【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10月12日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　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】	マネックス資産設計ファンド＜育成型＞
【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】

マネックス資産設計ファンド＜育成型＞
（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。
なお、収益分配金の再投資については、各計算期間終了日の基準価額とします。
※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上１万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

＜基準価額の照会方法等＞

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）
・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※収益分配金の再投資については、1口単位となります。

※確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2021年10月13日から2022年4月11日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金自動けいぞく投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」に従って分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

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

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

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

②当ファンドの信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 世界の6資産（国内外の株式・債券・リート）に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

●各資産への投資は各資産の市場を代表する指数に連動する投資成果をめざすファンド（マザーファンド）を通じて行います。

投資対象のマザーファンド	ベンチマーク
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）

※リート（REIT）はReal Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。

※パッシブ・ファンドとは市場（インデックス）そのものに連動する投資成果をめざすファンドです。インデックス・ファンドとも呼ばれます。

※当ファンドはファミリーファンド方式により運用します。また、上記マザーファンドには運用管理費用（信託報酬）はかかりません。

2 基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。

●基本資産配分比率は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。

※基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。

※分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。また、為替リスクの観点から外貨建資産への基本配分比率は50%以下にしております*。

※時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。

※ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

*2021年7月末時点

3 購入時手数料、換金手数料がかからないノーロードファンドです。運用管理費用(信託報酬)は信託財産の純資産総額に対して年率0.55%(税抜0.50%)と、低水準に設定しました。

●換金価額は、基準価額から信託財産留保額(換金申込日の翌営業日の基準価額の0.3%)を差し引いた価額となります。

4 「育成型」(自動けいぞく投資専用)のファンドです。

信託財産の成長を重視します。分配金は、決算ごとに原則として経費控除後の利子・配当等収益の範囲内から支払われ、税引後、自動的に無手数料で全額再投資されます。

※決算は原則として毎年1月11日(休業日の場合は翌営業日。)です。

●将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

5 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

○商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

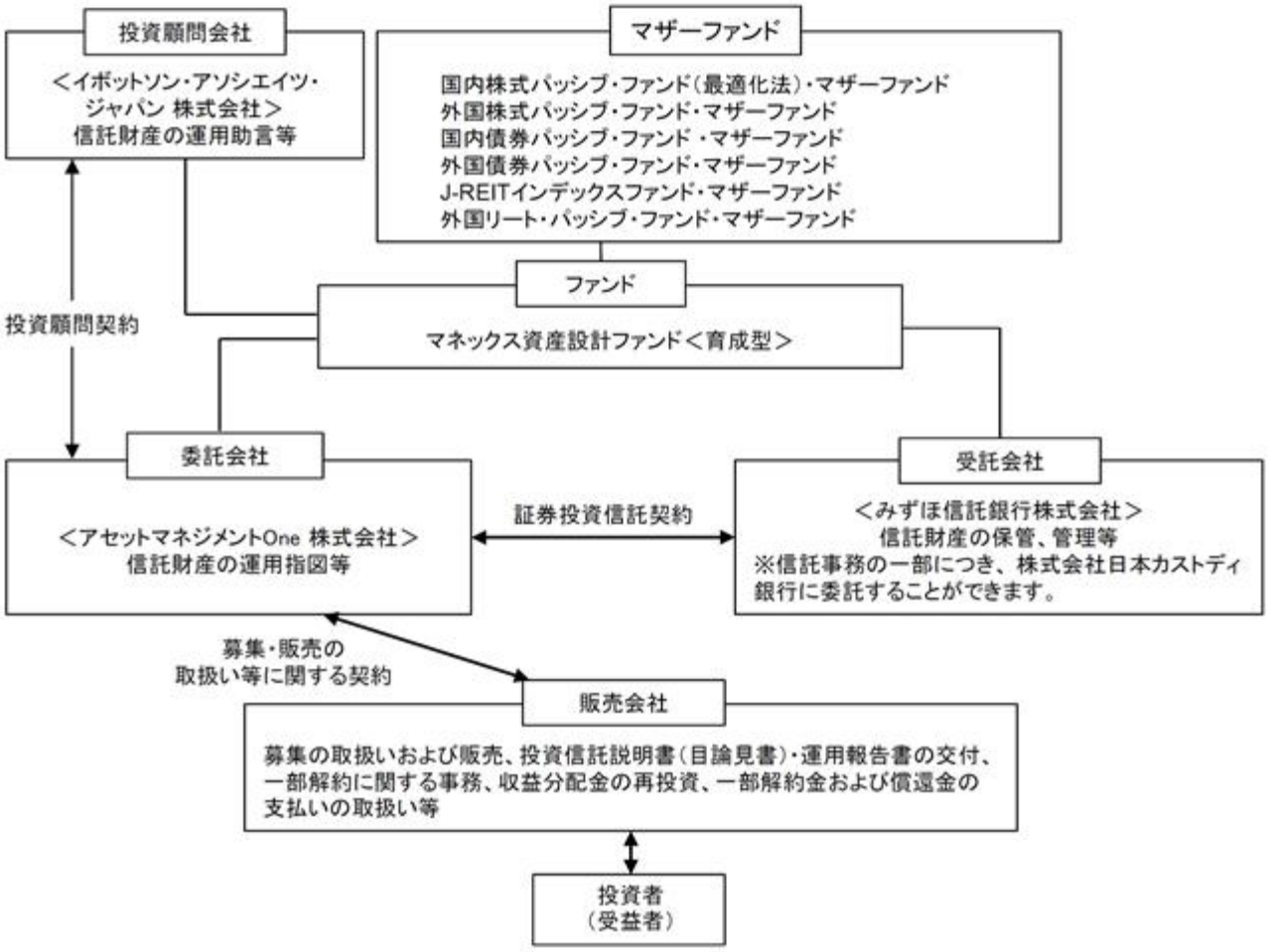
その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日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

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

（２）【ファンドの沿革】

2007年1月26日　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2016年4月13日　外国リートの投資対象マザーファンドを「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」から「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」へ変更
2018年10月12日　信託報酬率(税抜）を「年率0.95%」から「年率0.50%」に引き下げ

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

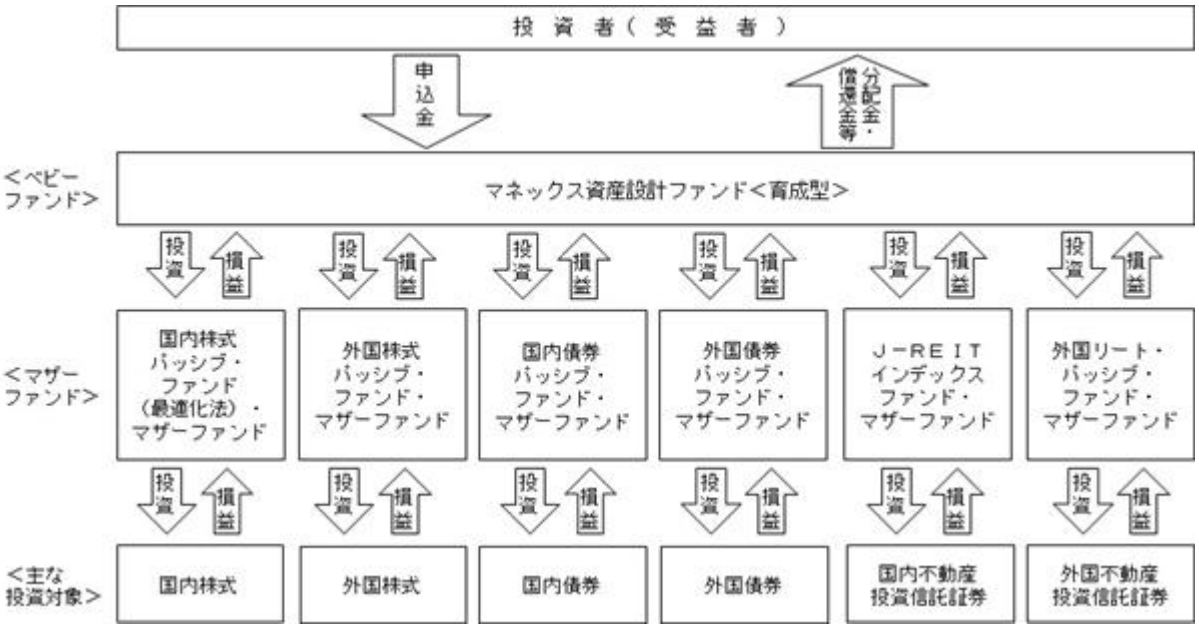
委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額

20億円（2021年7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

（2021年7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】

＜基本方針＞

この投資信託は、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

＜投資対象＞

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、Ｊ-ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド受益証券および外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

＜投資態度＞

①主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、Ｊ-ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンドおよび外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）の計6資産への分散投資を行います。

②基本資産配分は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。

③基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。

④基本資産配分比率については、分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

⑤実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

※リート（ＲＥＩＴ）とは
・リート（ＲＥＩＴ）とは、不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。（以下同じ。）
・ＲＥＩＴ（リート）とは、Real Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。なお、主に豪州市場に上場するリートについては、LPT（Listed Property Trust）と呼ばれる場合があります。
・リート（ＲＥＩＴ）は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くのリート（ＲＥＩＴ）は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、リート（ＲＥＩＴ）は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどをリート（ＲＥＩＴ）に投資する投資家が、配当金（もしくは分配金）として享受する仕組みになっています。

※投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

＜運用プロセス＞

・基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン（期待収益率）、リスク（標準偏差）、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の１つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。
・分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。
・決定した基本資産配分比率に基づき、6つのマザーファンドへ投資を行いポートフォリオを構築します。
・時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。
・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

（２）【投資対象】

1.投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

(2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

2.有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる(1)から(6)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ならびに(7)から(28)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) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

(2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(5) Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

(6) 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

(7) 株券または新株引受権証書

(8) 国債証券

(9) 地方債証券

(10)特別の法律により法人の発行する債券

(11)社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

(12)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。）

(13)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。）

(14)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。）

(15)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。）

(16)コマーシャル・ペーパー

(17)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

(18)外国または外国の者の発行する証券または証書で、(7)から(17)までの証券または証書の性質を有するもの

(19)投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）

(20)投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

(21)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。）

(22)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。）

(23)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。）

(24)外国法人が発行する譲渡性預金証書

(25)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。)

(26)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。)

(27)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

(28)外国の者に対する権利で上記(27)の有価証券の性質を有するもの

なお、(7)の証券または証書、(18)ならびに(23)の証券または証書のうち(7)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、(8)から(12)までの証券および(18)ならびに(23)の証券または証書のうち(8)から(12)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(19)の証券および(20)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

3.金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

(1) 預金

(2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

(3) コール・ローン

(4) 手形割引市場において売買される手形

(5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

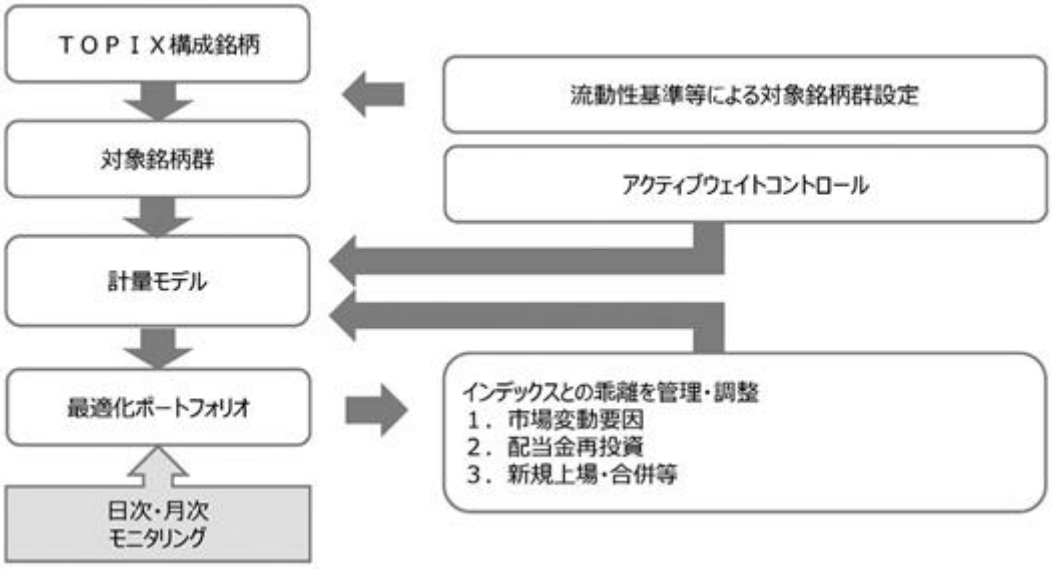
4.上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3.の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。（約款第16条第3項）

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	**国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。**
主な投資対象	**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。**

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めざして運用を行います。** **2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。** **3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。** **5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。** **＊東証市場再編に伴い、投資対象に関する記載を変更する約款変更を予定しております。約款変更日の2022年4月4日に「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更を行う予定です。**

	※①東証株価指数（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、利用など東証株価指数（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、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の停止または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、東証株価指数（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東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。** **④㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。** **⑤当マザーファンドおよび当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、当マザーファンドおよび当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、当マザーファンドおよび当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、委託会社または当マザーファンドおよび当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、東証株価指数（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、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当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。** **東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。**

運用プロセス	1)流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、ＴＯＰＩＸ採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 
主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ③外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

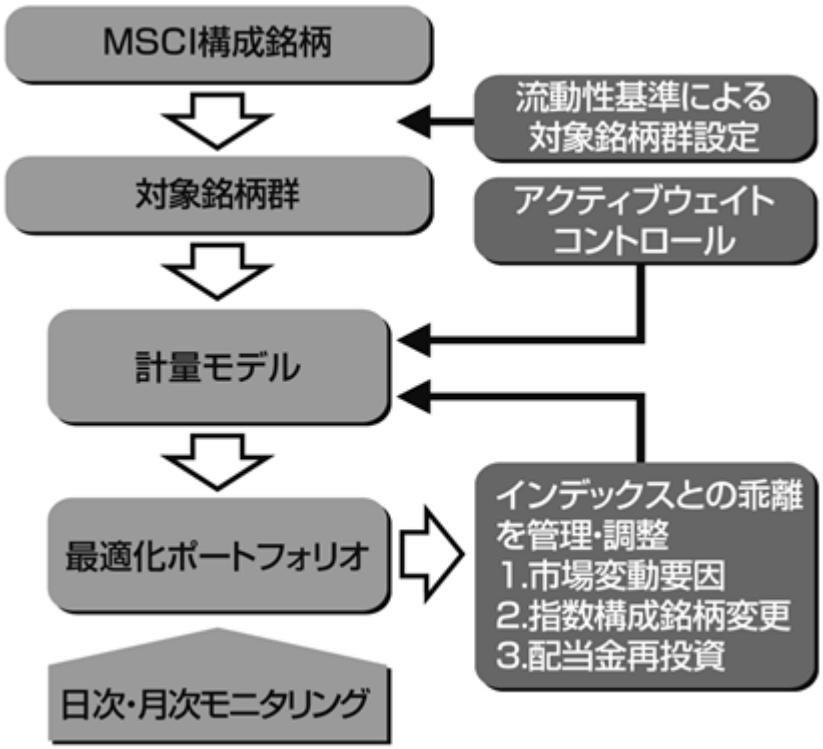
ファンド名	**外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。**
主な投資対象	**海外の株式を主要投資対象とします。**

