 06/01/22	110,000.000	115,685.900	
	CANADA 2.75 12/01/48	90,000.000	125,688.600	
	CANADA 2.75 12/01/64	40,000.000	62,867.200	
	CANADA 3.5 12/01/45	150,000.000	230,337.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	120,000.000	186,702.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	40,000.000	65,829.600	
	CANADA 5.75 06/01/29	90,000.000	132,141.600	
	CANADA 5.75 06/01/33	120,000.000	194,913.600	
カナダ・ドル　小計		3,240,000.000 (247,244,400)	3,733,069.200 (284,870,511)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.0 02/01/24	100,000.000	105,347.440	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	30,000.000	32,567.760	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	30,000.000	35,787.900	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	60,000.000	68,348.140	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	60,000.000	78,956.130	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	20,000.000	25,638.630	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	100,000.000	106,900.350	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	30,000.000	35,520.430	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	90,000.000	99,369.450	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	100,000.000	127,892.500	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	80,000.000	94,519.800	
シンガポール・ドル　小計		700,000.000 (52,752,000)	810,848.530 (61,105,545)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	400,000.000	430,292.920	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	370,000.000	400,695.200	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	420,000.000	455,215.740	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	600,000.000	639,409.200	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	850,000.000	971,581.270	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	300,000.000	469,605.000	
スウェーデン・クローナ　小計		2,940,000.000 (31,928,400)	3,366,799.330 (36,563,441)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/22	370,000.000	377,807.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	780,000.000	835,877.240	
	DENMARK 0.5 11/15/29	510,000.000	551,208.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	330,000.000	354,502.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	620,000.000	699,059.300	
	DENMARK 4.5 11/15/39	970,000.000	1,829,470.440	
デンマーク・クローネ　小計		3,580,000.000 (55,346,800)	4,647,924.480 (71,856,912)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	200,000.000	215,494.680	
	NORWAY 1.75 02/17/27	300,000.000	330,699.120	
	NORWAY 1.75 03/13/25	290,000.000	313,488.600	
	NORWAY 1.75 09/06/29	310,000.000	349,205.700	
	NORWAY 2.0 04/26/28	330,000.000	373,494.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	700,000.000	742,595.000	

	NORWAY 3.0 03/14/24	900,000.000	1,002,663.000	
ノルウェー・クローネ　小計		3,030,000.000 (31,542,300)	3,327,640.100 (34,640,733)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.25 04/25/22	170,000.000	175,741.180	
	POLAND 2.25 10/25/24	290,000.000	308,081.500	
	POLAND 2.5 01/25/23	480,000.000	504,229.050	
	POLAND 2.5 04/25/24	280,000.000	298,744.290	
	POLAND 2.5 07/25/26	320,000.000	343,803.890	
	POLAND 2.5 07/25/27	180,000.000	193,745.160	
	POLAND 2.75 04/25/28	390,000.000	427,167.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	170,000.000	188,207.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	300,000.000	333,236.780	
	POLAND 5.75 09/23/22	230,000.000	257,801.250	
	POLAND 5.75 10/25/21	200,000.000	215,299.000	
ポーランド・ズロチ　小計		3,010,000.000 (76,273,400)	3,246,056.100 (82,255,062)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.795 09/30/22	200,000.000	206,936.760	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	150,000.000	161,194.650	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	230,000.000	247,493.500	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	310,000.000	333,194.750	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	400,000.000	429,811.600	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	250,000.000	267,491.650	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	220,000.000	245,483.370	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	200,000.000	226,831.040	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	310,000.000	365,997.900	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	300,000.000	353,449.860	
マレーシア・リンギット　小計		2,570,000.000 (63,581,800)	2,837,885.080 (70,209,277)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	911,000.000	1,184,664.400	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	1,052,000.000	1,248,923.880	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	2,289,000.000	2,310,425.040	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	3,434,000.000	3,527,481.370	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	2,310,000.000	2,384,355.200	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	1,175,000.000	1,288,199.500	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	1,544,000.000	1,626,974.560	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	915,000.000	1,007,213.700	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	2,350,000.000	2,608,711.500	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	1,257,000.000	1,359,684.330	

	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	1,071,000.000	1,167,593.490	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	2,428,000.000	2,813,323.600	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	900,000.000	1,021,644.000	
メキシコ・ペソ　小計		21,636,000.000 (96,280,200)	23,549,194.570 (104,793,916)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	110,000.000	116,496.160	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	80,000.000	86,119.330	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	130,000.000	139,300.200	
	AUSTRIA 07/15/23	90,000.000	91,588.500	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	90,000.000	98,039.710	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	20,000.000	26,036.560	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	30,000.000	43,338.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	100,000.000	109,683.900	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	90,000.000	97,309.800	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	70,000.000	133,752.430	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	80,000.000	105,857.280	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	80,000.000	134,742.190	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	40,000.000	44,116.240	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	175,000.000	184,677.500	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	10,000.000	22,693.100	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	100,000.000	166,870.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	85,000.000	124,887.100	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	80,000.000	83,234.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	130,000.000	137,682.350	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	130,000.000	138,984.300	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	90,000.000	94,383.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	160,000.000	173,616.480	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	420,000.000	452,452.140	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	80,000.000	87,936.800	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	40,000.000	46,452.960	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	70,000.000	85,388.450	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	20,000.000	25,057.160	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	110,000.000	136,569.180	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	60,000.000	86,865.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	110,000.000	119,600.470	
	BELGIUM 2.25 06/22/57	50,000.000	72,878.400	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	150,000.000	168,922.950	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	70,000.000	96,266.940	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	100,000.000	171,542.700	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	160,000.000	173,869.120	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	60,000.000	87,138.660	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	110,000.000	188,539.890	
	BELGIUM 4.25 09/28/22	150,000.000	167,415.670	
	BELGIUM 4.5 03/28/26	70,000.000	89,878.460	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	180,000.000	301,682.880	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	80,000.000	115,801.600	

		BUNDESOBL 04/05/24	250,000.000	257,886.000	
		BUNDESOBL 04/08/22	100,000.000	101,458.000	
		BUNDESOBL 04/14/23	170,000.000	173,996.610	
		BUNDESOBL 10/08/21	210,000.000	212,062.200	
		BUNDESOBL 10/13/23	140,000.000	143,836.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	50,000.000	51,454.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	270,000.000	287,882.100	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	220,000.000	237,189.480	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	400,000.000	430,084.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	240,000.000	254,724.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	300,000.000	321,957.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	100,000.000	109,233.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	270,000.000	293,797.800	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	340,000.000	355,813.740	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	270,000.000	284,902.110	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	150,000.000	161,667.600	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	420,000.000	459,648.000	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	150,000.000	208,883.700	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	210,000.000	223,590.150	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	120,000.000	128,410.440	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	130,000.000	136,984.510	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	130,000.000	142,675.390	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	420,000.000	443,060.010	
		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	170,000.000	177,803.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	300,000.000	327,745.140	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	120,000.000	124,636.800	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	200,000.000	332,052.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	190,000.000	324,507.080	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	140,000.000	146,291.600	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	200,000.000	357,190.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	230,000.000	401,070.550	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	120,000.000	226,830.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	100,000.000	144,730.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	230,000.000	403,311.900	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	140,000.000	285,388.600	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	210,000.000	348,547.500	

		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	150,000.000	223,657.500	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	70,000.000	88,113.200	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	70,000.000	117,306.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	70,000.000	106,726.900	
		FINLAND 0.5 04/15/26	30,000.000	31,604.760	
		FINLAND 0.5 09/15/27	30,000.000	31,690.910	
		FINLAND 0.5 09/15/29	80,000.000	84,786.140	
		FINLAND 0.75 04/15/31	50,000.000	54,567.400	
		FINLAND 0.875 09/15/25	30,000.000	32,120.840	
		FINLAND 09/15/23	180,000.000	183,562.200	
		FINLAND 1.125 04/15/34	60,000.000	68,789.940	
		FINLAND 1.375 04/15/47	20,000.000	25,715.840	
		FINLAND 2.625 07/04/42	50,000.000	76,287.950	
		FINLAND 2.75 07/04/28	30,000.000	37,345.710	
		FINLAND 4.0 07/04/25	50,000.000	61,691.250	
		FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	120,000.000	152,268.740	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	240,000.000	240,845.760	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	290,000.000	299,964.400	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	350,000.000	366,496.900	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	340,000.000	357,113.560	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	130,000.000	136,908.460	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	380,000.000	407,960.400	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	330,000.000	354,809.400	
		FRANCE OAT 02/25/22	610,000.000	616,189.850	
		FRANCE OAT 03/25/23	340,000.000	345,468.960	
		FRANCE OAT 03/25/24	230,000.000	234,514.670	
		FRANCE OAT 03/25/25	110,000.000	112,255.220	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	300,000.000	326,103.600	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	40,000.000	43,064.200	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	180,000.000	204,811.740	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	330,000.000	376,431.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	490,000.000	568,803.760	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	230,000.000	279,192.400	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	300,000.000	321,378.390	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	90,000.000	122,934.780	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	230,000.000	284,217.900	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	370,000.000	407,644.910	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	150,000.000	200,391.150	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	480,000.000	534,069.600	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	340,000.000	363,856.100	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	300,000.000	376,006.050	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	120,000.000	146,830.560	
		FRANCE OAT 3.0 04/25/22	350,000.000	374,576.050	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	190,000.000	306,369.680	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	300,000.000	316,637.100	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	380,000.000	467,153.000	

FRANCE OAT 4.0 04/25/55	120,000.000	236,760.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	130,000.000	273,221.850	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	200,000.000	327,400.800	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	465,000.000	543,179.520	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	280,000.000	502,838.560	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	200,000.000	331,770.800	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	340,000.000	511,723.460	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	350,000.000	593,995.670	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	160,000.000	216,290.720	
IRISH 0.2 05/15/27	60,000.000	60,824.390	
IRISH 0.4 05/15/35	20,000.000	19,654.180	
IRISH 1.0 05/15/26	70,000.000	74,679.520	
IRISH 1.1 05/15/29	120,000.000	130,467.430	
IRISH 1.5 05/15/50	40,000.000	46,476.840	
IRISH 1.7 05/15/37	60,000.000	70,818.100	
IRISH 2.0 02/18/45	80,000.000	102,858.880	
IRISH 2.4 05/15/30	110,000.000	134,072.290	
IRISH 3.4 03/18/24	60,000.000	68,596.440	
IRISH 3.9 03/20/23	90,000.000	101,007.360	
IRISH 5.4 03/13/25	70,000.000	89,106.360	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	70,000.000	69,758.570	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	60,000.000	60,019.800	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	180,000.000	180,468.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	220,000.000	220,374.000	
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	140,000.000	140,744.260	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	160,000.000	161,363.200	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	240,000.000	228,612.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	160,000.000	161,857.920	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	130,000.000	130,443.430	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	160,000.000	162,406.400	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	110,000.000	110,836.330	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	190,000.000	190,998.450	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	110,000.000	110,352.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	320,000.000	308,143.360	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	240,000.000	245,688.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	130,000.000	133,782.220	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	180,000.000	184,603.500	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	210,000.000	216,644.400	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	140,000.000	143,362.800	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	220,000.000	227,590.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	170,000.000	169,337.000	
ITALY BTPS 2.3 10/15/21	320,000.000	327,810.560	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	130,000.000	123,552.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	340,000.000	356,091.860	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	107,000.000	112,623.920	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	150,000.000	151,455.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	90,000.000	89,244.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	140,000.000	151,051.040	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	160,000.000	169,744.000	

		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	170,000.000	188,009.460	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	130,000.000	148,735.990	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	230,000.000	262,018.300	
		ITALY BTPS 3.75 08/01/21	220,000.000	228,575.600	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	160,000.000	176,438.400	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	80,000.000	97,771.760	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	270,000.000	329,427.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	330,000.000	370,938.480	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	180,000.000	209,826.000	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	190,000.000	212,534.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/21	330,000.000	348,123.600	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	210,000.000	258,007.680	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	170,000.000	231,869.290	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/22	155,000.000	166,942.750	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	390,000.000	456,032.460	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	150,000.000	199,980.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	170,000.000	234,566.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	200,000.000	276,300.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	290,000.000	374,042.000	
		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	170,000.000	188,136.110	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	130,000.000	144,715.090	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	150,000.000	209,490.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	310,000.000	429,474.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	300,000.000	399,900.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	60,000.000	80,772.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	80,000.000	101,704.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	120,000.000	125,311.200	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	40,000.000	44,190.960	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	160,000.000	170,296.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	120,000.000	130,590.910	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	140,000.000	153,366.920	
		NETHERLANDS 01/15/22	300,000.000	303,344.610	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	80,000.000	86,223.680	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	210,000.000	233,522.940	
		NETHERLANDS 2.25 07/15/22	270,000.000	287,486.280	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	130,000.000	175,045.980	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	130,000.000	224,454.230	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	150,000.000	273,534.150	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	100,000.000	168,560.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	100,000.000	145,750.000	
		NETHERLANDS 7.5 01/15/23	70,000.000	85,575.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	250,000.000	251,334.500	

		SPAIN 0.4 04/30/22	130,000.000	131,372.800	
		SPAIN 0.45 10/31/22	240,000.000	243,383.040	
		SPAIN 0.6 10/31/29	180,000.000	177,287.400	
		SPAIN 0.75 07/30/21	160,000.000	161,868.320	
		SPAIN 1.3 10/31/26	210,000.000	221,677.050	
		SPAIN 1.4 04/30/28	200,000.000	211,970.060	
		SPAIN 1.4 07/30/28	180,000.000	190,296.000	
		SPAIN 1.45 04/30/29	200,000.000	212,506.800	
		SPAIN 1.45 10/31/27	200,000.000	212,739.600	
		SPAIN 1.5 04/30/27	170,000.000	181,560.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	230,000.000	245,522.010	
		SPAIN 1.85 07/30/35	30,000.000	32,884.890	
		SPAIN 1.95 04/30/26	160,000.000	174,899.760	
		SPAIN 1.95 07/30/30	280,000.000	310,542.400	
		SPAIN 2.15 10/31/25	230,000.000	253,075.210	
		SPAIN 2.35 07/30/33	160,000.000	185,520.000	
		SPAIN 2.7 10/31/48	200,000.000	250,842.890	
		SPAIN 2.75 10/31/24	180,000.000	200,821.140	
		SPAIN 2.9 10/31/46	70,000.000	90,329.680	
		SPAIN 3.45 07/30/66	90,000.000	137,541.940	
		SPAIN 3.8 04/30/24	230,000.000	263,754.340	
		SPAIN 4.2 01/31/37	210,000.000	305,154.990	
		SPAIN 4.4 10/31/23	230,000.000	265,113.180	
		SPAIN 4.65 07/30/25	215,000.000	263,887.990	
		SPAIN 4.7 07/30/41	120,000.000	192,612.000	
		SPAIN 4.8 01/31/24	140,000.000	164,734.920	
		SPAIN 4.9 07/30/40	130,000.000	210,470.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	220,000.000	299,948.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	130,000.000	226,712.720	
		SPAIN 5.4 01/31/23	290,000.000	333,405.750	
		SPAIN 5.75 07/30/32	245,000.000	381,080.840	
		SPAIN 5.9 07/30/26	80,000.000	106,876.130	
		SPAIN 6.0 01/31/29	180,000.000	260,341.200	
	ユーロ　小計		42,597,000.000 (4,913,989,920)	50,676,553.970 (5,846,047,266)	
国債証券　合計			12,826,438,480 (12,826,438,480)	15,005,413,244 (15,005,413,244)	
合計				15,005,413,244 (15,005,413,244)	

（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　185銘柄	45.84	47.18
イギリス・ポンド	国債証券　34銘柄	6.49	6.68

イスラエル・シュケル	国債証券	4銘柄	0.23	0.24
オーストラリア・ドル	国債証券	17銘柄	1.91	1.97
カナダ・ドル	国債証券	25銘柄	1.84	1.90
シンガポール・ドル	国債証券	11銘柄	0.40	0.41
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.24	0.24
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.47	0.48
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	0.22	0.23
ポーランド・ズロチ	国債証券	11銘柄	0.53	0.55
マレーシア・リンギット	国債証券	10銘柄	0.45	0.47
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	0.68	0.70
ユーロ	国債証券	247銘柄	37.86	38.96

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和2年5月8日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	384,826,875
株式	34,792,997,840
派生商品評価勘定	12,494,480
未収入金	1,784,340
未収配当金	419,513,166
前払金	1,107,700
差入委託証拠金	40,425,000
流動資産合計	35,653,149,401
資産合計	35,653,149,401
負債の部	
流動負債	
未払解約金	33,776,000
流動負債合計	33,776,000
負債合計	33,776,000
純資産の部	
元本等	
元本	20,061,470,270
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	15,557,903,131
元本等合計	35,619,373,401
純資産合計	35,619,373,401
負債純資産合計	35,653,149,401

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年5月9日 至　令和2年5月8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	令和2年5月8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	21,543,095,659円
同期中追加設定元本額	9,971,150,472円
同期中一部解約元本額	11,452,775,861円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM　ＴＯＰＩＸオープン	4,120,211,518円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	11,629,832,536円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	4,668,475円
コア資産形成ファンド	4,240,616円
MHAM　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	116,271,260円
MHAM動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	872,735,808円
MHAM日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	2,448,555,359円
計	20,061,470,270円
２．　受益権の総数	20,061,470,270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　令和1年5月9日 至　令和2年5月8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。リスク管理に関する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	令和2年5月8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	令和2年5月8日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,215,798,979
合計	1,215,798,979

（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（令和2年3月11日から令和2年5月8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	令和2年5月8日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	773,457,700	－	785,970,000	12,512,300
合計	773,457,700	－	785,970,000	12,512,300

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

す。

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年5月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7755円 (17,755円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和2年5月8日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,547.00	2,037,600	
日本水産	22,800	472.00	10,761,600	
マルハニチロ	3,200	2,250.00	7,200,000	
ホウスイ	400	886.00	354,400	
カネコ種苗	600	1,421.00	852,600	
サカタのタネ	2,800	3,640.00	10,192,000	
ホクト	1,800	1,958.00	3,524,400	
ホクリヨウ	400	578.00	231,200	
ヒノキヤグループ	500	1,684.00	842,000	
ショーボンドホールディングス	3,600	4,395.00	15,822,000	
ミライト・ホールディングス	6,900	1,433.00	9,887,700	
タマホーム	1,300	1,310.00	1,703,000	
サンヨーホームズ	300	599.00	179,700	
日本アクア	1,100	623.00	685,300	
ファーストコーポレーション	600	488.00	292,800	
ベステラ	400	990.00	396,000	
ＴＡＴＥＲＵ	5,100	115.00	586,500	
キャンディル	700	506.00	354,200	
スペースバリューホールディングス	2,900	344.00	997,600	
住石ホールディングス	5,600	113.00	632,800	
日鉄鉱業	500	4,515.00	2,257,500	
三井松島ホールディングス	900	856.00	770,400	
国際石油開発帝石	91,500	692.20	63,336,300	
石油資源開発	3,200	1,883.00	6,025,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,100	1,559.00	1,714,900	
ダイセキ環境ソリューション	700	1,060.00	742,000	
第一カッター興業	300	1,691.00	507,300	
明豊ファシリティワークス	900	550.00	495,000	
安藤・間	13,800	702.00	9,687,600	
東急建設	6,700	571.00	3,825,700	
コムシスホールディングス	8,200	3,080.00	25,256,000	
ビーアールホールディングス	2,600	495.00	1,287,000	

高松コンストラクショングループ	1,500	2,310.00	3,465,000	
東建コーポレーション	700	7,360.00	5,152,000	
ソネック	300	720.00	216,000	
ヤマウラ	1,000	745.00	745,000	
大成建設	17,700	3,495.00	61,861,500	
大林組	53,100	961.00	51,029,100	
清水建設	54,000	874.00	47,196,000	
飛島建設	1,500	1,077.00	1,615,500	
長谷工コーポレーション	20,500	1,179.00	24,169,500	
松井建設	1,900	658.00	1,250,200	
錢高組	200	3,390.00	678,000	
鹿島建設	41,500	1,151.00	47,766,500	
不動テトラ	1,400	1,378.00	1,929,200	
大末建設	500	760.00	380,000	
鉄建建設	1,200	2,179.00	2,614,800	
西松建設	4,100	2,087.00	8,556,700	
三井住友建設	12,700	445.00	5,651,500	
大豊建設	1,200	2,304.00	2,764,800	
前田建設工業	13,500	871.00	11,758,500	
佐田建設	1,200	403.00	483,600	
ナカノフドー建設	1,200	361.00	433,200	
奥村組	2,800	2,399.00	6,717,200	
東鉄工業	2,300	2,727.00	6,272,100	
イチケン	300	1,212.00	363,600	
富士ピー・エス	800	516.00	412,800	
淺沼組	600	3,525.00	2,115,000	
戸田建設	22,000	638.00	14,036,000	
熊谷組	2,500	2,479.00	6,197,500	
北野建設	300	2,533.00	759,900	
植木組	200	2,460.00	492,000	
矢作建設工業	2,200	793.00	1,744,600	
ピーエス三菱	1,800	537.00	966,600	
日本ハウスホールディングス	3,400	277.00	941,800	
大東建託	5,800	10,570.00	61,306,000	
新日本建設	2,200	765.00	1,683,000	
ＮＩＰＰＯ	4,500	2,507.00	11,281,500	
東亜道路工業	300	2,866.00	859,800	
前田道路	4,800	2,025.00	9,720,000	
日本道路	500	6,650.00	3,325,000	
東亜建設工業	1,700	1,435.00	2,439,500	
日本国土開発	5,200	550.00	2,860,000	
若築建設	900	1,179.00	1,061,100	
東洋建設	6,100	434.00	2,647,400	
五洋建設	21,300	556.00	11,842,800	
世紀東急工業	2,600	788.00	2,048,800	
福田組	600	4,245.00	2,547,000	
日本ドライケミカル	500	1,393.00	696,500	
住友林業	13,600	1,286.00	17,489,600	
日本基礎技術	2,100	402.00	844,200	
巴コーポレーション	2,600	350.00	910,000	

大和ハウス工業	52,500	2,723.50	142,983,750	
ライト工業	3,100	1,393.00	4,318,300	
積水ハウス	58,200	1,860.00	108,252,000	
日特建設	1,400	729.00	1,020,600	
北陸電気工事	900	903.00	812,700	
ユアテック	3,000	622.00	1,866,000	
日本リーテック	1,100	2,079.00	2,286,900	
四電工	200	2,318.00	463,600	
中電工	2,100	2,185.00	4,588,500	
関電工	7,700	901.00	6,937,700	
きんでん	12,700	1,779.00	22,593,300	
東京エネシス	1,700	759.00	1,290,300	
トーエネック	500	3,365.00	1,682,500	
住友電設	1,500	2,299.00	3,448,500	
日本電設工業	2,900	2,088.00	6,055,200	
協和エクシオ	8,000	2,687.00	21,496,000	
新日本空調	1,400	2,239.00	3,134,600	
日本工営	1,100	3,040.00	3,344,000	
九電工	3,700	2,972.00	10,996,400	
三機工業	3,800	1,258.00	4,780,400	
日揮ホールディングス	16,500	1,032.00	17,028,000	
中外炉工業	600	1,563.00	937,800	
ヤマト	1,900	637.00	1,210,300	
太平電業	1,300	2,219.00	2,884,700	
高砂熱学工業	4,600	1,701.00	7,824,600	
三晃金属工業	200	2,150.00	430,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	1,700	4,900.00	8,330,000	
朝日工業社	300	2,864.00	859,200	
明星工業	3,500	814.00	2,849,000	
大氣社	2,600	3,185.00	8,281,000	
ダイダン	1,200	2,775.00	3,330,000	
日比谷総合設備	1,600	1,818.00	2,908,800	
日本製粉	4,800	1,693.00	8,126,400	
日清製粉グループ本社	19,200	1,679.00	32,236,800	
日東富士製粉	100	5,800.00	580,000	
昭和産業	1,500	3,255.00	4,882,500	
鳥越製粉	1,400	889.00	1,244,600	
中部飼料	2,100	1,641.00	3,446,100	
フィード・ワン	10,700	174.00	1,861,800	
東洋精糖	300	1,206.00	361,800	
日本甜菜製糖	800	1,695.00	1,356,000	
三井製糖	1,500	2,197.00	3,295,500	
塩水港精糖	1,700	205.00	348,500	
日新製糖	700	1,896.00	1,327,200	
ＬＩＦＵＬＬ	5,700	355.00	2,023,500	
ジェイエイシーリクルートメント	1,000	1,180.00	1,180,000	
日本M&Aセンター	12,300	3,655.00	44,956,500	
メンバーズ	500	1,665.00	832,500	
中広	300	518.00	155,400	
ＵＴグループ	2,500	1,600.00	4,000,000	

アイティメディア	800	1,027.00	821,600	
タケエイ	1,700	844.00	1,434,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	400	1,550.00	620,000	
ビーネックスグループ	1,600	697.00	1,115,200	
コシダカホールディングス	3,800	467.00	1,774,600	
アルトナー	300	695.00	208,500	
パソナグループ	1,700	1,111.00	1,888,700	
ＣＤＳ	400	1,315.00	526,000	
リンクアンドモチベーション	3,300	354.00	1,168,200	
ＧＣＡ	2,000	664.00	1,328,000	
エス・エム・エス	5,100	2,396.00	12,219,600	
サニーサイドアップグループ	600	719.00	431,400	
パーソルホールディングス	16,200	1,210.00	19,602,000	
リニカル	800	900.00	720,000	
クックパッド	6,300	347.00	2,186,100	
エスクリ	500	399.00	199,500	
アイ・ケイ・ケイ	900	607.00	546,300	
森永製菓	4,000	4,415.00	17,660,000	
中村屋	400	3,970.00	1,588,000	
江崎グリコ	5,100	4,805.00	24,505,500	
名糖産業	800	1,271.00	1,016,800	
井村屋グループ	900	1,915.00	1,723,500	
不二家	1,000	1,964.00	1,964,000	
山崎製パン	12,900	1,897.00	24,471,300	
第一屋製パン	400	918.00	367,200	
モロゾフ	300	5,530.00	1,659,000	
亀田製菓	1,000	5,130.00	5,130,000	
寿スピリッツ	1,600	4,465.00	7,144,000	
カルビー	7,800	3,255.00	25,389,000	
森永乳業	3,200	4,155.00	13,296,000	
六甲バター	1,000	1,401.00	1,401,000	
ヤクルト本社	11,700	6,270.00	73,359,000	
明治ホールディングス	11,300	7,550.00	85,315,000	
雪印メグミルク	4,100	2,480.00	10,168,000	
プリマハム	2,700	2,447.00	6,606,900	
日本ハム	6,600	3,895.00	25,707,000	
丸大食品	1,900	1,952.00	3,708,800	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,200	2,333.00	2,799,600	
柿安本店	600	2,343.00	1,405,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,200	626.00	7,011,200	
学情	700	1,120.00	784,000	
スタジオアリス	800	1,522.00	1,217,600	
クロスキャット	300	1,018.00	305,400	
シミックホールディングス	800	1,529.00	1,223,200	
エプコ	400	899.00	359,600	
システナ	5,900	1,552.00	9,156,800	
ＮＪＳ	400	1,716.00	686,400	
デジタルアーツ	800	6,430.00	5,144,000	
日鉄ソリューションズ	2,500	2,738.00	6,845,000	
綜合警備保障	6,500	5,110.00	33,215,000	

キューブシステム	700	714.00	499,800	
いちご	21,400	274.00	5,863,600	
エイジア	300	1,310.00	393,000	
日本駐車場開発	16,800	128.00	2,150,400	
コア	700	1,182.00	827,400	
カカクコム	12,000	2,200.00	26,400,000	
アイロムグループ	600	2,154.00	1,292,400	
セントケア・ホールディング	700	410.00	287,000	
サイネックス	400	625.00	250,000	
ルネサンス	800	1,070.00	856,000	
ディップ	2,300	2,385.00	5,485,500	
ＳＢＳホールディングス	1,500	1,842.00	2,763,000	
オプトホールディング	900	1,487.00	1,338,300	
新日本科学	1,800	673.00	1,211,400	
ツクイ	3,900	465.00	1,813,500	
キャリアデザインセンター	300	847.00	254,100	
ベネフィット・ワン	5,900	1,935.00	11,416,500	
エムスリー	35,800	3,930.00	140,694,000	
ツカダ・グローバルホールディング	800	349.00	279,200	
ブラス	500	441.00	220,500	
アウトソーシング	9,100	560.00	5,096,000	
ウェルネット	1,600	612.00	979,200	
ワールドホールディングス	500	1,429.00	714,500	
ディー・エヌ・エー	8,000	1,307.00	10,456,000	
博報堂ＤＹホールディングス	22,200	1,161.00	25,774,200	
ぐるなび	3,200	599.00	1,916,800	
タカミヤ	1,600	430.00	688,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	773.00	927,600	
ファンコミュニケーションズ	4,500	452.00	2,034,000	
ライク	600	1,683.00	1,009,800	
ビジネス・ブレークスルー	700	419.00	293,300	
エスプール	4,200	751.00	3,154,200	
ＷＤＢホールディングス	700	2,550.00	1,785,000	
手間いらず	100	4,280.00	428,000	
ティア	700	500.00	350,000	
ＣＤＧ	200	1,443.00	288,600	
バリューコマース	900	2,420.00	2,178,000	
インフォマート	17,800	813.00	14,471,400	
サッポロホールディングス	5,900	2,015.00	11,888,500	
アサヒグループホールディングス	35,600	3,700.00	131,720,000	
キリンホールディングス	72,000	2,070.00	149,040,000	
宝ホールディングス	12,600	820.00	10,332,000	
オエノンホールディングス	4,200	392.00	1,646,400	
養命酒製造	400	1,913.00	765,200	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	12,000	1,964.00	23,568,000	
サントリー食品インターナショナル	11,400	3,980.00	45,372,000	
ダイドーグループホールディングス	900	4,375.00	3,937,500	
伊藤園	5,200	6,030.00	31,356,000	
キーコーヒー	1,700	2,253.00	3,830,100	