投資態度	**1. 主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。**

※本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

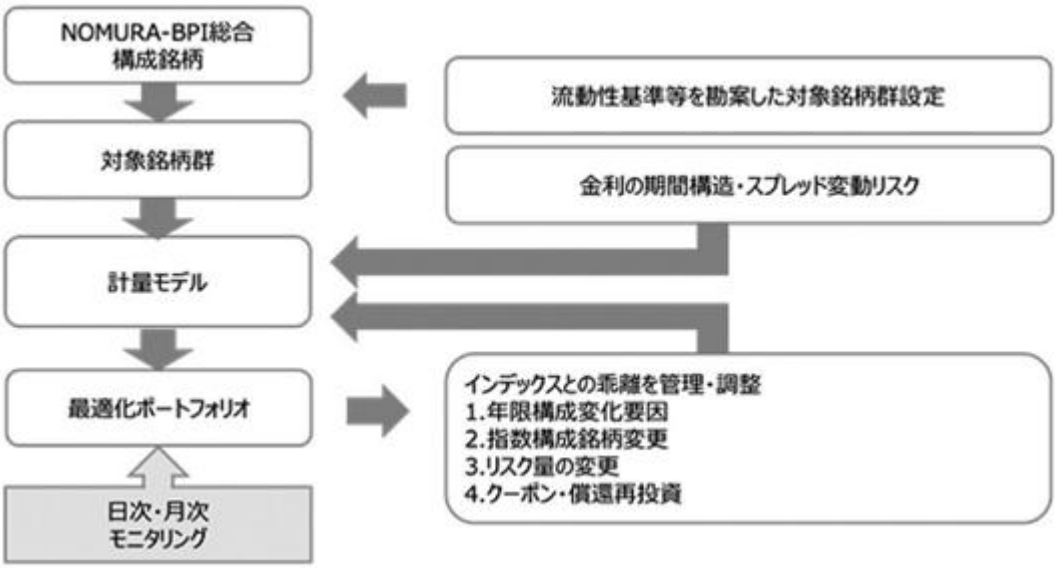
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、

	事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	**1)流動性基準による対象銘柄群設定** **取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。** **2)最適化法によるポートフォリオの構築** **インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。** **3)インデックスとの乖離を管理** **日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。** **インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。** **・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施** **・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施** **・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施** 

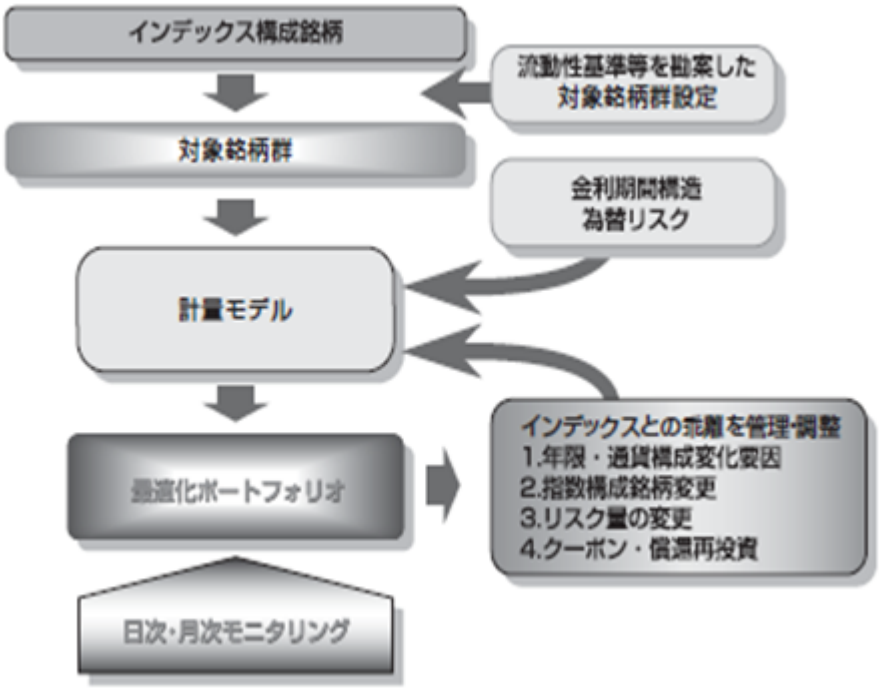
主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④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

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 ※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村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。

運用プロセス	1)流動性基準等による対象銘柄群設定 ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 1.債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2.金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1.、2.が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資 

主な投資制限	**①株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。** **②株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。** **③同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。** **④同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。** **⑤外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。** **⑥デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。** **⑦外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。** **⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。**

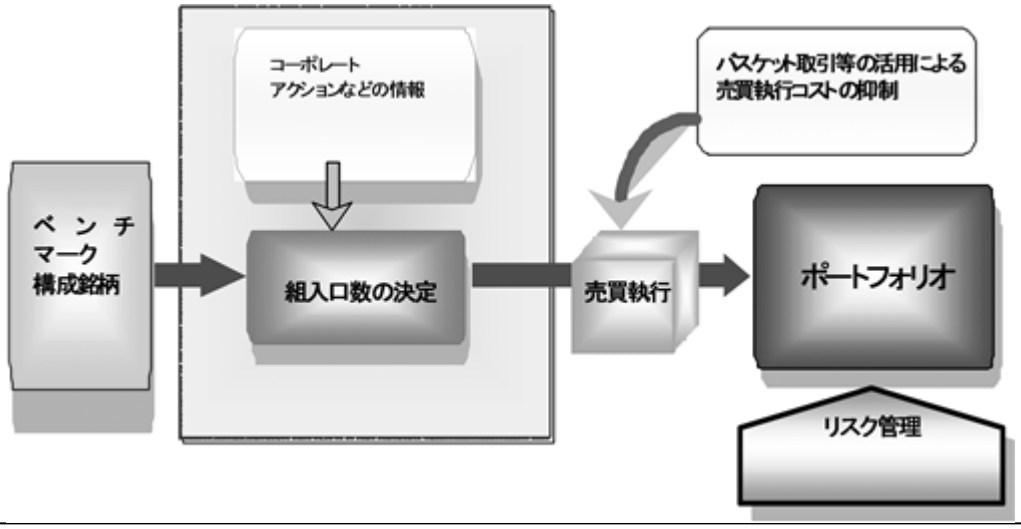
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 ※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。 このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

運用プロセス	1)流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資 

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

ファンド名	**Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。**
主な投資対象	**東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。**

投資態度	1.東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数※に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。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.但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。 ※①東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数の商標は、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、利用など東証ＲＥＩＴ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ指数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、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証ＲＥＩＴ指数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、東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証ＲＥＩＴ指数の指数値について、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、東証ＲＥＩＴ指数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、東証ＲＥＩＴ指数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当マザーファンドおよび当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、当マザーファンドおよび当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、当マザーファンドおよび当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、委託会社または当マザーファンドおよび当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、東証ＲＥＩＴ指数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、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当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。

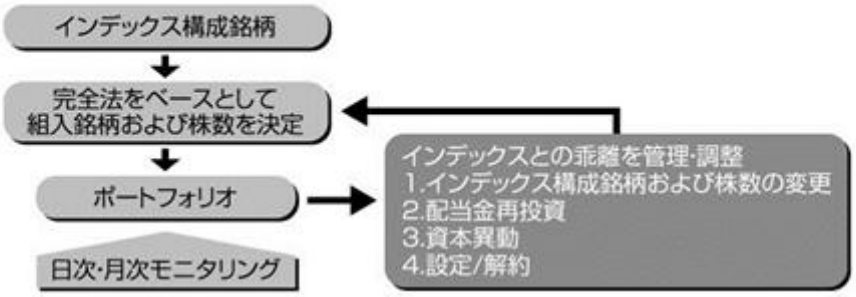
運用プロセス	・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 ③株式への投資は行いません。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	**外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。**
主な投資対象	**日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。** **※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。）とします。**

投資態度	**1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。**

※ＳＡＰ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor’s®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび／または特定の商標、サービスマーク、および／または商標名のライセンス供与です。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

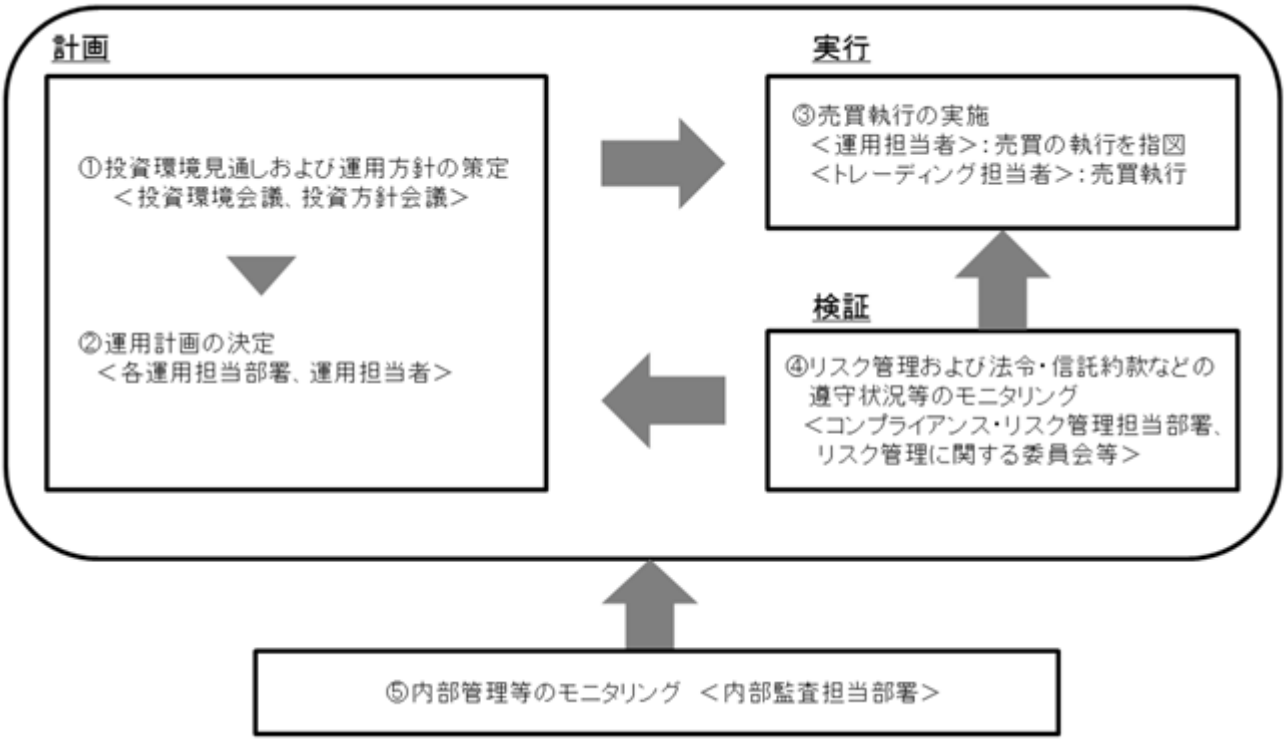
S&P Dow Jones Indicesは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託

	会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。
運用プロセス	ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス（除く日本）」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③株式への直接投資は行いません。 ④同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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

③ 売買執行の実施

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

④ モニタリング

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

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

当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2021年7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

毎決算時（毎年1月11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1)分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当等収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2)分配対象額についての分配方針

原則として、経費控除後の利子配当等収益の範囲内で、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

a.信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

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

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

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

c.毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の再投資

収益分配金は、税引後自動的に全額無手数料で再投資されます。

※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、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（５）【投資制限】

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

②株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限）

③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。（約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限）

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

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

⑥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は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限）

⑦同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限）

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限）

⑨投資する株式等の範囲（約款第19条）

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

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

⑩信用取引の指図および範囲（約款第22条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑪先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

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

2)委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

3)委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の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。

⑫スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

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

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

3)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を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あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑬金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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

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

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

⑭デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条の2）

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

⑮有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

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

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

2)上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3)委託会社は、有価証券の貸付け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。

⑯公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債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、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

2)上記1)の売り付けの指図は、当該売り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、上記2)の売り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り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑰公社債の借入れ（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、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)上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑱特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

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

⑲外国為替予約の指図および範囲（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、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3)上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信

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

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

⑳資金の借入れ（約款第37条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに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、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

㉑同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

○資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数または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。

各資産（国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート）への資産配分は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。
この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

金利リスクとは、金利変動により債券およびリートの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリートの価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

○リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。
当ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

○為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。
また、外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。

○信用リスク

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

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

○流動性リスク

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

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

○委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合、受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

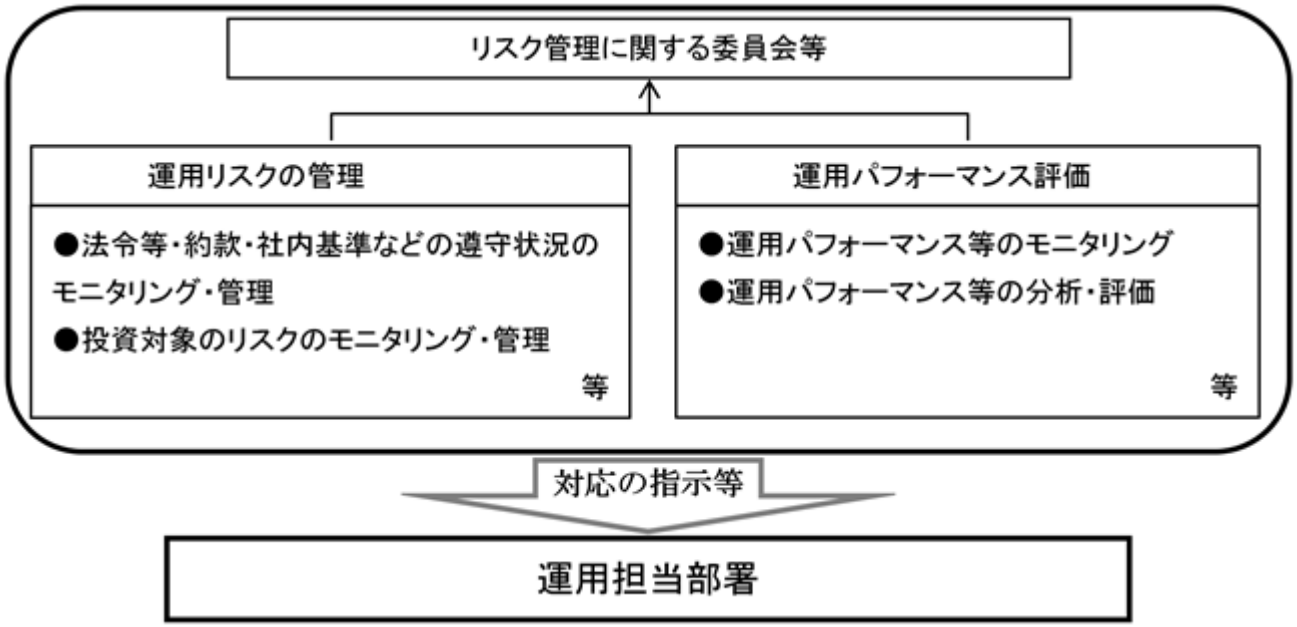
○注意事項

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

＜リスク管理体制＞

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

- **運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。**
- **運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。**
- **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。**



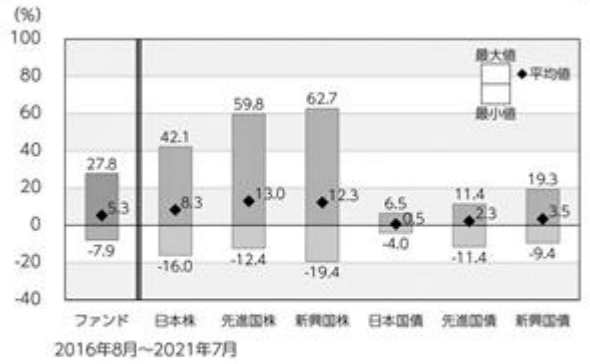
※リスク管理体制は2021年7月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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



2016年8月～2021年7月

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX)* (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数は、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。

*東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.26%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.20%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

※信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

1.信託財産留保額

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額とします。

2.その他の費用

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

①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

※上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※上場不動産投資信託（リート）は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託（リート）の費用は表示しておりません。
※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇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。

※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

※上記は、2021年7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】

2021年7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		13,552,198,698	97.31
	内　日本	13,552,198,698	97.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		374,503,512	2.69
純資産総額		13,926,702,210	100.00

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

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		380,011,045,030	97.23
	内　日本	380,011,045,030	97.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,820,495,389	2.77
純資産総額		390,831,540,419	100.00

その他資産の投資状況

2021年7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）		10,934,700,000	2.80
	内　日本	10,934,700,000	2.80

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		562,911,224,302	95.48
	内　アメリカ	391,255,565,752	66.36
	内　イギリス	24,469,651,734	4.15
	内　カナダ	20,429,565,037	3.47
	内　スイス	19,480,845,545	3.30
	内　フランス	18,878,838,866	3.20
	内　ドイツ	16,659,942,391	2.83
	内　オーストラリア	11,505,645,919	1.95
	内　オランダ	11,234,137,642	1.91
	内　アイルランド	10,649,612,742	1.81
	内　スウェーデン	6,579,489,193	1.12
	内　デンマーク	4,769,924,860	0.81
	内　スペイン	4,397,655,109	0.75
	内　香港	4,151,668,950	0.70
	内　イタリア	3,296,848,758	0.56
	内　フィンランド	2,370,820,939	0.40
	内　ジャージィー	2,321,418,864	0.39

	内　シンガポール	1,627,645,242	0.28
	内　ベルギー	1,494,905,528	0.25
	内　バミューダ	1,342,708,026	0.23
	内　ノルウェー	1,071,399,829	0.18
	内　イスラエル	1,060,893,006	0.18
	内　ケイマン諸島	1,029,250,696	0.17
	内　ルクセンブルグ	628,557,314	0.11
	内　ニュージーランド	565,257,423	0.10
	内　オランダ領キュラソー	428,906,416	0.07
	内　オーストリア	348,303,556	0.06
	内　ポルトガル	244,189,502	0.04
	内　リベリア	200,478,121	0.03
	内　パナマ	188,478,056	0.03
	内　マン島	161,958,938	0.03
	内　パプアニューギニア	66,660,348	0.01
投資信託受益証券		1,033,238,454	0.18
	内　オーストラリア	792,272,228	0.13
	内　シンガポール	240,966,226	0.04
投資証券		12,174,817,688	2.07
	内　アメリカ	11,240,239,957	1.91
	内　イギリス	347,497,631	0.06
	内　フランス	300,175,357	0.05
	内　香港	215,894,025	0.04
	内　カナダ	71,010,718	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		13,457,569,444	2.28
純資産総額		589,576,849,888	100.00

その他資産の投資状況

2021年7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）		13,718,971,440	2.33
	内　アメリカ	10,192,312,420	1.73
	内　ドイツ	2,129,607,952	0.36
	内　イギリス	610,165,449	0.10
	内　カナダ	490,493,289	0.08
	内　オーストラリア	296,392,330	0.05

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		431,126,621,300	85.41
	内　日本	431,126,621,300	85.41
地方債証券		27,104,973,598	5.37
	内　日本	27,104,973,598	5.37
特殊債券		25,989,937,581	5.15
	内　日本	25,989,937,581	5.15

社債券		19,172,771,990	3.80
	内　日本	18,364,717,990	3.64
	内　フランス	808,054,000	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,404,654,147	0.28
純資産総額		504,798,958,616	100.00

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		144,404,657,387	98.85
	内　アメリカ	65,392,413,190	44.76
	内　フランス	14,617,953,207	10.01
	内　イタリア	13,807,144,546	9.45
	内　ドイツ	10,881,425,587	7.45
	内　イギリス	9,449,134,398	6.47
	内　スペイン	8,583,504,610	5.88
	内　ベルギー	3,430,808,719	2.35
	内　オーストラリア	2,934,213,564	2.01
	内　オランダ	2,849,180,448	1.95
	内　カナダ	2,811,267,608	1.92
	内　オーストリア	2,167,376,097	1.48
	内　アイルランド	1,199,369,305	0.82
	内　メキシコ	1,047,613,201	0.72
	内　フィンランド	897,083,029	0.61
	内　ポーランド	893,302,710	0.61
	内　デンマーク	722,980,794	0.49
	内　イスラエル	679,909,023	0.47
	内　シンガポール	636,276,255	0.44
	内　マレーシア	629,430,055	0.43
	内　スウェーデン	435,346,135	0.30
	内　ノルウェー	338,924,906	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,680,777,351	1.15
純資産総額		146,085,434,738	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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		223,530,583,850	98.78
	内　日本	223,530,583,850	98.78
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,756,428,314	1.22
純資産総額		226,287,012,164	100.00

その他資産の投資状況

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		2,666,288,500	1.18
	内　日本	2,666,288,500	1.18

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		7,949,552,209	10.20
	内　オーストラリア	5,097,054,666	6.54
	内　シンガポール	2,852,497,543	3.66
投資証券		69,794,310,213	89.52
	内　アメリカ	58,425,997,058	74.94
	内　イギリス	4,323,042,652	5.54
	内　フランス	1,756,702,811	2.25
	内　カナダ	1,515,960,312	1.94
	内　香港	1,157,279,089	1.48
	内　ベルギー	1,091,037,208	1.40
	内　スペイン	341,372,372	0.44
	内　ニュージーランド	319,965,447	0.41
	内　ドイツ	231,566,239	0.30
	内　ガーンジィ	197,989,976	0.25
	内　オランダ	149,522,782	0.19
	内　韓国	133,239,835	0.17
	内　アイルランド	89,422,520	0.11
	内　イスラエル	47,689,636	0.06
	内　イタリア	13,522,276	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		224,636,388	0.29
純資産総額		77,968,498,810	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2021年7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	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,946,750,943	1.3062 3,849,173,158	1.3125 3,867,610,612	－ －	27.77
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	668,457,892	4.5196 3,021,162,291	5.4788 3,662,347,098	－ －	26.30
3	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,023,706,018	3.0170 3,088,607,331	3.1172 3,191,096,399	－ －	22.91

4	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	387,435,662	2.0877 808,856,190	2.5437 985,520,093	－ －	7.08
5	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	454,142,483	1.9898 903,652,714	2.0584 934,806,887	－ －	6.71
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	584,044,636	1.1731 685,142,788	1.5595 910,817,609	－ －	6.54

（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

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.31
合計	97.31

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年7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	1,478,100	8,442.46 12,478,807,343	9,805.00 14,492,770,500	－ －	3.71
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	913,800	11,772.06 10,757,316,407	11,375.00 10,394,475,000	－ －	2.66
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	143,200	55,531.38 7,952,094,533	60,740.00 8,697,968,000	－ －	2.23
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,135,900	9,201.51 10,452,005,351	6,837.00 7,766,148,300	－ －	1.99
5	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,842,600	559.31 5,505,138,493	578.50 5,693,944,100	－ －	1.46
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	998,600	5,127.41 5,120,234,254	5,629.00 5,621,119,400	－ －	1.44
7	任天堂 日本	株式 その他製品	83,600	63,545.89 5,312,436,409	56,400.00 4,715,040,000	－ －	1.21
8	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,674,500	2,822.45 4,726,202,543	2,802.50 4,692,786,250	－ －	1.20
9	信越化学工業 日本	株式 化学	264,200	18,318.38 4,839,717,623	17,750.00 4,689,550,000	－ －	1.20

10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,213,600	3,731.65 4,528,740,580	3,682.00 4,468,475,200	－ －	1.14
11	日立製作所 日本	株式 電気機器	701,000	5,288.26 3,707,076,355	6,258.00 4,386,858,000	－ －	1.12
12	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	284,600	13,532.36 3,851,311,208	15,405.00 4,384,263,000	－ －	1.12
13	日本電産 日本	株式 電気機器	351,300	13,662.03 4,799,472,658	12,240.00 4,299,912,000	－ －	1.10
14	ダイキン工業 日本	株式 機械	185,700	22,598.76 4,196,589,827	22,665.00 4,208,890,500	－ －	1.08
15	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,148,600	3,183.61 3,656,697,244	3,493.00 4,012,059,800	－ －	1.03
16	村田製作所 日本	株式 電気機器	428,900	9,145.87 3,922,667,120	9,040.00 3,877,256,000	－ －	0.99
17	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	85,500	43,426.62 3,712,976,533	44,920.00 3,840,660,000	－ －	0.98
18	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,148,100	3,419.67 3,926,127,985	3,332.00 3,825,469,200	－ －	0.98
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	995,900	3,740.11 3,724,779,995	3,695.00 3,679,850,500	－ －	0.94
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,005,200	3,208.18 3,224,866,941	3,232.00 3,248,806,400	－ －	0.83
21	ファナック 日本	株式 電気機器	128,100	27,575.10 3,532,370,313	24,380.00 3,123,078,000	－ －	0.80
22	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,955,100	1,573.18 3,075,725,570	1,565.50 3,060,709,050	－ －	0.78
23	三井物産 日本	株式 卸売業	1,145,800	2,185.54 2,504,198,962	2,499.50 2,863,927,100	－ －	0.73
24	ＳＭＣ 日本	株式 機械	42,600	64,802.39 2,760,582,100	64,800.00 2,760,480,000	－ －	0.71
25	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	562,000	4,506.93 2,532,896,180	4,868.00 2,735,816,000	－ －	0.70
26	三菱商事 日本	株式 卸売業	874,500	2,931.50 2,563,599,669	3,062.00 2,677,719,000	－ －	0.69
27	第一三共 日本	株式 医薬品	1,146,000	3,016.25 3,456,630,998	2,159.50 2,474,787,000	－ －	0.63
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	473,700	5,450.56 2,581,933,659	5,210.00 2,467,977,000	－ －	0.63
29	富士通 日本	株式 電気機器	131,400	16,984.08 2,231,708,357	18,565.00 2,439,441,000	－ －	0.62
30	デンソー 日本	株式 輸送用機器	321,200	7,005.93 2,250,304,787	7,482.00 2,403,218,400	－ －	0.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.23
合計	97.23

（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

2021年7月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	17.97
情報・通信業		8.26
輸送用機器		7.87
化学		6.93
サービス業		5.51
機械		5.36
医薬品		4.92
銀行業		4.79
卸売業		4.74
小売業		4.45
食料品		3.28
陸運業		3.19
精密機器		2.72
建設業		2.29
その他製品		2.25
不動産業		1.93
保険業		1.85
電気・ガス業		1.17
その他金融業		1.09
鉄鋼		0.79
ガラス・土石製品		0.75
証券、商品先物取引業		0.73
非鉄金属		0.71
ゴム製品		0.70
金属製品		0.61
繊維製品		0.49
空運業		0.44
石油・石炭製品		0.41
海運業		0.35
パルプ・紙		0.24
鉱業		0.18
倉庫・運輸関連業		0.18
水産・農林業		0.09
合計		97.23

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7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	1,597,566	14,699.55 23,483,515,481	15,946.12 25,474,984,895	－ －	4.32
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	681,800	26,906.30 18,344,719,065	31,368.88 21,387,305,793	－ －	3.63
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	40,745	358,324.73 14,599,941,441	394,155.24 16,059,855,286	－ －	2.72
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	229,029	30,313.96 6,942,777,987	39,232.45 8,985,370,348	－ －	1.52
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	28,694	232,248.53 6,664,139,563	297,325.56 8,531,459,891	－ －	1.45
6	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	27,998	233,621.57 6,540,936,993	298,996.38 8,371,300,840	－ －	1.42
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	73,128	86,232.28 6,305,994,863	74,163.05 5,423,395,630	－ －	0.92
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	235,800	16,521.54 3,895,781,323	21,527.92 5,076,284,432	－ －	0.86
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	290,618	15,765.04 4,581,605,734	16,751.96 4,868,424,017	－ －	0.83
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	250,084	18,200.45 4,551,642,003	18,851.98 4,714,580,617	－ －	0.80
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	161,378	23,273.39 3,755,813,234	27,144.76 4,380,567,208	－ －	0.74

12	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	90,263	36,931.81 3,333,576,790	45,118.63 4,072,543,730	－ －	0.69
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	130,659	27,102.85 3,541,231,686	30,630.92 4,002,205,689	－ －	0.68
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	274,327	12,303.58 3,375,206,233	13,740.64 3,769,429,920	－ －	0.64
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	102,578	30,828.80 3,162,357,163	35,850.31 3,677,453,170	－ －	0.62
16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	84,411	37,840.82 3,194,181,639	42,570.80 3,593,444,381	－ －	0.61
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	234,237	14,064.67 3,294,466,123	15,271.66 3,577,189,041	－ －	0.61
18	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	173,115	20,491.33 3,547,357,701	19,527.54 3,380,510,346	－ －	0.57
19	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	39,970	64,770.03 2,588,858,218	83,621.69 3,342,359,229	－ －	0.57
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術サービス	106,102	32,070.47 3,402,741,390	31,004.28 3,289,616,466	－ －	0.56
21	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	740,316	3,772.58 2,792,901,566	4,235.07 3,135,292,451	－ －	0.53
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	45,638	54,604.95 2,492,061,022	68,069.93 3,106,575,602	－ －	0.53
23	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	67,324	37,920.04 2,552,929,063	42,007.45 2,828,110,237	－ －	0.48
24	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	435,455	5,884.20 2,562,307,521	6,362.46 2,770,566,717	－ －	0.47
25	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	404,291	5,700.70 2,304,744,902	6,452.24 2,608,584,866	－ －	0.44
26	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	530,884	3,849.44 2,043,610,639	4,685.07 2,487,232,471	－ －	0.42
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	389,600	5,597.30 2,180,710,439	6,246.40 2,433,599,193	－ －	0.41