ユニカフェ	400	914.00	365,600	
ジャパンフーズ	100	1,145.00	114,500	
日清オイリオグループ	2,200	3,550.00	7,810,000	
不二製油グループ本社	4,100	2,520.00	10,332,000	
かどや製油	100	3,675.00	367,500	
Ｊ－オイルミルズ	900	4,105.00	3,694,500	
ローソン	4,300	5,550.00	23,865,000	
サンエー	1,400	4,190.00	5,866,000	
カワチ薬品	1,400	2,442.00	3,418,800	
エービーシー・マート	2,600	5,730.00	14,898,000	
ハードオフコーポレーション	500	683.00	341,500	
高千穂交易	1,100	931.00	1,024,100	
アスクル	1,800	3,255.00	5,859,000	
ゲオホールディングス	3,000	1,330.00	3,990,000	
アダストリア	2,300	1,592.00	3,661,600	
ジーフット	800	440.00	352,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	200	407.00	81,400	
カワニシホールディングス	200	1,276.00	255,200	
伊藤忠食品	500	4,630.00	2,315,000	
くら寿司	900	4,490.00	4,041,000	
キャンドゥ	900	1,916.00	1,724,400	
エレマテック	1,900	826.00	1,569,400	
パルグループホールディングス	1,700	1,302.00	2,213,400	
ＪＡＬＵＸ	500	1,523.00	761,500	
エディオン	7,600	946.00	7,189,600	
あらた	1,400	4,525.00	6,335,000	
サーラコーポレーション	3,000	570.00	1,710,000	
ワッツ	700	639.00	447,300	
トーメンデバイス	400	3,725.00	1,490,000	
ハローズ	600	2,959.00	1,775,400	
ＪＰホールディングス	5,100	275.00	1,402,500	
フジオフードシステム	1,400	1,349.00	1,888,600	
あみやき亭	300	2,891.00	867,300	
東京エレクトロン　デバイス	800	2,816.00	2,252,800	
ひらまつ	3,100	151.00	468,100	
フィールズ	1,700	322.00	547,400	
双日	92,600	245.00	22,687,000	
アルフレッサ　ホールディングス	18,600	2,097.00	39,004,200	
大黒天物産	400	4,130.00	1,652,000	
ハニーズホールディングス	1,500	1,143.00	1,714,500	
ファーマライズホールディングス	500	659.00	329,500	
キッコーマン	12,300	4,760.00	58,548,000	
味の素	37,800	1,921.50	72,632,700	
キユーピー	9,500	2,084.00	19,798,000	
ハウス食品グループ本社	6,400	3,445.00	22,048,000	
カゴメ	6,400	2,771.00	17,734,400	
焼津水産化学工業	600	929.00	557,400	
アリアケジャパン	1,600	6,220.00	9,952,000	
ピエトロ	200	1,602.00	320,400	
エバラ食品工業	400	2,200.00	880,000	

やまみ	200	2,054.00	410,800	
ニチレイ	8,200	2,726.00	22,353,200	
横浜冷凍	5,000	887.00	4,435,000	
東洋水産	8,800	5,250.00	46,200,000	
イートアンド	600	1,750.00	1,050,000	
大冷	200	1,880.00	376,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,100	1,107.00	1,217,700	
日清食品ホールディングス	7,300	9,020.00	65,846,000	
永谷園ホールディングス	700	2,216.00	1,551,200	
一正蒲鉾	700	952.00	666,400	
フジッコ	1,800	1,925.00	3,465,000	
ロック・フィールド	1,900	1,277.00	2,426,300	
日本たばこ産業	98,000	1,970.50	193,109,000	
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,980.00	1,980,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,607.00	1,928,400	
なとり	900	1,735.00	1,561,500	
イフジ産業	200	796.00	159,200	
ピックルスコーポレーション	400	2,236.00	894,400	
北の達人コーポレーション	6,000	525.00	3,150,000	
ユーグレナ	7,400	666.00	4,928,400	
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,504.00	1,353,600	
ＡＤワークスグループ	2,900	170.00	493,000	
片倉工業	2,500	1,043.00	2,607,500	
グンゼ	1,200	3,710.00	4,452,000	
ヒューリック	35,900	1,021.00	36,653,900	
ラサ商事	1,100	835.00	918,500	
アルペン	1,400	1,623.00	2,272,200	
ハブ	400	670.00	268,000	
ラクーンホールディングス	900	668.00	601,200	
クオールホールディングス	2,500	1,153.00	2,882,500	
アルコニックス	1,900	1,138.00	2,162,200	
神戸物産	5,800	5,250.00	30,450,000	
ソリトンシステムズ	800	1,356.00	1,084,800	
ジンズホールディングス	900	5,920.00	5,328,000	
ビックカメラ	9,900	1,021.00	10,107,900	
ＤＣＭホールディングス	9,200	1,077.00	9,908,400	
ハイパー	400	579.00	231,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	11,900	3,765.00	44,803,500	
東京一番フーズ	400	439.00	175,600	
ＤＤホールディングス	700	906.00	634,200	
あい　ホールディングス	2,600	1,373.00	3,569,800	
ディーブイエックス	900	913.00	821,700	
きちりホールディングス	400	588.00	235,200	
アークランドサービスホールディングス	1,200	1,752.00	2,102,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	19,900	871.00	17,332,900	
ドトール・日レスホールディングス	2,700	1,693.00	4,571,100	
マツモトキヨシホールディングス	6,900	3,605.00	24,874,500	
ブロンコビリー	900	2,113.00	1,901,700	
ＺＯＺＯ	11,500	1,919.00	22,068,500	

トレジャー・ファクトリー	600	679.00	407,400	
物語コーポレーション	400	6,840.00	2,736,000	
ココカラファイン	1,800	4,930.00	8,874,000	
三越伊勢丹ホールディングス	29,400	635.00	18,669,000	
東洋紡	6,700	1,264.00	8,468,800	
ユニチカ	5,600	316.00	1,769,600	
富士紡ホールディングス	800	2,944.00	2,355,200	
日清紡ホールディングス	11,300	760.00	8,588,000	
倉敷紡績	1,700	2,447.00	4,159,900	
ダイワボウホールディングス	1,400	6,990.00	9,786,000	
シキボウ	1,000	1,050.00	1,050,000	
日東紡績	2,600	5,140.00	13,364,000	
トヨタ紡織	5,000	1,320.00	6,600,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	4,100	1,503.00	6,162,300	
Ｈａｍｅｅ	600	1,338.00	802,800	
ラクト・ジャパン	600	3,630.00	2,178,000	
ウエルシアホールディングス	5,000	7,900.00	39,500,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,800	3,100.00	8,680,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,500	1,082.00	3,787,000	
八洲電機	1,800	832.00	1,497,600	
メディアスホールディングス	1,200	908.00	1,089,600	
レスターホールディングス	1,800	1,758.00	3,164,400	
ジューテックホールディングス	500	989.00	494,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	2,000	377.00	754,000	
大光	800	702.00	561,600	
ＯＣＨＩホールディングス	600	1,405.00	843,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	9,200	989.00	9,098,800	
黒谷	600	435.00	261,000	
ミサワ	800	502.00	401,600	
ティーライフ	400	932.00	372,800	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	500	765.00	382,500	
三洋貿易	1,800	859.00	1,546,200	
チムニー	500	1,717.00	858,500	
シュッピン	1,200	756.00	907,200	
ビューティガレージ	300	1,604.00	481,200	
ウイン・パートナーズ	1,300	908.00	1,180,400	
ネクステージ	2,300	785.00	1,805,500	
ジョイフル本田	4,800	1,272.00	6,105,600	
鳥貴族	600	1,694.00	1,016,400	
キリン堂ホールディングス	700	2,084.00	1,458,800	
ホットランド	1,200	1,111.00	1,333,200	
すかいらーくホールディングス	18,900	1,700.00	32,130,000	
ＳＦＰホールディングス	1,000	1,453.00	1,453,000	
綿半ホールディングス	600	1,781.00	1,068,600	
日本毛織	5,500	937.00	5,153,500	
トーア紡コーポレーション	700	460.00	322,000	
ダイドーリミテッド	3,000	198.00	594,000	
ヨシックス	200	2,004.00	400,800	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,000	1,032.00	5,160,000	
三栄建築設計	600	1,136.00	681,600	
野村不動産ホールディングス	10,300	1,837.00	18,921,100	
三重交通グループホールディングス	3,600	485.00	1,746,000	
サムティ	2,400	1,411.00	3,386,400	
ディア・ライフ	2,300	418.00	961,400	
コーセーアールイー	500	465.00	232,500	
日本商業開発	1,100	1,394.00	1,533,400	
プレサンスコーポレーション	2,800	1,131.00	3,166,800	
フィル・カンパニー	300	2,875.00	862,500	
ハウスコム	400	1,277.00	510,800	
日本管理センター	1,200	1,035.00	1,242,000	
サンセイランディック	600	749.00	449,400	
エストラスト	300	603.00	180,900	
フージャースホールディングス	3,300	611.00	2,016,300	
オープンハウス	4,900	2,398.00	11,750,200	
東急不動産ホールディングス	46,800	529.00	24,757,200	
飯田グループホールディングス	14,000	1,432.00	20,048,000	
イーグランド	300	636.00	190,800	
ムゲンエステート	1,300	459.00	596,700	
帝国繊維	1,800	2,196.00	3,952,800	
日本コークス工業	13,200	58.00	765,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	491.00	343,700	
ミタチ産業	600	602.00	361,200	
ＢＥＥＮＯＳ	800	973.00	778,400	
あさひ	1,300	1,376.00	1,788,800	
日本調剤	1,000	1,680.00	1,680,000	
コスモス薬品	700	28,790.00	20,153,000	
シップヘルスケアホールディングス	2,700	4,810.00	12,987,000	
トーエル	700	696.00	487,200	
ソフトクリエイトホールディングス	700	1,850.00	1,295,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	65,300	3,454.00	225,546,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	9,000	655.00	5,895,000	
明治電機工業	600	1,242.00	745,200	
ツルハホールディングス	3,700	14,320.00	52,984,000	
デリカフーズホールディングス	900	627.00	564,300	
スターティアホールディングス	500	589.00	294,500	
サンマルクホールディングス	1,300	1,867.00	2,427,100	
フェリシモ	400	980.00	392,000	
トリドールホールディングス	4,200	1,315.00	5,523,000	
帝人	13,700	1,681.00	23,029,700	
東レ	120,600	479.50	57,827,700	
クラレ	26,200	1,082.00	28,348,400	
旭化成	109,800	741.30	81,394,740	
サカイオーベックス	400	1,892.00	756,800	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,400	341.00	477,400	
稲葉製作所	1,000	1,336.00	1,336,000	
宮地エンジニアリンググループ	500	1,613.00	806,500	

トーカロ	4,800	1,048.00	5,030,400	
アルファ	400	906.00	362,400	
ＳＵＭＣＯ	20,200	1,549.00	31,289,800	
川田テクノロジーズ	300	4,965.00	1,489,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	500	2,775.00	1,387,500	
信和	700	706.00	494,200	
ビーロット	800	621.00	496,800	
ファーストブラザーズ	400	639.00	255,600	
ハウスドゥ	800	831.00	664,800	
シーアールイー	500	1,196.00	598,000	
プロパティエージェント	200	919.00	183,800	
ケイアイスター不動産	400	1,101.00	440,400	
アグレ都市デザイン	300	413.00	123,900	
グッドコムアセット	400	1,519.00	607,600	
ジェイ・エス・ビー	400	2,403.00	961,200	
テンポイノベーション	600	714.00	428,400	
グローバル・リンク・マネジメント	200	588.00	117,600	
住江織物	300	1,795.00	538,500	
日本フエルト	900	468.00	421,200	
イチカワ	200	1,387.00	277,400	
日東製網	200	1,416.00	283,200	
芦森工業	200	826.00	165,200	
アツギ	1,500	624.00	936,000	
ウイルプラスホールディングス	100	646.00	64,600	
ＪＭホールディングス	1,300	2,500.00	3,250,000	
コメダホールディングス	4,200	1,706.00	7,165,200	
サツドラホールディングス	300	2,083.00	624,900	
アレンザホールディングス	600	877.00	526,200	
串カツ田中ホールディングス	300	1,520.00	456,000	
バロックジャパンリミテッド	1,100	574.00	631,400	
クスリのアオキホールディングス	1,500	8,310.00	12,465,000	
ダイニック	600	734.00	440,400	
共和レザー	600	671.00	402,600	
ピーバンドットコム	500	919.00	459,500	
力の源ホールディングス	800	661.00	528,800	
スシローグローバルホールディングス	9,200	1,977.00	18,188,400	
ＬＩＸＩＬビバ	1,900	2,047.00	3,889,300	
アセンテック	200	3,130.00	626,000	
セーレン	4,000	1,262.00	5,048,000	
ソトー	500	944.00	472,000	
東海染工	200	1,128.00	225,600	
小松マテーレ	2,600	730.00	1,898,000	
ワコールホールディングス	4,300	2,142.00	9,210,600	
ホギメディカル	1,900	3,365.00	6,393,500	
クラウディアホールディングス	400	412.00	164,800	
ＴＳＩホールディングス	5,400	420.00	2,268,000	
マツオカコーポレーション	500	1,968.00	984,000	
ワールド	2,300	1,239.00	2,849,700	
ＴＩＳ	16,700	2,082.00	34,769,400	
ネオス	700	668.00	467,600	

電算システム	600	3,125.00	1,875,000	
グリー	10,500	431.00	4,525,500	
コーエーテクモホールディングス	3,500	2,988.00	10,458,000	
三菱総合研究所	700	3,545.00	2,481,500	
ボルテージ	600	409.00	245,400	
電算	200	2,007.00	401,400	
ＡＧＳ	800	766.00	612,800	
ファインデックス	1,400	889.00	1,244,600	
ブレインパッド	400	5,490.00	2,196,000	
ＫＬａｂ	3,300	727.00	2,399,100	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,000	905.00	1,810,000	
イーブックイニシアティブジャパン	300	2,219.00	665,700	
ネクソン	46,400	1,792.00	83,148,800	
アイスタイル	4,500	295.00	1,327,500	
エムアップホールディングス	500	2,606.00	1,303,000	
エイチーム	1,100	728.00	800,800	
エニグモ	1,600	913.00	1,460,800	
テクノスジャパン	1,200	433.00	519,600	
コロプラ	5,500	910.00	5,005,000	
ブロードリーフ	8,300	518.00	4,299,400	
クロス・マーケティンググループ	600	291.00	174,600	
デジタルハーツホールディングス	900	754.00	678,600	
システム情報	1,200	899.00	1,078,800	
メディアドゥホールディングス	600	4,110.00	2,466,000	
じげん	4,200	332.00	1,394,400	
ブイキューブ	1,200	1,204.00	1,444,800	
エンカレッジ・テクノロジ	400	859.00	343,600	
サイバーリンクス	300	1,339.00	401,700	
フィックスターズ	1,800	1,116.00	2,008,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	900	837.00	753,300	
オプティム	900	2,196.00	1,976,400	
セレス	500	844.00	422,000	
ＳＨＩＦＴ	700	8,450.00	5,915,000	
特種東海製紙	1,000	4,050.00	4,050,000	
ティーガイア	1,500	2,156.00	3,234,000	
セック	300	3,590.00	1,077,000	
日本アジアグループ	1,700	248.00	421,600	
テクマトリックス	1,200	2,830.00	3,396,000	
プロシップ	400	1,229.00	491,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	1,706.00	6,824,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,500	9,800.00	34,300,000	
ザッパラス	1,000	344.00	344,000	
システムリサーチ	400	1,754.00	701,600	
インターネットイニシアティブ	2,500	3,840.00	9,600,000	
さくらインターネット	1,800	592.00	1,065,600	
ヴィンクス	500	1,007.00	503,500	
GMOクラウド	300	3,275.00	982,500	
ＳＲＡホールディングス	700	2,195.00	1,536,500	

システムインテグレータ	500	738.00	369,000	
朝日ネット	1,400	1,092.00	1,528,800	
ｅＢＡＳＥ	2,000	1,075.00	2,150,000	
アバント	1,600	990.00	1,584,000	
アドソル日進	600	2,534.00	1,520,400	
フリービット	900	810.00	729,000	
コムチュア	1,900	2,268.00	4,309,200	
サイバーコム	300	1,885.00	565,500	
アステリア	1,000	442.00	442,000	
アイル	1,000	1,817.00	1,817,000	
王子ホールディングス	69,400	572.00	39,696,800	
日本製紙	7,400	1,532.00	11,336,800	
三菱製紙	2,200	377.00	829,400	
北越コーポレーション	9,700	416.00	4,035,200	
中越パルプ工業	700	1,342.00	939,400	
大王製紙	7,400	1,469.00	10,870,600	
阿波製紙	600	514.00	308,400	
マークラインズ	900	1,784.00	1,605,600	
メディカル・データ・ビジョン	1,300	798.00	1,037,400	
ｇｕｍｉ	2,300	740.00	1,702,000	
ショーケース	500	516.00	258,000	
モバイルファクトリー	400	1,055.00	422,000	
テラスカイ	600	2,671.00	1,602,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,368.00	957,600	
ＰＣＩホールディングス	500	864.00	432,000	
パイプドＨＤ	400	1,442.00	576,800	
アイビーシー	300	964.00	289,200	
ネオジャパン	300	1,269.00	380,700	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	200	2,187.00	437,400	
ランドコンピュータ	200	1,072.00	214,400	
ダブルスタンダード	200	4,080.00	816,000	
オープンドア	800	1,000.00	800,000	
アカツキ	600	4,225.00	2,535,000	
ベネフィットジャパン	200	1,446.00	289,200	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	400	1,341.00	536,400	
ＬＩＮＥ	3,900	5,300.00	20,670,000	
カナミックネットワーク	1,500	729.00	1,093,500	
ノムラシステムコーポレーション	400	382.00	152,800	
レンゴー	15,800	840.00	13,272,000	
トーモク	900	1,720.00	1,548,000	
ザ・パック	1,300	3,430.00	4,459,000	
チェンジ	600	4,395.00	2,637,000	
シンクロ・フード	700	284.00	198,800	
オークネット	1,000	1,079.00	1,079,000	
セグエグループ	500	928.00	464,000	
エイトレッド	400	1,901.00	760,400	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,400	446.00	624,400	
マクロミル	3,400	698.00	2,373,200	
ビーグリー	500	1,568.00	784,000	

オロ	400	3,175.00	1,270,000	
ユーザーローカル	200	2,943.00	588,600	
テモナ	500	749.00	374,500	
ニーズウェル	400	653.00	261,200	
サインポスト	300	1,454.00	436,200	
昭和電工	11,800	2,272.00	26,809,600	
住友化学	121,800	329.00	40,072,200	
住友精化	700	2,960.00	2,072,000	
日産化学	9,200	4,080.00	37,536,000	
ラサ工業	600	1,303.00	781,800	
クレハ	1,400	4,285.00	5,999,000	
多木化学	600	5,500.00	3,300,000	
テイカ	1,100	1,544.00	1,698,400	
石原産業	3,000	652.00	1,956,000	
片倉コープアグリ	400	1,165.00	466,000	
日本曹達	2,500	2,811.00	7,027,500	
東ソー	25,600	1,317.00	33,715,200	
トクヤマ	4,800	2,283.00	10,958,400	
セントラル硝子	3,400	1,864.00	6,337,600	
東亞合成	10,300	993.00	10,227,900	
大阪ソーダ	1,600	2,453.00	3,924,800	
関東電化工業	4,000	848.00	3,392,000	
デンカ	6,000	2,636.00	15,816,000	
イビデン	10,500	2,911.00	30,565,500	
信越化学工業	28,500	12,045.00	343,282,500	
日本カーバイド工業	500	1,107.00	553,500	
堺化学工業	1,100	1,828.00	2,010,800	
第一稀元素化学工業	1,800	743.00	1,337,400	
エア・ウォーター	15,600	1,522.00	23,743,200	
大陽日酸	16,000	1,666.00	26,656,000	
日本化学工業	600	2,259.00	1,355,400	
東邦アセチレン	100	1,270.00	127,000	
日本パーカライジング	8,400	1,109.00	9,315,600	
高圧ガス工業	2,200	764.00	1,680,800	
チタン工業	300	1,681.00	504,300	
四国化成工業	2,400	1,083.00	2,599,200	
戸田工業	400	1,321.00	528,400	
ステラ　ケミファ	900	2,370.00	2,133,000	
保土谷化学工業	600	3,590.00	2,154,000	
日本触媒	2,600	5,210.00	13,546,000	
大日精化工業	1,300	2,310.00	3,003,000	
カネカ	4,300	2,750.00	11,825,000	
協和キリン	17,100	2,614.00	44,699,400	
三菱瓦斯化学	15,400	1,329.00	20,466,600	
三井化学	15,000	2,032.00	30,480,000	
ＪＳＲ	15,700	1,946.00	30,552,200	
東京応化工業	2,900	4,520.00	13,108,000	
大阪有機化学工業	1,600	1,757.00	2,811,200	
三菱ケミカルホールディングス	110,600	605.80	67,001,480	
ＫＨネオケム	2,900	1,993.00	5,779,700	

ダイセル	21,700	865.00	18,770,500	
住友ベークライト	2,600	2,789.00	7,251,400	
積水化学工業	35,600	1,359.00	48,380,400	
日本ゼオン	15,000	953.00	14,295,000	
アイカ工業	4,900	3,030.00	14,847,000	
宇部興産	8,300	1,780.00	14,774,000	
積水樹脂	3,000	2,320.00	6,960,000	
タキロンシーアイ	3,500	618.00	2,163,000	
旭有機材	1,000	1,309.00	1,309,000	
日立化成	7,700	4,610.00	35,497,000	
ニチバン	800	1,450.00	1,160,000	
リケンテクノス	3,900	418.00	1,630,200	
大倉工業	700	1,574.00	1,101,800	
積水化成品工業	1,900	615.00	1,168,500	
群栄化学工業	400	2,609.00	1,043,600	
タイガースポリマー	1,000	435.00	435,000	
ミライアル	600	1,117.00	670,200	
ダイキアクシス	500	745.00	372,500	
ダイキョーニシカワ	3,200	548.00	1,753,600	
竹本容器	500	746.00	373,000	
森六ホールディングス	400	1,449.00	579,600	
日本化薬	10,500	1,024.00	10,752,000	
カーリットホールディングス	1,700	506.00	860,200	
ＥＰＳホールディングス	2,100	1,141.00	2,396,100	
ソルクシーズ	600	672.00	403,200	
レッグス	400	855.00	342,000	
プレステージ・インターナショナル	6,100	849.00	5,178,900	
フェイス	600	629.00	377,400	
プロトコーポレーション	1,600	966.00	1,545,600	
ハイマックス	100	1,945.00	194,500	
アミューズ	900	2,259.00	2,033,100	
野村総合研究所	23,700	2,630.00	62,331,000	
ドリームインキュベータ	500	1,250.00	625,000	
サイバネットシステム	1,300	661.00	859,300	
クイック	900	1,028.00	925,200	
ＴＡＣ	1,300	195.00	253,500	
ＣＥホールディングス	1,000	421.00	421,000	
ケネディクス	15,100	490.00	7,399,000	
日本システム技術	200	1,184.00	236,800	
電通グループ	16,600	2,244.00	37,250,400	
インテージホールディングス	2,000	784.00	1,568,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	633.00	379,800	
東邦システムサイエンス	400	918.00	367,200	
ぴあ	400	2,980.00	1,192,000	
イオンファンタジー	600	1,799.00	1,079,400	
ソースネクスト	8,000	321.00	2,568,000	
シーティーエス	1,800	671.00	1,207,800	
ネクシィーズグループ	500	1,039.00	519,500	
インフォコム	1,800	2,565.00	4,617,000	
メディカルシステムネットワーク	1,500	460.00	690,000	

日本精化	1,300	1,350.00	1,755,000	
扶桑化学工業	1,700	3,170.00	5,389,000	
トリケミカル研究所	400	9,600.00	3,840,000	
ＨＥＲＯＺ	200	3,555.00	711,000	
ラクスル	1,300	2,569.00	3,339,700	
ＦＩＧ	1,700	257.00	436,900	
システムサポート	200	2,941.00	588,200	
ＡＤＥＫＡ	7,600	1,397.00	10,617,200	
日油	6,200	3,535.00	21,917,000	
ミヨシ油脂	500	1,156.00	578,000	
新日本理化	2,900	177.00	513,300	
ハリマ化成グループ	1,200	914.00	1,096,800	
イーソル	800	1,253.00	1,002,400	
アルテリア・ネットワークス	1,900	2,083.00	3,957,700	
東海ソフト	200	1,266.00	253,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	200	961.00	192,200	
花王	40,600	8,510.00	345,506,000	
第一工業製薬	700	4,660.00	3,262,000	
石原ケミカル	500	1,910.00	955,000	
日華化学	500	893.00	446,500	
ニイタカ	500	2,694.00	1,347,000	
三洋化成工業	1,000	4,315.00	4,315,000	
武田薬品工業	140,800	3,736.00	526,028,800	
アステラス製薬	147,000	1,835.00	269,745,000	
大日本住友製薬	12,500	1,500.00	18,750,000	
塩野義製薬	21,600	5,960.00	128,736,000	
わかもと製薬	2,900	243.00	704,700	
あすか製薬	1,900	1,117.00	2,122,300	
日本新薬	4,400	7,110.00	31,284,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,313.00	462,600	
中外製薬	17,700	13,090.00	231,693,000	
科研製薬	2,900	5,740.00	16,646,000	
エーザイ	20,300	7,544.00	153,143,200	
理研ビタミン	1,600	2,102.00	3,363,200	
ロート製薬	8,700	3,090.00	26,883,000	
小野薬品工業	39,000	2,619.00	102,141,000	
久光製薬	4,500	5,080.00	22,860,000	
有機合成薬品工業	2,700	348.00	939,600	
持田製薬	2,300	4,095.00	9,418,500	
参天製薬	31,600	1,881.00	59,439,600	
扶桑薬品工業	500	2,378.00	1,189,000	
日本ケミファ	200	2,518.00	503,600	
ツムラ	5,200	2,908.00	15,121,600	
日医工	4,900	1,424.00	6,977,600	
テルモ	48,000	3,563.00	171,024,000	
みらかホールディングス	4,500	2,549.00	11,470,500	
キッセイ薬品工業	3,000	2,640.00	7,920,000	
生化学工業	3,300	1,084.00	3,577,200	
栄研化学	3,000	1,819.00	5,457,000	

日水製薬	700	1,242.00	869,400	
鳥居薬品	1,200	2,948.00	3,537,600	
ＪＣＲファーマ	1,200	10,880.00	13,056,000	
東和薬品	2,100	2,300.00	4,830,000	
富士製薬工業	1,000	1,168.00	1,168,000	
沢井製薬	3,500	5,890.00	20,615,000	
ゼリア新薬工業	3,100	2,070.00	6,417,000	
第一三共	48,500	7,750.00	375,875,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,800	2,225.00	8,455,000	
大幸薬品	2,200	1,728.00	3,801,600	
ダイト	1,000	4,000.00	4,000,000	
大塚ホールディングス	32,300	4,241.00	136,984,300	
大正製薬ホールディングス	3,600	6,720.00	24,192,000	
ペプチドリーム	8,600	4,260.00	36,636,000	
大日本塗料	1,600	945.00	1,512,000	
日本ペイントホールディングス	13,700	6,390.00	87,543,000	
関西ペイント	18,700	2,047.00	38,278,900	
神東塗料	1,800	172.00	309,600	
中国塗料	4,700	819.00	3,849,300	
日本特殊塗料	1,100	899.00	988,900	
藤倉化成	1,600	515.00	824,000	
太陽ホールディングス	1,300	4,415.00	5,739,500	
ＤＩＣ	6,900	2,501.00	17,256,900	
サカタインクス	3,600	978.00	3,520,800	
東洋インキＳＣホールディングス	3,400	2,003.00	6,810,200	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,100	720.00	792,000	
アルプス技研	1,400	1,750.00	2,450,000	
ダイオーズ	200	1,062.00	212,400	
日本空調サービス	1,400	698.00	977,200	
オリエンタルランド	17,300	13,730.00	237,529,000	
フォーカスシステムズ	900	797.00	717,300	
ダスキン	4,000	2,755.00	11,020,000	
パーク２４	9,000	1,705.00	15,345,000	
明光ネットワークジャパン	2,100	793.00	1,665,300	
ファルコホールディングス	900	1,605.00	1,444,500	
クレスコ	1,000	1,433.00	1,433,000	
フジ・メディア・ホールディングス	15,900	1,083.00	17,219,700	
ラウンドワン	4,500	881.00	3,964,500	
リゾートトラスト	7,400	1,127.00	8,339,800	
オービック	5,800	17,110.00	99,238,000	
ジャストシステム	2,700	7,070.00	19,089,000	
ＴＤＣソフト	1,200	850.00	1,020,000	
Ｚホールディングス	228,900	435.00	99,571,500	
ビー・エム・エル	2,100	3,075.00	6,457,500	
ワタベウェディング	200	390.00	78,000	
トレンドマイクロ	7,400	5,420.00	40,108,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,100	1,144.00	3,546,400	
ＩＤホールディングス	500	1,494.00	747,000	
リソー教育	7,100	267.00	1,895,700	
日本オラクル	3,400	11,870.00	40,358,000	