28	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア	90,909	25,968.44 2,360,765,729	26,719.93 2,429,082,989	－ －	0.41
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	401,554	5,249.86 2,108,102,462	6,029.61 2,421,215,740	－ －	0.41
30	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	392,604	5,970.95 2,344,222,028	6,129.25 2,406,368,145	－ －	0.41

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.48
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.07
合計	97.72

（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。

投資株式の業種別投資比率

2021年7月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	7.56
銀行		5.76
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.88
情報技術サービス		4.60
コンピュータ・周辺機器		4.59
医薬品		4.59
半導体・半導体製造装置		4.51
インターネット販売・通信販売		3.26
資本市場		3.21
ヘルスケア機器・用品		3.02
石油・ガス・消耗燃料		2.89
保険		2.88
化学		2.08
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.92
ホテル・レストラン・レジャー		1.81
バイオテクノロジー		1.76
電力		1.70
機械		1.70
専門小売り		1.67
自動車		1.62
飲料		1.59
金属・鉱業		1.59
繊維・アパレル・贅沢品		1.58
食品		1.54
航空宇宙・防衛		1.45
娯楽		1.40
各種電気通信サービス		1.35
食品・生活必需品小売り		1.33

ライフサイエンス・ツール／サービス	1.15
コングロマリット	1.13
メディア	1.08
家庭用品	1.06
陸運・鉄道	1.00
各種金融サービス	0.91
電気設備	0.88
専門サービス	0.81
総合公益事業	0.78
通信機器	0.67
航空貨物・物流サービス	0.67
タバコ	0.65
パーソナル用品	0.63
建設関連製品	0.63
電子装置・機器・部品	0.56
複合小売り	0.53
消費者金融	0.49
商業サービス・用品	0.43
不動産管理・開発	0.42
家庭用耐久財	0.37
商社・流通業	0.32
無線通信サービス	0.28
容器・包装	0.28
自動車部品	0.27
建設資材	0.25
建設・土木	0.21
ヘルスケア・テクノロジー	0.16
エネルギー設備・サービス	0.14
ガス	0.14
運送インフラ	0.13
紙製品・林産品	0.11
水道	0.11
販売	0.10
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
海運業	0.08
レジャー用品	0.07
旅客航空輸送業	0.05
合計	95.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7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	３２５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,700,000,000	101.28 5,772,994,000	101.05 5,760,192,000	0.8 2022/9/20	1.14

2	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,410,000,000	101.07 5,468,112,900	101.50 5,491,366,400	0.1 2028/3/20	1.09
3	４２０回　利付国庫債券 （２年） 日本	国債証券	4,900,000,000	100.38 4,919,106,000	100.34 4,916,660,000	0.1 2023/1/1	0.97
4	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,790,000,000	101.04 4,840,265,400	101.24 4,849,683,400	0.1 2026/12/20	0.96
5	３２９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,750,000,000	102.02 4,845,982,800	101.74 4,832,887,500	0.8 2023/6/20	0.96
6	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,710,000,000	102.28 4,817,604,200	102.24 4,815,739,500	0.4 2025/9/20	0.95
7	３３４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,640,000,000	102.32 4,747,984,600	102.14 4,739,342,400	0.6 2024/6/20	0.94
8	３３３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,630,000,000	102.08 4,726,675,000	101.94 4,719,822,000	0.6 2024/3/20	0.93
9	３３８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,530,000,000	102.01 4,621,158,000	101.98 4,620,056,400	0.4 2025/3/20	0.92
10	３４９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,530,000,000	101.07 4,578,638,100	101.48 4,597,044,000	0.1 2027/12/20	0.91
11	３４３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.99 4,544,722,000	101.13 4,550,850,000	0.1 2026/6/20	0.90
12	３３０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,460,000,000	102.23 4,559,598,700	101.97 4,548,263,400	0.8 2023/9/20	0.90
13	１４７回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.53 4,524,288,000	100.62 4,528,260,000	0.005 2026/3/20	0.90
14	３４１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,420,000,000	101.91 4,504,548,900	101.91 4,504,775,600	0.3 2025/12/20	0.89
15	３３９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,410,000,000	102.17 4,505,799,400	102.12 4,503,800,700	0.4 2025/6/20	0.89
16	３４８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,390,000,000	101.10 4,438,713,200	101.42 4,452,425,800	0.1 2027/9/20	0.88
17	３４４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,390,000,000	100.99 4,433,772,700	101.18 4,442,153,200	0.1 2026/9/20	0.88
18	３５２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,340,000,000	101.02 4,384,319,000	101.58 4,408,702,200	0.1 2028/9/20	0.87

19	１４５回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,350,000,000	100.96 4,391,930,000	100.99 4,393,369,500	0.1 2025/9/20	0.87
20	３４７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,330,000,000	101.08 4,376,889,400	101.36 4,389,017,900	0.1 2027/6/20	0.87
21	３３５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,300,000,000	102.14 4,392,326,000	102.01 4,386,602,000	0.5 2024/9/20	0.87
22	３５３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,310,000,000	101.01 4,353,921,500	101.60 4,379,003,100	0.1 2028/12/20	0.87
23	３５１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,300,000,000	101.11 4,347,858,200	101.56 4,367,123,000	0.1 2028/6/20	0.87
24	３４６回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,290,000,000	101.08 4,336,693,000	101.30 4,345,941,600	0.1 2027/3/20	0.86
25	３４２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,280,000,000	100.99 4,322,377,000	101.07 4,325,838,800	0.1 2026/3/20	0.86
26	３３２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,180,000,000	101.93 4,260,720,400	101.74 4,252,941,000	0.6 2023/12/20	0.84
27	１４２回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,130,000,000	100.83 4,164,664,900	100.83 4,164,402,900	0.1 2024/12/20	0.82
28	１４４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,100,000,000	100.90 4,136,977,000	100.95 4,139,196,000	0.1 2025/6/20	0.82
29	３６２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,950,000,000	100.49 3,969,651,000	100.96 3,988,038,500	0.1 2031/3/20	0.79
30	３６０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,940,000,000	100.41 3,956,444,500	101.19 3,986,886,000	0.1 2030/9/20	0.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	85.41
地方債証券	5.37
特殊債券	5.15
社債券	3.80
合計	99.72

（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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7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 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	974,461,000	95.55 931,153,458	96.78 943,133,598	0.875 2030/11/15	0.65
2	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	675,553,300	113.96 769,916,910	114.55 773,851,580	3.125 2028/11/15	0.53
3	US T N/B 0.125 09/30/22 アメリカ	国債証券	769,714,700	99.97 769,530,738	100.03 770,015,365	0.125 2022/9/30	0.53
4	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	751,101,400	95.88 720,178,863	98.78 741,976,688	1.125 2031/2/15	0.51
5	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証券	721,539,100	103.34 745,665,563	102.51 739,662,126	2 2022/11/30	0.51
6	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	679,932,900	93.92 638,658,844	94.86 645,006,657	0.625 2030/8/15	0.44
7	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	604,384,800	107.02 646,833,385	105.76 639,207,747	2.75 2023/11/15	0.44
8	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	615,333,800	102.61 631,414,201	101.95 627,376,072	1.625 2022/11/15	0.43
9	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	604,384,800	103.73 626,954,794	102.80 621,359,508	2.125 2022/12/31	0.43
10	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	582,486,800	107.55 626,491,853	106.30 619,233,520	2.75 2024/2/15	0.42
11	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	567,158,200	106.80 605,751,539	105.70 599,526,093	2 2025/8/15	0.41
12	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	574,822,500	102.64 590,001,406	101.93 585,937,227	1.75 2022/9/30	0.40
13	US T N/B 0.125 11/30/22 アメリカ	国債証券	584,676,600	100.02 584,836,467	100.01 584,767,955	0.125 2022/11/30	0.40
14	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	545,260,200	103.17 562,597,767	102.40 558,380,523	1.75 2023/1/31	0.38
15	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	513,508,100	108.07 554,989,284	106.96 549,273,132	2.25 2025/11/15	0.38
16	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証券	547,450,000	100.10 548,045,893	100.15 548,305,390	0.375 2024/4/15	0.38
17	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証券	522,267,300	105.67 551,889,647	104.71 546,870,982	2 2024/5/31	0.37
18	US T N/B 0.25 05/15/24 アメリカ	国債証券	547,450,000	99.90 546,908,024	99.76 546,145,525	0.25 2024/5/15	0.37
19	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証券	547,450,000	99.57 545,131,067	99.65 545,546,751	0.125 2024/1/15	0.37
20	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	485,040,700	113.13 548,740,181	112.39 545,178,164	2.875 2028/5/15	0.37
21	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	513,508,100	107.10 549,975,195	105.97 544,178,171	2.25 2024/11/15	0.37
22	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	571,537,800	92.50 528,727,166	95.16 543,920,916	0.625 2030/5/15	0.37
23	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	300,554,100	179.14 538,413,606	178.88 537,632,376	4.5 2041/4/25	0.37

24	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	478,471,300	112.14 536,598,082	111.40 533,046,932	2.75 2028/2/15	0.36
25	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証券	526,646,900	99.75 525,335,549	99.88 526,029,732	0.25 2024/3/15	0.36
26	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	426,760,800	120.87 515,845,425	120.74 515,284,646	2.75 2027/10/25	0.35
27	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	450,003,900	111.60 502,211,379	111.14 500,172,299	2.625 2029/2/15	0.34
28	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証券	474,091,700	105.81 501,648,280	104.71 496,425,861	2.5 2023/8/15	0.34
29	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	470,807,000	106.45 501,188,175	105.35 496,020,917	2 2025/2/15	0.34
30	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証券	448,909,000	104.27 468,088,260	110.39 495,553,450	2.375 2051/5/15	0.34

（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

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.85
合計	98.85

（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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2021年7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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	21,403	708,116.73 15,155,822,503	708,000.00 15,153,324,000	－ －	6.70
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	18,885	688,756.89 13,007,174,053	687,000.00 12,973,995,000	－ －	5.73
3	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	61,161	188,234.56 11,512,614,374	196,500.00 12,018,136,500	－ －	5.31
4	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	29,919	346,811.48 10,376,252,888	366,000.00 10,950,354,000	－ －	4.84
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	95,284	118,247.02 11,267,049,489	114,500.00 10,910,018,000	－ －	4.82
6	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	61,069	179,491.41 10,961,361,164	174,100.00 10,632,112,900	－ －	4.70
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	26,945	328,857.53 8,861,066,412	326,000.00 8,784,070,000	－ －	3.88
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	37,628	211,642.54 7,963,685,828	209,000.00 7,864,252,000	－ －	3.48

9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	18,882	366,479.26 6,919,861,552	373,500.00 7,052,427,000	－ －	3.12
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	42,513	161,239.81 6,854,788,247	161,100.00 6,848,844,300	－ －	3.03
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	26,810	207,014.30 5,550,053,490	211,900.00 5,681,039,000	－ －	2.51
12	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	55,545	93,100.58 5,171,271,772	96,600.00 5,365,647,000	－ －	2.37
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	12,411	437,857.70 5,434,251,953	428,000.00 5,311,908,000	－ －	2.35
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	5,842	805,067.99 4,703,207,242	807,000.00 4,714,494,000	－ －	2.08
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	9,463	513,753.39 4,861,648,387	497,500.00 4,707,842,500	－ －	2.08
16	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	23,119	184,072.76 4,255,578,180	201,000.00 4,646,919,000	－ －	2.05
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	6,521	644,369.82 4,201,935,648	671,000.00 4,375,591,000	－ －	1.93
18	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	7,020	586,061.14 4,114,149,221	614,000.00 4,310,280,000	－ －	1.90
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	12,339	327,193.86 4,037,245,062	332,500.00 4,102,717,500	－ －	1.81
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	57,855	68,149.63 3,942,797,339	66,700.00 3,858,928,500	－ －	1.71
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	83,120	44,401.15 3,690,623,945	43,050.00 3,578,316,000	－ －	1.58
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	22,207	165,011.71 3,664,415,260	161,100.00 3,577,547,700	－ －	1.58
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,620	513,801.53 3,401,366,151	508,000.00 3,362,960,000	－ －	1.49
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	20,432	163,035.54 3,331,142,217	159,500.00 3,258,904,000	－ －	1.44
25	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	16,601	187,706.28 3,116,111,967	193,800.00 3,217,273,800	－ －	1.42
26	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	3,993	787,350.91 3,143,892,199	790,000.00 3,154,470,000	－ －	1.39
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	12,898	234,620.67 3,026,137,480	237,300.00 3,060,695,400	－ －	1.35

28	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,503	351,362.25 2,987,633,290	350,500.00 2,980,301,500	－ －	1.32
29	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	24,701	119,955.57 2,963,022,734	120,400.00 2,974,000,400	－ －	1.31
30	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 日本	投資証券	120,009	22,661.06 2,719,531,589	22,750.00 2,730,204,750	－ －	1.21

（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

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	98.78
合計	98.78

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	339,424	13,429.90 4,558,433,168	14,002.67 4,752,844,332	－ －	6.10
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	41,106	90,037.59 3,701,085,498	86,100.74 3,539,257,273	－ －	4.54
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	69,875	33,253.84 2,323,612,430	34,140.07 2,385,537,873	－ －	3.06
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	129,261	17,037.37 2,202,267,982	16,477.15 2,129,852,899	－ －	2.73
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	150,455	14,384.63 2,164,240,451	13,786.98 2,074,320,196	－ －	2.66
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	191,229	8,839.03 1,690,280,582	9,605.55 1,836,861,193	－ －	2.36
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	63,951	23,243.88 1,486,469,383	25,173.94 1,609,898,688	－ －	2.06
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	157,637	8,694.75 1,370,614,531	9,248.62 1,457,924,758	－ －	1.87
9	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	770,246	1,693.19 1,304,175,678	1,819.34 1,401,347,060	－ －	1.80
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	62,853	20,424.16 1,283,720,273	21,870.62 1,374,634,550	－ －	1.76
11	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	171,169	7,453.72 1,275,846,748	7,688.38 1,316,013,651	－ －	1.69
12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	61,288	17,937.06 1,099,326,946	19,022.79 1,165,868,912	－ －	1.50

13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	260,153	4,114.76 1,070,468,118	4,449.67 1,157,595,936	－ －	1.48
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	171,933	6,311.78 1,085,204,701	6,529.98 1,122,719,670	－ －	1.44
15	MID AMERICA アメリカ	投資証券	52,475	18,745.16 983,652,537	21,132.66 1,108,936,590	－ －	1.42
16	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	51,259	19,304.98 989,554,395	21,419.52 1,097,943,621	－ －	1.41
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	29,792	33,771.35 1,006,116,210	36,197.39 1,078,392,762	－ －	1.38
18	LINK REIT 香港	投資証券	953,620	1,095.25 1,044,455,088	1,056.75 1,007,737,935	－ －	1.29
19	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	247,065	3,708.23 916,176,178	4,066.45 1,004,679,594	－ －	1.29
20	SEGRO PLC イギリス	投資証券	549,561	1,672.79 919,303,299	1,825.48 1,003,213,713	－ －	1.29
21	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	171,911	5,338.97 917,828,525	5,574.13 958,255,276	－ －	1.23
22	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	65,135	13,083.74 852,209,936	12,964.71 844,456,444	－ －	1.08
23	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	246,266	3,503.30 862,743,906	3,393.09 835,603,957	－ －	1.07
24	UDR INC アメリカ	投資証券	136,132	5,433.84 739,719,743	6,086.54 828,574,102	－ －	1.06
25	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	44,813	14,846.46 665,314,584	16,286.63 729,853,086	－ －	0.94
26	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	81,647	8,422.07 687,636,776	8,809.56 719,274,586	－ －	0.92
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	77,790	8,409.66 654,187,966	9,119.42 709,399,845	－ －	0.91
28	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	132,242	4,957.50 655,591,016	4,756.24 628,975,430	－ －	0.81
29	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	269,140	2,219.54 597,367,559	2,280.67 613,821,327	－ －	0.79
30	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD フランス	投資証券	63,574	10,217.22 649,549,663	9,488.92 603,248,746	－ －	0.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	10.20
投資証券	89.52
合計	99.71

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年7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　０３０９月	買建	574	11,128,323,620	10,934,700,000	2.80

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7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 Sep21	買建	422	9,984,327,406	10,192,312,420	1.73
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep21	買建	398	2,104,855,826	2,129,607,952	0.36
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep21	買建	57	607,290,505	610,165,449	0.10
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep21	買建	23	486,322,646	490,493,289	0.08
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep21	買建	20	292,397,846	296,392,330	0.05

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2021年7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（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ 先物　０３０９月	買建	1,241	2,659,393,010	2,666,288,500	1.18

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2021年7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5計算期間末（2012年1月11日）	7,492	7,492	0.6688	0.6688
第6計算期間末（2013年1月11日）	8,892	8,892	0.8003	0.8003
第7計算期間末（2014年1月14日）	9,193	9,193	0.9817	0.9817
第8計算期間末（2015年1月13日）	9,794	9,794	1.1261	1.1261
第9計算期間末（2016年1月12日）	10,062	10,062	1.0954	1.0954
第10計算期間末（2017年1月11日）	11,012	11,012	1.1844	1.1844
第11計算期間末（2018年1月11日）	11,528	11,528	1.3017	1.3017
第12計算期間末（2019年1月11日）	10,725	10,725	1.2039	1.2039
第13計算期間末（2020年1月14日）	12,252	12,252	1.3699	1.3699
第14計算期間末（2021年1月12日）	12,539	12,539	1.4212	1.4212
2020年7月末日	11,368	－	1.2704	－

8月末日	11,885	－	1.3271	－
9月末日	11,758	－	1.3130	－
10月末日	11,499	－	1.2841	－
11月末日	12,176	－	1.3741	－
12月末日	12,411	－	1.4021	－
2021年1月末日	12,437	－	1.4149	－
2月末日	12,646	－	1.4450	－
3月末日	13,200	－	1.5067	－
4月末日	13,350	－	1.5211	－
5月末日	13,529	－	1.5355	－
6月末日	13,805	－	1.5564	－
7月末日	13,926	－	1.5597	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
2021年1月13日～2021年7月12日	－

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第5計算期間	△7.4
第6計算期間	19.7
第7計算期間	22.7
第8計算期間	14.7
第9計算期間	△2.7
第10計算期間	8.1
第11計算期間	9.9
第12計算期間	△7.5
第13計算期間	13.8
第14計算期間	3.7
2021年1月13日～2021年7月12日	10.2

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第5計算期間	1,553,939,256	1,049,226,063
第6計算期間	1,341,335,454	1,433,126,499
第7計算期間	1,753,311,968	3,498,697,249
第8計算期間	1,496,503,368	2,163,948,960
第9計算期間	1,823,323,622	1,334,995,256

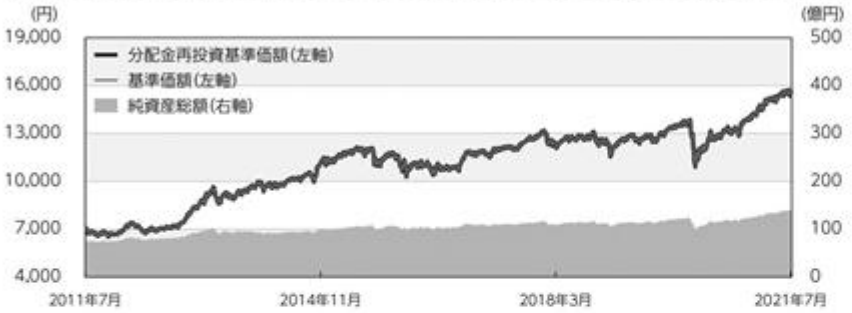
第10計算期間	1,257,703,399	1,145,956,042
第11計算期間	1,031,255,707	1,472,513,113
第12計算期間	914,554,043	862,640,600
第13計算期間	954,093,952	918,248,197
第14計算期間	1,140,451,287	1,261,088,330
2021年1月13日～ 2021年7月12日	553,026,442	481,761,189

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2021年7月30日

基準価額・純資産の推移 《2011年7月29日～2021年7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、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2007年1月26日)

分配の推移(税引前)

2017年 1月	0円
2018年 1月	0円
2019年 1月	0円
2020年 1月	0円
2021年 1月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	27.77
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.30
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	22.91
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	7.08
5	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.71
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.54

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.71
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.66
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.23
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.99
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.46

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.32
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.63
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.72
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	1.52
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.45

○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:2021年7月30日

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	325回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2022/9/20	1.14
2	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.09
3	420回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2023/1/1	0.97
4	345回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	0.96
5	329回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2023/6/20	0.96

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.65
2	US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	0.53
3	US T N/B 0.125 09/30/22	国債証券	アメリカ	0.125	2022/9/30	0.53
4	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.51
5	US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	アメリカ	2	2022/11/30	0.51

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.70
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.73
3	GLP投資法人	投資証券	日本	5.31
4	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.84
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.82

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	6.10
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.54
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.06
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.73
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	2.66

年間収益率の推移(暦年ベース)

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金自動けいぞく投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合に、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金再投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）することができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付は行いません。

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

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

・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

なお、収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※収益分配金の再投資については、1口単位となります。

※確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に販売会社の定める単位をもって解約を請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約のお申込みの受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の請求の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の請求の受付を行いません。

※解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該解約に係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するときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社への問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は2007年1月26日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

a.計算期間は原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

b.上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（５）【その他】

イ.償還規定

a.委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

b.委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、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、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

c.委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

d.委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

e.上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。

f.委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

g.上記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

h.委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

i.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、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、下記

「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その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。

j.受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。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。

k.上記d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

a.委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

b.委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

c.委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

d.上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。

e.委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

f.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a.からe.の規定にしたがいます。

g.上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ハ.関係法人との契約の更改

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

また、投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、当ファンドの信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ.運用報告書

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

①収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため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。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

②償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、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14期計算期間（2020年1月15日から2021年1月12日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【マネックス資産設計ファンド＜育成型＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 2020年1月14日現在	第14期 2021年1月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	171,145,930	153,512,422
親投資信託受益証券	12,130,018,870	12,398,753,036
未収入金	－	46,932,000
流動資産合計	12,301,164,800	12,599,197,458
資産合計	12,301,164,800	12,599,197,458
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,255,491	26,226,255
未払受託者報酬	2,628,706	2,621,498
未払委託者報酬	30,230,538	30,147,682
その他未払費用	249,079	234,615
流動負債合計	48,363,814	59,230,050
負債合計	48,363,814	59,230,050
純資産の部		
元本等		
元本	8,944,442,516	8,823,805,473
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,308,358,470	3,716,161,935
（分配準備積立金）	2,953,167,127	3,100,766,159
元本等合計	12,252,800,986	12,539,967,408
純資産合計	12,252,800,986	12,539,967,408
負債純資産合計	12,301,164,800	12,599,197,458

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自　2019年1月12日 至　2020年1月14日	第14期 自　2020年1月15日 至　2021年1月12日
営業収益		
受取利息	－	122
有価証券売買等損益	1,548,327,564	515,009,166
その他収益	70,650	15,518
営業収益合計	1,548,398,214	515,024,806
営業費用		
支払利息	103,255	77,848
受託者報酬	5,041,081	5,071,894
委託者報酬	57,973,331	58,327,684
その他費用	478,161	455,676
営業費用合計	63,595,828	63,933,102
営業利益又は営業損失（△）	1,484,802,386	451,091,704
経常利益又は経常損失（△）	1,484,802,386	451,091,704
当期純利益又は当期純損失（△）	1,484,802,386	451,091,704
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（△）	76,202,003	△85,944,975
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,816,536,006	3,308,358,470
剰余金増加額又は欠損金減少額	273,612,004	329,183,524
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	273,612,004	329,183,524
剰余金減少額又は欠損金増加額	190,389,923	458,416,738
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	190,389,923	458,416,738
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（△）	3,308,358,470	3,716,161,935

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第14期 自　2020年1月15日 至　2021年1月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2020年1月14日、当計算期間末日を2021年1月12日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第13期 2020年1月14日現在	第14期 2021年1月12日現在
１．　期首元本額	8,908,596,761円	8,944,442,516円
期中追加設定元本額	954,093,952円	1,140,451,287円
期中一部解約元本額	918,248,197円	1,261,088,330円
２．　受益権の総数	8,944,442,516口	8,823,805,473口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第13期 自　2019年1月12日 至　2020年1月14日	第14期 自　2020年1月15日 至　2021年1月12日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（231,105,081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（302,028,925円）、信託約款に規定される収益調整金（1,923,437,391円）及び分配準備積立金（2,420,033,121円）より分配対象収益は4,876,604,518円（1万口当たり5,452.10円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（193,472,604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（343,564,075円）、信託約款に規定される収益調整金（2,248,235,831円）及び分配準備積立金（2,563,729,480円）より分配対象収益は5,349,001,990円（1万口当たり6,062.01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13期 自　2019年1月12日 至　2020年1月14日	第14期 自　2020年1月15日 至　2021年1月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

２． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。	同左
３． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 2020年1月14日現在	第14期 2021年1月12日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 2020年1月14日現在	第14期 2021年1月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,513,825,662	521,010,547
合計	1,513,825,662	521,010,547

（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13期 2020年1月14日現在	第14期 2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3699円 (13,699円)	1.4212円 (14,212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

2021年1月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,117,787,592	3,367,558,678	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,195,480,384	2,869,273,313	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	343,607,543	705,769,893	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	819,611,278	3,704,315,132	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	519,649,244	1,033,998,065	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	611,915,400	717,837,955	
親投資信託受益証券　合計		5,608,051,441	12,398,753,036	
合計			12,398,753,036	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年1月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,910,924,583
株式	306,704,606,970
派生商品評価勘定	248,836,080
未収入金	53,238,020
未収配当金	373,176,729
差入委託証拠金	333,645,000
流動資産合計	319,624,427,382
資産合計	319,624,427,382
負債の部	
流動負債	
前受金	311,686,000
未払金	5,292,762,828
未払解約金	300,493,000
流動負債合計	5,904,941,828
負債合計	5,904,941,828
純資産の部	
元本等	
元本	104,131,508,084
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	209,587,977,470
元本等合計	313,719,485,554
純資産合計	313,719,485,554
負債純資産合計	319,624,427,382

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1月15日 至　2021年1月12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	2021年1月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	96,962,453,569円
同期中追加設定元本額	69,069,523,945円
同期中一部解約元本額	61,900,469,430円
元本の内訳	
ファンド名	
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	15,804,103,756円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	3,169,673,160円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,626,890円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	5,088,758円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	8,310,092円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	22,476,334円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	14,070,978円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	12,548,505円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	775,729,610円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	590,980,682円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	22,596,563円
たわらノーロード　バランス（標準型）	135,624,181円
たわらノーロード　バランス（積極型）	198,976,884円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	1,639,089円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	105,425,884円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	235,019,047円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	159,852,585円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	229,867,499円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	420,512円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,207,599円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	4,539,880円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,132,023円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	5,935,357円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	34,849,871,176円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,031,882,499円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,421,613,066円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,481,105,191円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	339,039,656円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,168,050,893円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,091,698,757円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	35,744,954円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,117,787,592円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	21,186,872円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	315,755,103円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	264,026,418円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	435,230,406円
投資のソムリエ	17,048,819,300円
クルーズコントロール	825,785,468円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,093,891,187円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	294,879,120円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	363,981,556円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	8,968,348円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	20,779,348円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	297,747,217円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,288,821,379円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	19,274,398円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	9,104,559円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,836,262円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	45,503,033円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	97,403,828円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,950,639,161円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	266,512,122円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	8,972,634円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	4,968,881円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	4,926,590円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	3,530,651円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	48,442,798円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	59,470,127円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	73,096,677円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	29,957,007円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	41,784,534円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	295,591,390円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	79,081,788円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	73,600,406円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	129,526,183円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,141,564円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,365,565円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,743,294円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,301,757円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,220,221円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	48,482,013円

ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	702,320,931円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	735,300,863円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,085,297,095円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	153,291,297円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	39,400,879円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	377,703,613円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	104,830,074円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,604,300円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	474,372,852円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,214,446円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	99,869,784円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	238,007,354円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	332,837,301円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	46,281,245円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,660,276円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１２１２）（適格機関投資家限定）	362,800,005円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	1,106,076,367円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,467,666,407円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	58,984,178円
計	104,131,508,084円
２．　受益権の総数	104,131,508,084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　2020年1月15日 至　2021年1月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。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	2021年1月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年1月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	29,203,411,772
合計	29,203,411,772

（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（2020年2月8日から2021年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2021年1月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 　先物取引 　　買建	5,764,497,000	－	6,013,440,000	248,943,000
合計	5,764,497,000	－	6,013,440,000	248,943,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