早稲田アカデミー	800	971.00	776,800	
アルファシステムズ	500	3,355.00	1,677,500	
フューチャー	1,900	1,627.00	3,091,300	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,000	1,129.00	1,129,000	
ＳＢテクノロジー	600	2,681.00	1,608,600	
トーセ	400	799.00	319,600	
ユー・エス・エス	18,000	1,740.00	31,320,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,700	5,020.00	8,534,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,600	3,470.00	26,372,000	
アイティフォー	1,900	667.00	1,267,300	
東京個別指導学院	600	569.00	341,400	
東計電算	200	3,980.00	796,000	
サイバーエージェント	10,000	4,520.00	45,200,000	
楽天	75,800	956.00	72,464,800	
エックスネット	200	957.00	191,400	
クリーク・アンド・リバー社	800	939.00	751,200	
テー・オー・ダブリュー	1,800	277.00	498,600	
大塚商会	9,000	4,975.00	44,775,000	
サイボウズ	2,000	2,210.00	4,420,000	
ソフトブレーン	1,000	457.00	457,000	
山田コンサルティンググループ	1,000	1,162.00	1,162,000	
セントラルスポーツ	500	2,266.00	1,133,000	
パラカ	400	1,671.00	668,400	
電通国際情報サービス	1,000	4,550.00	4,550,000	
ＡＣＣＥＳＳ	1,700	887.00	1,507,900	
デジタルガレージ	3,000	3,940.00	11,820,000	
イーエムシステムズ	2,400	815.00	1,956,000	
ウェザーニューズ	600	3,765.00	2,259,000	
ＣＩＪ	1,000	776.00	776,000	
ビジネスエンジニアリング	200	2,450.00	490,000	
日本エンタープライズ	2,300	231.00	531,300	
WOWOW	800	2,530.00	2,024,000	
スカラ	1,000	526.00	526,000	
インテリジェント　ウェイブ	1,000	602.00	602,000	
フルキャストホールディングス	1,600	1,443.00	2,308,800	
エン・ジャパン	2,900	2,440.00	7,076,000	
富士フイルムホールディングス	32,600	5,287.00	172,356,200	
コニカミノルタ	36,400	389.00	14,159,600	
資生堂	33,700	6,390.00	215,343,000	
ライオン	22,100	2,300.00	50,830,000	
高砂香料工業	1,000	2,207.00	2,207,000	
マンダム	3,800	2,025.00	7,695,000	
ミルボン	2,300	4,860.00	11,178,000	
ファンケル	6,900	2,900.00	20,010,000	
コーセー	3,200	13,100.00	41,920,000	
コタ	1,000	1,215.00	1,215,000	
シーボン	200	2,170.00	434,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,200	1,919.00	13,816,800	
ノエビアホールディングス	1,400	4,965.00	6,951,000	
アジュバンコスメジャパン	500	938.00	469,000	

エステー	1,100	1,562.00	1,718,200	
アグロ　カネショウ	600	1,483.00	889,800	
コニシ	2,700	1,425.00	3,847,500	
長谷川香料	3,000	2,178.00	6,534,000	
星光ＰＭＣ	1,000	662.00	662,000	
小林製薬	4,800	9,980.00	47,904,000	
荒川化学工業	1,500	1,326.00	1,989,000	
メック	1,300	1,654.00	2,150,200	
日本高純度化学	400	2,654.00	1,061,600	
タカラバイオ	4,500	2,469.00	11,110,500	
ＪＣＵ	2,100	2,752.00	5,779,200	
新田ゼラチン	1,100	692.00	761,200	
ＯＡＴアグリオ	200	1,038.00	207,600	
デクセリアルズ	4,500	716.00	3,222,000	
アース製薬	1,300	6,180.00	8,034,000	
北興化学工業	1,500	570.00	855,000	
大成ラミック	500	2,608.00	1,304,000	
クミアイ化学工業	7,200	872.00	6,278,400	
日本農薬	3,400	436.00	1,482,400	
富士興産	1,000	405.00	405,000	
ニチレキ	2,000	1,475.00	2,950,000	
ユシロ化学工業	900	1,151.00	1,035,900	
ビーピー・カストロール	500	1,134.00	567,000	
富士石油	5,300	180.00	954,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	500	909.00	454,500	
出光興産	18,700	2,443.00	45,684,100	
ＪＸＴＧホールディングス	256,800	380.10	97,609,680	
コスモエネルギーホールディングス	4,800	1,578.00	7,574,400	
横浜ゴム	9,800	1,337.00	13,102,600	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	9,900	1,268.00	12,553,200	
ブリヂストン	48,900	3,303.00	161,516,700	
住友ゴム工業	15,300	1,010.00	15,453,000	
藤倉コンポジット	1,600	366.00	585,600	
オカモト	1,000	4,365.00	4,365,000	
アキレス	1,200	1,622.00	1,946,400	
フコク	800	600.00	480,000	
ニッタ	1,800	2,024.00	3,643,200	
クリエートメディック	500	982.00	491,000	
住友理工	3,300	556.00	1,834,800	
三ツ星ベルト	2,100	1,474.00	3,095,400	
バンドー化学	2,500	630.00	1,575,000	
ＡＧＣ	16,700	2,667.00	44,538,900	
日本板硝子	7,700	345.00	2,656,500	
石塚硝子	400	2,144.00	857,600	
有沢製作所	2,800	762.00	2,133,600	
日本山村硝子	400	852.00	340,800	
日本電気硝子	6,700	1,583.00	10,606,100	
オハラ	800	913.00	730,400	
住友大阪セメント	3,200	3,625.00	11,600,000	
太平洋セメント	10,700	2,184.00	23,368,800	

リソルホールディングス	100	3,360.00	336,000	
日本ヒューム	1,600	639.00	1,022,400	
日本コンクリート工業	4,000	255.00	1,020,000	
三谷セキサン	800	4,865.00	3,892,000	
アジアパイルホールディングス	2,300	423.00	972,900	
東海カーボン	17,700	831.00	14,708,700	
日本カーボン	900	3,305.00	2,974,500	
東洋炭素	1,000	1,498.00	1,498,000	
ノリタケカンパニーリミテド	900	3,485.00	3,136,500	
ＴＯＴＯ	12,100	3,965.00	47,976,500	
日本碍子	20,500	1,374.00	28,167,000	
日本特殊陶業	12,900	1,576.00	20,330,400	
ＭＡＲＵＷＡ	700	7,700.00	5,390,000	
品川リフラクトリーズ	400	2,246.00	898,400	
黒崎播磨	300	3,870.00	1,161,000	
ヨータイ	1,500	604.00	906,000	
イソライト工業	900	442.00	397,800	
東京窯業	2,000	295.00	590,000	
ニッカトー	600	591.00	354,600	
フジミインコーポレーテッド	1,600	3,060.00	4,896,000	
クニミネ工業	900	1,048.00	943,200	
エーアンドエーマテリアル	300	1,146.00	343,800	
ニチアス	4,600	2,141.00	9,848,600	
日本製鉄	74,700	896.60	66,976,020	
神戸製鋼所	32,300	351.00	11,337,300	
中山製鋼所	2,400	368.00	883,200	
合同製鐵	900	2,025.00	1,822,500	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	45,800	707.00	32,380,600	
東京製鐵	8,300	764.00	6,341,200	
共英製鋼	1,900	1,354.00	2,572,600	
大和工業	3,500	2,132.00	7,462,000	
東京鐵鋼	800	1,197.00	957,600	
大阪製鐵	800	1,213.00	970,400	
淀川製鋼所	2,200	1,680.00	3,696,000	
丸一鋼管	5,400	2,445.00	13,203,000	
モリ工業	500	2,334.00	1,167,000	
大同特殊鋼	2,700	3,545.00	9,571,500	
日本高周波鋼業	1,300	362.00	470,600	
日本冶金工業	1,400	1,692.00	2,368,800	
山陽特殊製鋼	1,300	997.00	1,296,100	
愛知製鋼	900	2,800.00	2,520,000	
日立金属	18,300	1,035.00	18,940,500	
日本金属	300	613.00	183,900	
大平洋金属	1,200	1,585.00	1,902,000	
新日本電工	11,200	151.00	1,691,200	
栗本鐵工所	900	1,791.00	1,611,900	
虹　技	200	1,145.00	229,000	
日本製鋼所	5,100	1,340.00	6,834,000	
三菱製鋼	900	765.00	688,500	

日亜鋼業	2,500	260.00	650,000	
日本精線	300	2,970.00	891,000	
エンビプロ・ホールディングス	700	571.00	399,700	
大紀アルミニウム工業所	2,500	568.00	1,420,000	
日本軽金属ホールディングス	41,400	169.00	6,996,600	
三井金属鉱業	4,600	2,071.00	9,526,600	
東邦亜鉛	900	1,349.00	1,214,100	
三菱マテリアル	11,100	2,210.00	24,531,000	
住友金属鉱山	21,500	2,715.00	58,372,500	
ＤＯＷＡホールディングス	4,300	3,020.00	12,986,000	
古河機械金属	2,900	1,088.00	3,155,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	951.00	1,711,800	
東邦チタニウム	3,100	616.00	1,909,600	
ＵＡＣＪ	2,600	1,726.00	4,487,600	
ＣＫサンエツ	300	2,906.00	871,800	
古河電気工業	5,200	1,998.00	10,389,600	
住友電気工業	62,600	1,085.00	67,921,000	
フジクラ	21,000	306.00	6,426,000	
昭和電線ホールディングス	2,100	1,198.00	2,515,800	
東京特殊電線	300	2,427.00	728,100	
タツタ電線	3,400	536.00	1,822,400	
カナレ電気	300	1,629.00	488,700	
平河ヒューテック	800	1,035.00	828,000	
リョービ	1,900	1,277.00	2,426,300	
アーレスティ	2,200	376.00	827,200	
アサヒホールディングス	3,000	2,575.00	7,725,000	
東洋製罐グループホールディングス	10,700	1,065.00	11,395,500	
ホッカンホールディングス	700	1,542.00	1,079,400	
コロナ	800	968.00	774,400	
横河ブリッジホールディングス	3,100	1,879.00	5,824,900	
ＯＳＪＢホールディングス	8,500	245.00	2,082,500	
駒井ハルテック	300	1,526.00	457,800	
高田機工	100	2,250.00	225,000	
三和ホールディングス	15,500	834.00	12,927,000	
文化シヤッター	4,900	791.00	3,875,900	
三協立山	2,200	890.00	1,958,000	
アルインコ	1,100	938.00	1,031,800	
東洋シヤッター	400	680.00	272,000	
ＬＩＸＩＬグループ	24,800	1,382.00	34,273,600	
日本フイルコン	1,200	520.00	624,000	
ノーリツ	3,400	1,262.00	4,290,800	
長府製作所	1,700	2,415.00	4,105,500	
リンナイ	3,300	8,250.00	27,225,000	
ユニプレス	3,300	938.00	3,095,400	
ダイニチ工業	900	697.00	627,300	
日東精工	2,100	468.00	982,800	
三洋工業	100	1,957.00	195,700	
岡部	3,200	775.00	2,480,000	
ジーテクト	1,900	1,106.00	2,101,400	
東プレ	3,000	1,268.00	3,804,000	

高周波熱錬	2,900	586.00	1,699,400	
東京製綱	1,200	540.00	648,000	
サンコール	1,100	387.00	425,700	
モリテックスチール	1,200	276.00	331,200	
パイオラックス	2,400	1,586.00	3,806,400	
エイチワン	1,500	509.00	763,500	
日本発条	17,900	704.00	12,601,600	
中央発條	100	2,760.00	276,000	
アドバネクス	200	1,381.00	276,200	
三浦工業	7,300	4,520.00	32,996,000	
タクマ	5,700	1,227.00	6,993,900	
テクノプロ・ホールディングス	3,200	5,990.00	19,168,000	
アトラ	600	258.00	154,800	
インターワークス	200	382.00	76,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	700	6,800.00	4,760,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	700	1,498.00	1,048,600	
ファーストロジック	500	567.00	283,500	
三機サービス	300	1,185.00	355,500	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,000	899.00	899,000	
デザインワン・ジャパン	1,200	217.00	260,400	
イー・ガーディアン	700	1,875.00	1,312,500	
リブセンス	1,600	275.00	440,000	
ジャパンマテリアル	5,000	1,537.00	7,685,000	
ベクトル	2,100	740.00	1,554,000	
ウチヤマホールディングス	900	347.00	312,300	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	894.00	1,251,600	
ライクキッズ	300	634.00	190,200	
キャリアリンク	900	490.00	441,000	
ＩＢＪ	1,200	809.00	970,800	
アサンテ	500	1,462.00	731,000	
Ｎ・フィールド	1,200	453.00	543,600	
バリューＨＲ	700	1,438.00	1,006,600	
Ｍ&Ａキャピタルパートナーズ	1,300	3,160.00	4,108,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,498.00	1,048,600	
ＥＲＩホールディングス	200	660.00	132,000	
アビスト	100	2,077.00	207,700	
シグマクシス	1,200	1,662.00	1,994,400	
ウィルグループ	900	635.00	571,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	193.00	424,600	
リクルートホールディングス	116,100	3,149.00	365,598,900	
エラン	1,000	1,750.00	1,750,000	
ツガミ	3,600	995.00	3,582,000	
オークマ	2,000	4,290.00	8,580,000	
芝浦機械	1,900	2,183.00	4,147,700	
アマダ	20,900	974.00	20,356,600	
アイダエンジニアリング	4,500	732.00	3,294,000	
滝澤鉄工所	400	1,062.00	424,800	
ＦＵＪＩ	7,300	1,777.00	12,972,100	

牧野フライス製作所	2,000	3,285.00	6,570,000	
オーエスジー	7,700	1,415.00	10,895,500	
ダイジェット工業	200	1,241.00	248,200	
旭ダイヤモンド工業	4,600	489.00	2,249,400	
ＤＭＧ森精機	10,600	1,130.00	11,978,000	
ソディック	4,000	780.00	3,120,000	
ディスコ	2,300	24,910.00	57,293,000	
日東工器	800	1,932.00	1,545,600	
日進工具	700	2,706.00	1,894,200	
パンチ工業	1,700	350.00	595,000	
冨士ダイス	700	587.00	410,900	
土木管理総合試験所	700	327.00	228,900	
ネットマーケティング	900	719.00	647,100	
日本郵政	132,300	814.10	107,705,430	
ベルシステム２４ホールディングス	2,700	1,252.00	3,380,400	
鎌倉新書	1,200	1,034.00	1,240,800	
ＳＭＮ	400	882.00	352,800	
一蔵	500	357.00	178,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	600	2,358.00	1,414,800	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	400	647.00	258,800	
エアトリ	800	957.00	765,600	
アトラエ	500	2,613.00	1,306,500	
ストライク	600	4,275.00	2,565,000	
ソラスト	4,500	1,120.00	5,040,000	
セラク	600	866.00	519,600	
インソース	700	2,472.00	1,730,400	
豊田自動織機	13,800	5,350.00	73,830,000	
豊和工業	1,000	786.00	786,000	
ＯＫＫ	900	477.00	429,300	
東洋機械金属	1,100	405.00	445,500	
津田駒工業	400	777.00	310,800	
エンシュウ	400	995.00	398,000	
島精機製作所	2,600	1,629.00	4,235,400	
オプトラン	1,900	3,000.00	5,700,000	
ＮＣホールディングス	900	526.00	473,400	
イワキ	1,100	956.00	1,051,600	
フリュー	1,700	840.00	1,428,000	
ヤマシンフィルタ	3,700	843.00	3,119,100	
日阪製作所	1,900	736.00	1,398,400	
やまびこ	3,100	833.00	2,582,300	
平田機工	800	5,220.00	4,176,000	
ペガサスミシン製造	1,400	317.00	443,800	
マルマエ	600	890.00	534,000	
タツモ	800	1,195.00	956,000	
ナブテスコ	9,900	3,280.00	32,472,000	
三井海洋開発	1,700	1,589.00	2,701,300	
レオン自動機	1,600	1,276.00	2,041,600	
ＳＭＣ	5,300	50,560.00	267,968,000	
ホソカワミクロン	600	5,060.00	3,036,000	
ユニオンツール	700	2,769.00	1,938,300	

オイレス工業	2,100	1,351.00	2,837,100	
日精エー・エス・ビー機械	500	2,942.00	1,471,000	
サトーホールディングス	2,400	2,278.00	5,467,200	
技研製作所	1,500	4,010.00	6,015,000	
日本エアーテック	700	1,053.00	737,100	
カワタ	400	712.00	284,800	
日精樹脂工業	1,400	968.00	1,355,200	
オカダアイヨン	500	879.00	439,500	
ワイエイシイホールディングス	800	439.00	351,200	
小松製作所	76,700	2,034.50	156,046,150	
住友重機械工業	9,600	2,244.00	21,542,400	
日立建機	6,800	2,538.00	17,258,400	
日工	2,500	563.00	1,407,500	
巴工業	700	1,900.00	1,330,000	
井関農機	1,600	1,175.00	1,880,000	
ＴＯＷＡ	1,900	944.00	1,793,600	
丸山製作所	500	1,256.00	628,000	
北川鉄工所	600	1,567.00	940,200	
シンニッタン	1,900	260.00	494,000	
ローツェ	800	4,900.00	3,920,000	
タカキタ	500	547.00	273,500	
クボタ	90,000	1,336.00	120,240,000	
荏原実業	500	2,229.00	1,114,500	
三菱化工機	600	1,590.00	954,000	
月島機械	3,100	1,238.00	3,837,800	
帝国電機製作所	1,500	1,348.00	2,022,000	
東京機械製作所	1,100	240.00	264,000	
新東工業	3,800	755.00	2,869,000	
澁谷工業	1,500	2,642.00	3,963,000	
アイチコーポレーション	2,900	689.00	1,998,100	
小森コーポレーション	4,200	757.00	3,179,400	
鶴見製作所	1,200	1,880.00	2,256,000	
住友精密工業	300	2,183.00	654,900	
日本ギア工業	700	268.00	187,600	
酒井重工業	300	2,046.00	613,800	
荏原製作所	7,000	2,420.00	16,940,000	
石井鐵工所	200	2,422.00	484,400	
酉島製作所	1,600	739.00	1,182,400	
北越工業	1,700	1,010.00	1,717,000	
ダイキン工業	21,600	14,090.00	304,344,000	
オルガノ	700	5,730.00	4,011,000	
トーヨーカネツ	800	1,936.00	1,548,800	
栗田工業	9,200	2,995.00	27,554,000	
椿本チエイン	2,300	2,471.00	5,683,300	
大同工業	600	629.00	377,400	
日機装	5,000	847.00	4,235,000	
木村化工機	1,700	431.00	732,700	
レイズネクスト	2,800	1,191.00	3,334,800	
アネスト岩田	2,600	848.00	2,204,800	
ダイフク	8,700	7,470.00	64,989,000	

サムコ	500	1,895.00	947,500	
加藤製作所	1,000	1,243.00	1,243,000	
油研工業	300	1,337.00	401,100	
タダノ	8,300	801.00	6,648,300	
フジテック	6,200	1,543.00	9,566,600	
ＣＫＤ	4,900	1,811.00	8,873,900	
キトー	1,200	1,088.00	1,305,600	
平和	4,800	1,868.00	8,966,400	
理想科学工業	1,500	1,473.00	2,209,500	
ＳＡＮＫＹＯ	3,800	2,909.00	11,054,200	
日本金銭機械	1,900	569.00	1,081,100	
マースグループホールディングス	1,000	1,682.00	1,682,000	
フクシマガリレイ	1,000	3,210.00	3,210,000	
オーイズミ	900	430.00	387,000	
ダイコク電機	800	1,211.00	968,800	
竹内製作所	2,900	1,634.00	4,738,600	
アマノ	4,400	2,212.00	9,732,800	
ＪＵＫＩ	2,400	615.00	1,476,000	
蛇の目ミシン工業	1,500	419.00	628,500	
ブラザー工業	20,600	1,809.00	37,265,400	
マックス	2,700	1,623.00	4,382,100	
モリタホールディングス	2,900	1,627.00	4,718,300	
グローリー	4,400	2,448.00	10,771,200	
新晃工業	1,600	1,387.00	2,219,200	
大和冷機工業	2,200	940.00	2,068,000	
セガサミーホールディングス	16,900	1,322.00	22,341,800	
日本ピストンリング	500	1,142.00	571,000	
リケン	600	2,809.00	1,685,400	
ＴＰＲ	2,200	1,247.00	2,743,400	
ツバキ・ナカシマ	2,800	770.00	2,156,000	
ホシザキ	5,000	8,250.00	41,250,000	
大豊工業	1,200	551.00	661,200	
日本精工	32,000	764.00	24,448,000	
ＮＴＮ	39,800	205.00	8,159,000	
ジェイテクト	16,100	759.00	12,219,900	
不二越	1,600	3,210.00	5,136,000	
ミネベアミツミ	31,600	1,768.00	55,868,800	
日本トムソン	5,200	380.00	1,976,000	
ＴＨＫ	10,000	2,604.00	26,040,000	
ユーシン精機	1,400	673.00	942,200	
前澤給装工業	600	2,067.00	1,240,200	
イーグル工業	1,900	687.00	1,305,300	
前澤工業	1,000	344.00	344,000	
日本ピラー工業	1,800	1,317.00	2,370,600	
キッツ	6,700	685.00	4,589,500	
日立製作所	81,500	3,205.00	261,207,500	
三菱電機	169,500	1,335.00	226,282,500	
富士電機	10,200	2,672.00	27,254,400	
東洋電機製造	600	1,249.00	749,400	
安川電機	18,300	3,500.00	64,050,000	

シンフォニア　テクノロジー	2,100	1,046.00	2,196,600	
明電舎	3,200	1,694.00	5,420,800	
オリジン	500	1,459.00	729,500	
山洋電気	800	4,615.00	3,692,000	
デンヨー	1,500	2,000.00	3,000,000	
ベイカレント・コンサルティング	1,000	6,320.00	6,320,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	400	882.00	352,800	
アイモバイル	800	632.00	505,600	
キャリアインデックス	800	319.00	255,200	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	400	757.00	302,800	
船場	100	927.00	92,700	
グレイステクノロジー	800	3,210.00	2,568,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,700	2,679.00	4,554,300	
フルテック	200	1,280.00	256,000	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	700	623.00	436,100	
ソウルドアウト	300	2,259.00	677,700	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	200	586.00	117,200	
ミダック	400	1,142.00	456,800	
日総工産	1,000	503.00	503,000	
キュービーネットホールディングス	800	2,021.00	1,616,800	
ＲＰＡホールディングス	1,200	820.00	984,000	
三櫻工業	2,400	692.00	1,660,800	
マキタ	22,100	3,385.00	74,808,500	
東芝テック	2,200	3,520.00	7,744,000	
芝浦メカトロニクス	300	2,829.00	848,700	
マブチモーター	4,700	3,280.00	15,416,000	
日本電産	40,800	6,169.00	251,695,200	
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,060.00	1,060,000	
東光高岳	800	922.00	737,600	
ダイヘン	1,800	3,075.00	5,535,000	
ヤーマン	2,800	696.00	1,948,800	
ＪＶＣケンウッド	14,100	167.00	2,354,700	
ミマキエンジニアリング	1,500	409.00	613,500	
第一精工	800	2,202.00	1,761,600	
日新電機	4,000	1,083.00	4,332,000	
大崎電気工業	3,300	518.00	1,709,400	
オムロン	15,300	6,700.00	102,510,000	
日東工業	2,400	1,807.00	4,336,800	
ＩＤＥＣ	2,400	1,635.00	3,924,000	
正興電機製作所	400	895.00	358,000	
不二電機工業	300	1,247.00	374,100	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5,700	1,530.00	8,721,000	
サクサホールディングス	400	1,702.00	680,800	
メルコホールディングス	500	2,587.00	1,293,500	
テクノメディカ	300	1,860.00	558,000	
日本電気	20,600	4,100.00	84,460,000	
富士通	16,400	10,545.00	172,938,000	
沖電気工業	6,900	1,049.00	7,238,100	

岩崎通信機	700	843.00	590,100	
電気興業	800	2,533.00	2,026,400	
サンケン電気	2,000	2,258.00	4,516,000	
ナカヨ	300	1,374.00	412,200	
アイホン	800	1,570.00	1,256,000	
ルネサスエレクトロニクス	81,400	580.00	47,212,000	
セイコーエプソン	21,000	1,206.00	25,326,000	
ワコム	11,500	377.00	4,335,500	
アルバック	3,100	2,927.00	9,073,700	
アクセル	900	728.00	655,200	
ＥＩＺＯ	1,300	3,270.00	4,251,000	
日本信号	4,400	1,047.00	4,606,800	
京三製作所	4,100	513.00	2,103,300	
能美防災	2,300	2,157.00	4,961,100	
ホーチキ	1,200	1,317.00	1,580,400	
星和電機	800	589.00	471,200	
エレコム	1,900	4,360.00	8,284,000	
パナソニック	193,800	799.60	154,962,480	
シャープ	19,700	1,181.00	23,265,700	
アンリツ	11,000	2,208.00	24,288,000	
富士通ゼネラル	4,700	1,792.00	8,422,400	
ソニー	106,200	6,948.00	737,877,600	
ＴＤＫ	8,200	9,370.00	76,834,000	
帝国通信工業	400	1,206.00	482,400	
タムラ製作所	5,600	439.00	2,458,400	
アルプスアルパイン	15,000	1,122.00	16,830,000	
池上通信機	400	842.00	336,800	
鈴木	900	721.00	648,900	
日本トリム	200	3,130.00	626,000	
ローランド　ディー．ジー．	900	1,358.00	1,222,200	
フォスター電機	1,800	1,197.00	2,154,600	
ＳＭＫ	400	2,645.00	1,058,000	
ヨコオ	1,200	2,474.00	2,968,800	
ホシデン	4,600	912.00	4,195,200	
ヒロセ電機	2,600	12,030.00	31,278,000	
日本航空電子工業	4,000	1,428.00	5,712,000	
ＴＯＡ	1,600	737.00	1,179,200	
マクセルホールディングス	4,000	984.00	3,936,000	
古野電気	2,200	809.00	1,779,800	
ユニデンホールディングス	500	1,882.00	941,000	
スミダコーポレーション	1,100	663.00	729,300	
アイコム	1,000	2,600.00	2,600,000	
リオン	700	2,330.00	1,631,000	
本多通信工業	1,300	431.00	560,300	
船井電機	2,000	424.00	848,000	
横河電機	15,500	1,497.00	23,203,500	
新電元工業	600	2,518.00	1,510,800	
アズビル	10,700	2,848.00	30,473,600	
東亜ディーケーケー	800	872.00	697,600	
日本光電工業	7,000	3,975.00	27,825,000	

チノー	500	1,337.00	668,500	
共和電業	1,400	398.00	557,200	
日本電子材料	900	953.00	857,700	
堀場製作所	3,400	5,790.00	19,686,000	
アドバンテスト	12,700	5,370.00	68,199,000	
小野測器	700	489.00	342,300	
エスペック	1,500	1,705.00	2,557,500	
キーエンス	15,400	39,490.00	608,146,000	
日置電機	800	3,105.00	2,484,000	
シスメックス	12,100	7,461.00	90,278,100	
日本マイクロニクス	3,000	890.00	2,670,000	
メガチップス	1,600	1,580.00	2,528,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,000	2,918.00	2,918,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,400	364.00	509,600	
澤藤電機	200	2,377.00	475,400	
デンソー	37,400	3,682.00	137,706,800	
原田工業	800	847.00	677,600	
コーセル	2,400	868.00	2,083,200	
イリソ電子工業	1,400	3,055.00	4,277,000	
オプテックスグループ	2,700	1,252.00	3,380,400	
千代田インテグレ	700	1,776.00	1,243,200	
アイ・オー・データ機器	500	964.00	482,000	
レーザーテック	7,500	7,670.00	57,525,000	
スタンレー電気	11,900	2,399.00	28,548,100	
岩崎電気	700	1,489.00	1,042,300	
ウシオ電機	9,300	1,134.00	10,546,200	
岡谷電機産業	1,300	319.00	414,700	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,400	331.00	463,400	
エノモト	600	1,038.00	622,800	
日本セラミック	1,600	2,019.00	3,230,400	
遠藤照明	700	565.00	395,500	
古河電池	1,200	552.00	662,400	
双信電機	1,000	332.00	332,000	
山一電機	1,300	1,497.00	1,946,100	
図研	1,200	2,533.00	3,039,600	
日本電子	3,400	3,355.00	11,407,000	
カシオ計算機	15,100	1,678.00	25,337,800	
ファナック	16,100	17,910.00	288,351,000	
日本シイエムケイ	4,000	425.00	1,700,000	
エンプラス	900	2,304.00	2,073,600	
大真空	800	1,805.00	1,444,000	
ローム	7,600	6,870.00	52,212,000	
浜松ホトニクス	12,200	4,665.00	56,913,000	
三井ハイテック	2,100	1,277.00	2,681,700	
新光電気工業	5,900	1,364.00	8,047,600	
京セラ	23,900	5,803.00	138,691,700	
協栄産業	300	1,120.00	336,000	
太陽誘電	7,700	3,050.00	23,485,000	
村田製作所	49,800	6,054.00	301,489,200	
双葉電子工業	2,500	1,056.00	2,640,000	