す。

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.0127円 (30,127円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2021年1月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	5,900	3,130.00	18,467,000	
日本水産	161,100	443.00	71,367,300	
マルハニチロ	23,400	2,261.00	52,907,400	
ホウスイ	600	1,009.00	605,400	
雪国まいたけ	10,000	1,784.00	17,840,000	
カネコ種苗	4,700	1,590.00	7,473,000	
サカタのタネ	19,300	3,650.00	70,445,000	
ホクト	12,500	2,136.00	26,700,000	
ホクリヨウ	2,300	698.00	1,605,400	
ヒノキヤグループ	4,200	2,100.00	8,820,000	
ショーボンドホールディングス	25,100	4,840.00	121,484,000	
ミライト・ホールディングス	48,000	1,769.00	84,912,000	
タマホーム	8,700	1,462.00	12,719,400	
サンヨーホームズ	1,000	821.00	821,000	
日本アクア	6,500	654.00	4,251,000	
ファーストコーポレーション	5,000	703.00	3,515,000	
ベステラ	2,900	1,807.00	5,240,300	
ＴＡＴＥＲＵ	30,500	181.00	5,520,500	
キャンディル	3,100	538.00	1,667,800	
スペースバリューホールディングス	19,700	702.00	13,829,400	
住石ホールディングス	33,100	119.00	3,938,900	
日鉄鉱業	3,800	6,270.00	23,826,000	
三井松島ホールディングス	6,500	770.00	5,005,000	
国際石油開発帝石	595,000	618.00	367,710,000	
石油資源開発	21,200	2,015.00	42,718,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7,900	1,450.00	11,455,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,400	803.00	2,730,200	
第一カッター興業	4,400	1,444.00	6,353,600	
明豊ファシリティワークス	5,400	658.00	3,553,200	
安藤・間	96,400	746.00	71,914,400	
東急建設	47,400	523.00	24,790,200	
コムシスホールディングス	57,400	3,235.00	185,689,000	

ビーアールホールディングス	17,600	652.00	11,475,200	
高松コンストラクショングループ	10,200	2,088.00	21,297,600	
東建コーポレーション	5,000	8,240.00	41,200,000	
ソネック	1,700	873.00	1,484,100	
ヤマウラ	7,300	936.00	6,832,800	
大成建設	124,600	3,550.00	442,330,000	
大林組	373,700	919.00	343,430,300	
清水建設	379,400	764.00	289,861,600	
飛島建設	10,700	1,082.00	11,577,400	
長谷工コーポレーション	144,400	1,206.00	174,146,400	
松井建設	15,000	723.00	10,845,000	
錢高組	1,200	4,130.00	4,956,000	
鹿島建設	293,600	1,435.00	421,316,000	
不動テトラ	9,800	1,749.00	17,140,200	
大末建設	5,000	849.00	4,245,000	
鉄建建設	8,100	1,861.00	15,074,100	
西松建設	28,700	2,312.00	66,354,400	
三井住友建設	90,000	444.00	39,960,000	
大豊建設	8,700	3,760.00	32,712,000	
前田建設工業	93,600	918.00	85,924,800	
佐田建設	6,800	455.00	3,094,000	
ナカノフドー建設	10,500	416.00	4,368,000	
奥村組	17,600	2,695.00	47,432,000	
東鉄工業	16,100	2,732.00	43,985,200	
イチケン	2,700	1,815.00	4,900,500	
富士ピー・エス	5,900	613.00	3,616,700	
淺沼組	4,300	4,150.00	17,845,000	
戸田建設	155,400	743.00	115,462,200	
熊谷組	17,300	2,693.00	46,588,900	
北野建設	1,900	2,493.00	4,736,700	
植木組	1,600	2,799.00	4,478,400	
矢作建設工業	16,800	903.00	15,170,400	
ピーエス三菱	12,400	611.00	7,576,400	
日本ハウスホールディングス	26,100	334.00	8,717,400	
大東建託	40,800	9,670.00	394,536,000	
新日本建設	16,000	866.00	13,856,000	
ＮＩＰＰＯ	31,000	2,720.00	84,320,000	
東亜道路工業	2,300	3,890.00	8,947,000	
前田道路	33,100	1,742.00	57,660,200	
日本道路	3,800	7,780.00	29,564,000	
東亜建設工業	11,700	2,030.00	23,751,000	
日本国土開発	36,400	588.00	21,403,200	
若築建設	6,600	1,235.00	8,151,000	
東洋建設	42,000	466.00	19,572,000	
五洋建設	148,200	930.00	137,826,000	
世紀東急工業	18,100	848.00	15,348,800	
福田組	4,500	5,520.00	24,840,000	
日本ドライケミカル	3,200	1,584.00	5,068,800	
住友林業	94,700	2,167.00	205,214,900	
日本基礎技術	12,900	489.00	6,308,100	

巴コーポレーション	17,100	413.00	7,062,300	
大和ハウス工業	369,800	3,094.00	1,144,161,200	
ライト工業	21,500	1,761.00	37,861,500	
積水ハウス	405,300	2,112.50	856,196,250	
日特建設	10,100	795.00	8,029,500	
北陸電気工事	6,700	1,259.00	8,435,300	
ユアテック	21,700	821.00	17,815,700	
日本リーテック	7,800	2,484.00	19,375,200	
四電工	1,700	2,809.00	4,775,300	
中電工	15,200	2,280.00	34,656,000	
関電工	53,300	900.00	47,970,000	
きんでん	88,900	1,723.00	153,174,700	
東京エネシス	12,600	942.00	11,869,200	
トーエネック	4,000	4,120.00	16,480,000	
住友電設	10,600	2,630.00	27,878,000	
日本電設工業	20,600	2,034.00	41,900,400	
協和エクシオ	56,700	2,894.00	164,089,800	
新日本空調	10,000	2,335.00	23,350,000	
日本工営	7,600	2,835.00	21,546,000	
九電工	26,200	3,300.00	86,460,000	
三機工業	26,500	1,254.00	33,231,000	
日揮ホールディングス	114,800	1,137.00	130,527,600	
中外炉工業	4,300	1,731.00	7,443,300	
ヤマト	12,100	736.00	8,905,600	
太平電業	9,200	2,523.00	23,211,600	
高砂熱学工業	28,600	1,607.00	45,960,200	
三晃金属工業	1,700	2,874.00	4,885,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	33,300	1,850.00	61,605,000	
朝日工業社	2,100	2,995.00	6,289,500	
明星工業	24,200	831.00	20,110,200	
大氣社	18,100	2,827.00	51,168,700	
ダイダン	9,000	2,969.00	26,721,000	
日比谷総合設備	12,200	1,882.00	22,960,400	
ニップン	35,200	1,673.00	58,889,600	
日清製粉グループ本社	135,200	1,682.00	227,406,400	
日東富士製粉	600	6,620.00	3,972,000	
昭和産業	11,200	3,130.00	35,056,000	
鳥越製粉	11,000	910.00	10,010,000	
中部飼料	14,600	1,490.00	21,754,000	
フィード・ワン	16,300	894.00	14,572,200	
東洋精糖	1,700	1,229.00	2,089,300	
日本甜菜製糖	6,300	1,656.00	10,432,800	
三井製糖	10,700	1,876.00	20,073,200	
塩水港精糖	14,700	224.00	3,292,800	
日新製糖	4,600	1,858.00	8,546,800	
ＬＩＦＵＬＬ	39,700	373.00	14,808,100	
ミクシィ	21,800	2,594.00	56,549,200	
ジェイエイシーリクルートメント	7,600	1,789.00	13,596,400	
日本M&Aセンター	87,200	6,160.00	537,152,000	
メンバーズ	3,500	2,766.00	9,681,000	

中広	1,200	324.00	388,800	
ＵＴグループ	17,900	3,000.00	53,700,000	
アイティメディア	4,600	2,127.00	9,784,200	
タケエイ	12,500	1,396.00	17,450,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	4,200	1,052.00	4,418,400	
ビーネックスグループ	14,400	1,215.00	17,496,000	
コシダカホールディングス	27,300	425.00	11,602,500	
アルトナー	2,900	892.00	2,586,800	
パソナグループ	12,400	2,176.00	26,982,400	
ＣＤＳ	2,500	1,386.00	3,465,000	
リンクアンドモチベーション	21,100	536.00	11,309,600	
ＧＣＡ	14,600	733.00	10,701,800	
エス・エム・エス	35,400	4,105.00	145,317,000	
サニーサイドアップグループ	4,300	627.00	2,696,100	
パーソルホールディングス	113,800	1,924.00	218,951,200	
リニカル	5,700	766.00	4,366,200	
クックパッド	35,700	313.00	11,174,100	
エスクリ	3,700	303.00	1,121,100	
アイ・ケイ・ケイ	5,700	613.00	3,494,100	
森永製菓	28,100	3,910.00	109,871,000	
中村屋	2,600	3,910.00	10,166,000	
江崎グリコ	33,100	4,585.00	151,763,500	
名糖産業	6,100	1,449.00	8,838,900	
井村屋グループ	6,800	2,574.00	17,503,200	
不二家	7,600	2,321.00	17,639,600	
山崎製パン	89,800	1,720.00	154,456,000	
第一屋製パン	1,700	981.00	1,667,700	
モロゾフ	1,700	5,690.00	9,673,000	
亀田製菓	6,800	4,935.00	33,558,000	
寿スピリッツ	11,500	4,995.00	57,442,500	
カルビー	54,600	3,110.00	169,806,000	
森永乳業	22,200	5,010.00	111,222,000	
六甲バター	8,000	1,860.00	14,880,000	
ヤクルト本社	82,200	5,260.00	432,372,000	
明治ホールディングス	79,100	7,330.00	579,803,000	
雪印メグミルク	28,800	2,210.00	63,648,000	
プリマハム	18,700	3,365.00	62,925,500	
日本ハム	45,700	4,610.00	210,677,000	
林兼産業	3,700	596.00	2,205,200	
丸大食品	12,900	1,714.00	22,110,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	9,700	3,480.00	33,756,000	
柿安本店	4,300	2,670.00	11,481,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	77,300	682.00	52,718,600	
学情	4,100	1,313.00	5,383,300	
スタジオアリス	5,700	1,974.00	11,251,800	
クロスキャット	3,300	1,218.00	4,019,400	
シミックホールディングス	5,600	1,422.00	7,963,200	
エプコ	2,900	982.00	2,847,800	
システナ	41,700	2,163.00	90,197,100	
ＮＪＳ	3,100	2,023.00	6,271,300	

デジタルアーツ	5,700	9,560.00	54,492,000	
日鉄ソリューションズ	17,500	3,220.00	56,350,000	
綜合警備保障	45,300	5,390.00	244,167,000	
キューブシステム	6,100	1,239.00	7,557,900	
いちご	149,500	302.00	45,149,000	
エイジア	2,100	1,845.00	3,874,500	
日本駐車場開発	116,600	142.00	16,557,200	
コア	5,000	1,471.00	7,355,000	
カカクコム	84,100	2,744.00	230,770,400	
アイロムグループ	4,200	1,735.00	7,287,000	
セントケア・ホールディング	7,400	942.00	6,970,800	
サイネックス	2,200	664.00	1,460,800	
ルネサンス	6,200	887.00	5,499,400	
ディップ	15,600	2,654.00	41,402,400	
ＳＢＳホールディングス	9,000	2,459.00	22,131,000	
デジタルホールディングス	7,900	1,942.00	15,341,800	
新日本科学	12,400	719.00	8,915,600	
ツクイホールディングス	26,900	542.00	14,579,800	
キャリアデザインセンター	2,600	942.00	2,449,200	
ベネフィット・ワン	41,500	3,065.00	127,197,500	
エムスリー	251,200	10,225.00	2,568,520,000	
ツカダ・グローバルホールディング	10,100	245.00	2,474,500	
ブラス	1,500	491.00	736,500	
アウトソーシング	65,100	1,333.00	86,778,300	
ウェルネット	11,700	452.00	5,288,400	
ワールドホールディングス	4,000	1,918.00	7,672,000	
ディー・エヌ・エー	48,100	1,922.00	92,448,200	
博報堂ＤＹホールディングス	158,400	1,425.00	225,720,000	
ぐるなび	19,600	491.00	9,623,600	
タカミヤ	12,700	537.00	6,819,900	
ジャパンベストレスキューシステム	9,100	871.00	7,926,100	
ファンコミュニケーションズ	31,400	412.00	12,936,800	
ライク	3,900	2,108.00	8,221,200	
ビジネス・ブレークスルー	5,200	473.00	2,459,600	
エスプール	29,200	724.00	21,140,800	
ＷＤＢホールディングス	5,200	2,739.00	14,242,800	
手間いらず	700	5,000.00	3,500,000	
ティア	7,300	413.00	3,014,900	
ＣＤＧ	1,300	1,523.00	1,979,900	
バリューコマース	7,600	3,385.00	25,726,000	
インフォマート	115,200	846.00	97,459,200	
サッポロホールディングス	40,800	1,962.00	80,049,600	
アサヒグループホールディングス	261,400	4,144.00	1,083,241,600	
キリンホールディングス	507,500	2,301.00	1,167,757,500	
宝ホールディングス	88,700	1,258.00	111,584,600	
オエノンホールディングス	34,900	408.00	14,239,200	
養命酒製造	4,100	1,863.00	7,638,300	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	91,600	1,577.00	144,453,200	
サントリー食品インターナショナル	80,200	3,605.00	289,121,000	

ダイドーグループホールディングス	6,100	5,100.00	31,110,000	
伊藤園	36,300	6,580.00	238,854,000	
キーコーヒー	11,900	2,144.00	25,513,600	
ユニカフェ	4,200	1,015.00	4,263,000	
ジャパンフーズ	1,500	1,212.00	1,818,000	
日清オイリオグループ	15,500	3,135.00	48,592,500	
不二製油グループ本社	29,200	2,979.00	86,986,800	
かどや製油	1,000	3,980.00	3,980,000	
Ｊ－オイルミルズ	6,200	3,665.00	22,723,000	
ローソン	29,700	5,030.00	149,391,000	
サンエー	9,800	4,335.00	42,483,000	
カワチ薬品	9,200	3,085.00	28,382,000	
エービーシー・マート	18,300	5,520.00	101,016,000	
ハードオフコーポレーション	5,100	770.00	3,927,000	
高千穂交易	4,500	1,224.00	5,508,000	
アスクル	12,300	3,900.00	47,970,000	
ゲオホールディングス	21,200	1,232.00	26,118,400	
アダストリア	16,200	1,915.00	31,023,000	
ジーフット	7,800	427.00	3,330,600	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	2,300	406.00	933,800	
オルバヘルスケアホールディングス	1,600	1,456.00	2,329,600	
伊藤忠食品	2,400	5,470.00	13,128,000	
くら寿司	6,800	5,840.00	39,712,000	
キャンドゥ	5,700	1,922.00	10,955,400	
エレマテック	11,200	1,051.00	11,771,200	
パルグループホールディングス	11,900	1,205.00	14,339,500	
ＪＡＬＵＸ	3,500	1,346.00	4,711,000	
エディオン	53,700	1,032.00	55,418,400	
あらた	9,400	5,060.00	47,564,000	
サーラコーポレーション	24,100	591.00	14,243,100	
ワッツ	5,300	926.00	4,907,800	
トーメンデバイス	1,800	3,425.00	6,165,000	
ハローズ	4,500	3,600.00	16,200,000	
ＪＰホールディングス	36,000	278.00	10,008,000	
フジオフードグループ本社	10,000	1,200.00	12,000,000	
あみやき亭	2,600	2,980.00	7,748,000	
東京エレクトロン　デバイス	4,400	3,355.00	14,762,000	
ひらまつ	22,300	139.00	3,099,700	
フィールズ	9,100	476.00	4,331,600	
双日	647,100	246.00	159,186,600	
アルフレッサ　ホールディングス	130,500	1,975.00	257,737,500	
大黒天物産	2,700	6,220.00	16,794,000	
ハニーズホールディングス	10,300	1,001.00	10,310,300	
ファーマライズホールディングス	3,400	783.00	2,662,200	
キッコーマン	86,100	7,210.00	620,781,000	
味の素	264,300	2,419.50	639,473,850	
キユーピー	66,700	2,369.00	158,012,300	
ハウス食品グループ本社	44,800	3,860.00	172,928,000	
カゴメ	48,900	3,500.00	171,150,000	
焼津水産化学工業	4,900	1,006.00	4,929,400	

アリアケジャパン	11,000	7,030.00	77,330,000	
ピエトロ	1,200	1,706.00	2,047,200	
エバラ食品工業	2,400	2,464.00	5,913,600	
やまみ	1,100	2,185.00	2,403,500	
ニチレイ	57,100	2,918.00	166,617,800	
横浜冷凍	31,000	884.00	27,404,000	
東洋水産	61,600	5,320.00	327,712,000	
イートアンドホールディングス	4,500	1,820.00	8,190,000	
大冷	1,500	1,920.00	2,880,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,600	775.00	5,115,000	
日清食品ホールディングス	51,000	9,090.00	463,590,000	
永谷園ホールディングス	6,100	2,311.00	14,097,100	
一正蒲鉾	4,100	1,164.00	4,772,400	
フジッコ	13,200	2,027.00	26,756,400	
ロック・フィールド	12,900	1,536.00	19,814,400	
日本たばこ産業	641,700	2,048.00	1,314,201,600	
ケンコーマヨネーズ	6,700	1,817.00	12,173,900	
わらべや日洋ホールディングス	7,800	1,639.00	12,784,200	
なとり	6,900	1,893.00	13,061,700	
イフジ産業	2,300	830.00	1,909,000	
ピックルスコーポレーション	2,600	3,480.00	9,048,000	
北の達人コーポレーション	41,700	469.00	19,557,300	
ユーグレナ	51,700	821.00	42,445,700	
スター・マイカ・ホールディングス	6,000	1,352.00	8,112,000	
ＡＤワークスグループ	23,000	155.00	3,565,000	
片倉工業	15,700	1,368.00	21,477,600	
グンゼ	8,600	3,395.00	29,197,000	
ヒューリック	249,300	1,130.00	281,709,000	
神栄	1,900	2,312.00	4,392,800	
ラサ商事	6,600	910.00	6,006,000	
アルペン	9,100	2,321.00	21,121,100	
ハブ	3,700	559.00	2,068,300	
ラクーンホールディングス	5,700	1,701.00	9,695,700	
クオールホールディングス	17,300	1,160.00	20,068,000	
アルコニックス	12,500	1,487.00	18,587,500	
神戸物産	81,100	3,000.00	243,300,000	
ソリトンシステムズ	5,800	1,846.00	10,706,800	
ジンズホールディングス	6,200	6,650.00	41,230,000	
ビックカメラ	69,600	1,145.00	79,692,000	
ＤＣＭホールディングス	72,000	1,119.00	80,568,000	
ペッパーフードサービス	11,500	242.00	2,783,000	
ハイパー	2,000	539.00	1,078,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	83,500	5,230.00	436,705,000	
東京一番フーズ	2,700	582.00	1,571,400	
ＤＤホールディングス	4,700	535.00	2,514,500	
あい　ホールディングス	16,800	2,044.00	34,339,200	
ディーブイエックス	4,600	1,050.00	4,830,000	
きちりホールディングス	3,500	569.00	1,991,500	
アークランドサービスホールディングス	9,800	2,090.00	20,482,000	

Ｊ．フロント　リテイリング	140,200	811.00	113,702,200	
ドトール・日レスホールディングス	16,900	1,488.00	25,147,200	
マツモトキヨシホールディングス	48,600	4,370.00	212,382,000	
ブロンコビリー	6,100	2,229.00	13,596,900	
ＺＯＺＯ	80,800	2,750.00	222,200,000	
トレジャー・ファクトリー	3,700	697.00	2,578,900	
物語コーポレーション	3,200	11,230.00	35,936,000	
ココカラファイン	12,300	7,290.00	89,667,000	
三越伊勢丹ホールディングス	205,100	614.00	125,931,400	
東洋紡	46,100	1,411.00	65,047,100	
ユニチカ	34,100	402.00	13,708,200	
富士紡ホールディングス	5,600	3,970.00	22,232,000	
日清紡ホールディングス	72,600	768.00	55,756,800	
倉敷紡績	11,700	1,870.00	21,879,000	
ダイワボウホールディングス	10,000	9,540.00	95,400,000	
シキボウ	6,300	1,034.00	6,514,200	
日東紡績	17,700	4,825.00	85,402,500	
トヨタ紡織	34,600	1,677.00	58,024,200	
マクニカ・富士エレホールディングス	28,000	2,058.00	57,624,000	
Ｈａｍｅｅ	4,300	1,831.00	7,873,300	
ラクト・ジャパン	5,100	2,820.00	14,382,000	
ウエルシアホールディングス	69,900	3,770.00	263,523,000	
クリエイトＳＤホールディングス	19,800	3,865.00	76,527,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,700	824.00	18,704,800	
八洲電機	9,400	965.00	9,071,000	
メディアスホールディングス	6,900	805.00	5,554,500	
レスターホールディングス	12,300	2,326.00	28,609,800	
ジューテックホールディングス	2,300	1,005.00	2,311,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	16,100	374.00	6,021,400	
大光	5,400	670.00	3,618,000	
ＯＣＨＩホールディングス	2,900	1,321.00	3,830,900	
ＴＯＫＡＩホールディングス	62,400	1,024.00	63,897,600	
黒谷	3,800	838.00	3,184,400	
ミサワ	2,400	686.00	1,646,400	
ティーライフ	1,700	1,158.00	1,968,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,700	758.00	1,288,600	
エー・ピーホールディングス	1,900	398.00	756,200	
三洋貿易	11,800	1,006.00	11,870,800	
チムニー	3,700	1,150.00	4,255,000	
シュッピン	7,900	955.00	7,544,500	
ビューティガレージ	1,800	2,541.00	4,573,800	
オイシックス・ラ・大地	11,600	3,240.00	37,584,000	
ウイン・パートナーズ	8,700	1,158.00	10,074,600	
ネクステージ	20,000	1,506.00	30,120,000	
ジョイフル本田	34,400	1,475.00	50,740,000	
鳥貴族	3,500	1,409.00	4,931,500	
ホットランド	8,800	1,197.00	10,533,600	
すかいらーくホールディングス	131,400	1,554.00	204,195,600	
ＳＦＰホールディングス	6,600	1,248.00	8,236,800	

綿半ホールディングス	8,800	1,425.00	12,540,000	
日本毛織	38,400	1,020.00	39,168,000	
ダイトウボウ	19,700	111.00	2,186,700	
トーア紡コーポレーション	4,200	463.00	1,944,600	
ダイドーリミテッド	13,300	182.00	2,420,600	
ヨシックス	1,900	1,906.00	3,621,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	34,200	1,176.00	40,219,200	
三栄建築設計	4,900	1,806.00	8,849,400	
野村不動産ホールディングス	71,400	2,268.00	161,935,200	
三重交通グループホールディングス	24,200	487.00	11,785,400	
サムティ	16,600	1,700.00	28,220,000	
ディア・ライフ	16,700	423.00	7,064,100	
コーセーアールイー	3,600	659.00	2,372,400	
日本商業開発	7,400	1,664.00	12,313,600	
プレサンスコーポレーション	19,200	1,768.00	33,945,600	
フィル・カンパニー	2,100	2,033.00	4,269,300	
ＴＨＥグローバル社	5,600	264.00	1,478,400	
ハウスコム	1,200	1,331.00	1,597,200	
日本管理センター	6,300	1,175.00	7,402,500	
サンセイランディック	3,900	735.00	2,866,500	
エストラスト	1,300	718.00	933,400	
フージャースホールディングス	23,500	648.00	15,228,000	
オープンハウス	37,100	4,085.00	151,553,500	
東急不動産ホールディングス	319,000	555.00	177,045,000	
飯田グループホールディングス	98,000	2,150.00	210,700,000	
イーグランド	2,500	795.00	1,987,500	
ムゲンエステート	7,400	461.00	3,411,400	
帝国繊維	13,100	2,385.00	31,243,500	
日本コークス工業	102,600	96.00	9,849,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,100	872.00	5,319,200	
ミタチ産業	3,100	602.00	1,866,200	
ＢＥＥＮＯＳ	5,400	2,728.00	14,731,200	
あさひ	8,700	1,725.00	15,007,500	
日本調剤	7,200	1,517.00	10,922,400	
コスモス薬品	10,400	16,750.00	174,200,000	
シップヘルスケアホールディングス	18,800	5,820.00	109,416,000	
トーエル	5,800	826.00	4,790,800	
ソフトクリエイトホールディングス	5,100	2,788.00	14,218,800	
オンリー	2,700	435.00	1,174,500	
セブン&アイ・ホールディングス	459,500	3,909.00	1,796,185,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	63,100	606.00	38,238,600	
明治電機工業	3,200	1,570.00	5,024,000	
ツルハホールディングス	25,500	14,780.00	376,890,000	
デリカフーズホールディングス	4,700	635.00	2,984,500	
スターティアホールディングス	2,900	1,041.00	3,018,900	
サンマルクホールディングス	9,300	1,390.00	12,927,000	
フェリシモ	2,700	1,422.00	3,839,400	
トリドールホールディングス	29,000	1,374.00	39,846,000	

帝人	95,200	1,984.00	188,876,800	
東レ	845,200	654.60	553,267,920	
クラレ	183,700	1,096.00	201,335,200	
旭化成	773,800	1,139.00	881,358,200	
サカイオーベックス	3,300	2,165.00	7,144,500	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	10,600	474.00	5,024,400	
稲葉製作所	6,800	1,426.00	9,696,800	
宮地エンジニアリンググループ	3,700	2,561.00	9,475,700	
トーカロ	32,800	1,491.00	48,904,800	
アルファ	3,700	1,042.00	3,855,400	
ＳＵＭＣＯ	150,700	2,400.00	361,680,000	
川田テクノロジーズ	2,400	4,295.00	10,308,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	3,900	6,370.00	24,843,000	
ジェイテックコーポレーション	800	3,765.00	3,012,000	
信和	7,000	700.00	4,900,000	
ビーロット	5,500	653.00	3,591,500	
ファーストブラザーズ	2,200	1,081.00	2,378,200	
ハウスドゥ	5,700	1,210.00	6,897,000	
シーアールイー	3,200	1,304.00	4,172,800	
プロパティエージェント	1,900	1,400.00	2,660,000	
ケイアイスター不動産	3,800	2,598.00	9,872,400	
アグレ都市デザイン	2,100	670.00	1,407,000	
グッドコムアセット	5,600	1,263.00	7,072,800	
ジェイ・エス・ビー	2,200	3,370.00	7,414,000	
テンポイノベーション	2,600	845.00	2,197,000	
グローバル・リンク・マネジメント	2,000	741.00	1,482,000	
住江織物	2,100	2,061.00	4,328,100	
日本フエルト	5,600	419.00	2,346,400	
イチカワ	1,300	1,267.00	1,647,100	
エコナックホールディングス	21,100	94.00	1,983,400	
日東製網	1,300	1,486.00	1,931,800	
芦森工業	2,700	946.00	2,554,200	
アツギ	10,000	497.00	4,970,000	
ウイルプラスホールディングス	1,600	732.00	1,171,200	
ＪＭホールディングス	9,000	2,350.00	21,150,000	
コメダホールディングス	25,400	1,856.00	47,142,400	
サツドラホールディングス	1,500	2,023.00	3,034,500	
アレンザホールディングス	5,900	1,306.00	7,705,400	
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,445.00	4,624,000	
バロックジャパンリミテッド	8,300	711.00	5,901,300	
クスリのアオキホールディングス	10,600	9,400.00	99,640,000	
ダイニック	3,700	817.00	3,022,900	
共和レザー	7,100	658.00	4,671,800	
ピーバンドットコム	1,200	1,119.00	1,342,800	
力の源ホールディングス	5,500	552.00	3,036,000	
スシローグローバルホールディングス	64,400	3,625.00	233,450,000	
アセンテック	2,400	1,805.00	4,332,000	
セーレン	28,700	1,640.00	47,068,000	
ソトー	4,100	822.00	3,370,200	
東海染工	1,300	1,130.00	1,469,000	

小松マテーレ	19,200	1,015.00	19,488,000	
ワコールホールディングス	29,100	2,086.00	60,702,600	
ホギメディカル	13,300	3,245.00	43,158,500	
クラウディアホールディングス	2,500	262.00	655,000	
ＴＳＩホールディングス	35,400	222.00	7,858,800	
マツオカコーポレーション	3,500	2,074.00	7,259,000	
ワールド	16,500	1,251.00	20,641,500	
ＴＩＳ	117,100	2,117.00	247,900,700	
ＪＮＳホールディングス	4,900	539.00	2,641,100	
電算システム	4,500	3,230.00	14,535,000	
グリー	71,900	604.00	43,427,600	
コーエーテクモホールディングス	24,000	6,160.00	147,840,000	
三菱総合研究所	5,000	4,295.00	21,475,000	
ボルテージ	2,900	499.00	1,447,100	
電算	1,000	2,443.00	2,443,000	
ＡＧＳ	6,800	879.00	5,977,200	
ファインデックス	9,900	1,130.00	11,187,000	
ブレインパッド	3,100	4,165.00	12,911,500	
ＫＬａｂ	21,300	906.00	19,297,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	14,300	1,175.00	16,802,500	
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	2,683.00	4,561,100	
ネクソン	295,300	3,180.00	939,054,000	
アイスタイル	32,800	409.00	13,415,200	
エムアップホールディングス	3,500	2,387.00	8,354,500	
エイチーム	8,000	1,132.00	9,056,000	
エニグモ	11,100	1,205.00	13,375,500	
テクノスジャパン	9,100	680.00	6,188,000	
ｅｎｉｓｈ	6,000	447.00	2,682,000	
コロプラ	38,300	972.00	37,227,600	
オルトプラス	6,900	403.00	2,780,700	
ブロードリーフ	57,900	653.00	37,808,700	
クロス・マーケティンググループ	5,500	365.00	2,007,500	
デジタルハーツホールディングス	6,100	1,241.00	7,570,100	
システム情報	8,700	1,148.00	9,987,600	
メディアドゥ	3,900	7,740.00	30,186,000	
じげん	28,800	376.00	10,828,800	
ブイキューブ	6,300	3,220.00	20,286,000	
エンカレッジ・テクノロジ	2,700	731.00	1,973,700	
サイバーリンクス	4,000	2,305.00	9,220,000	
ディー・エル・イー	9,400	310.00	2,914,000	
フィックスターズ	12,400	943.00	11,693,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,800	1,277.00	6,129,600	
オプティム	6,100	2,842.00	17,336,200	
セレス	3,900	2,509.00	9,785,100	
ＳＨＩＦＴ	5,100	11,840.00	60,384,000	
特種東海製紙	7,100	5,020.00	35,642,000	
ティーガイア	10,500	1,974.00	20,727,000	
セック	1,700	2,838.00	4,824,600	
日本アジアグループ	12,400	818.00	10,143,200	