日東電工	11,700	5,410.00	63,297,000	
北陸電気工業	700	922.00	645,400	
東海理化電機製作所	4,500	1,380.00	6,210,000	
ニチコン	5,700	685.00	3,904,500	
日本ケミコン	1,400	1,217.00	1,703,800	
ＫＯＡ	2,500	890.00	2,225,000	
日立造船	14,200	359.00	5,097,800	
三菱重工業	28,300	2,686.00	76,013,800	
川崎重工業	13,300	1,599.00	21,266,700	
ＩＨＩ	12,200	1,302.00	15,884,400	
名村造船所	5,900	177.00	1,044,300	
サノヤスホールディングス	2,700	150.00	405,000	
スプリックス	400	923.00	369,200	
マネジメントソリューションズ	800	1,097.00	877,600	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	300	1,017.00	305,100	
カーブスホールディングス	4,300	552.00	2,373,600	
日本車輌製造	700	2,662.00	1,863,400	
三菱ロジスネクスト	2,300	1,035.00	2,380,500	
近畿車輌	300	1,069.00	320,700	
ＦＰＧ	5,000	515.00	2,575,000	
島根銀行	1,400	481.00	673,400	
じもとホールディングス	11,500	93.00	1,069,500	
全国保証	4,700	3,195.00	15,016,500	
めぶきフィナンシャルグループ	86,900	231.00	20,073,900	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,048.00	2,410,400	
九州フィナンシャルグループ	37,100	440.00	16,324,000	
かんぽ生命保険	6,100	1,290.00	7,869,000	
ゆうちょ銀行	47,500	1,010.00	47,975,000	
富山第一銀行	2,800	268.00	750,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	95,400	324.00	30,909,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,100	611.00	6,782,100	
マーキュリアインベストメント	800	566.00	452,800	
イントラスト	800	641.00	512,800	
日本モーゲージサービス	400	1,584.00	633,600	
ＣＡＳＡ	700	1,127.00	788,900	
アルヒ	2,600	1,273.00	3,309,800	
プレミアグループ	1,000	1,765.00	1,765,000	
日産自動車	200,100	347.60	69,554,760	
いすゞ自動車	49,000	813.30	39,851,700	
トヨタ自動車	189,200	6,492.00	1,228,286,400	
日野自動車	21,500	652.00	14,018,000	
三菱自動車工業	62,800	289.00	18,149,200	
エフテック	1,100	459.00	504,900	
レシップホールディングス	800	464.00	371,200	
ＧＭＢ	100	659.00	65,900	
ファルテック	400	640.00	256,000	
武蔵精密工業	3,700	851.00	3,148,700	
日産車体	3,600	889.00	3,200,400	

新明和工業	4,700	1,081.00	5,080,700	
極東開発工業	3,100	1,224.00	3,794,400	
日信工業	3,700	2,210.00	8,177,000	
トピー工業	1,400	1,260.00	1,764,000	
ティラド	400	1,364.00	545,600	
タチエス	2,800	929.00	2,601,200	
ＮＯＫ	9,300	1,206.00	11,215,800	
フタバ産業	4,900	483.00	2,366,700	
ＫＹＢ	2,000	2,081.00	4,162,000	
市光工業	2,600	480.00	1,248,000	
大同メタル工業	3,200	530.00	1,696,000	
プレス工業	7,800	251.00	1,957,800	
ミクニ	1,800	256.00	460,800	
太平洋工業	3,400	940.00	3,196,000	
ケーヒン	4,100	2,545.00	10,434,500	
河西工業	2,300	507.00	1,166,100	
アイシン精機	13,900	3,060.00	42,534,000	
マツダ	49,800	585.00	29,133,000	
今仙電機製作所	1,500	762.00	1,143,000	
本田技研工業	133,400	2,538.00	338,569,200	
スズキ	33,600	3,345.00	112,392,000	
ＳＵＢＡＲＵ	52,600	2,115.00	111,249,000	
安永	800	993.00	794,400	
ヤマハ発動機	22,000	1,365.00	30,030,000	
ショーワ	4,100	2,256.00	9,249,600	
小糸製作所	10,100	4,005.00	40,450,500	
ＴＢＫ	2,100	460.00	966,000	
エクセディ	2,300	1,664.00	3,827,200	
豊田合成	5,600	2,012.00	11,267,200	
愛三工業	2,700	551.00	1,487,700	
盟和産業	200	938.00	187,600	
日本プラスト	1,100	444.00	488,400	
ヨロズ	1,700	1,093.00	1,858,100	
エフ・シー・シー	2,800	1,539.00	4,309,200	
新家工業	200	1,078.00	215,600	
シマノ	6,300	17,150.00	108,045,000	
テイ・エス　テック	4,000	2,869.00	11,476,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,500	344.00	2,924,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,600	1,524.00	2,438,400	
第四北越フィナンシャルグループ	2,900	2,263.00	6,562,700	
ジャムコ	800	652.00	521,600	
小野建	1,400	1,155.00	1,617,000	
はるやまホールディングス	700	741.00	518,700	
南陽	400	1,379.00	551,600	
ノジマ	2,900	1,874.00	5,434,600	
佐鳥電機	1,400	828.00	1,159,200	
カッパ・クリエイト	2,400	1,383.00	3,319,200	
エコートレーディング	1,200	500.00	600,000	
伯東	1,400	965.00	1,351,000	
コンドーテック	1,500	964.00	1,446,000	

中山福	1,900	477.00	906,300	
ライトオン	1,200	499.00	598,800	
ナガイレーベン	2,300	2,585.00	5,945,500	
ジーンズメイト	600	238.00	142,800	
三菱食品	1,900	2,610.00	4,959,000	
良品計画	22,100	1,366.00	30,188,600	
三城ホールディングス	600	268.00	160,800	
松田産業	1,400	1,371.00	1,919,400	
第一興商	2,500	3,375.00	8,437,500	
メディパルホールディングス	18,200	2,077.00	37,801,400	
アドヴァン	2,500	1,105.00	2,762,500	
ＳＰＫ	1,000	1,300.00	1,300,000	
萩原電気ホールディングス	600	2,174.00	1,304,400	
アルビス	600	2,049.00	1,229,400	
アズワン	1,100	9,930.00	10,923,000	
スズデン	600	1,177.00	706,200	
尾家産業	700	1,500.00	1,050,000	
シモジマ	1,300	1,248.00	1,622,400	
ドウシシャ	1,700	1,386.00	2,356,200	
小津産業	700	1,917.00	1,341,900	
コナカ	1,700	321.00	545,700	
高速	1,100	1,451.00	1,596,100	
ハウス　オブ　ローゼ	100	1,545.00	154,500	
Ｇ－７ホールディングス	1,000	2,404.00	2,404,000	
たけびし	700	1,385.00	969,500	
イオン北海道	2,200	795.00	1,749,000	
コジマ	2,800	399.00	1,117,200	
ヒマラヤ	400	745.00	298,000	
コーナン商事	2,300	2,645.00	6,083,500	
ネットワンシステムズ	6,400	3,255.00	20,832,000	
エコス	600	1,914.00	1,148,400	
ワタミ	2,000	1,052.00	2,104,000	
マルシェ	200	595.00	119,000	
リックス	500	1,464.00	732,000	
システムソフト	3,800	74.00	281,200	
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	36,700	2,100.00	77,070,000	
丸文	1,700	504.00	856,800	
西松屋チェーン	3,800	843.00	3,203,400	
ゼンショーホールディングス	8,000	2,187.00	17,496,000	
ハピネット	1,500	1,075.00	1,612,500	
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,564.00	1,720,400	
ハークスレイ	200	1,015.00	203,000	
橋本総業ホールディングス	400	1,854.00	741,600	
日本ライフライン	5,000	1,282.00	6,410,000	
サイゼリヤ	2,600	2,293.00	5,961,800	
タカショー	2,100	469.00	984,900	
ＶＴホールディングス	6,400	291.00	1,862,400	
マルカ	800	1,775.00	1,420,000	
アルゴグラフィックス	1,400	3,485.00	4,879,000	

魚力	400	1,496.00	598,400	
ＩＤＯＭ	4,900	447.00	2,190,300	
日本エム・ディ・エム	1,000	1,595.00	1,595,000	
フジ・コーポレーション	400	1,865.00	746,000	
ユナイテッドアローズ	1,700	1,800.00	3,060,000	
進和	1,000	1,766.00	1,766,000	
エスケイジャパン	400	297.00	118,800	
ダイトロン	800	1,499.00	1,199,200	
ハイデイ日高	2,400	1,735.00	4,164,000	
シークス	2,300	931.00	2,141,300	
京都きもの友禅	700	221.00	154,700	
コロワイド	5,600	1,499.00	8,394,400	
ピーシーデポコーポレーション	2,300	574.00	1,320,200	
田中商事	900	695.00	625,500	
オーハシテクニカ	1,100	1,461.00	1,607,100	
壱番屋	1,200	4,570.00	5,484,000	
白銅	700	1,285.00	899,500	
ＰＬＡＮＴ	400	622.00	248,800	
スギホールディングス	3,400	6,370.00	21,658,000	
薬王堂ホールディングス	800	2,648.00	2,118,400	
島津製作所	20,200	2,635.00	53,227,000	
ＪＭＳ	1,600	842.00	1,347,200	
長野計器	1,300	784.00	1,019,200	
ブイ・テクノロジー	800	3,870.00	3,096,000	
スター精密	2,600	1,187.00	3,086,200	
東京計器	1,000	740.00	740,000	
愛知時計電機	100	4,390.00	439,000	
インターアクション	900	2,459.00	2,213,100	
オーバル	1,600	229.00	366,400	
東京精密	3,100	3,415.00	10,586,500	
マニー	6,800	2,433.00	16,544,400	
ニコン	25,700	984.00	25,288,800	
トプコン	8,600	842.00	7,241,200	
オリンパス	93,900	1,681.50	157,892,850	
理研計器	1,300	1,975.00	2,567,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	3,000	5,180.00	15,540,000	
キヤノン電子	1,700	1,566.00	2,662,200	
タムロン	1,400	1,807.00	2,529,800	
ＨＯＹＡ	33,900	9,872.00	334,660,800	
シード	700	822.00	575,400	
ノーリツ鋼機	1,100	1,225.00	1,347,500	
エー・アンド・デイ	1,500	777.00	1,165,500	
朝日インテック	19,200	2,778.00	53,337,600	
キヤノン	90,900	2,184.50	198,571,050	
リコー	43,000	763.00	32,809,000	
シチズン時計	19,600	371.00	7,271,600	
リズム時計工業	400	641.00	256,400	
大研医器	1,300	641.00	833,300	
メニコン	2,400	4,640.00	11,136,000	
シンシア	400	352.00	140,800	

中本パックス	300	1,461.00	438,300	
スノーピーク	900	812.00	730,800	
パラマウントベッドホールディングス	1,800	4,475.00	8,055,000	
トランザクション	1,000	981.00	981,000	
粧美堂	500	369.00	184,500	
ニホンフラッシュ	1,600	1,236.00	1,977,600	
前田工繊	1,900	2,050.00	3,895,000	
永大産業	1,700	277.00	470,900	
アートネイチャー	1,800	671.00	1,207,800	
バンダイナムコホールディングス	17,500	5,479.00	95,882,500	
アイフィスジャパン	500	690.00	345,000	
共立印刷	2,500	145.00	362,500	
ＳＨＯＥＩ	1,500	2,081.00	3,121,500	
フランスベッドホールディングス	2,400	884.00	2,121,600	
マーベラス	2,500	557.00	1,392,500	
パイロットコーポレーション	2,800	3,530.00	9,884,000	
萩原工業	1,000	1,289.00	1,289,000	
エイベックス	2,700	817.00	2,205,900	
トッパン・フォームズ	4,000	956.00	3,824,000	
フジシールインターナショナル	3,700	1,854.00	6,859,800	
タカラトミー	7,500	876.00	6,570,000	
廣済堂	1,300	780.00	1,014,000	
エステールホールディングス	300	598.00	179,400	
アーク	6,900	90.00	621,000	
レック	1,800	1,293.00	2,327,400	
タカノ	600	717.00	430,200	
三光合成	1,900	299.00	568,100	
プロネクサス	1,300	1,099.00	1,428,700	
ホクシン	1,600	114.00	182,400	
ウッドワン	500	1,042.00	521,000	
大建工業	1,000	1,595.00	1,595,000	
きもと	3,300	140.00	462,000	
凸版印刷	24,100	1,558.00	37,547,800	
大日本印刷	22,200	2,216.00	49,195,200	
共同印刷	500	2,800.00	1,400,000	
ＮＩＳＳＨＡ	3,600	797.00	2,869,200	
光村印刷	100	1,638.00	163,800	
藤森工業	1,500	3,220.00	4,830,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	700	1,842.00	1,289,400	
前澤化成工業	1,100	1,048.00	1,152,800	
未来工業	800	1,958.00	1,566,400	
アシックス	14,200	1,005.00	14,271,000	
ツツミ	600	1,624.00	974,400	
ウェーブロックホールディングス	500	721.00	360,500	
ＪＳＰ	1,000	1,374.00	1,374,000	
ニチハ	2,300	2,053.00	4,721,900	
エフピコ	1,900	8,170.00	15,523,000	
小松ウオール工業	500	1,840.00	920,000	
ヤマハ	10,100	4,385.00	44,288,500	
河合楽器製作所	500	3,025.00	1,512,500	

クリナップ	1,600	525.00	840,000	
ピジョン	10,300	4,040.00	41,612,000	
天馬	1,000	1,524.00	1,524,000	
オリバー	400	2,707.00	1,082,800	
兼松サステック	100	1,497.00	149,700	
キングジム	1,400	885.00	1,239,000	
象印マホービン	5,000	1,656.00	8,280,000	
リンテック	4,000	2,380.00	9,520,000	
信越ポリマー	3,400	850.00	2,890,000	
東リ	3,800	257.00	976,600	
イトーキ	3,500	330.00	1,155,000	
任天堂	10,400	44,300.00	460,720,000	
三菱鉛筆	2,700	1,370.00	3,699,000	
松風	800	1,587.00	1,269,600	
タカラスタンダード	3,500	1,588.00	5,558,000	
コクヨ	8,100	1,305.00	10,570,500	
ナカバヤシ	1,400	535.00	749,000	
ニフコ	6,200	2,043.00	12,666,600	
立川ブラインド工業	600	1,128.00	676,800	
グローブライド	700	1,979.00	1,385,300	
オカムラ	5,800	797.00	4,622,600	
バルカー	1,200	1,819.00	2,182,800	
ＭＵＴＯＨホールディングス	200	1,332.00	266,400	
伊藤忠商事	117,200	2,159.50	253,093,400	
丸紅	174,400	471.40	82,212,160	
スクロール	2,300	332.00	763,600	
高島	400	1,542.00	616,800	
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,679.00	2,686,400	
三陽商会	1,000	889.00	889,000	
長瀬産業	9,700	1,259.00	12,212,300	
ナイガイ	900	418.00	376,200	
蝶理	1,200	1,682.00	2,018,400	
豊田通商	18,700	2,532.00	47,348,400	
オンワードホールディングス	10,300	331.00	3,409,300	
三共生興	3,200	463.00	1,481,600	
兼松	6,400	1,142.00	7,308,800	
美津濃	1,500	1,819.00	2,728,500	
ツカモトコーポレーション	500	1,109.00	554,500	
ファミリーマート	13,400	1,826.00	24,468,400	
ルックホールディングス	500	790.00	395,000	
三井物産	147,400	1,590.50	234,439,700	
日本紙パルプ商事	1,000	3,615.00	3,615,000	
東京エレクトロン	10,800	22,490.00	242,892,000	
カメイ	2,200	1,050.00	2,310,000	
東都水産	300	2,921.00	876,300	
ＯＵＧホールディングス	400	2,690.00	1,076,000	
スターゼン	700	4,390.00	3,073,000	
セイコーホールディングス	2,400	1,767.00	4,240,800	
山善	6,700	917.00	6,143,900	
椿本興業	400	3,300.00	1,320,000	

住友商事	105,900	1,292.00	136,822,800	
日本ユニシス	5,200	3,125.00	16,250,000	
内田洋行	700	5,390.00	3,773,000	
三菱商事	117,400	2,341.50	274,892,100	
第一実業	900	3,645.00	3,280,500	
キヤノンマーケティングジャパン	4,400	2,136.00	9,398,400	
西華産業	1,100	1,133.00	1,246,300	
佐藤商事	1,400	867.00	1,213,800	
菱洋エレクトロ	1,900	2,484.00	4,719,600	
東京産業	2,000	492.00	984,000	
ユアサ商事	1,600	2,993.00	4,788,800	
神鋼商事	500	1,815.00	907,500	
トルク	1,500	278.00	417,000	
阪和興業	3,000	1,733.00	5,199,000	
正栄食品工業	1,100	3,915.00	4,306,500	
カナデン	1,700	1,227.00	2,085,900	
菱電商事	1,600	1,347.00	2,155,200	
ニプロ	11,700	1,198.00	14,016,600	
フルサト工業	1,000	1,370.00	1,370,000	
岩谷産業	3,900	3,730.00	14,547,000	
ナイス	1,100	806.00	886,600	
昭光通商	1,400	570.00	798,000	
極東貿易	500	1,406.00	703,000	
イワキ	2,800	440.00	1,232,000	
兼松エレクトロニクス	800	3,740.00	2,992,000	
三愛石油	4,400	1,139.00	5,011,600	
稲畑産業	3,800	1,187.00	4,510,600	
ＧＳＩクレオス	500	1,050.00	525,000	
明和産業	2,000	489.00	978,000	
クワザワ	1,100	498.00	547,800	
ゴールドウイン	3,000	5,670.00	17,010,000	
ユニ・チャーム	32,700	4,011.00	131,159,700	
デサント	3,200	1,360.00	4,352,000	
キング	700	489.00	342,300	
ワキタ	3,800	1,008.00	3,830,400	
ヤマトインターナショナル	1,300	348.00	452,400	
東邦ホールディングス	5,500	2,216.00	12,188,000	
サンゲツ	4,800	1,580.00	7,584,000	
ミツウロコグループホールディングス	2,900	1,151.00	3,337,900	
シナネンホールディングス	900	2,765.00	2,488,500	
伊藤忠エネクス	4,100	802.00	3,288,200	
サンリオ	4,800	1,636.00	7,852,800	
サンワ　テクノス	1,500	821.00	1,231,500	
リョーサン	2,000	2,362.00	4,724,000	
新光商事	2,900	869.00	2,520,100	
トーホー	900	1,780.00	1,602,000	
三信電気	1,000	1,530.00	1,530,000	
東陽テクニカ	2,200	1,021.00	2,246,200	
モスフードサービス	2,500	2,796.00	6,990,000	
加賀電子	1,700	1,974.00	3,355,800	

三益半導体工業	1,500	2,161.00	3,241,500	
ソーダニッカ	2,300	602.00	1,384,600	
立花エレテック	1,500	1,561.00	2,341,500	
木曽路	2,200	2,324.00	5,112,800	
ＳＲＳホールディングス	2,100	882.00	1,852,200	
千趣会	4,000	331.00	1,324,000	
タカキュー	1,700	130.00	221,000	
ケーヨー	3,300	590.00	1,947,000	
上新電機	1,900	2,057.00	3,908,300	
日本瓦斯	2,700	3,900.00	10,530,000	
ロイヤルホールディングス	2,900	1,812.00	5,254,800	
東天紅	200	868.00	173,600	
いなげや	2,100	1,590.00	3,339,000	
島忠	3,200	2,769.00	8,860,800	
チヨダ	1,500	1,044.00	1,566,000	
ライフコーポレーション	1,300	3,155.00	4,101,500	
リンガーハット	2,100	2,225.00	4,672,500	
ＭｒＭａｘＨＤ	1,900	432.00	820,800	
テンアライド	1,800	371.00	667,800	
ＡＯＫＩホールディングス	2,900	638.00	1,850,200	
オークワ	2,700	1,382.00	3,731,400	
コメリ	2,600	2,326.00	6,047,600	
青山商事	3,100	882.00	2,734,200	
しまむら	2,000	6,820.00	13,640,000	
はせがわ	700	408.00	285,600	
高島屋	12,400	953.00	11,817,200	
松屋	3,400	606.00	2,060,400	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	7,600	798.00	6,064,800	
近鉄百貨店	600	2,590.00	1,554,000	
丸井グループ	15,300	1,727.00	26,423,100	
クレディセゾン	11,800	1,189.00	14,030,200	
アクシアル　リテイリング	1,400	3,945.00	5,523,000	
イオン	64,200	2,175.00	139,635,000	
イズミ	3,300	3,195.00	10,543,500	
フォーバル	900	1,150.00	1,035,000	
平和堂	3,400	1,814.00	6,167,600	
フジ	2,000	1,713.00	3,426,000	
ヤオコー	1,900	6,720.00	12,768,000	
ゼビオホールディングス	2,100	900.00	1,890,000	
ケーズホールディングス	16,100	1,191.00	19,175,100	
ＰＡＬＴＡＣ	2,700	5,440.00	14,688,000	
三谷産業	3,100	430.00	1,333,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	800	641.00	512,800	
日産東京販売ホールディングス	2,300	217.00	499,100	
新生銀行	12,600	1,321.00	16,644,600	
あおぞら銀行	10,000	1,895.00	18,950,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,141,600	419.20	478,558,720	
りそなホールディングス	183,000	324.50	59,383,500	
三井住友トラスト・ホールディングス	31,600	3,061.00	96,727,600	
三井住友フィナンシャルグループ	115,300	2,763.50	318,631,550	

千葉銀行	56,100	491.00	27,545,100	
群馬銀行	32,700	333.00	10,889,100	
武蔵野銀行	2,300	1,324.00	3,045,200	
千葉興業銀行	5,700	233.00	1,328,100	
筑波銀行	7,800	166.00	1,294,800	
七十七銀行	5,900	1,385.00	8,171,500	
青森銀行	1,300	2,281.00	2,965,300	
秋田銀行	1,000	1,463.00	1,463,000	
山形銀行	1,800	1,282.00	2,307,600	
岩手銀行	1,100	2,529.00	2,781,900	
東邦銀行	15,100	238.00	3,593,800	
東北銀行	500	893.00	446,500	
みちのく銀行	1,100	1,077.00	1,184,700	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,900	1,574.00	21,878,600	
静岡銀行	41,800	646.00	27,002,800	
十六銀行	2,200	1,879.00	4,133,800	
スルガ銀行	17,700	369.00	6,531,300	
八十二銀行	40,900	363.00	14,846,700	
山梨中央銀行	1,600	798.00	1,276,800	
大垣共立銀行	3,400	2,206.00	7,500,400	
福井銀行	1,400	1,618.00	2,265,200	
北國銀行	1,800	3,075.00	5,535,000	
清水銀行	700	1,790.00	1,253,000	
富山銀行	200	2,167.00	433,400	
滋賀銀行	3,500	2,559.00	8,956,500	
南都銀行	2,900	2,233.00	6,475,700	
百五銀行	15,900	307.00	4,881,300	
京都銀行	6,100	3,655.00	22,295,500	
紀陽銀行	6,000	1,587.00	9,522,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,300	866.00	9,785,800	
広島銀行	24,200	442.00	10,696,400	
山陰合同銀行	9,700	548.00	5,315,600	
中国銀行	14,700	994.00	14,611,800	
鳥取銀行	500	1,130.00	565,000	
伊予銀行	24,500	585.00	14,332,500	
百十四銀行	1,800	1,938.00	3,488,400	
四国銀行	2,400	856.00	2,054,400	
阿波銀行	2,800	2,275.00	6,370,000	
大分銀行	800	2,132.00	1,705,600	
宮崎銀行	1,000	2,330.00	2,330,000	
佐賀銀行	600	1,119.00	671,400	
沖縄銀行	1,500	3,145.00	4,717,500	
琉球銀行	3,800	1,021.00	3,879,800	
セブン銀行	56,100	280.00	15,708,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,268,700	122.60	278,142,620	
高知銀行	500	720.00	360,000	
山口フィナンシャルグループ	20,900	570.00	11,913,000	
芙蓉総合リース	1,700	5,830.00	9,911,000	
みずほリース	2,500	2,069.00	5,172,500	
東京センチュリー	3,300	3,585.00	11,830,500	

ＳＢＩホールディングス	18,600	2,112.00	39,283,200	
日本証券金融	7,400	487.00	3,603,800	
アイフル	25,900	244.00	6,319,600	
長野銀行	300	1,108.00	332,400	
名古屋銀行	1,200	2,266.00	2,719,200	
北洋銀行	25,500	191.00	4,870,500	
愛知銀行	600	3,135.00	1,881,000	
中京銀行	700	2,109.00	1,476,300	
大光銀行	500	1,506.00	753,000	
愛媛銀行	2,300	1,106.00	2,543,800	
トマト銀行	600	993.00	595,800	
京葉銀行	7,200	517.00	3,722,400	
栃木銀行	9,200	157.00	1,444,400	
北日本銀行	600	1,934.00	1,160,400	
東和銀行	2,800	658.00	1,842,400	
福島銀行	3,100	166.00	514,600	
大東銀行	900	578.00	520,200	
リコーリース	1,300	2,963.00	3,851,900	
イオンフィナンシャルサービス	10,100	1,074.00	10,847,400	
アコム	33,900	435.00	14,746,500	
ジャックス	1,900	1,769.00	3,361,100	
オリエントコーポレーション	46,500	121.00	5,626,500	
日立キャピタル	3,900	2,060.00	8,034,000	
アプラスフィナンシャル	10,000	62.00	620,000	
オリックス	104,300	1,248.00	130,166,400	
三菱ＵＦＪリース	42,200	504.00	21,268,800	
ジャフコ	2,600	3,430.00	8,918,000	
九州リースサービス	400	445.00	178,000	
トモニホールディングス	12,900	346.00	4,463,400	
大和証券グループ本社	134,600	432.00	58,147,200	
野村ホールディングス	295,500	441.10	130,345,050	
岡三証券グループ	14,200	323.00	4,586,600	
丸三証券	5,200	412.00	2,142,400	
東洋証券	7,500	121.00	907,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,300	228.00	4,400,400	
光世証券	700	516.00	361,200	
水戸証券	5,100	191.00	974,100	
いちよし証券	2,400	456.00	1,094,400	
松井証券	9,600	759.00	7,286,400	
ＳＯＭＰＯホールディングス	31,300	3,244.00	101,537,200	
だいこう証券ビジネス	1,200	920.00	1,104,000	
日本取引所グループ	48,000	2,120.00	101,760,000	
マネックスグループ	12,500	219.00	2,737,500	
極東証券	2,100	508.00	1,066,800	
岩井コスモホールディングス	1,400	940.00	1,316,000	
藍澤證券	3,000	695.00	2,085,000	
フィデアホールディングス	14,700	106.00	1,558,200	
池田泉州ホールディングス	19,400	167.00	3,239,800	
アニコム　ホールディングス	1,400	3,915.00	5,481,000	

ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	43,600	2,963.00	129,186,800	
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,800	1,985.00	27,393,000	
マネーパートナーズグループ	1,900	199.00	378,100	
スパークス・グループ	7,800	190.00	1,482,000	
第一生命ホールディングス	94,700	1,296.50	122,778,550	
東京海上ホールディングス	59,000	4,447.00	262,373,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	800	763.00	610,400	
イー・ギャランティ	1,800	1,926.00	3,466,800	
アサックス	900	633.00	569,700	
ＮＥＣキャピタルソリューション	700	1,867.00	1,306,900	
Ｔ＆Ｄホールディングス	50,100	876.00	43,887,600	
アドバンスクリエイト	300	1,954.00	586,200	
三井不動産	83,200	1,896.00	157,747,200	
三菱地所	118,200	1,781.50	210,573,300	
平和不動産	3,200	2,929.00	9,372,800	
東京建物	18,000	1,205.00	21,690,000	
ダイビル	4,700	1,000.00	4,700,000	
京阪神ビルディング	3,000	1,425.00	4,275,000	
住友不動産	37,700	2,866.00	108,048,200	
太平洋興発	1,000	591.00	591,000	
テーオーシー	3,700	692.00	2,560,400	
東京楽天地	300	4,100.00	1,230,000	
スターツコーポレーション	2,300	2,059.00	4,735,700	
フジ住宅	1,500	513.00	769,500	
空港施設	1,800	425.00	765,000	
明和地所	800	436.00	348,800	
ゴールドクレスト	1,400	1,621.00	2,269,400	
リログループ	8,800	2,268.00	19,958,400	
エスリード	700	1,350.00	945,000	
日神グループホールディングス	2,500	394.00	985,000	
日本エスコン	3,000	729.00	2,187,000	
タカラレーベン	7,900	355.00	2,804,500	
ＡＶＡＮＴＩＡ	800	696.00	556,800	
イオンモール	8,600	1,425.00	12,255,000	
毎日コムネット	600	799.00	479,400	
ファースト住建	700	927.00	648,900	
カチタス	4,200	2,003.00	8,412,600	
東祥	900	1,052.00	946,800	
トーセイ	2,400	1,018.00	2,443,200	
穴吹興産	400	1,530.00	612,000	
サンフロンティア不動産	2,300	854.00	1,964,200	
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	789.00	1,183,500	
インテリックス	500	527.00	263,500	
ランドビジネス	600	293.00	175,800	
日本社宅サービス	600	1,038.00	622,800	
グランディハウス	900	342.00	307,800	
東武鉄道	17,800	3,570.00	63,546,000	
相鉄ホールディングス	5,400	2,759.00	14,898,600	

東急	42,800	1,600.00	68,480,000	
京浜急行電鉄	21,800	1,735.00	37,823,000	
小田急電鉄	25,300	2,331.00	58,974,300	
京王電鉄	8,800	5,610.00	49,368,000	
京成電鉄	11,900	2,993.00	35,616,700	
富士急行	2,300	3,040.00	6,992,000	
新京成電鉄	500	2,096.00	1,048,000	
東日本旅客鉄道	29,800	7,811.00	232,767,800	
西日本旅客鉄道	15,100	6,274.00	94,737,400	
東海旅客鉄道	14,100	17,105.00	241,180,500	
西武ホールディングス	22,700	1,261.00	28,624,700	
鴻池運輸	2,500	1,146.00	2,865,000	
西日本鉄道	4,800	2,590.00	12,432,000	
ハマキョウレックス	1,300	3,030.00	3,939,000	
サカイ引越センター	900	5,430.00	4,887,000	
近鉄グループホールディングス	16,100	5,130.00	82,593,000	
阪急阪神ホールディングス	21,400	3,755.00	80,357,000	
南海電気鉄道	7,600	2,404.00	18,270,400	
京阪ホールディングス	7,200	4,780.00	34,416,000	
神戸電鉄	400	3,770.00	1,508,000	
名古屋鉄道	13,300	3,080.00	40,964,000	
山陽電気鉄道	1,100	2,130.00	2,343,000	
トランコム	500	6,820.00	3,410,000	
日本通運	5,600	5,090.00	28,504,000	
ヤマトホールディングス	28,200	1,912.00	53,918,400	
山九	4,400	4,025.00	17,710,000	
日新	1,300	1,606.00	2,087,800	
丸運	800	224.00	179,200	
丸全昭和運輸	1,200	2,450.00	2,940,000	
センコーグループホールディングス	8,800	870.00	7,656,000	
トナミホールディングス	400	4,960.00	1,984,000	
ニッコンホールディングス	5,600	2,049.00	11,474,400	
日本石油輸送	200	3,000.00	600,000	
福山通運	2,100	3,700.00	7,770,000	
セイノーホールディングス	12,100	1,286.00	15,560,600	
エスライン	400	994.00	397,600	
神奈川中央交通	400	4,050.00	1,620,000	
日立物流	3,000	2,599.00	7,797,000	
丸和運輸機関	1,700	3,280.00	5,576,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,500	1,347.00	2,020,500	
日本郵船	14,000	1,370.00	19,180,000	
商船三井	10,200	1,795.00	18,309,000	
川崎汽船	5,300	1,023.00	5,421,900	
ＮＳユナイテッド海運	700	1,459.00	1,021,300	
飯野海運	7,100	317.00	2,250,700	
共栄タンカー	300	882.00	264,600	
九州旅客鉄道	14,100	2,873.00	40,509,300	
ＳＧホールディングス	16,800	3,030.00	50,904,000	
日本航空	28,100	1,792.00	50,355,200	
ＡＮＡホールディングス	29,300	2,186.00	64,049,800	

パスコ	500	1,504.00	752,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	400	1,962.00	784,800	
シルバーライフ	300	2,066.00	619,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	1,936.00	774,400	
一家ダイニングプロジェクト	200	599.00	119,800	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	800	2,482.00	1,985,600	
国際紙パルプ商事	4,400	317.00	1,394,800	
ナルミヤ・インターナショナル	100	590.00	59,000	
ブックオフグループホールディングス	1,100	791.00	870,100	
三菱倉庫	5,300	2,380.00	12,614,000	
三井倉庫ホールディングス	1,800	1,450.00	2,610,000	
住友倉庫	5,700	1,241.00	7,073,700	
澁澤倉庫	800	2,226.00	1,780,800	
ヤマタネ	1,000	1,205.00	1,205,000	
東陽倉庫	2,500	314.00	785,000	
乾汽船	1,000	1,213.00	1,213,000	
日本トランスシティ	3,200	480.00	1,536,000	
ケイヒン	100	1,272.00	127,200	
中央倉庫	900	1,066.00	959,400	
川西倉庫	300	1,010.00	303,000	
安田倉庫	1,400	865.00	1,211,000	
ファイズホールディングス	400	1,135.00	454,000	
東洋埠頭	400	1,306.00	522,400	
宇徳	1,300	455.00	591,500	
上組	9,100	1,916.00	17,435,600	
キムラユニティー	400	998.00	399,200	
キユーソー流通システム	400	1,706.00	682,400	
近鉄エクスプレス	3,500	1,525.00	5,337,500	
東海運	1,800	252.00	453,600	
エーアイテイー	900	739.00	665,100	
内外トランスライン	500	1,104.00	552,000	
ショーエイコーポレーション	200	734.00	146,800	
日本コンセプト	600	1,446.00	867,600	
東京放送ホールディングス	10,100	1,664.00	16,806,400	
日本テレビホールディングス	13,800	1,188.00	16,394,400	
朝日放送グループホールディングス	1,400	704.00	985,600	
テレビ朝日ホールディングス	4,600	1,610.00	7,406,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	10,800	410.00	4,428,000	
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,450.00	3,185,000	
日本ＢＳ放送	600	1,029.00	617,400	
ビジョン	1,500	789.00	1,183,500	
スマートバリュー	500	833.00	416,500	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	800	1,438.00	1,150,400	
コネクシオ	900	1,542.00	1,387,800	
クロップス	100	642.00	64,200	
日本電信電話	222,000	2,447.50	543,345,000	
ＫＤＤＩ	124,000	3,175.00	393,700,000	
ソフトバンク	151,100	1,455.50	219,926,050	

光通信	1,700	22,180.00	37,706,000	
ＮＴＴドコモ	123,000	3,135.00	385,605,000	
エムティーアイ	1,600	581.00	929,600	
GMOインターネット	6,600	2,363.00	15,595,800	
ファイバーゲート	600	1,355.00	813,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	600	439.00	263,400	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	4,600	1,649.00	7,585,400	
学研ホールディングス	2,300	1,716.00	3,946,800	
ゼンリン	3,200	1,245.00	3,984,000	
昭文社ホールディングス	1,100	387.00	425,700	
インプレスホールディングス	1,700	160.00	272,000	
東京電力ホールディングス	135,400	359.00	48,608,600	
中部電力	51,800	1,454.00	75,317,200	
関西電力	64,000	1,053.50	67,424,000	
中国電力	24,600	1,456.00	35,817,600	
北陸電力	15,900	710.00	11,289,000	
東北電力	42,000	1,024.00	43,008,000	
四国電力	15,100	799.00	12,064,900	
九州電力	34,700	868.00	30,119,600	
北海道電力	16,100	413.00	6,649,300	
沖縄電力	3,200	2,026.00	6,483,200	
電源開発	13,400	1,977.00	26,491,800	
エフオン	900	517.00	465,300	
イーレックス	2,400	1,568.00	3,763,200	
レノバ	2,900	903.00	2,618,700	
東京瓦斯	32,700	2,491.50	81,472,050	
大阪瓦斯	33,000	2,061.00	68,013,000	
東邦瓦斯	8,300	5,670.00	47,061,000	
北海道瓦斯	800	1,575.00	1,260,000	
広島ガス	3,100	355.00	1,100,500	
西部瓦斯	1,800	2,718.00	4,892,400	
静岡ガス	4,800	957.00	4,593,600	
メタウォーター	900	4,335.00	3,901,500	
アイネット	700	1,570.00	1,099,000	
松竹	1,100	12,340.00	13,574,000	
東宝	9,800	3,565.00	34,937,000	
エイチ・アイ・エス	2,500	1,477.00	3,692,500	
東映	600	13,880.00	8,328,000	
ラックランド	400	1,919.00	767,600	
エヌ・ティ・ティ・データ	44,400	1,131.00	50,216,400	
共立メンテナンス	2,600	2,878.00	7,482,800	
イチネンホールディングス	1,800	1,145.00	2,061,000	
建設技術研究所	1,200	1,751.00	2,101,200	
スペース	800	998.00	798,400	
長　大	700	856.00	599,200	
アインホールディングス	2,100	6,160.00	12,936,000	
燦ホールディングス	600	1,271.00	762,600	
ピー・シー・エー	300	3,740.00	1,122,000	
スバル興業	100	7,850.00	785,000	

東京テアトル	700	1,192.00	834,400	
タナベ経営	200	1,220.00	244,000	
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,772.00	831,600	
ナガワ	500	7,530.00	3,765,000	
よみうりランド	400	3,340.00	1,336,000	
東京都競馬	1,100	3,715.00	4,086,500	
常磐興産	600	1,344.00	806,400	
カナモト	2,700	2,141.00	5,780,700	
東京ドーム	6,600	803.00	5,299,800	
ＤＴＳ	3,700	2,153.00	7,966,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,100	4,545.00	32,269,500	
シーイーシー	1,700	1,670.00	2,839,000	
カプコン	7,900	3,385.00	26,741,500	
西尾レントオール	1,500	2,261.00	3,391,500	
アイ・エス・ビー	300	1,670.00	501,000	
日本空港ビルデング	5,400	3,945.00	21,303,000	
トランス・コスモス	1,600	2,182.00	3,491,200	
乃村工藝社	6,700	836.00	5,601,200	
ジャステック	900	1,158.00	1,042,200	
ＳＣＳＫ	3,800	4,930.00	18,734,000	
藤田観光	700	1,793.00	1,255,100	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	1,100	939.00	1,032,900	
日本管財	1,700	1,848.00	3,141,600	
トーカイ	1,600	2,816.00	4,505,600	
白洋舎	100	2,755.00	275,500	
セコム	17,200	9,029.00	155,298,800	
日本システムウエア	500	2,129.00	1,064,500	
セントラル警備保障	800	4,330.00	3,464,000	
アイネス	1,700	1,485.00	2,524,500	
丹青社	2,900	694.00	2,012,600	
メイテック	2,000	4,730.00	9,460,000	
ＴＫＣ	1,400	5,120.00	7,168,000	
富士ソフト	2,100	3,900.00	8,190,000	
応用地質	1,800	1,287.00	2,316,600	
船井総研ホールディングス	3,300	2,345.00	7,738,500	
ＮＳＤ	5,400	1,593.00	8,602,200	
進学会ホールディングス	600	528.00	316,800	
丸紅建材リース	200	1,423.00	284,600	
オオバ	1,200	645.00	774,000	
コナミホールディングス	6,000	3,435.00	20,610,000	
いであ	500	1,561.00	780,500	
学究社	300	1,103.00	330,900	
ベネッセホールディングス	5,500	3,110.00	17,105,000	
イオンディライト	2,000	3,125.00	6,250,000	
ナック	800	872.00	697,600	
福井コンピュータホールディングス	700	2,891.00	2,023,700	
ニチイ学館	2,300	1,155.00	2,656,500	
ダイセキ	2,800	2,455.00	6,874,000	
ステップ	500	1,396.00	698,000	

日鉄物産	1,200	3,305.00	3,966,000	
泉州電業	600	2,510.00	1,506,000	
元気寿司	400	2,414.00	965,600	
トラスコ中山	3,700	2,365.00	8,750,500	
ヤマダ電機	50,900	520.00	26,468,000	
オートバックスセブン	6,500	1,303.00	8,469,500	
モリト	1,700	674.00	1,145,800	
アークランドサカモト	2,400	1,067.00	2,560,800	
ニトリホールディングス	7,200	16,795.00	120,924,000	
グルメ杵屋	1,100	928.00	1,020,800	
愛眼	1,300	210.00	273,000	
ケーユーホールディングス	500	772.00	386,000	
吉野家ホールディングス	5,600	2,276.00	12,745,600	
加藤産業	2,500	3,645.00	9,112,500	
北恵	700	856.00	599,200	
イノテック	1,000	927.00	927,000	
イエローハット	3,300	1,491.00	4,920,300	
松屋フーズホールディングス	800	3,810.00	3,048,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,100	2,028.00	2,230,800	
ＪＫホールディングス	1,800	728.00	1,310,400	
サガミホールディングス	2,300	1,279.00	2,941,700	
日伝	1,800	2,049.00	3,688,200	
関西スーパーマーケット	1,300	1,062.00	1,380,600	
ミロク情報サービス	1,400	2,681.00	3,753,400	
北沢産業	2,100	272.00	571,200	
杉本商事	1,000	1,766.00	1,766,000	
因幡電機産業	5,000	2,284.00	11,420,000	
王将フードサービス	1,200	5,800.00	6,960,000	
プレナス	1,900	1,814.00	3,446,600	
ミニストップ	1,400	1,496.00	2,094,400	
アークス	3,400	2,035.00	6,919,000	
バローホールディングス	3,600	2,009.00	7,232,400	
東テク	600	2,090.00	1,254,000	
ミスミグループ本社	21,100	2,630.00	55,493,000	
藤久	400	807.00	322,800	
アルテック	2,200	206.00	453,200	
ベルク	800	6,070.00	4,856,000	
大　庄	800	1,217.00	973,600	
タキヒヨー	800	1,676.00	1,340,800	
ファーストリテイリング	2,200	51,930.00	114,246,000	
ソフトバンクグループ	132,000	4,668.00	616,176,000	
蔵王産業	600	1,427.00	856,200	
スズケン	7,100	4,095.00	29,074,500	
サンドラッグ	6,300	3,640.00	22,932,000	
サックスバー　ホールディングス	1,100	531.00	584,100	
ジェコス	1,300	879.00	1,142,700	
ヤマザワ	400	1,710.00	684,000	
やまや	300	2,237.00	671,100	
グローセル	2,500	426.00	1,065,000	
ベルーナ	3,300	502.00	1,656,600	

合計	19,885,400		34,792,997,840	

（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。

ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和2年5月8日現在
資産の部	
流動資産	
預金	534,126,187
コール・ローン	34,705,774
株式	27,594,088,808
投資信託受益証券	49,067,276
投資証券	673,690,177
派生商品評価勘定	69,348,577
未収入金	145,313
未収配当金	34,165,965
差入委託証拠金	621,511,748
流動資産合計	29,610,849,825
資産合計	29,610,849,825
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,402,016
未払解約金	13,942,000
流動負債合計	15,344,016
負債合計	15,344,016
純資産の部	
元本等	
元本	16,518,425,621
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	13,077,080,188
元本等合計	29,595,505,809
純資産合計	29,595,505,809
負債純資産合計	29,610,849,825

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年5月9日 至　令和2年5月8日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		令和2年5月8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	15,015,808,427円
	同期中追加設定元本額	10,856,834,110円
	同期中一部解約元本額	9,354,216,916円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	3,047,212円
	コア資産形成ファンド	2,719,976円
	ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	12,236,937,691円
	ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	303,995,231円
	ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	21,213,198円
	ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	557,620,659円
	ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,392,891,654円
	計	16,518,425,621円
２．	受益権の総数	16,518,425,621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　令和1年5月9日 至　令和2年5月8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。リスク管理に関する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	令和2年5月8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	令和2年5月8日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△1,357,008,252
投資信託受益証券	△14,989,824
投資証券	△116,139,552
合計	△1,488,137,628

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	令和2年5月8日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 　先物取引 　　買建	1,178,930,202	－	1,246,876,763	67,946,561
合計	1,178,930,202	－	1,246,876,763	67,946,561

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

す。

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年5月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7917円 (17,917円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和2年5月8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	3,184	2,367.610	7,538,470.240	
	ABBOTT LABORATORIES	13,391	93.990	1,258,620.090	
	AES CORP	5,297	12.120	64,199.640	
	ABIOMED INC	284	188.330	53,485.720	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	6,698	121.230	811,998.540	
	ADVANCED MICRO DEVICES	8,022	51.950	416,742.900	
	ADOBE INC	3,665	366.780	1,344,248.700	
	CHUBB LTD	3,423	98.990	338,842.770	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,673	226.800	379,436.400	
	ALLEGHANY CORP	124	511.070	63,372.680	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	510	123.610	63,041.100	
	RALPH LAUREN CORP	287	70.230	20,156.010	
	ALLSTATE CORP	2,453	100.850	247,385.050	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	5,410	132.790	718,393.900	
	AMGEN INC	4,493	233.330	1,048,351.690	
	HESS CORP	2,005	46.400	93,032.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	5,276	86.730	457,587.480	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	3,852	78.600	302,767.200	
	AFLAC INC	5,574	35.870	199,939.380	
	AMERICAN INTL GROUP	6,011	25.520	153,400.720	
	AMERCO	51	283.680	14,467.680	
	ANALOG DEVICES	2,864	106.350	304,586.400	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,701	96.920	164,860.920	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	5,780	28.520	164,845.600	
	JONES LANG LASALLE INC	406	102.950	41,797.700	
	VALERO ENERGY CORP	2,780	61.260	170,302.800	

APACHE CORP	2,701	11.880	32,087.880	
ANSYS INC	650	260.760	169,494.000	
APPLE INC	33,577	303.740	10,198,677.980	
APPLIED MATERIALS INC	7,050	51.250	361,312.500	
ALBEMARLE CORP	720	59.740	43,012.800	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	4,096	34.760	142,376.960	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	733	71.760	52,600.080	
AMEREN CORP	2,050	69.650	142,782.500	
ARROW ELECTRONICS INC	524	62.140	32,561.360	
AUTOLIV INC	615	57.970	35,651.550	
AUTODESK INC	1,675	184.000	308,200.000	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	3,281	147.770	484,833.370	
AUTOZONE INC	167	1,012.160	169,030.720	
AVERY DENNISON CORP	658	104.320	68,642.560	
BALL CORP	2,367	65.890	155,961.630	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	9,930	173.480	1,722,656.400	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	6,329	34.850	220,565.650	
BAXTER INTERNATIONAL INC	3,724	88.440	329,350.560	
BECTON DICKINSON & CO	2,059	256.250	527,618.750	
AMETEK INC	1,606	83.310	133,795.860	
VERIZON COMM INC	31,300	55.580	1,739,654.000	
WR BERKLEY CORP	1,198	51.130	61,253.740	
BEST BUY CO INC	1,690	76.250	128,862.500	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	159	460.420	73,206.780	
YUM! BRANDS INC	2,242	84.600	189,673.200	
FIRSTENERGY CORP	3,965	40.210	159,432.650	
BOEING CO	4,048	128.650	520,775.200	
ROBERT HALF INTL INC	1,054	45.160	47,598.640	
BORGWARNER INC	1,582	27.840	44,042.880	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	10,628	37.000	393,236.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	931	71.950	66,985.450	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	780	128.780	100,448.400	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	181	732.740	132,625.940	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	17,719	61.040	1,081,567.760	
INGREDION INC	418	80.910	33,820.380	
ONEOK INC	3,360	29.750	99,960.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	644	62.280	40,108.320	
UNITED RENTALS INC	657	112.730	74,063.610	
SEMPRA ENERGY	2,146	123.730	265,524.580	

FEDEX CORP	1,887	116.740	220,288.380	
VERISIGN INC	826	211.780	174,930.280	
AMPHENOL CORP	2,328	87.240	203,094.720	
BROWN-FORMAN CORP	2,322	64.650	150,117.300	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	9,708	5.520	53,588.160	
CSX CORP	5,591	63.920	357,376.720	
CABOT OIL & GAS CORP	3,192	19.980	63,776.160	
CAMPBELL SOUP CO	1,072	50.240	53,857.280	
SEAGATE TECHNOLOGY	1,896	48.720	92,373.120	
CONSTELLATION BRANDS INC	1,273	164.770	209,752.210	
CARDINAL HEALTH INC	2,159	48.520	104,754.680	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	3,008	13.530	40,698.240	
CATERPILLAR INC	4,188	107.290	449,330.520	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	865	107.210	92,736.650	
CITRIX SYSTEMS INC	919	150.680	138,474.920	
CENTURYLINK INC	7,253	9.520	69,048.560	
CERNER CORP	2,448	66.990	163,991.520	
JPMORGAN CHASE & CO	23,655	91.210	2,157,572.550	
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,848	72.380	133,758.240	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,240	55.010	68,212.400	
CINTAS CORP	654	213.400	139,563.600	
CISCO SYSTEMS INC	32,153	41.370	1,330,169.610	
CLOROX COMPANY	945	201.990	190,880.550	
COCA-COLA CO/THE	30,773	44.600	1,372,475.800	
COPART INC	1,690	81.550	137,819.500	
COGNEX CORP	1,331	55.700	74,136.700	
COLGATE-PALMOLIVE CO	6,193	68.800	426,078.400	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	2,165	85.980	186,146.700	
COMERICA INC	1,171	32.370	37,905.270	
NRG ENERGY, INC.	1,989	32.120	63,886.680	
COMCAST CORP-CL A	34,399	35.580	1,223,916.420	
CONAGRA BRANDS INC	3,611	33.170	119,776.870	
CONSOLIDATED EDISON INC	2,479	74.070	183,619.530	
CMS ENERGY CORP	2,385	54.540	130,077.900	
COOPER COS INC	403	303.900	122,471.700	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	1,130	37.600	42,488.000	
CORNING INC	5,334	20.950	111,747.300	
SEALED AIR CORP	1,552	28.530	44,278.560	
HEICO CORP-CL A	523	67.450	35,276.350	
CUMMINS INC	1,057	155.720	164,596.040	
DR HORTON INC	2,577	47.160	121,531.320	
DANAHER CORP	4,727	163.480	772,769.960	
MOODY'S CORP	1,280	247.690	317,043.200	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	4,165	58.760	244,735.400	

TARGET CORP	3,851	113.360	436,549.360	
DEERE & CO	2,272	136.000	308,992.000	
MORGAN STANLEY	9,142	38.810	354,801.020	
REPUBLIC SERVICES INC	1,832	81.210	148,776.720	
COSTAR GROUP INC	283	638.990	180,834.170	
THE WALT DISNEY CO	13,647	105.570	1,440,713.790	
DOLLAR TREE INC	1,842	76.690	141,262.980	
DOVER CORP	1,027	91.070	93,528.890	
OMNICOM GROUP	1,693	53.630	90,795.590	
DTE ENERGY CO	1,410	98.720	139,195.200	
DUKE ENERGY CORP	5,363	80.310	430,702.530	
FLOWSERVE CORP	1,374	27.430	37,688.820	
DARDEN RESTAURANTS INC	888	70.530	62,630.640	
EBAY INC	5,751	41.370	237,918.870	
BANK OF AMERICA CORP	64,426	22.840	1,471,489.840	
CITIGROUP INC	16,403	44.640	732,229.920	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,087	60.470	65,730.890	
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,929	39.970	77,102.130	
EATON CORP PLC	3,090	80.260	248,003.400	
EATON VANCE CORP	642	35.980	23,099.160	
CADENCE DESIGN SYS INC	2,176	81.370	177,061.120	
DISH NETWORK CORP	1,771	23.350	41,352.850	
ECOLAB INC	1,964	194.120	381,251.680	
PERKINELMER INC	852	92.760	79,031.520	
ELECTRONIC ARTS INC	2,066	116.800	241,308.800	
SALESFORCE.COM INC	6,298	169.900	1,070,030.200	
ERIE INDEMNITY CO	188	184.660	34,716.080	
EMERSON ELECTRIC CO	4,483	55.260	247,730.580	
ATMOS ENERGY CORP	894	96.380	86,163.720	
ENTERGY CORP	1,440	92.770	133,588.800	
EOG RESOURCES INC	4,344	48.310	209,858.640	
EQUIFAX INC	888	148.310	131,699.280	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	1,576	171.940	270,977.440	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	1,328	74.380	98,776.640	
EXXON MOBIL CORP	31,865	44.240	1,409,707.600	
FMC CORP	1,069	94.110	100,603.590	
NEXTERA ENERGY INC	3,692	224.480	828,780.160	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	269	275.740	74,174.060	
ASSURANT INC	511	98.590	50,379.490	
FASTENAL CO	4,471	38.180	170,702.780	
FIFTH THIRD BANCORP	5,488	17.330	95,107.040	
M&T BANK CORP	922	101.620	93,693.640	
FISERV INC	4,379	107.320	469,954.280	
FLIR SYSTEMS INC	847	47.900	40,571.300	
FORD MOTOR CO	30,627	4.870	149,153.490	
FRANKLIN RESOURCES INC	2,358	18.140	42,774.120	
FREEPORT-MCMORAN INC	12,130	8.970	108,806.100	
FLEX LTD	3,809	9.300	35,423.700	

ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,348	85.380	115,092.240	
GAP INC/THE	2,672	7.420	19,826.240	
DENTSPLY SIRONA INC	1,836	41.060	75,386.160	
GENERAL DYNAMICS CORP	1,892	127.130	240,529.960	
GENERAL MILLS INC	4,545	58.770	267,109.650	
GENUINE PARTS CO	985	73.720	72,614.200	
GILEAD SCIENCES INC	9,583	77.610	743,736.630	
GARTNER INC	749	123.810	92,733.690	
MCKESSON CORP	1,118	134.580	150,460.440	
NVIDIA CORP	4,396	304.870	1,340,208.520	
GENERAL ELECTRIC CO	66,112	6.110	403,944.320	
WW GRAINGER INC	346	281.110	97,264.060	
HALLIBURTON CO	6,266	10.010	62,722.660	
MONSTER BEVERAGE CORP	2,818	62.090	174,969.620	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,404	182.320	438,297.280	
HARLEY-DAVIDSON INC	542	20.440	11,078.480	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	1,685	182.490	307,495.650	
HASBRO INC	1,010	68.380	69,063.800	
HENRY SCHEIN INC	1,138	53.890	61,326.820	
HEICO CORP	256	85.070	21,777.920	
HERSHEY FOODS CORP	1,170	130.530	152,720.100	
HP INC	10,429	14.950	155,913.550	
F5 NETWORKS INC	501	142.710	71,497.710	
CROWN HOLDINGS INC NPR	1,053	62.460	65,770.380	
JUNIPER NETWORKS INC	2,624	23.120	60,666.880	
HOLLYFRONTIER CORP	1,221	28.310	34,566.510	
HOLOGIC INC	2,199	52.940	116,415.060	
UNUM GROUP	1,707	14.760	25,195.320	
HOME DEPOT INC	8,252	229.450	1,893,421.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,328	92.000	122,176.000	
HORMEL FOODS CORP	2,097	46.590	97,699.230	
CENTERPOINT ENERGY INC	3,593	17.810	63,991.330	
LENNOX INTERNATIONAL INC	290	192.630	55,862.700	
HUMANA INC	1,003	371.420	372,534.260	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	681	100.100	68,168.100	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,607	8.250	71,007.750	
BIOGEN INC	1,367	314.010	429,251.670	
IDEX CORP	608	153.400	93,267.200	
ILLINOIS TOOL WORKS	2,462	156.950	386,410.900	
INTUIT INC	1,971	280.800	553,456.800	
IDEXX LABORATORIES INC	595	294.260	175,084.700	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	853	53.260	45,430.780	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	1,654	81.030	134,023.620	
INTEL CORP	32,910	59.170	1,947,284.700	

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	731	130.280	95,234.680	
INTERNATIONAL PAPER CO	2,761	32.600	90,008.600	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,246	16.270	52,812.420	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	953	78.550	74,858.150	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	611	183.810	112,307.910	
INCYTE CORP	1,352	96.470	130,427.440	
JOHNSON & JOHNSON	19,904	147.590	2,937,631.360	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	2,877	34.910	100,436.070	
KLA CORPORATION	1,108	163.840	181,534.720	
DEVON ENERGY CORP	2,368	12.010	28,439.680	
KELLOGG CO	1,829	62.690	114,660.010	
EAST WEST BANCORP INC	1,210	32.940	39,857.400	
KEYCORP	6,959	10.760	74,878.840	
KIMBERLY-CLARK CORP	2,617	136.700	357,743.900	
BLACKROCK INC/NEW YORK	869	497.390	432,231.910	
KOHLS CORP	1,291	17.900	23,108.900	
KROGER CO	6,239	32.680	203,890.520	
LAM RESEARCH CORP	1,109	247.630	274,621.670	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	277	320.240	88,706.480	
PACKAGING CORP OF AMERICA	825	93.790	77,376.750	
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,331	100.600	133,898.600	
LEGGETT & PLATT INC	967	26.870	25,983.290	
LENNAR CORP	2,048	50.840	104,120.320	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	1,774	13.400	23,771.600	
ELI LILLY & CO	6,542	152.970	1,000,729.740	
LINCOLN NATIONAL CORP	1,571	34.770	54,623.670	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	5,309	92.830	492,834.470	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,321	78.500	182,198.500	
LOCKHEED MARTIN CORP	1,923	376.540	724,086.420	
LOEWS CORP	1,820	30.340	55,218.800	
LOWE'S COS INC	5,821	111.920	651,486.320	
DOMINION ENERGY INC	6,277	78.100	490,233.700	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	3,752	14.930	56,017.360	
MCCORMICK & CO INC	920	160.860	147,991.200	
MCDONALD'S CORPORATION	5,706	181.120	1,033,470.720	
S&P GLOBAL INC	1,845	295.580	545,345.100	
EVEREST RE GROUP LTD	321	173.830	55,799.430	
MANPOWERGROUP INC	381	68.390	26,056.590	
MARKEL CORPORATION	102	836.010	85,273.020	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	1,589	218.040	346,465.560	
MARSH & MCLENNAN COS	3,836	101.650	389,929.400	
MASCO CORP	1,997	41.550	82,975.350	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	450	179.690	80,860.500	
METLIFE INC	5,891	34.440	202,886.040	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	1,892	52.850	99,992.200	
MEDTRONIC PLC	10,138	98.940	1,003,053.720	
ACTIVISION BLIZZARD INC	5,829	73.100	426,099.900	
CVS HEALTH CORP	9,857	61.450	605,712.650	
MERCK & CO.INC.	19,265	75.600	1,456,434.000	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	2,418	15.980	38,639.640	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	716	160.180	114,688.880	
MICROSOFT CORP	54,752	183.600	10,052,467.200	
MICRON TECH INC	8,431	46.590	392,800.290	
MIDDLEBY CORP	557	59.230	32,991.110	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,776	85.500	151,848.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	4,576	26.440	120,989.440	
3M CO	4,368	145.740	636,592.320	
MOHAWK INDUSTRIES INC	527	80.370	42,354.990	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,325	136.210	180,478.250	
KANSAS CITY SOUTHERN	769	131.330	100,992.770	
MYLAN NV	3,791	17.320	65,660.120	
ILLUMINA INC	1,113	313.360	348,769.680	
XCEL ENERGY INC	3,949	59.960	236,782.040	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	696	108.940	75,822.240	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	2,930	12.350	36,185.500	
NETAPP INC	1,980	43.010	85,159.800	
NEWELL BRANDS INC	2,782	12.040	33,495.280	
NEWMONT CORP	5,934	64.560	383,099.040	
NVR INC	27	3,000.000	81,000.000	
NIKE INC-CL B	9,425	88.560	834,678.000	
NOBLE ENERGY INC	4,625	8.860	40,977.500	
NORDSTROM INC	689	17.290	11,912.810	
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,974	169.580	334,750.920	
EVERSOURCE ENERGY	2,425	77.640	188,277.000	
NISOURCE INC	3,280	22.900	75,112.000	
TAPESTRY INC	2,454	14.500	35,583.000	
NORTHERN TRUST CORP	1,626	73.940	120,226.440	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,190	324.140	385,726.600	
WELLS FARGO & CO	30,335	25.230	765,352.050	
NUCOR CORP	1,899	40.910	77,688.090	

CHENIERE ENERGY INC	1,512	43.210	65,333.520	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	3,514	60.820	213,721.480	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	6,810	13.880	94,522.800	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	765	149.710	114,528.150	
OGE ENERGY CORP	1,738	29.290	50,906.020	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	586	386.450	226,459.700	
ORACLE CORP	17,398	52.600	915,134.800	
PACCAR INC	2,505	68.610	171,868.050	
PTC INC	926	70.860	65,616.360	
EXELON CORP	7,472	35.040	261,818.880	
PARKER HANNIFIN CORP	927	155.990	144,602.730	
PAYCHEX INC	2,349	68.070	159,896.430	
ALIGN TECHNOLOGY INC	512	213.500	109,312.000	
PPL CORPORATION	5,616	24.290	136,412.640	
PEPSICO INC	10,562	131.550	1,389,431.100	
PENTAIR PLC	1,079	34.230	36,934.170	
PFIZER INC	41,863	36.960	1,547,256.480	
ESSENTIAL UTILITIES INC	1,600	40.530	64,848.000	
CONOCOPHILLIPS	8,128	42.420	344,789.760	
PVH CORP	445	42.940	19,108.300	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,287	87.020	111,994.740	
ALTRIA GROUP INC	14,202	35.100	498,490.200	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	3,294	101.290	333,649.260	
BROWN & BROWN INC	1,607	37.130	59,667.910	
POLARIS INC	250	68.240	17,060.000	
GARMIN LTD	1,077	78.040	84,049.080	
PPG INDUSTRIES INC	1,691	90.360	152,798.760	
IPG PHOTONICS CORP	233	147.390	34,341.870	
COSTCO WHOLESALE CORP	3,349	305.000	1,021,445.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	1,798	111.340	200,189.320	
QUEST DIAGNOSTICS	991	107.360	106,393.760	
PROCTER & GAMBLE CO	18,844	112.170	2,113,731.480	
PROGRESSIVE CORP	4,446	74.930	333,138.780	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	3,895	47.820	186,258.900	
PULTE GROUP INC	2,043	28.180	57,571.740	
GLOBAL PAYMENTS INC	2,279	174.760	398,278.040	
QUALCOMM INC	8,662	78.830	682,825.460	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	890	64.430	57,342.700	
EXACT SCIENCES CORP	1,217	82.850	100,828.450	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	343	149.640	51,326.520	

REGENERON PHARMACEUTICALS	615	559.830	344,295.450	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	504	92.080	46,408.320	
RESMED INC	1,049	160.700	168,574.300	
US BANCORP	11,279	34.200	385,741.800	
SEATTLE GENETICS INC /WA	864	163.260	141,056.640	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,135	24.710	77,465.850	
ROSS STORES INC	2,697	89.850	242,325.450	
ROLLINS INC	1,139	41.710	47,507.690	
ROPER TECHNOLOGIES INC	784	356.190	279,252.960	
ROCKWELL AUTOMATION INC	835	191.020	159,501.700	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,269	38.030	48,260.070	
RPM INTERNATIONAL INC	990	67.500	66,825.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	296	45.500	13,468.000	
ACCENTURE PLC-CL A	4,800	187.110	898,128.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	10,940	50.160	548,750.400	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	955	193.150	184,458.250	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	1,983	95.800	189,971.400	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	4,648	129.440	601,637.120	
BOOKING HOLDINGS INC	318	1,443.910	459,163.380	
SCHLUMBERGER LTD	10,381	16.730	173,674.130	
SCHWAB (CHARLES) CORP	8,754	35.170	307,878.180	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,534	119.400	183,159.600	
BUNGE LTD	1,099	36.370	39,970.630	
SEI INVESTMENTS CO	1,055	50.530	53,309.150	
ANTHEM INC	1,920	265.730	510,201.600	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,139	88.740	101,074.860	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,020	36.290	73,305.800	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	623	528.560	329,292.880	
CENTENE CORP	4,447	64.610	287,320.670	
SVB FINANCIAL GROUP	423	183.640	77,679.720	
IAC INTERACTIVE CORP	588	237.060	139,391.280	
SMITH (A.O.) CORP	824	43.310	35,687.440	
ACUITY BRANDS INC	412	84.620	34,863.440	
SNAP-ON INC	456	122.210	55,727.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3,033	56.720	172,031.760	
ADVANCE AUTO PARTS	509	119.610	60,881.490	
EDISON INTERNATIONAL	2,510	54.530	136,870.300	
SOUTHERN CO	8,023	54.230	435,087.290	
TRUIST FINANCIAL CORP	10,096	35.240	355,783.040	
SOUTHWEST AIRLINES	759	25.450	19,316.550	

AT&T INC	55,237	28.890	1,595,796.930	
CHEVRON CORP	14,252	92.640	1,320,305.280	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,169	109.980	128,566.620	
STATE STREET CORP	2,765	58.240	161,033.600	
STARBUCKS CORP	8,957	76.000	680,732.000	
STEEL DYNAMICS INC	1,740	24.130	41,986.200	
STRYKER CORP	2,560	192.190	492,006.400	
NETFLIX INC	3,316	436.530	1,447,533.480	
NORTONLIFELOCK INC	4,198	21.180	88,913.640	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	843	37.300	31,443.900	
SYNOPSYS INC	1,165	158.940	185,165.100	
SYSCO CORP	3,368	52.280	176,079.040	
INTUITIVE SURGICAL INC	877	535.940	470,019.380	
TELEFLEX INC	366	343.270	125,636.820	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	8,632	11.550	99,699.600	
TERADYNE INC	1,374	62.430	85,778.820	
TEXAS INSTRUMENTS INC	7,125	113.650	809,756.250	
TEXTRON INC	1,586	25.680	40,728.480	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,029	339.080	1,027,073.320	
TIFFANY & CO	715	128.170	91,641.550	
GLOBE LIFE INC	722	75.730	54,677.060	
DAVITA INC	785	80.160	62,925.600	
TRACTOR SUPPLY CO	805	105.170	84,661.850	
TRIMBLE INC	1,673	36.450	60,980.850	
TYLER TECHNOLOGIES INC	299	332.590	99,444.410	
TYSON FOODS INC	2,278	57.260	130,438.280	
UGI CORP	1,860	28.130	52,321.800	
MARATHON OIL CORP	5,977	5.510	32,933.270	
UNION PACIFIC CORP	5,232	156.220	817,343.040	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	11,348	57.010	646,949.480	
UNITEDHEALTH GROUP INC	7,161	285.000	2,040,885.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	573	96.530	55,311.690	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	646	116.940	75,543.240	
VF CORP	2,637	57.280	151,047.360	
VIACOMCBS INC	3,952	16.420	64,891.840	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,952	270.010	527,059.520	
VULCAN MATERIALS CO	951	102.180	97,173.180	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	5,871	40.660	238,714.860	
WALMART INC	10,792	121.890	1,315,436.880	

WASTE MANAGEMENT INC	3,272	101.450	331,944.400	
WATERS CORP	529	185.980	98,383.420	
ALLERGAN PLC	2,488	192.990	480,159.120	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	587	197.970	116,208.390	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	896	113.530	101,722.880	
VAIL RESORTS INC	328	171.510	56,255.280	
WESTERN DIGITAL CORP	2,214	41.850	92,655.900	
WABTEC CORP	1,319	55.260	72,887.940	
WHIRLPOOL CORP	491	106.900	52,487.900	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,249	106.190	132,631.310	
WYNN RESORTS LTD	779	79.600	62,008.400	
NASDAQ INC	908	107.330	97,455.640	
CME GROUP INC	2,712	178.490	484,064.880	
WILLIAMS COS INC	9,227	19.210	177,250.670	
LKQ CORP	2,481	25.200	62,521.200	
ALLIANT ENERGY CORP	1,820	46.240	84,156.800	
WEC ENERGY GROUP INC	2,292	85.130	195,117.960	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	2,003	36.600	73,309.800	
CARMAX INC	1,366	72.870	99,540.420	
XILINX INC	1,772	84.430	149,609.960	
TJX COMPANIES INC	9,210	48.500	446,685.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	364	233.860	85,125.040	
ZIONS BANCORP NA	1,532	29.570	45,301.240	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	2,000	4.800	9,600.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	6,849	4.050	27,738.450	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	1,628	44.610	72,625.080	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	1,661	21.720	36,076.920	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	839	141.450	118,676.550	
SIGNATURE BANK	270	100.200	27,054.000	
CBRE GROUP INC	2,434	40.890	99,526.260	
LIBERTY GLOBAL PLC	1,182	21.890	25,873.980	
REGIONS FINANCIAL CORP	6,611	9.850	65,118.350	
DOMINO'S PIZZA INC	303	367.170	111,252.510	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	236	41.550	9,805.800	
T-MOBILE US INC	3,246	95.290	309,311.340	
LAS VEGAS SANDS CORP	2,280	47.370	108,003.600	
MOSAIC CO/THE	3,109	11.100	34,509.900	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	263	480.750	126,437.250	
CELANESE CORP	986	80.350	79,225.100	
DEXCOM INC	642	404.360	259,599.120	
DISCOVERY INC-A	957	20.530	19,647.210	
EXPEDIA GROUP INC	988	66.460	65,662.480	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,325	27.540	36,490.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	928	121.730	112,965.440	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,228	21.460	69,272.880	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	4,223	93.090	393,119.070	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	1,033	9.610	9,927.130	
LIVE NATION	834	39.370	32,834.580	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	204	897.510	183,092.040	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	690	22.750	15,697.500	
TRANSDIGM GROUP INC	366	324.550	118,785.300	
MASTERCARD INC	6,778	278.470	1,887,469.660	
HANESBRANDS INC	3,842	9.310	35,769.020	
WESTERN UNION CO	3,485	19.450	67,783.250	
OWENS CORNING	1,082	41.700	45,119.400	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,051	100.380	105,499.380	
AERCAP HOLDINGS NV	1,053	28.250	29,747.250	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	877	18.770	16,461.290	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	1,310	15.590	20,422.900	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	810	116.690	94,518.900	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	3,636	11.540	41,959.440	
DELTA AIR LINES INC	1,063	21.680	23,045.840	
INSULET CORP	497	215.150	106,929.550	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	578	13.600	7,860.800	
DISCOVER FINANCIAL	2,563	40.480	103,750.240	
TE CONNECTIVITY LTD	2,449	73.320	179,560.680	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	1,474	57.190	84,298.060	
WABCO HOLDING INC	324	135.010	43,743.240	
LULULEMON ATHLETICA INC	866	225.990	195,707.340	
VMWARE INC	689	133.300	91,843.700	
MERCADOLIBRE INC	311	772.020	240,098.220	
ULTA BEAUTY INC	409	222.160	90,863.440	
INVESCO LTD	3,248	7.670	24,912.160	
MSCI INC	641	334.100	214,158.100	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	11,776	70.140	825,968.640	
VISA INC	12,932	182.720	2,362,935.040	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,444	119.080	171,951.520	
DISCOVERY INC-C	2,687	18.870	50,703.690	

MARATHON PETROLEUM CORP	4,873	30.780	149,990.940	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	1,250	53.830	67,287.500	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	15,286	14.940	228,372.840	
XYLEM INC	1,282	63.550	81,471.100	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	1,762	53.730	94,672.260	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	252	173.310	43,674.120	
SPLUNK INC	1,052	150.630	158,462.760	
EPAM SYSTEMS INC	445	227.010	101,019.450	
HCA HEALTHCARE INC	2,061	102.540	211,334.940	
VERISK ANALYTICS INC	1,162	158.270	183,909.740	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	502	109.450	54,943.900	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	591	248.740	147,005.340	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	1,212	101.880	123,478.560	
NXP SEMICONDUCTOR NV	2,183	102.660	224,106.780	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	1,035	73.850	76,434.750	
TARGA RESOURCES CORP	1,973	13.420	26,477.660	
LEAR CORP	498	92.730	46,179.540	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	864	99.460	85,933.440	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	1,626	57.300	93,169.800	
DOLLAR GENERAL CORP	1,932	173.600	335,395.200	
FORTINET INC	1,142	135.120	154,307.040	
TESLA INC	1,022	780.040	797,200.880	
GENERAL MOTORS CO	10,090	22.440	226,419.600	
XPO LOGISTICS INC	748	66.180	49,502.640	
TRIPADVISOR INC	625	18.720	11,700.000	
ALLY FINANCIAL INC	2,551	15.080	38,469.080	
CAPRI HOLDINGS LTD	1,682	14.030	23,598.460	
VOYA FINANCIAL INC	978	43.760	42,797.280	
APTIV PLC	1,859	65.230	121,262.570	
PHILLIPS 66	3,331	73.310	244,195.610	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	656	95.700	62,779.200	
FACEBOOK INC	18,184	211.260	3,841,551.840	
IQVIA HOLDINGS INC	1,250	135.520	169,400.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,488	40.370	60,070.560	
SERVICENOW INC	1,435	381.830	547,926.050	
PALO ALTO NETWORKS INC	739	213.130	157,503.070	
WORKDAY INC	1,227	160.660	197,129.820	
ABBVIE INC	11,178	84.220	941,411.160	
ZOETIS INC	3,603	124.240	447,636.720	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	1,724	12.000	20,688.000	

COTY INC	3,069	4.930	15,130.170	
NEWS CORP/NEW-CL A	3,947	9.650	38,088.550	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,400	29.130	40,782.000	
CDW CORP	1,160	106.670	123,737.200	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	695	9.540	6,630.300	
HOWMET AEROSPACE INC	2,862	11.870	33,971.940	
TWILIO INC	872	170.890	149,016.080	
SNAP INC	6,716	18.150	121,895.400	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	1,620	30.350	49,167.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	521	31.130	16,218.730	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	1,460	30.850	45,041.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1,875	8.610	16,143.750	
OKTA INC	723	170.290	123,119.670	
BLACK KNIGHT INC	1,105	72.770	80,410.850	
BAKER HUGHES CO	4,823	14.020	67,618.460	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,186	55.420	65,728.120	
ALTICE USA INC-A	1,090	23.000	25,070.000	
TECHNIPFMC LTD	4,158	7.570	31,476.060	
BROADCOM INC	3,007	267.750	805,124.250	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	592	259.700	153,742.400	
MONGODB INC	366	175.430	64,207.380	
BURLINGTON STORES INC	474	178.330	84,528.420	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	3,083	19.880	61,290.040	
VEEVA SYSTEMS INC	990	191.250	189,337.500	
TWITTER INC	5,600	28.770	161,112.000	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	1,309	35.650	46,665.850	
EVERGY INC	1,554	55.870	86,821.980	
ALLEGION PLC	777	100.140	77,808.780	
STERIS PLC	689	143.860	99,119.540	
DOCUSIGN INC	766	117.700	90,158.200	
WIX.COM LTD	349	149.900	52,315.100	
DROPBOX INC	1,455	21.890	31,849.950	
KKR & CO INC	3,683	26.890	99,035.870	
PERRIGO CO PLC	1,064	51.690	54,998.160	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	1,953	71.900	140,420.700	
ARAMARK	1,708	23.780	40,616.240	
CIGNA CORP	2,830	184.180	521,229.400	
DELL TECHNOLOGIES INC	1,478	41.750	61,706.500	
DOW INC	5,662	32.850	185,996.700	
AMCOR PLC	12,000	8.610	103,320.000	
PINTEREST INC	2,285	18.700	42,729.500	
XEROX HOLDINGS CORP	1,347	17.330	23,343.510	
FOX CORP-A	2,350	25.250	59,337.500	
FOX CORP-B	1,755	25.010	43,892.550	
CARRIER GLOBAL CORP	5,868	16.410	96,293.880	

OTIS WORLDWIDE CORP	2,934	51.810	152,010.540	
UBER TECHNOLOGIES INC	3,212	30.930	99,347.160	
CORTEVA INC	5,230	26.450	138,333.500	
BLACKSTONE GROUP INC	4,992	52.790	263,527.680	
GRUBHUB INC	932	44.890	41,837.480	
INGERSOLL RAND INC	2,756	27.680	76,286.080	
PAYCOM SOFTWARE INC	408	268.820	109,678.560	
SABRE CORP	2,751	6.680	18,376.680	
AON PLC	1,772	184.830	327,518.760	
ARISTA NETWORKS INC	378	210.430	79,542.540	
IHS MARKIT LTD	2,799	66.320	185,629.680	
FNF GROUP	2,163	25.070	54,226.410	
SYNCHRONY FINANCIAL	3,668	17.990	65,987.320	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	3,340	21.250	70,975.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD	299	105.930	31,673.070	
CDK GLOBAL INC	1,019	39.710	40,464.490	
WAYFAIR INC	473	176.890	83,668.970	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	1,305	96.990	126,571.950	
QORVO INC	935	100.820	94,266.700	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	865	126.630	109,534.950	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,197	19.040	41,830.880	
GODADDY INC	1,399	73.040	102,182.960	
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,781	13.680	38,044.080	
TRANSUNION	1,380	78.780	108,716.400	
SQUARE INC	2,624	74.620	195,802.880	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,180	44.760	231,856.800	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	1,891	38.070	71,990.370	
WESTROCK CO	1,676	25.090	42,050.840	
KRAFT HEINZ CO	5,114	28.830	147,436.620	
FORTIVE CORP	2,344	57.930	135,787.920	
MATCH GROUP INC	457	82.630	37,761.910	
WASTE CONNECTIONS INC	2,085	91.940	191,694.900	
ALPHABET INC-CL A	2,266	1,369.280	3,102,788.480	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	10,345	9.580	99,105.100	
PAYPAL HOLDINGS INC	8,431	146.290	1,233,370.990	
EQUITABLE HOLDINGS INC	2,928	17.460	51,122.880	
DXC TECHNOLOGY CO	2,201	17.330	38,143.330	
ZILLOW GROUP INC-C	728	48.560	35,351.680	
ALPHABET INC-CL C	2,334	1,372.560	3,203,555.040	
BEIGENE LTD ADR	303	153.420	46,486.260	
LINDE PLC	4,051	184.790	748,584.290	
ATHENE HOLDING LTD	1,398	24.860	34,754.280	
ROKU INC	771	137.500	106,012.500	

	CHARTER COMMUNICATIONS INC	1,142	514.250	587,273.500	
	VISTRA ENERGY CORP	2,954	17.950	53,024.300	
アメリカ・ドル　小計		2,269,342		185,653,421.650 (19,746,097,927)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	4,864	8.058	39,194.110	
	ASHTEAD GROUP	3,183	22.160	70,535.280	
	SEVERN TRENT PLC	1,450	24.170	35,046.500	
	BHP GROUP PLC	15,650	13.766	215,437.900	
	BARCLAYS PLC	132,280	1.054	139,423.120	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	6,897	5.308	36,609.270	
	BT GROUP PLC	63,647	1.049	66,765.700	
	BUNZL PLC	2,623	17.305	45,391.010	
	EASYJET PLC	1,034	5.314	5,494.670	
	AVIVA PLC	29,905	2.473	73,955.060	
	CRODA INTERNATIONAL	1,095	49.660	54,377.700	
	DIAGEO PLC	17,802	27.780	494,539.560	
	SCHRODERS PLC	722	27.910	20,151.020	
	DCC PLC	777	58.280	45,283.560	
	NATIONAL GRID PLC	26,711	9.212	246,061.730	
	KINGFISHER PLC	21,891	1.561	34,171.850	
	BAE SYSTEMS PLC	24,796	5.122	127,005.110	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	17,405	29.770	518,146.850	
	HALMA PLC	3,140	22.330	70,116.200	
	NEXT PLC	1,093	48.820	53,360.260	
	IMPERIAL BRANDS PLC	7,023	16.270	114,264.210	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,674	19.550	32,726.700	
	ANGLO AMERICAN PLC	7,411	14.670	108,719.370	
	COMPASS GROUP PLC	11,887	12.870	152,985.690	
	HSBC HOLDINGS PLC	153,742	4.127	634,493.230	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	43,178	2.050	88,514.900	
	CENTRICA PLC	46,558	0.399	18,576.640	
	UNILEVER PLC	8,433	40.830	344,319.390	
	MEGGITT PLC	7,873	2.577	20,288.720	
	MORRISON ＜WM.＞ SUPERMARKETS	23,987	1.871	44,879.670	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	4,410	8.996	39,672.360	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	5,128	3.936	20,183.800	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	2,842	17.660	50,189.720	
	PEARSON PLC	6,087	4.496	27,367.150	
	PERSIMMON PLC	2,395	22.820	54,653.900	
	PRUDENTIAL PLC	19,755	11.230	221,848.650	
	RIO TINTO PLC	8,490	37.255	316,294.950	

VODAFONE GROUP PLC	203,407	1.129	229,646.500	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	5,376	66.480	357,396.480	
RELX PLC	14,711	18.590	273,477.490	
RENTOKIL INITIAL PLC	12,892	4.821	62,152.330	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	12,466	2.871	35,789.880	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	35,149	1.141	40,105.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	3,304	8.492	28,057.560	
SSE PLC	6,819	12.355	84,248.740	
BP PLC	153,311	3.159	484,309.440	
SAGE GROUP PLC(THE)	8,722	6.420	55,995.240	
SMITHS GROUP PLC	3,158	12.500	39,475.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	472	93.700	44,226.400	
STANDARD CHARTERED PLC	21,393	4.134	88,438.660	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	536,930	0.312	167,522.160	
TAYLOR WIMPLEY PLC	26,759	1.519	40,646.920	
TESCO PLC	75,830	2.373	179,944.590	
3I GROUP PLC	6,903	7.650	52,807.950	
SMITH & NEPHEW PLC	6,729	16.575	111,533.170	
GLAXOSMITHKLINE PLC	37,806	16.746	633,099.270	
WEIR GROUP	2,794	9.626	26,895.040	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	2,391	78.280	187,167.480	
WPP PLC	9,675	6.050	58,533.750	
ASTRAZENECA PLC	9,919	85.590	848,967.210	
WHITBREAD PLC	1,185	28.580	33,867.300	
CARNIVAL PLC	1,594	9.370	14,935.780	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	17,565	0.951	16,704.310	
INTERTEK GROUP PLC	1,301	47.220	61,433.220	
BURBERRY GROUP PLC	2,340	13.850	32,409.000	
INTERCONTINENTAL HOTELS	1,420	35.940	51,034.800	
ITV PLC	12,027	0.733	8,815.790	
SAINSBURY (J) PLC	9,303	1.927	17,926.880	
G4S PLC	9,712	0.969	9,410.920	
ADMIRAL GROUP PLC	1,238	24.150	29,897.700	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	868	42.680	37,046.240	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	32,226	13.206	425,576.550	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	27,612	12.636	348,905.230	
TUI AG-DI	4,789	2.650	12,690.850	
AVEVA GROUP PLC	523	39.100	20,449.300	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	20,129	2.195	44,183.150	
EXPERIAN PLC	6,847	26.010	178,090.470	

	MONDI PLC	3,853	13.610	52,439.330	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	2,835	15.050	42,666.750	
	OCADO GROUP PLC	3,303	18.640	61,567.920	
	INFORMA PLC	8,267	4.543	37,556.980	
	GLENCORE PLC	79,111	1.481	117,163.390	
	GVC HOLDINGS PLC	6,015	7.928	47,686.920	
	EVRAZ PLC	3,046	2.700	8,224.200	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	7,157	2.806	20,082.540	
	COCA-COLA HBC AG	1,957	18.965	37,114.500	
	FERGUSON PLC	1,492	57.000	85,044.000	
	M&G PLC	23,453	1.316	30,864.140	
	JD SPORTS FASHION PLC	3,338	5.542	18,499.190	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	2,124	4.769	10,129.350	
	AUTO TRADER GROUP PLC	4,841	4.798	23,227.110	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	33,900	0.960	32,544.000	
イギリス・ポンド　小計		2,270,125		10,779,669.580 (1,420,113,670)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	7,328	22.560	165,319.680	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	11,726	19.100	223,966.600	
	ELBIT SYSTEMS LTD	145	478.000	69,310.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	9,236	11.520	106,398.720	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	4,209	12.660	53,285.940	
	NICE LTD	532	608.200	323,562.400	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	617	70.850	43,714.450	
	AZRIELI GROUP	258	197.800	51,032.400	
イスラエル・シュケル　小計		34,051		1,036,590.190 (31,419,049)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,367	62.000	84,754.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	22,174	15.850	351,457.900	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	27,849	15.600	434,444.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	11,411	11.450	130,655.950	
	TELSTRA CORP LTD	33,491	3.060	102,482.460	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	2,995	5.920	17,730.400	
	AMP LTD	38,238	1.365	52,194.870	
	ASX LTD	1,313	80.980	106,326.740	
	BHP GROUP LTD	22,198	31.000	688,138.000	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	1,582	24.340	38,505.880	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	3,640	2.840	10,337.600	
	COMPUTERSHARE LT	4,652	11.420	53,125.840	
	CSL LIMITED	3,442	307.930	1,059,895.060	

REA GROUP LTD	322	88.350	28,448.700	
TRANSURBAN GROUP	21,039	13.420	282,343.380	
COCA-COLA AMATIL LTD	3,091	8.410	25,995.310	
COCHLEAR LTD	454	184.500	83,763.000	
ORIGIN ENERGY LTD	14,483	5.530	80,090.990	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	13,520	59.260	801,195.200	
BORAL LIMITED	9,378	2.740	25,695.720	
RIO TINTO LIMITED	3,034	81.510	247,301.340	
APA GROUP	9,187	11.110	102,067.570	
ARISTOCRAT LEISU	4,739	25.000	118,475.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	15,996	5.300	84,778.800	
TPG TELECOM LTD	2,243	7.200	16,149.600	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	334	9.950	3,323.300	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	2,511	21.480	53,936.280	
ORICA LTD	4,078	16.760	68,347.280	
CIMIC GROUP LTD	569	23.190	13,195.110	
LEND LEASE CORP LTD	3,195	11.300	36,103.500	
BLUESCOPE STEEL LTD	3,379	10.070	34,026.530	
SYDNEY AIRPORT	5,343	5.420	28,959.060	
MACQUARIE GROUP LTD	2,592	99.550	258,033.600	
WORLEY LTD	1,865	8.470	15,796.550	
SUNCORP GROUP LTD	10,224	8.770	89,664.480	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	22,603	16.220	366,620.660	
NEWCREST MINING LTD	6,147	27.830	171,071.010	
OIL SEARCH LTD	14,493	2.870	41,594.910	
INCITEC PIVOT LTD	9,850	2.200	21,670.000	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	5,176	3.460	17,908.960	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	9,438	7.510	70,879.380	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	3,359	4.540	15,249.860	
SANTOS LTD	13,601	4.760	64,740.760	
SONIC HEALTHCARE	2,963	25.860	76,623.180	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	617	17.860	11,019.620	
TABCORP HOLDINGS LTD	21,933	3.140	68,869.620	
WESFARMERS LTD	8,426	36.400	306,706.400	
ALUMINA LIMITED	18,772	1.580	29,659.760	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	7,111	21.650	153,953.150	
WOOLWORTHS GROUP LTD	9,518	34.910	332,273.380	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	778	53.040	41,265.120	
SEEK LTD	2,025	16.930	34,283.250	
AUSNET SERVICES	11,262	1.950	21,960.900	

	AGL ENERGY LTD	4,374	16.390	71,689.860	
	BRAMBLES LTD	12,904	10.650	137,427.600	
	CROWN RESORTS LTD	2,284	9.160	20,921.440	
	AURIZON HOLDINGS LTD	15,106	4.580	69,185.480	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	6,065	9.910	60,104.150	
	MEDIBANK PVT LTD	22,304	2.850	63,566.400	
	SOUTH32 LTD(AUD)	40,769	1.865	76,034.180	
	COLES GROUP LTD	9,090	15.230	138,440.700	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,219	20.060	24,453.140	
オーストラリア・ドル　小計		588,115		8,135,912.270 (564,795,030)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,829	91.720	167,755.880	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	6,146	39.960	245,594.160	
	BARRICK GOLD CORP	13,793	38.150	526,202.950	
	ATCO LTD	468	37.480	17,540.640	
	BANK OF MONTREAL	4,885	67.100	327,783.500	
	BANK OF NOVA SCOTIA	9,398	52.400	492,455.200	
	NATIONAL BANK OF CANADA	2,702	54.600	147,529.200	
	BCE INC	1,136	56.540	64,229.440	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	10,058	46.420	466,892.360	
	BAUSCH HEALTH COS INC	2,058	22.180	45,646.440	
	SAPUTO INC	2,087	34.200	71,375.400	
	BLACKBERRY LTD	3,184	6.430	20,473.120	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	4,106	19.120	78,506.720	
	CGI INC	1,917	91.030	174,504.510	
	CCL INDUSTRIES INC	1,557	43.820	68,227.740	
	CAE INC	1,840	21.530	39,615.200	
	CAMECO CORP	2,459	14.840	36,491.560	
	ROGERS COMM-CL B	2,910	56.680	164,938.800	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	3,416	81.840	279,565.440	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	9,022	21.600	194,875.200	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	348	92.690	32,256.120	
	CANADIAN UTILITIES LTD	1,630	32.060	52,257.800	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	5,427	112.980	613,142.460	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,082	18.660	38,850.120	
	OPEN TEXT CORP	1,863	54.680	101,868.840	
	EMPIRE CO LTD	1,076	29.970	32,247.720	
	KINROSS GOLD CORP	10,767	9.930	106,916.310	
	FORTIS INC	3,607	52.950	190,990.650	
	TELUS CORP	1,200	22.750	27,300.000	
	GREAT WEST LIFECO INC	2,541	21.070	53,538.870	
	IMPERIAL OIL LTD	2,228	20.810	46,364.680	
	ENBRIDGE INC	15,340	44.620	684,470.800	

IGM FINANCIAL INC	536	27.680	14,836.480	
MANULIFE FINANCIAL CORP	14,986	16.400	245,770.400	
LOBLAW CO LTD	1,598	67.410	107,721.180	
MAGNA INTERNATIONAL INC	2,057	53.460	109,967.220	
SUN LIFE FINANCIAL INC	4,536	47.790	216,775.440	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	211	349.190	73,679.090	
METRO INC	1,998	57.790	115,464.420	
HUSKY ENERGY INC	2,214	3.950	8,745.300	
EMERA INC	2,084	54.500	113,578.000	
METHANEX CORP	401	21.680	8,693.680	
ONEX CORP	511	64.630	33,025.930	
POWER CORP OF CANADA	4,152	20.450	84,908.400	
QUEBECOR INC-B	1,153	29.900	34,474.700	
ROYAL BANK OF CANADA	10,886	84.180	916,383.480	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,044	314.050	327,868.200	
SHAW COMM INC-B	3,602	22.590	81,369.180	
SUNCOR ENERGY INC	11,685	23.170	270,741.450	
LUNDIN MINING CORP	4,452	6.380	28,403.760	
TECK RESOURCES LTD-CL B	4,111	12.170	50,030.870	
THOMSON REUTERS CORP	1,548	95.730	148,190.040	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	13,723	56.250	771,918.750	
TC ENERGY CORP	7,094	64.180	455,292.920	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	375	36.950	13,856.250	
WESTON (GEORGE) LTD	493	96.590	47,618.870	
INTACT FINANCIAL CORP	1,093	135.580	148,188.940	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	3,061	61.200	187,333.200	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	140	1,402.380	196,333.200	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	1,466	202.200	296,425.200	
CI FINANCIAL CORP	1,599	14.080	22,513.920	
KEYERA CORP	2,418	20.540	49,665.720	
PARKLAND FUEL CORP	1,168	32.000	37,376.000	
ALTAGAS LTD	1,677	16.200	27,167.400	
PEMBINA PIPELINE CORP	3,928	31.240	122,710.720	
DOLLARAMA INC	1,991	43.670	86,946.970	
STARS GROUP INC	1,214	37.490	45,512.860	
CENOVUS ENERGY INC W/I	8,004	5.350	42,821.400	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	1,899	60.460	114,813.540	
INTER PIPELINE LTD	4,196	10.590	44,435.640	
NUTRIEN LTD	4,442	48.180	214,015.560	
WSP GLOBAL INC	694	89.590	62,175.460	
IA FINANCIAL CORP INC	753	41.920	31,565.760	
OVINTIV INC	2,101	7.420	15,589.420	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,335	9.580	12,789.300	

	AIR CANADA	874	16.530	14,447.220	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	2,268	70.590	160,098.120	
	AURORA CANNABIS INC	3,928	0.960	3,770.880	
	SHOPIFY INC	784	1,016.310	796,787.040	
	CANOPY GROWTH CORP	1,653	21.580	35,671.740	
	HYDRO ONE LTD	2,186	25.440	55,611.840	
カナダ・ドル　小計		283,402		12,714,488.890 (970,242,647)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	11,000	3.300	36,300.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	6,234	1.580	9,849.720	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	10,100	1.600	16,160.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	13,510	19.740	266,687.400	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,000	7.870	39,350.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	604	20.130	12,158.520	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	4,200	2.990	12,558.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	7,900	9.760	77,104.000	
	CAPITALAND LTD	20,975	2.900	60,827.500	
	GENTING SINGAPORE LTD	36,993	0.765	28,299.640	
	KEPPEL CORP LTD	8,500	6.000	51,000.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	13,318	1.590	21,175.620	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	24,745	8.880	219,735.600	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	66,208	2.750	182,072.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	7,100	4.400	31,240.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	10,266	19.880	204,088.080	
	UOL GROUP LIMITED	3,100	6.770	20,987.000	
	VENTURE CORP LTD	1,700	15.760	26,792.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	10,500	3.480	36,540.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	14,400	0.975	14,040.000	
シンガポール・ドル　小計		276,353		1,366,965.080 (103,014,488)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	19,136	8.184	156,609.020	
	NESTLE SA-REGISTERED	22,528	103.780	2,337,955.840	
	CIE FINANC RICHEMONT	3,924	54.680	214,564.320	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	5,312	342.000	1,816,704.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	332	210.000	69,720.000	
	SIKA INHABER	978	164.250	160,636.500	
	SGS SA-REG	49	2,141.000	104,909.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	16,245	83.180	1,351,259.100	
	BALOISE HOLDING AG -R	322	138.500	44,597.000	

	BARRY CALLEBAUT AG	19	1,855.000	35,245.000	
	CLARIANT AG-REG	824	17.505	14,424.120	
	SWISSCOM AG-REG	176	488.200	85,923.200	
	ABB LTD	14,058	17.500	246,015.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	991	40.980	40,611.180	
	GEBERIT AG	296	422.900	125,178.400	
	LONZA GROUP AG-REG	571	440.300	251,411.300	
	LINDT & SPRUENGLI PART	7	7,710.000	53,970.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	1	81,200.000	81,200.000	
	GIVAUDAN-REG	71	3,288.000	233,448.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,126	291.000	327,666.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	3,778	39.150	147,908.700	
	TEMENOS GROUP	511	130.300	66,583.300	
	SONOVA HOLDING AG	391	188.150	73,566.650	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	365	134.650	49,147.250	
	STRAUMANN HOLDING AG	86	738.600	63,519.600	
	THE SWATCH GROUP AG-B	238	184.250	43,851.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	434	35.620	15,459.080	
	SCHINDLER NAMEN	167	206.400	34,468.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	238	334.800	79,682.400	
	VIFOR PHARMA AG	300	153.100	45,930.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	64	624.000	39,936.000	
	SWISS PRIME SITE AG	664	90.300	59,959.200	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	229	68.600	15,709.400	
	DUFRY GROUP	482	25.180	12,136.760	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	138	794.600	109,654.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	1,773	37.770	66,966.210	
	SWISS RE LTD	2,259	66.680	150,630.120	
	ALCON INC	3,141	52.320	164,337.120	
	UBS GROUP AG	29,282	9.616	281,575.710	
スイス・フラン　小計		131,506		9,273,069.580 (1,014,659,273)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	4,727	338.100	1,598,198.700	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	3,293	305.800	1,006,999.400	
	ERICSSON LM-B SHS	22,989	82.280	1,891,534.920	
	LUNDBERGS B	477	406.200	193,757.400	
	SKF AB-B SHS	2,963	152.000	450,376.000	
	SANDVIK AB	9,209	146.400	1,348,197.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	11,916	74.640	889,410.240	
	SKANSKA AB-B SHS	2,318	179.400	415,849.200	
	SWEDBANK AB	6,651	107.240	713,253.240	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	12,017	87.620	1,052,929.540	
	VOLVO AB-B SHS	11,424	122.250	1,396,584.000	
	SWEDISH MATCH AB	1,359	619.000	841,221.000	

	TELE2 AB-B SHS	4,457	124.500	554,896.500	
	INDUSTRIVARDEN C	1,007	199.800	201,198.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,688	135.900	229,399.200	
	SECURITAS AB-B SHS	2,126	120.350	255,864.100	
	INVESTOR AB-B SHS	3,501	475.200	1,663,675.200	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	5,946	130.850	778,034.100	
	ASSA ABLOY AB-B	7,846	181.800	1,426,402.800	
	TELIA CO AB	21,030	32.300	679,269.000	
	LUNDIN ENERGY AB	1,911	227.800	435,325.800	
	BOLIDEN AB	2,155	190.050	409,557.750	
	ALFA LAVAL AB	2,783	184.650	513,880.950	
	KINNEVIK AB-B	1,948	217.300	423,300.400	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	657	230.300	151,307.100	
	ICA GRUPPEN AB	423	420.200	177,744.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,611	58.020	151,490.220	
	HEXAGON AB	1,895	464.000	879,280.000	
	EPIROC AB-A	5,988	98.360	588,979.680	
	EPIROC AB-B	2,262	97.760	221,133.120	
	ESSITY AB-B	4,475	306.300	1,370,692.500	
	NORDEA BANK ABP	21,871	59.450	1,300,230.950	
スウェーデン・クローナ　小計		185,923		24,209,973.810 (262,920,316)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	943	829.800	782,501.400	
	A P MOLLER A/S	39	6,340.000	247,260.000	
	AP MOLLER MAERSK A	36	5,910.000	212,760.000	
	DANSKE BANK A/S	5,174	77.260	399,743.240	
	GENMAB A/S	535	1,820.000	973,700.000	
	NOVOZYMES-B SHS	1,742	349.400	608,654.800	
	NOVO NORDISK A/S-B	13,460	432.000	5,814,720.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,409	593.600	836,382.400	
	COLOPLAST-B	851	1,052.000	895,252.000	
	DSV PANALPINA A S	1,636	692.400	1,132,766.400	
	DEMANT A/S	628	171.800	107,890.400	
	H LUNDBECK A/S	434	242.600	105,288.400	
	TRYG A/S	596	182.500	108,770.000	
	PANDORA A/S	647	272.000	175,984.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	861	611.000	526,071.000	
	ISS A/S	980	101.350	99,323.000	
	ORSTED A/S	1,285	696.000	894,360.000	
デンマーク・クローネ　小計		31,256		13,921,427.040 (215,225,262)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	9,573	5.700	54,566.100	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	2,319	12.180	28,245.420	
	A2 MILK CO LTD	4,805	19.740	94,850.700	
	FISHER & PAYKEL	5,297	29.390	155,678.830	

	FLETCHER BUILDING LTD	5,350	3.500	18,725.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	11,228	4.490	50,413.720	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	8,340	4.640	38,697.600	
	MERIDIAN ENERGY LTD	7,995	4.600	36,777.000	
ニュージーランド・ドル　小計		54,907		477,954.370 (31,071,814)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	2,653	174.950	464,142.350	
	DNB ASA	7,617	116.050	883,952.850	
	NORSK HYDRO ASA	14,769	24.010	354,603.690	
	TELENOR ASA	5,601	146.950	823,066.950	
	ORKLA ASA	6,557	84.340	553,017.380	
	EQUINOR ASA	6,857	138.550	950,037.350	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,360	347.100	472,056.000	
	AKER BP ASA	668	169.650	113,326.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,253	176.000	220,528.000	
	SCHIBSTED ASA	613	221.000	135,473.000	
ノルウェー・クローネ　小計		47,948		4,970,203.770 (51,739,821)	
ユーロ	CRH PLC	6,215	26.880	167,059.200	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	478	110.850	52,986.300	
	KERRY GROUP PLC-A	1,158	100.500	116,379.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	949	48.680	46,197.320	
	UMICORE	1,224	36.590	44,786.160	
	AIR LIQUIDE	3,627	119.950	435,058.650	
	AIRBUS SE	4,475	55.750	249,481.250	
	AXA	15,003	16.294	244,458.880	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	3,806	19.135	72,827.810	
	ADIDAS AG	1,379	209.100	288,348.900	
	ASSICURAZIONI GENERALI	8,002	12.820	102,585.640	
	DASSAULT AVIATION SA	17	700.500	11,908.500	
	DANONE	4,684	62.960	294,904.640	
	SAFRAN SA	2,513	81.080	203,754.040	
	INTESA SANPAOLO	115,600	1.404	162,302.400	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,477	49.365	122,277.100	
	ACCOR SA	922	23.050	21,252.100	
	BOUYGUES	2,029	27.410	55,614.890	
	BNP PARIBAS	8,740	28.495	249,046.300	
	THALES SA	871	70.000	60,970.000	
	CAPGEMINI SA	1,030	89.600	92,288.000	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	336	34.900	11,726.400	
	INGENICO GROUP	367	118.800	43,599.600	
	UNICREDIT SPA	14,354	6.496	93,243.580	
	NATIXIS	4,279	2.129	9,109.990	
	KONINKLIJKE DSM NV	1,377	115.000	158,355.000	

COMMERZBANK AG	6,566	3.247	21,319.800	
EIFFAGE	498	73.280	36,493.440	
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,270	39.440	128,968.800	
UNITED INTERNET	442	31.710	14,015.820	
FUCHS PETROLUB SE PREF	409	35.100	14,355.900	
PUBLICIS GROUPE	1,441	25.420	36,630.220	
FAURECIA	475	31.500	14,962.500	
IBERDROLA SA	46,705	8.838	412,778.790	
ENI SPA	18,956	8.556	162,187.530	
JERONIMO MARTINS	1,509	15.505	23,397.040	
KBC GROUPE	2,039	48.900	99,707.100	
HANNOVER RUECK SE	493	141.100	69,562.300	
WARTSILA OYJ	4,056	6.680	27,094.080	
L'OREAL	1,904	249.000	474,096.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	2,109	345.550	728,764.950	
GEA GROUP AG	998	21.970	21,926.060	
BOLLORE	5,461	2.452	13,390.370	
MEDIOBANCA SPA	3,220	5.140	16,550.800	
MICHELIN(CGDE)-B	1,388	87.360	121,255.680	
CONTINENTAL AG	744	74.960	55,770.240	
DEUTSCHE POST AG-REG	7,433	26.420	196,379.860	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	1,460	13.465	19,658.900	
NOKIAN RENKAAT OYJ	737	18.695	13,778.210	
OMV AG	1,298	31.200	40,497.600	
VERBUND AG	404	42.440	17,145.760	
PERNOD-RICARD	1,619	134.850	218,322.150	
PEUGEOT SA	3,989	12.940	51,617.660	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	1,314	45.990	60,430.860	
RENAULT SA	1,830	17.092	31,278.360	
REPSOL SA	8,894	8.774	78,035.950	
REMY COINTREAU	139	98.650	13,712.350	
MERCK KGAA	973	105.300	102,456.900	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	3,587	24.320	87,235.840	
RWE AG	3,980	26.730	106,385.400	
SEB SA	143	109.200	15,615.600	
SOCIETE GENERALE-A	5,347	13.066	69,863.900	
VINCI S.A.	3,981	73.920	294,275.520	
SODEXO	698	63.700	44,462.600	
SOLVAY SA	681	72.500	49,372.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,236	79.320	335,999.520	
VIVENDI SA	6,104	19.500	119,028.000	
SAP SE	7,436	107.340	798,180.240	
TELEFONICA S.A	36,272	4.284	155,389.240	
TOTAL SA	18,085	32.570	589,028.450	
VALEO	2,376	20.060	47,662.560	

E.ON SE	17,387	9.058	157,491.440	
VOEST-ALPINE AG	718	18.860	13,541.480	
HENKEL AG & CO KGAA	795	70.050	55,689.750	
SIEMENS AG-REG	5,828	84.310	491,358.680	
UPM-KYMMENE OYJ	3,923	25.160	98,702.680	
ING GROEP NV-CVA	29,151	4.893	142,635.840	
PUMA AG	621	59.260	36,800.460	
BAYER AG	7,453	57.920	431,677.760	
STORA ENSO OYJ-R SHS	5,856	10.405	60,931.680	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,396	78.000	108,888.000	
DAIMLER AG	6,738	30.095	202,780.110	
BASF SE	6,883	45.580	313,727.140	
BEIERSDORF AG	805	92.240	74,253.200	
HOCHTIEF AG	169	68.900	11,644.100	
HEIDELBERGCEMENT AG	902	41.900	37,793.800	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	1,600	71.000	113,600.000	
ORANGE	14,713	10.690	157,281.970	
SAMPO OYJ-A SHS	3,353	30.400	101,931.200	
RANDSTAD NV	726	36.190	26,273.940	
ALLIANZ SE	3,153	157.000	495,021.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	21,487	3.890	83,584.430	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	8,155	22.930	186,994.150	
HERMES INTL	233	672.200	156,622.600	
ENDESA S.A.	2,611	20.070	52,402.770	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,422	7.860	11,176.920	
ERSTE GROUP BANK AG	2,211	19.140	42,318.540	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,114	194.900	217,118.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	5,916	10.210	60,402.360	
DASSAULT SYSTEMES SA	921	139.400	128,387.400	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	1,574	23.420	36,863.080	
HEINEKEN NV	1,940	74.020	143,598.800	
AKZO NOBEL	1,598	69.980	111,828.040	
ASML HOLDING NV	3,227	276.600	892,588.200	
AEGON NV	12,573	2.226	27,987.490	
BANKINTER S.A.	5,940	3.444	20,457.360	
VOLKSWAGEN AG	279	135.300	37,748.700	
VOLKSWAGEN AG PFD	1,361	127.140	173,037.540	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	48,681	2.693	131,097.930	
KERING	578	442.650	255,851.700	
CNP ASSURANCES	2,268	9.140	20,729.520	
FORTUM OYJ	3,667	15.090	55,335.030	
AGEAS	1,081	33.870	36,613.470	
UCB SA	919	83.640	76,865.160	

THYSSENKRUPP AG	4,508	5.350	24,117.800	
CARREFOUR SA	4,724	13.315	62,900.060	
NATURGY ENERGY GROUP SA	1,649	16.220	26,746.780	
ATOS SE	757	64.440	48,781.080	
NOKIA OYJ	43,421	3.305	143,506.400	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	6,827	39.670	270,827.090	
WOLTERS KLUWER-CVA	2,151	66.840	143,772.840	
SANOFI	8,565	90.750	777,273.750	
STMICROELECTRONICS NV	5,038	23.130	116,528.940	
ELISA OYJ	976	53.620	52,333.120	
BANCO SANTANDER SA	126,268	1.959	247,359.010	
METSO OYJ	647	24.870	16,090.890	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	2,774	15.430	42,802.820	
QIAGEN N.V.	1,811	38.890	70,429.790	
DEUTSCHE BANK AG-REG	14,497	6.555	95,027.830	
BMW VORZUG	559	41.500	23,198.500	
ENEL SPA	61,695	6.188	381,768.660	
COLRUYT NV	357	57.900	20,670.300	
VOPAK (KON.)	432	50.360	21,755.520	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	25,619	13.285	340,348.410	
SARTORIUS AG	281	280.000	78,680.000	
LEONARDO SPA	2,496	5.990	14,951.040	
UBISOFT ENTERTAINMENT	666	72.620	48,364.920	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	9,658	18.200	175,775.600	
CARL ZEISS MEDITEC AG	301	96.000	28,896.000	
KONINKLIJKE KPN NV	23,868	2.106	50,266.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	73	533.400	38,938.200	
TELEPERFORMANCE	421	223.700	94,177.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	1,455	148.400	215,922.000	
EURAZEO	303	42.640	12,919.920	
BANCO SABADELL	46,517	0.336	15,629.710	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	801	71.820	57,527.820	
FRAPORT AG	244	35.760	8,725.440	
HEINEKEN HOLDING NV-A	937	69.000	64,653.000	
INDITEX	8,295	23.380	193,937.100	
JC DECAUX SA	467	18.750	8,756.250	
ANDRITZ AG	442	30.640	13,542.880	
MAPFRE SA	6,736	1.638	11,033.560	
ESSILORLUXOTTICA	2,150	110.700	238,005.000	
SNAM SPA	16,686	4.003	66,794.050	
CREDIT AGRICOLE SA	9,536	7.178	68,449.400	
ENAGAS	2,422	20.440	49,505.680	
WENDEL	134	73.950	9,909.300	
WIRECARD AG	882	84.210	74,273.220	
TENARIS SA	2,870	6.178	17,730.860	
TELECOM ITALIA SPA	114,757	0.342	39,246.890	
TELECOM ITALIA-RNC	34,357	0.345	11,853.160	

ATLANTIA SPA	3,899	13.310	51,895.690	
ILIAD SA	166	144.250	23,945.500	
PROXIMUS	901	18.000	16,218.000	
SES FDR	3,721	5.666	21,083.180	
TERNA SPA	13,278	5.650	75,020.700	
BIOMERIEUX	258	118.300	30,521.400	
GRIFOLS SA	2,529	29.100	73,593.900	
FERROVIAL SA	3,419	22.160	75,765.040	
LANXESS AG	661	45.810	30,280.410	
NESTE OYJ	3,175	30.980	98,361.500	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	915	15.750	14,411.250	
RECORDATI SPA	656	40.910	26,836.960	
GALAPAGOS NV	365	209.700	76,540.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	4,480	7.030	31,494.400	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	382	128.350	49,029.700	
KONE OYJ	2,566	56.100	143,952.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	197	221.800	43,694.600	
ENGIE	12,709	9.690	123,150.210	
ALSTOM	1,492	35.230	52,563.160	
TELENET GROUP HOLDING NV	340	34.380	11,689.200	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	1,087	9.420	10,239.540	
ELECTRICITE DE FRANCE	4,762	7.128	33,943.530	
IPSEN SA	227	66.450	15,084.150	
DEUTSCHE WOHNEN	2,928	38.050	111,410.400	
ARKEMA SA	600	74.700	44,820.000	
LEGRAND SA	2,235	57.660	128,870.100	
UNILEVER NV	11,222	44.700	501,623.400	
ADP	251	80.200	20,130.200	
ORION OYJ	646	45.300	29,263.800	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	4,339	10.380	45,038.820	
SYMRISE AG	860	93.600	80,496.000	
SCOR SE	1,438	24.320	34,972.160	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1,825	28.720	52,414.000	
PRYSMIAN SPA	2,514	17.415	43,781.310	
CAIXABANK	29,833	1.641	48,955.950	
BUREAU VERITAS SA	2,410	18.430	44,416.300	
GETLINK	3,377	11.040	37,282.080	
SUEZ SA	1,514	10.150	15,367.100	
AMADEUS IT GROUP SA	3,308	39.940	132,121.520	
BRENNTAG AG	1,210	43.320	52,417.200	
EVONIK INDUSTRIES AG	2,043	21.980	44,905.140	
EDENRED	1,764	37.810	66,696.840	
BANKIA SA	7,806	0.910	7,103.460	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	7,089	2.600	18,431.400	

	KION GROUP AG	418	45.010	18,814.180	
	VONOVIA SE	4,011	48.620	195,014.820	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	11,123	1.637	18,208.350	
	KNORR-BREMSE AG	384	81.140	31,157.760	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	801	40.980	32,824.980	
	FERRARI NV	987	145.650	143,756.550	
	METRO AG	985	7.550	7,436.750	
	CNH INDUSTRIAL NV	5,110	4.969	25,391.590	
	AROUNDTOWN SA	7,207	5.092	36,698.040	
	AIB GROUP PLC	5,183	0.993	5,146.710	
	MONCLER SPA	1,164	33.290	38,749.560	
	PROSUS NV	3,710	70.860	262,890.600	
	WORLDLINE SA	1,008	65.500	66,024.000	
	NN GROUP NV	2,094	25.830	54,088.020	
	FINECOBANK SPA	2,918	9.436	27,534.240	
	ZALANDO SE	1,138	53.500	60,883.000	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	6,865	7.600	52,174.000	
	AENA SME SA	528	108.900	57,499.200	
	CELLNEX TELECOM SAU	2,135	48.980	104,572.300	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	905	97.980	88,671.900	
	ABN AMRO BANK NV	3,503	6.710	23,505.130	
	EXOR NV	946	47.700	45,124.200	
	ALTICE EUROPE NV	5,378	3.663	19,699.610	
	COVESTRO AG	1,533	30.650	46,986.450	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	5,388	39.490	212,772.120	
	POSTE ITALIANE SPA	3,140	7.228	22,695.920	
	AMUNDI SA	368	59.850	22,024.800	
	ADYEN NV	82	953.600	78,195.200	
	PIRELLI & C SPA	2,542	3.700	9,405.400	
	UNIPER SE	1,089	24.540	26,724.060	
	DELIVERY HERO SE	979	85.720	83,919.880	
ユーロ　小計		1,509,586		24,794,322.930 (2,860,273,093)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	1,800	80.900	145,620.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	11,000	16.120	177,320.000	
	BANK OF EAST ASIA	6,657	15.860	105,580.020	
	CLP HOLDINGS LTD	12,296	79.950	983,065.200	
	PCCW LTD	25,000	4.750	118,750.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	3,814	45.300	172,774.200	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	9,251	246.400	2,279,446.400	
	MTR CORP	12,441	42.850	533,096.850	
	HANG SENG BANK LTD	5,696	134.000	763,264.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	11,522	30.250	348,540.500	

	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	9,820	50.100	491,982.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	76,282	13.720	1,046,589.040	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	14,904	51.100	761,594.400	
	KERRY PROPERTIES LTD	3,500	21.250	74,375.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	27,495	23.950	658,505.250	
	NWS HOLDINGS LTD	9,000	7.690	69,210.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	4,500	12.680	57,060.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	52,000	9.040	470,080.000	
	SINO LAND CO	29,800	10.700	318,860.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	11,565	102.500	1,185,412.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	3,520	48.650	171,248.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	11,156	63.950	713,426.200	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	28.900	115,600.000	
	WHEELOCK & CO LTD	8,144	56.950	463,800.800	
	SJM HOLDINGS LTD	12,000	7.690	92,280.000	
	WYNN MACAU LTD	9,553	13.480	128,774.440	
	AIA GROUP LTD	91,889	69.200	6,358,718.800	
	HKT TRUST / HKT LTD	34,136	12.560	428,748.160	
	SANDS CHINA LTD	20,200	30.700	620,140.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	10,200	21.200	216,240.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	9,385	33.000	309,705.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	16,500	8.000	132,000.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	10,700	21.200	226,840.000	
	WH GROUP LTD	78,000	7.160	558,480.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	21,113	55.950	1,181,272.350	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	21,363	48.150	1,028,628.450	
香港・ドル　小計		700,202		23,507,027.560 (322,516,418)	
合計		8,382,716		27,594,088,808 (27,594,088,808)	

（２）株式以外の有価証券

令和2年5月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	7,062.000	61,439.400	
		GOODMAN GROUP	13,462.000	189,948.820	
		GPT GROUP	11,931.000	46,172.970	
		MIRVAC GROUP	21,917.000	47,779.060	
		SCENTRE GROUP	36,515.000	77,411.800	

		STOCKLAND	15,847.000	43,420.780	
		VICINITY CENTRES	35,904.000	48,829.440	
	オーストラリア・ドル　小計		142,638.000	515,002.270 (35,751,458)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	24,272.000	71,845.120	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	21,681.000	34,255.980	
		CAPITALAND MALL TRUST	13,900.000	25,576.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	14,100.000	27,072.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	13,100.000	17,947.000	
	シンガポール・ドル　小計		87,053.000	176,696.100 (13,315,818)	
投資信託受益証券　合計			229,691	49,067,276 (49,067,276)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	4,066.000	51,109.620	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	923.000	139,825.270	
		AMERICAN TOWER CORP	3,354.000	789,028.500	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	10,589.000	64,487.010	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,022.000	163,969.680	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,102.000	94,606.700	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	769.000	67,102.940	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	3,156.000	488,201.640	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,003.000	298,507.090	
		DUKE REALTY TRUST	2,996.000	99,557.080	
		EQUINIX INC	648.000	437,620.320	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,468.000	89,136.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	2,701.000	170,298.050	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	452.000	112,575.120	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,024.000	90,286.080	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	670.000	50,243.300	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3,918.000	91,877.100	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	4,826.000	53,327.300	
		INVITATION HOMES INC	4,384.000	107,890.240	
		IRON MOUNTAIN INC	2,306.000	56,612.300	
		KIMCO REALTY	3,334.000	33,506.700	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	3,874.000	65,741.780	
		MID AMERICA	996.000	113,295.000	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,410.000	43,963.800	

		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	1,699.000	44,887.580	
		PROLOGIS INC	5,580.000	491,430.600	
		PUBLIC STORAGE	1,133.000	207,916.830	
		REALTY INCOME CORP	2,294.000	124,816.540	
		REGENCY CENTERS CORP	1,001.000	39,159.120	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	859.000	245,785.670	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	2,316.000	132,012.000	
		SL GREEN	701.000	32,764.740	
		SUN COMMUNITIES INC	730.000	95,608.100	
		UDR INC	2,464.000	93,237.760	
		VENTAS INC	2,748.000	74,415.840	
		VEREIT INC	9,014.000	47,503.780	
		VICI PROPERTIES INC	3,569.000	59,138.330	
		VORNADO REALTY TRUST	1,100.000	41,459.000	
		WELLTOWER INC	3,021.000	126,882.000	
		WEYERHAEUSER CO	5,751.000	107,141.130	
		WP CAREY INC	1,492.000	90,907.560	
	アメリカ・ドル　小計		107,463.000	5,827,836.160 (619,848,654)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	8,045.000	31,295.050	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	6,057.000	38,994.960	
		SEGRO PLC	8,155.000	67,066.720	
	イギリス・ポンド　小計		22,257.000	137,356.730 (18,095,376)	
	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	371.000	17,867.360	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,227.000	15,963.270	
		H & R REAL ESTATE INVESTMENT	890.000	8,090.100	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	957.000	14,077.470	
		SMARTCENTRES REIT	439.000	8,674.640	
	カナダ・ドル　小計		3,884.000	64,672.840 (4,935,184)	
	ユーロ	COVIVIO	403.000	21,298.550	
		GECINA SA	282.000	32,176.200	
		ICADE	206.000	13,781.400	
		KLEPIERRE	1,688.000	28,628.480	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	996.000	49,859.760	
	ユーロ　小計		3,575.000	145,744.390 (16,813,073)	
	香港・ドル	LINK REIT	14,916.000	1,020,254.400	
	香港・ドル　小計		14,916.000	1,020,254.400 (13,997,890)	
投資証券　合計			152,095	673,690,177 (673,690,177)	

合計		722,757,453 (722,757,453)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率（%）	組入投資信託受益証券時価比率（%）	組入投資証券時価比率（%）	有価証券の合計金額に対する比率（%）
アメリカ・ドル	株式	608銘柄	66.72	－	－	71.92
	投資証券	41銘柄	－	－	2.09	
イギリス・ポンド	株式	92銘柄	4.80	－	－	5.08
	投資証券	3銘柄	－	－	0.06	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.11	－	－	0.11
オーストラリア・ドル	株式	62銘柄	1.91	－	－	2.12
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.12	－	
カナダ・ドル	株式	81銘柄	3.28	－	－	3.44
	投資証券	5銘柄	－	－	0.02	
シンガポール・ドル	株式	20銘柄	0.35	－	－	0.41
	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.04	－	
スイス・フラン	株式	39銘柄	3.43	－	－	3.58
スウェーデン・クローナ	株式	32銘柄	0.89	－	－	0.93
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.73	－	－	0.76
ニュージーランド・ドル	株式	8銘柄	0.10	－	－	0.11
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	0.17	－	－	0.18
ユーロ	株式	236銘柄	9.66	－	－	10.16
	投資証券	5銘柄	－	－	0.06	
香港・ドル	株式	36銘柄	1.09	－	－	1.19
	投資証券	1銘柄	－	－	0.05	

（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、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、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6期中間計算期間（2020年5月9日から2020年11月8日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【コア資産形成ファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2020年5月8日現在	第6期中間計算期間末 2020年11月8日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	－	621,406
コール・ローン	25,206,102	15,335,127
親投資信託受益証券	410,580,829	462,290,660
流動資産合計	435,786,931	478,247,193
資産合計	435,786,931	478,247,193
負債の部		
流動負債		
未払解約金	405,974	－
未払受託者報酬	93,526	102,161
未払委託者報酬	2,011,614	2,197,199
未払利息	－	32
その他未払費用	8,505	9,106
流動負債合計	2,519,619	2,308,498
負債合計	2,519,619	2,308,498
純資産の部		
元本等		
元本	438,357,789	477,900,946
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△5,090,477	△1,962,251
（分配準備積立金）	5,343,733	4,837,603
元本等合計	433,267,312	475,938,695
純資産合計	433,267,312	475,938,695
負債純資産合計	435,786,931	478,247,193

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自　2019年5月9日 至　2019年11月8日	第6期中間計算期間 自　2020年5月9日 至　2020年11月8日
営業収益		
受取利息	6	－
有価証券売買等損益	8,924,331	5,709,831
営業収益合計	8,924,337	5,709,831
営業費用		
支払利息	2,409	3,110
受託者報酬	88,985	102,161
委託者報酬	1,913,297	2,197,199
その他費用	8,386	9,106
営業費用合計	2,013,077	2,311,576
営業利益又は営業損失（△）	6,911,260	3,398,255
経常利益又は経常損失（△）	6,911,260	3,398,255
中間純利益又は中間純損失（△）	6,911,260	3,398,255
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（△）	585,041	335,161
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,746,516	△5,090,477
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,224,138	511,296
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	511,296
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,224,138	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	915,674	446,164
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	915,674	－
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	446,164
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	13,381,199	△1,962,251

（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6期中間計算期間 自　2020年5月9日 至　2020年11月8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。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第5期 2020年5月8日現在	第6期中間計算期間末 2020年11月8日現在
１．　期首元本額	377,033,265円	438,357,789円
期中追加設定元本額	184,043,588円	85,862,687円
期中一部解約元本額	122,719,064円	46,319,530円
２．　受益権の総数	438,357,789口	477,900,946口
３．　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,090,477円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,962,251円であります。

（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5期 2020年5月8日現在	第6期中間計算期間末 2020年11月8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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第5期 2020年5月8日現在	第6期中間計算期間末 2020年11月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9884円 (9,884円)	0.9959円 (9,959円)

（参考）
当ファンドは、「ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド」受益証券及び「ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド」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。

ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年11月8日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	643,231,966
国債証券	114,324,219,800
地方債証券	7,030,978,144
特殊債券	7,723,985,819
社債券	4,350,544,900
未収利息	240,842,607
前払費用	8,853,352
流動資産合計	134,322,656,588
資産合計	134,322,656,588
負債の部	
流動負債	
未払解約金	63,090,000
未払利息	1,390
流動負債合計	63,091,390
負債合計	63,091,390
純資産の部	
元本等	
元本	107,414,682,944
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	26,844,882,254
元本等合計	134,259,565,198
純資産合計	134,259,565,198
負債純資産合計	134,322,656,588

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2020年5月9日 至　2020年11月8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	2020年11月8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	126,035,115,497円
同期中追加設定元本額	7,803,816,145円
同期中一部解約元本額	26,424,248,698円
元本の内訳	
ファンド名	
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	292,736,967円
コア資産形成ファンド	253,829,622円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	47,356,544,500円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	43,893,920,351円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	10,100,603,753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］	5,517,047,751円
計	107,414,682,944円
２．　受益権の総数	107,414,682,944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	2020年11月8日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2020年11月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2499円 (12,499円)

ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年11月8日現在
資産の部	
流動資産	
預金	895,852,271
コール・ローン	28,785,339
国債証券	23,423,390,203
派生商品評価勘定	243
未収利息	121,734,685
前払費用	18,120,453
差入委託証拠金	46,314,644
流動資産合計	24,534,197,838
資産合計	24,534,197,838
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,085
未払金	457,017,771
未払解約金	53,500
未払利息	62
流動負債合計	457,077,418
負債合計	457,077,418
純資産の部	
元本等	
元本	17,713,666,009
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,363,454,411
元本等合計	24,077,120,420
純資産合計	24,077,120,420
負債純資産合計	24,534,197,838

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2020年5月9日 至　2020年11月8日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2020年11月8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	11,785,412,583円
同期中追加設定元本額	10,110,639,328円
同期中一部解約元本額	4,182,385,902円
元本の内訳	
ファンド名	
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	72,113,515円
コア資産形成ファンド	62,315,872円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	2,227,591,789円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	943,449,699円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	11,096,877,853円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,311,317,281円
計	17,713,666,009円
２．　受益権の総数	17,713,666,009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	2020年11月8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	2020年11月8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				
買建	16,660,000	－	16,654,158	△5,842
アメリカ・ドル	2,870,000	－	2,870,000	－
デンマーク・クローネ	2,980,000	－	2,979,637	△363
ノルウェー・クローネ	5,140,000	－	5,139,087	△913
ポーランド・ズロチ	2,960,000	－	2,955,191	△4,809
ユーロ	2,710,000	－	2,710,243	243
合計	16,660,000	－	16,654,158	△5,842

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2020年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.3592円
（1万口当たり純資産額）	(13,592円)

ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年11月8日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	592,178,336
株式	39,293,380,800
派生商品評価勘定	21,801,520
未収入金	843,862
未収配当金	382,944,364
差入委託証拠金	43,500,000
流動資産合計	40,334,648,882
資産合計	40,334,648,882
負債の部	
流動負債	
前受金	14,930,000
未払金	1,320
未払解約金	43,094,000
未払利息	1,280
流動負債合計	58,026,600
負債合計	58,026,600
純資産の部	
元本等	
元本	19,743,819,553
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	20,532,802,729
元本等合計	40,276,622,282
純資産合計	40,276,622,282
負債純資産合計	40,334,648,882

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2020年5月9日 至　2020年11月8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	2020年11月8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	20,061,470,270円
同期中追加設定元本額	7,459,947,397円
同期中一部解約元本額	7,777,598,114円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM　ＴＯＰＩＸオープン	4,004,745,108円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	8,988,586,686円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	20,289,119円
コア資産形成ファンド	17,032,177円
MHAM　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	104,126,743円
MHAM動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	3,057,454,140円
MHAM日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	2,686,630,882円
計	19,743,819,553円
２．　受益権の総数	19,743,819,553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	2020年11月8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一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2020年11月8日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 　先物取引 　　買建	908,060,000	－	929,880,000	21,820,000
合計	908,060,000	－	929,880,000	21,820,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2020年11月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0400円 (20,400円)

ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年11月8日現在
資産の部	
流動資産	
預金	556,910,322
コール・ローン	22,474,113
株式	32,858,742,906
投資信託受益証券	65,529,450
投資証券	706,055,309
派生商品評価勘定	35,474,611
未収入金	2,657,060
未収配当金	22,033,787
差入委託証拠金	312,077,714
流動資産合計	34,581,955,272
資産合計	34,581,955,272
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,750
未払解約金	1,388,000
未払利息	48
流動負債合計	1,389,798
負債合計	1,389,798
純資産の部	
元本等	
元本	16,144,479,543
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	18,436,085,931
元本等合計	34,580,565,474
純資産合計	34,580,565,474
負債純資産合計	34,581,955,272

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2020年5月9日 至　2020年11月8日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2020年11月8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		16,518,425,621円
同期中追加設定元本額		5,026,544,455円
同期中一部解約元本額		5,400,490,533円
元本の内訳		
ファンド名		
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞		13,665,590円
コア資産形成ファンド		11,947,278円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）		9,542,960,641円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド		288,704,848円

MHAM外国株式インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	20,683,568円
MHAM動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	2,070,087,832円
MHAM外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	4,196,429,786円
計	16,144,479,543円
２．　受益権の総数	16,144,479,543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	2020年11月8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	2020年11月8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	17,145,450	－	17,147,200	△1,750
ユーロ	17,145,450	－	17,147,200	△1,750
合計	17,145,450	－	17,147,200	△1,750

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

れている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2020年11月8日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	867,568,529	－	903,043,140	35,474,611
合計	867,568,529	－	903,043,140	35,474,611

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2020年11月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1419円 (21,419円)

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2020年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	484,022,616円
Ⅱ　負債総額	2,461,812円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	481,560,804円
Ⅳ　発行済数量	479,605,472口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0041円

（参考）

ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	132,743,559,779円
Ⅱ　負債総額	2,434,211,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	130,309,348,779円
Ⅳ　発行済数量	104,336,723,269口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2489円

ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	23,470,057,606円
Ⅱ　負債総額	4,946,700円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	23,465,110,906円
Ⅳ　発行済数量	17,118,864,345口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3707円

ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド

2020年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	44,437,419,702円
Ⅱ　負債総額	53,500,780円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	44,383,918,922円
Ⅳ　発行済数量	20,560,847,248口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1587円

ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	37,459,364,002円
Ⅱ　負債総額	124,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	37,459,240,002円
Ⅳ　発行済数量	16,566,058,507口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2612円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（1）資本金の額（2020年11月30日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

（2）会社の機構（2020年11月30日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,424,219,612,532
追加型株式投資信託	853	14,458,430,616,466
単位型公社債投資信託	34	77,591,955,040
単位型株式投資信託	196	1,282,801,429,704
合計	1,109	17,243,043,613,742

３【委託会社等の経理状況】

１．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

２．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千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35期事業年度（自2019年4月1日至2020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36期中間会計期間（自2020年4月1日至2020年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		第34期 （2019年3月31日現在）		第35期 （2020年3月31日現在）
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		41,087,475		32,932,013
金銭の信託		18,773,228		28,548,165
有価証券		153,518		996
未収委託者報酬		12,438,085		11,487,393
未収運用受託報酬		3,295,109		4,674,225
未収投資助言報酬		327,064		331,543
未収収益		56,925		11,674
前払費用		573,874		480,129
その他		491,914		2,815,351
流動資産計		77,197,195		81,281,494
固定資産				
有形固定資産		1,461,316		1,278,455
建物	※1	1,096,916	※1	1,006,793
器具備品	※1	364,399	※1	270,768
建設仮勘定		―		894
無形固定資産		2,411,540		3,524,781
ソフトウエア		885,545		3,299,065
ソフトウエア仮勘定		1,522,040		221,784
電話加入権		3,931		3,931
電信電話専用施設利用権		23		―
投資その他の資産		9,269,808		9,482,127
投資有価証券		1,611,931		261,361
関係会社株式		4,499,196		5,299,196
長期差入保証金		1,312,328		1,302,402
繰延税金資産		1,748,459		2,508,004
その他		97,892		111,162
固定資産計		13,142,665		14,285,364
資産合計		90,339,861		95,566,859

（単位：千円）

	第34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	△7
評価・換算差額等計	846,755	△7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第34期 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）		第35期 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

（単位：千円）

	第34期 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）		第35期 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	1,749		4,440	
受取配当金	73,517		11,185	
時効成立分配金・償還金	8,582		49,164	
投資信託償還益	－		5,528	
受取負担金	177,066		297,886	
雑収入	24,919		7,394	
時効後支払損引当金戻入額	19,797		3,473	
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損	17,542		19,750	
投資信託償還損	－		1	
金銭の信託運用損	175,164		169,505	
システム解約料	－		31,680	
雑損失	5,659		104	
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益	353,644		1,169,758	
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	※1　19,121		※1　16,085	
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		△71,767		△385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

（３）【株主資本等変動計算書】

第34期（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：千円）

	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	研究開発積立金	運用責任準備積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									△12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							△300,000		
運用責任準備積立金の取崩								△200,000	
繰越利益剰余金の取崩									△6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	7,100,000	△300,000	△200,000	△5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	－	－	14,146,079

	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	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	△12,520,000	△12,520,000			△12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	△300,000	△300,000			△300,000
運用責任準備積立金の取崩	△200,000	△200,000			△200,000
繰越利益剰余金の取崩	△6,600,000	△6,600,000			△6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		－	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

第35期（自　2019年4月1日　至　2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							△11,280,000	△11,280,000	△11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									―
当期変動額合計	―	―	―	―	―	―	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	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	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			△11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△846,763	△846,763	△846,763
当期変動額合計	△846,763	△846,763	2,878,247
当期末残高	△7	△7	71,227,333

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：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） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 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。 (2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．引当金の計上基準	(1) 賞与引当金は、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事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金は、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事業年度に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、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計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

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

（千円）

	第34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

（損益計算書関係）

※1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

（株主資本等変動計算書関係）

第34期（自 2018年4月1日 至 2019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（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21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（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類株式					

第35期（自 2019年4月1日 至 2020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（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年6月20日定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21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

2020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（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月17日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020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。

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第34期（2019年3月31日現在）

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
（1）現金・預金	41,087,475	41,087,475	－
（2）金銭の信託	18,773,228	18,773,228	－
（3）未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	－
（4）未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	－
（5）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	1,488,684	1,488,684	－
資産計	77,082,582	77,082,582	－
（1）未払手数料	4,883,723	4,883,723	－
負債計	4,883,723	4,883,723	－

第35期（2020年3月31日現在）

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
（1）現金・預金	32,932,013	32,932,013	－
（2）金銭の信託	28,548,165	28,548,165	－
（3）未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	－
（4）未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	－
（5）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	2,988	2,988	－
資産計	77,644,787	77,644,787	－
（1）未払手数料	4,582,140	4,582,140	－
負債計	4,582,140	4,582,140	－

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（2）金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（5）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負　債

（1）未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
①非上場株式	276,764	259,369
②関係会社株式	4,499,196	5,299,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）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34期（2019年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
（1）現金・預金	41,087,475	―	―	―
（2）金銭の信託	18,773,228	―	―	―
（3）未収委託者報酬	12,438,085	―	―	―
（4）未収運用受託報酬	3,295,109	―	―	―
（5）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	―

第35期（2020年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
（1）現金・預金	32,932,013	―	―	―
（2）金銭の信託	28,548,165	―	―	―
（3）未収委託者報酬	11,487,393	―	―	―
（4）未収運用受託報酬	4,674,225	―	―	―
（5）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	―

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2．その他有価証券

第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

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			
①株式	1,326,372	111,223	1,215,148
②投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	3,990	4,000	△ 9
小計	3,990	4,000	△ 9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

（注）非上場株式（貸借対照表計上額276,764千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第35期（2020年3月31日現在）

（千円）

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			
①株式	―	―	―
②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			
①株式	―	―	―
②投資信託	2,988	3,000	△ 11
小計	2,988	3,000	△ 11
合計	2,988	3,000	△ 11

（注）非上場株式（貸借対照表計上額259,369千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

区分	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	394,222	353,644	－
投資信託	－	－	－

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

区分	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	1,298,377	1,169,758	－
投資信託	159,526	5,528	1

（注）投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、償還によるものであります。

（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

（千円）

	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	△10,147	18,448
退職給付の支払額	△158,018	△187,749
その他	438	△1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

（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

（千円）

	第34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	△150,568	△130,155
未認識過去勤務費用	△243,317	△173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	△3,640	△11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

（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34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～4.42%	1.00%～4.42%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額（一括償却資産）	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額（税法上）	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	－	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	－	－
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△321,067	－
繰延税金負債合計	△321,067	－
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

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

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間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a.発生したのれんの金額	76,224,837千円
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	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b.負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

（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	53,030,000千円
b.主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
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34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
流動資産	－千円	－千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	－千円	－千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

（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	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

（2）損益計算書項目

	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
営業収益	－千円	－千円
営業利益	△9,043,138千円	△8,954,439千円
経常利益	△9,043,138千円	△8,954,439千円
税引前当期純利益	△9,091,728千円	△9,111,312千円
当期純利益	△7,489,721千円	△7,536,465千円
1株当たり当期純利益	△187,243円04銭	△188,411円64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	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,241,252千円	5,149,555千円

（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。

（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34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）及び第35期（自 2019年4月1日 至 2020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。

（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34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

第35期（自 2019年4月1日 至 2020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34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第34期（自 2018年4月1日 至 2019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（千円）	科目	期末残高（千円）
						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	6,048,352	未払手数料	915,980
								子会社株式の取得	1,270,000	―	―
	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	10,215,017	未払手数料	1,670,194

第35期（自 2019年4月1日 至 2020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（千円）	科目	期末残高（千円）
						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	5,793,912	未払手数料	1,112,061
	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	10,294,840	未払手数料	1,231,431

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）子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

（注3）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34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
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	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

		第36期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		27,281,363
金銭の信託		25,870,423
有価証券		996
未収委託者報酬		13,747,204
未収運用受託報酬		3,023,356
未収投資助言報酬		304,673
未収収益		24,940
前払費用		757,672
その他		2,912,168
流動資産計		73,922,799
固定資産		
有形固定資産		1,199,340
建物	※1	961,771
器具備品	※1	237,569
無形固定資産		3,660,076
ソフトウエア		3,099,921
ソフトウエア仮勘定		556,224
電話加入権		3,931
投資その他の資産		9,943,868
投資有価証券		261,361
関係会社株式		5,299,196
長期差入保証金		1,295,930
繰延税金資産		2,294,343
その他		793,037
固定資産計		14,803,286
資産合計		88,726,085

（単位：千円）

	第36期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	1,297,202
未払金	5,820,782
未払収益分配金	899
未払償還金	19,850
未払手数料	5,549,722
その他未払金	250,310
未払費用	7,902,650
未払法人税等	2,901,506
未払消費税等	824,900
前受収益	20,779
賞与引当金	1,126,713
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	19,928,648
固定負債	
退職給付引当金	2,207,043
時効後支払損引当金	156,886
固定負債計	2,363,929
負債合計	22,292,578
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	44,880,558
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	44,757,265
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	13,077,265
株主資本計	66,433,515
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△8
評価・換算差額等計	△8
純資産合計	66,433,506
負債・純資産合計	88,726,085

(2) 中間損益計算書

（単位：千円）

	第36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
営業収益		
委託者報酬	40,520,928	
運用受託報酬	6,813,891	
投資助言報酬	548,146	
その他営業収益	773,786	
営業収益計		48,656,752
営業費用		
支払手数料	16,685,574	
広告宣伝費	116,359	
調査費	12,452,140	
調査費	4,305,114	
委託調査費	8,147,025	
委託計算費	269,176	
営業雑経費	450,999	
通信費	24,247	
印刷費	314,201	
協会費	20,394	
諸会費	32,852	
支払販売手数料	59,302	
営業費用計		29,974,250
一般管理費		
給料	4,693,004	
役員報酬	75,939	
給料・手当	4,496,351	
賞与	120,714	
交際費	5,108	
寄付金	6,331	
旅費交通費	20,383	
租税公課	277,754	
不動産賃借料	734,008	
退職給付費用	267,068	
固定資産減価償却費	※1 534,020	
福利厚生費	17,379	
修繕費	511	
賞与引当金繰入額	1,126,713	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	139	
事務委託費	1,899,643	
事務用消耗品費	35,787	
器具備品費	265	
諸経費	66,792	
一般管理費計		9,719,026
営業利益		8,963,474

（単位：千円）

	第36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	17,653	
受取配当金	2,356	
時効成立分配金・償還金	176	
時効後支払損引当金戻入額	16,343	
為替差益	8,484	
金銭の信託運用損益	1,367,091	
雑収入	1,361	
営業外収益計		1,413,467
経常利益		10,376,942
特別損失		
固定資産除却損	0	
特別損失計		0
税引前中間純利益		10,376,942
法人税、住民税及び事業税		2,957,106
法人税等調整額		213,661
法人税等合計		3,170,767
中間純利益		7,206,174

(3) 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

	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	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090
当中間期変動額							
剰余金の配当							△12,000,000
中間純利益							7,206,174
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	－	－	－	－	－	－	△4,793,825
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	13,077,265

	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	49,674,383	71,227,341	△7	△7	71,227,333
当中間期変動額					
剰余金の配当	△12,000,000	△12,000,000			△12,000,000
中間純利益	7,206,174	7,206,174			7,206,174
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	△4,793,825	△4,793,825	△0	△0	△4,793,826
当中間期末残高	44,800,558	66,433,515	△8	△8	66,433,506

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：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） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物　…　6～18年 器具備品　…　2～20年 (2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第36期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）
※1.有形固定資産の減価償却累計額	建物　…　365,042千円 器具備品　…　980,577千円

（中間損益計算書関係）

項目	第36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）
※1.減価償却実施額	有形固定資産　…　79,115千円 無形固定資産　…　454,905千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類株式				

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

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第36期中間会計期間末（2020年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

2020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。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
（1）現金・預金	27,281,363	27,281,363	－
（2）金銭の信託	25,870,423	25,870,423	－
（3）未収委託者報酬	13,747,204	13,747,204	－
（4）未収運用受託報酬	3,023,356	3,023,356	－
（5）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,987	2,987	－
資産計	69,925,335	69,925,335	－
（1）未払手数料	5,549,722	5,549,722	－
負債計	5,549,722	5,549,722	－

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（2）金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（5）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負　債

(1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 （千円）
①非上場株式	259,369
②関係会社株式	5,299,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(有価証券関係)

第36期中間会計期間末
(2020年9月30日現在)

1.子会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額5,299,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2.その他有価証券

区　分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
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	2,987	3,000	△12
小計	2,987	3,000	△12
合計	2,987	3,000	△12

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額259,369千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（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

2020年4月1日から2020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**	**144,212,500千円**
取得原価		**144,212,500千円**

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a.発生したのれんの金額	**76,224,837千円**
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**	**40,451,657千円**
	うち現金・預金	**11,605,537千円**
	うち金銭の信託	**11,792,364千円**
b.負債の額	**負債合計**	**9,256,209千円**
	うち未払手数料及び未払費用	**4,539,592千円**

（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	**53,030,000千円**
b.主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	**53,030,000千円**
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	－千円
固定資産	90,405,440千円
資産合計	90,405,440千円
流動負債	－千円
固定負債	7,722,834千円
負債合計	7,722,834千円
純資産	82,682,605千円

（注）固定資産及び資産合計には、のれんの金額60,979,870千円及び顧客関連資産の金額32,301,694千円が含まれております。

（2）損益計算書項目

営業収益	－千円
営業利益	△4,411,813千円
経常利益	△4,411,813千円
税引前中間純利益	△4,411,813千円
中間純利益	△3,644,417千円
1株当たり中間純利益	△91,110円42銭

（注）営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,508,336千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。

（セグメント情報等）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,660,837円67銭
1株当たり中間純利益金額	180,154円36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36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）
中間純利益金額	7,206,174千円
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	7,206,174千円
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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2020年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社北都銀行	12,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社七十七銀行	24,658	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社三重銀行（※1）	15,295	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社（※1）	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社名古屋銀行	25,090	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社西京銀行	23,498	日本において銀行業務を営んでおります。
第一勧業信用組合	（※2）14,132	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ＯＫＢ証券株式会社（※1）	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2020年3月末日現在
（※1）新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。
（※2）出資の総額

２【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産を保管・管理し、受益権設定にかかる振替機関への通知等を行います。

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付けならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払い等を行います。

３【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率５％以上を記載します。

第３【その他】

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

- **金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨**
- **委託会社の金融商品取引業者登録番号**
- **詳細情報の入手方法**
  - **① 委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など**
  - **② 請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨**
- **目論見書の使用開始日**
- **届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。**
  - **① 届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法**
  - **② 届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日**
- **ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨**
- **投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨**
- **請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨**
- **「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載**

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

２０２０年5月２７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	山野　浩	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川　敬	印

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２０１９年４月１日から２０２０年３月３１日までの第３５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２０２０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。

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。

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）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和２年６月１９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　山 野 浩 印

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」に掲げられているコア資産形成ファンドの令和１年５月９日から令和２年５月８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、コア資産形成ファンドの令和２年５月８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。

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）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

２０２０年１１月２６日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　京　事　務　所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	丘本　正彦　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川　敬　印

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２０２０年４月１日から２０２１年３月３１日までの第３６期事業年度の中間会計期間（２０２０年４月１日から２０２０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２０２０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（２０２０年４月１日から２０２０年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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）上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

２０２０年１２月１８日

アセットマネジメントOne株式会社
取 締 役 会 御 中

EY新日本有限責任監査法人
東 京 事 務 所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 丘 本 正 彦 印

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」に掲げられているコア資産形成ファンドの２０２０年5月9日から２０２０年１１月８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、コア資産形成ファンドの２０２０年１１月８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（２０２０年5月9日から２０２０年１１月８日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注１）上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。