テクマトリックス	16,500	1,988.00	32,802,000	
プロシップ	3,600	1,562.00	5,623,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	28,200	2,457.00	69,287,400	
GMOペイメントゲートウェイ	24,700	14,280.00	352,716,000	
ザッパラス	5,200	526.00	2,735,200	
システムリサーチ	3,300	1,806.00	5,959,800	
インターネットイニシアティブ	34,600	2,193.00	75,877,800	
さくらインターネット	12,500	698.00	8,725,000	
ヴィンクス	3,500	1,121.00	3,923,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,500	8,950.00	22,375,000	
ＳＲＡホールディングス	6,200	2,606.00	16,157,200	
システムインテグレータ	3,900	643.00	2,507,700	
朝日ネット	8,200	888.00	7,281,600	
ｅＢＡＳＥ	13,900	1,010.00	14,039,000	
アバント	11,200	1,188.00	13,305,600	
アドソル日進	4,300	3,320.00	14,276,000	
フリービット	6,100	933.00	5,691,300	
コムチュア	13,100	2,975.00	38,972,500	
サイバーコム	2,100	1,674.00	3,515,400	
アステリア	7,000	1,058.00	7,406,000	
アイル	6,400	1,486.00	9,510,400	
王子ホールディングス	487,900	638.00	311,280,200	
日本製紙	51,500	1,265.00	65,147,500	
三菱製紙	14,300	330.00	4,719,000	
北越コーポレーション	69,600	421.00	29,301,600	
中越パルプ工業	5,200	1,256.00	6,531,200	
巴川製紙所	3,800	804.00	3,055,200	
大王製紙	56,500	2,002.00	113,113,000	
阿波製紙	3,100	473.00	1,466,300	
マークラインズ	4,900	2,580.00	12,642,000	
メディカル・データ・ビジョン	13,300	2,925.00	38,902,500	
ｇｕｍｉ	14,800	848.00	12,550,400	
ショーケース	2,400	956.00	2,294,400	
モバイルファクトリー	2,500	1,032.00	2,580,000	
テラスカイ	4,300	4,180.00	17,974,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,482.00	6,965,400	
ＰＣＩホールディングス	4,500	1,571.00	7,069,500	
パイプドHD	1,500	1,685.00	2,527,500	
アイビーシー	1,900	1,078.00	2,048,200	
ネオジャパン	2,200	1,958.00	4,307,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,900	3,790.00	7,201,000	
ランドコンピュータ	1,500	1,123.00	1,684,500	
ダブルスタンダード	1,500	4,235.00	6,352,500	
オープンドア	5,700	1,419.00	8,088,300	
マイネット	3,900	932.00	3,634,800	
アカツキ	4,200	4,290.00	18,018,000	
ベネフィットジャパン	900	1,814.00	1,632,600	

Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,500	3,690.00	9,225,000	
カナミックネットワーク	10,800	722.00	7,797,600	
ノムラシステムコーポレーション	5,200	366.00	1,903,200	
レンゴー	110,300	878.00	96,843,400	
トーモク	7,200	1,838.00	13,233,600	
ザ・パック	8,800	2,693.00	23,698,400	
チェンジ	16,400	3,260.00	53,464,000	
シンクロ・フード	5,200	320.00	1,664,000	
オークネット	6,200	1,376.00	8,531,200	
セグエグループ	3,100	1,445.00	4,479,500	
エイトレッド	1,900	2,644.00	5,023,600	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	12,200	419.00	5,111,800	
マクロミル	23,800	668.00	15,898,400	
ビーグリー	2,200	1,840.00	4,048,000	
オロ	3,800	4,285.00	16,283,000	
ユーザーローカル	1,100	4,195.00	4,614,500	
テモナ	2,400	972.00	2,332,800	
ニーズウェル	2,200	663.00	1,458,600	
サインポスト	2,500	923.00	2,307,500	
昭和電工	88,700	2,303.00	204,276,100	
住友化学	856,800	432.00	370,137,600	
住友精化	5,200	4,350.00	22,620,000	
日産化学	64,300	6,050.00	389,015,000	
ラサ工業	4,200	2,485.00	10,437,000	
クレハ	10,000	7,100.00	71,000,000	
多木化学	4,600	6,560.00	30,176,000	
テイカ	8,600	1,500.00	12,900,000	
石原産業	21,000	691.00	14,511,000	
片倉コープアグリ	2,500	1,220.00	3,050,000	
日本曹達	17,200	3,145.00	54,094,000	
東ソー	180,300	1,701.00	306,690,300	
トクヤマ	33,600	2,558.00	85,948,800	
セントラル硝子	23,900	2,429.00	58,053,100	
東亞合成	73,200	1,210.00	88,572,000	
大阪ソーダ	11,900	2,760.00	32,844,000	
関東電化工業	27,700	842.00	23,323,400	
デンカ	42,600	4,225.00	179,985,000	
イビデン	72,900	4,900.00	357,210,000	
信越化学工業	200,400	19,645.00	3,936,858,000	
日本カーバイド工業	4,300	1,318.00	5,667,400	
堺化学工業	7,500	2,060.00	15,450,000	
第一稀元素化学工業	12,900	933.00	12,035,700	
エア・ウォーター	108,600	1,833.00	199,063,800	
日本酸素ホールディングス	112,300	2,044.00	229,541,200	
日本化学工業	3,800	2,994.00	11,377,200	
東邦アセチレン	1,500	1,503.00	2,254,500	
日本パーカライジング	58,800	1,128.00	66,326,400	
高圧ガス工業	18,600	815.00	15,159,000	
チタン工業	1,500	1,945.00	2,917,500	
四国化成工業	17,100	1,243.00	21,255,300	

戸田工業	2,700	2,392.00	6,458,400	
ステラ　ケミファ	6,300	3,475.00	21,892,500	
保土谷化学工業	4,400	5,440.00	23,936,000	
日本触媒	18,100	6,050.00	109,505,000	
大日精化工業	10,400	2,454.00	25,521,600	
カネカ	30,100	3,700.00	111,370,000	
協和キリン	119,900	2,782.00	333,561,800	
三菱瓦斯化学	108,600	2,384.00	258,902,400	
三井化学	108,300	2,974.00	322,084,200	
ＪＳＲ	108,800	3,090.00	336,192,000	
東京応化工業	20,000	7,780.00	155,600,000	
大阪有機化学工業	10,800	3,870.00	41,796,000	
三菱ケミカルホールディングス	780,400	636.30	496,568,520	
ＫＨネオケム	19,200	2,525.00	48,480,000	
ダイセル	145,600	779.00	113,422,400	
住友ベークライト	18,300	3,905.00	71,461,500	
積水化学工業	246,800	2,025.00	499,770,000	
日本ゼオン	105,300	1,512.00	159,213,600	
アイカ工業	35,000	3,575.00	125,125,000	
宇部興産	58,800	1,963.00	115,424,400	
積水樹脂	21,200	2,242.00	47,530,400	
タキロンシーアイ	25,700	688.00	17,681,600	
旭有機材	6,700	1,543.00	10,338,100	
ニチバン	6,200	1,697.00	10,521,400	
リケンテクノス	28,800	487.00	14,025,600	
大倉工業	5,600	2,040.00	11,424,000	
積水化成品工業	15,900	539.00	8,570,100	
群栄化学工業	2,200	2,470.00	5,434,000	
タイガースポリマー	7,100	407.00	2,889,700	
ミライアル	4,300	1,241.00	5,336,300	
ダイキアクシス	4,500	1,181.00	5,314,500	
ダイキョーニシカワ	24,500	834.00	20,433,000	
竹本容器	4,300	932.00	4,007,600	
森六ホールディングス	6,300	2,178.00	13,721,400	
日本化薬	72,200	991.00	71,550,200	
カーリットホールディングス	12,700	813.00	10,325,100	
ＥＰＳホールディングス	15,400	992.00	15,276,800	
ソルクシーズ	4,500	982.00	4,419,000	
レッグス	2,900	1,631.00	4,729,900	
プレステージ・インターナショナル	42,600	907.00	38,638,200	
フェイス	4,200	848.00	3,561,600	
プロトコーポレーション	10,600	1,057.00	11,204,200	
ハイマックス	3,100	1,191.00	3,692,100	
アミューズ	6,200	2,582.00	16,008,400	
野村総合研究所	165,900	3,880.00	643,692,000	
ドリームインキュベータ	3,400	1,378.00	4,685,200	
サイバネットシステム	8,200	968.00	7,937,600	
クイック	7,100	1,050.00	7,455,000	
ＴＡＣ	7,600	250.00	1,900,000	
ＣＥホールディングス	6,300	586.00	3,691,800	

ケネディクス	96,300	746.00	71,839,800	
日本システム技術	1,800	1,582.00	2,847,600	
電通グループ	128,100	2,974.00	380,969,400	
インテージホールディングス	14,700	1,151.00	16,919,700	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	555.00	2,497,500	
東邦システムサイエンス	3,100	931.00	2,886,100	
ぴあ	3,400	2,682.00	9,118,800	
イオンファンタジー	4,500	2,314.00	10,413,000	
ソースネクスト	55,200	278.00	15,345,600	
シーティーエス	12,900	939.00	12,113,100	
ネクシィーズグループ	3,600	881.00	3,171,600	
インフォコム	12,800	3,315.00	42,432,000	
メディカルシステムネットワーク	11,500	634.00	7,291,000	
日本精化	9,500	1,469.00	13,955,500	
扶桑化学工業	11,800	3,735.00	44,073,000	
トリケミカル研究所	2,500	17,910.00	44,775,000	
ＨＥＲＯＺ	1,600	2,676.00	4,281,600	
ラクスル	9,500	4,375.00	41,562,500	
ＦＩＧ	13,400	264.00	3,537,600	
システムサポート	2,600	1,655.00	4,303,000	
ＡＤＥＫＡ	53,600	1,835.00	98,356,000	
日油	43,900	5,030.00	220,817,000	
ミヨシ油脂	4,700	1,192.00	5,602,400	
新日本理化	20,300	260.00	5,278,000	
ハリマ化成グループ	9,900	1,035.00	10,246,500	
イーソル	6,300	1,222.00	7,698,600	
アルテリア・ネットワークス	13,000	1,615.00	20,995,000	
ＥＤＵＬＡＢ	1,000	6,610.00	6,610,000	
東海ソフト	800	1,214.00	971,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,000	1,693.00	3,386,000	
東名	600	1,138.00	682,800	
ヴィッツ	400	2,411.00	964,400	
トビラシステムズ	1,100	1,328.00	1,460,800	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	700	1,207.00	844,900	
花王	285,500	7,750.00	2,212,625,000	
第一工業製薬	4,400	4,405.00	19,382,000	
石原ケミカル	3,400	2,153.00	7,320,200	
日華化学	4,400	932.00	4,100,800	
ニイタカ	2,400	3,040.00	7,296,000	
三洋化成工業	6,900	5,630.00	38,847,000	
武田薬品工業	991,900	3,815.00	3,784,098,500	
アステラス製薬	1,033,400	1,639.00	1,693,742,600	
大日本住友製薬	88,400	1,522.00	134,544,800	
塩野義製薬	149,900	5,955.00	892,654,500	
わかもと製薬	14,600	242.00	3,533,200	
あすか製薬	13,500	1,647.00	22,234,500	
日本新薬	31,100	7,370.00	229,207,000	
ビオフェルミン製薬	2,200	2,537.00	5,581,400	
中外製薬	372,800	5,862.00	2,185,353,600	

科研製薬	20,400	4,135.00	84,354,000	
エーザイ	142,700	7,606.00	1,085,376,200	
理研ビタミン	11,400	1,424.00	16,233,600	
ロート製薬	61,200	3,060.00	187,272,000	
小野薬品工業	273,700	3,137.00	858,596,900	
久光製薬	31,600	6,370.00	201,292,000	
有機合成薬品工業	9,400	318.00	2,989,200	
持田製薬	16,500	4,005.00	66,082,500	
参天製薬	222,100	1,699.00	377,347,900	
扶桑薬品工業	4,300	2,749.00	11,820,700	
日本ケミファ	1,200	2,168.00	2,601,600	
ツムラ	36,800	3,345.00	123,096,000	
日医工	33,800	1,023.00	34,577,400	
テルモ	337,300	4,338.00	1,463,207,400	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	31,900	2,916.00	93,020,400	
キッセイ薬品工業	21,200	2,318.00	49,141,600	
生化学工業	23,200	1,020.00	23,664,000	
栄研化学	21,000	2,059.00	43,239,000	
日水製薬	5,300	1,000.00	5,300,000	
鳥居薬品	7,400	3,170.00	23,458,000	
ＪＣＲファーマ	33,700	2,534.00	85,395,800	
東和薬品	15,300	1,998.00	30,569,400	
富士製薬工業	8,100	1,251.00	10,133,100	
沢井製薬	24,300	4,850.00	117,855,000	
ゼリア新薬工業	21,800	1,935.00	42,183,000	
第一三共	1,023,500	3,640.00	3,725,540,000	
キョーリン製薬ホールディングス	26,300	1,983.00	52,152,900	
大幸薬品	14,600	1,667.00	24,338,200	
ダイト	7,500	3,900.00	29,250,000	
大塚ホールディングス	247,700	4,402.00	1,090,375,400	
大正製薬ホールディングス	25,100	7,030.00	176,453,000	
ペプチドリーム	60,600	5,830.00	353,298,000	
大日本塗料	13,300	958.00	12,741,400	
日本ペイントホールディングス	96,300	10,350.00	996,705,000	
関西ペイント	131,100	3,085.00	404,443,500	
神東塗料	10,300	215.00	2,214,500	
中国塗料	33,400	1,093.00	36,506,200	
日本特殊塗料	9,000	1,262.00	11,358,000	
藤倉化成	16,300	539.00	8,785,700	
太陽ホールディングス	8,600	6,260.00	53,836,000	
ＤＩＣ	49,300	2,594.00	127,884,200	
サカタインクス	25,400	1,157.00	29,387,800	
東洋インキＳＣホールディングス	24,600	1,929.00	47,453,400	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	9,600	845.00	8,112,000	
アルプス技研	10,100	2,006.00	20,260,600	
サニックス	19,700	324.00	6,382,800	
ダイオーズ	2,200	946.00	2,081,200	
日本空調サービス	12,400	761.00	9,436,400	
オリエンタルランド	121,000	16,190.00	1,958,990,000	
フォーカスシステムズ	7,200	965.00	6,948,000	

ダスキン	28,300	2,877.00	81,419,100	
パーク２４	63,000	1,809.00	113,967,000	
明光ネットワークジャパン	14,500	537.00	7,786,500	
ファルコホールディングス	6,300	1,690.00	10,647,000	
クレスコ	7,100	1,298.00	9,215,800	
フジ・メディア・ホールディングス	112,300	1,177.00	132,177,100	
秀英予備校	2,900	413.00	1,197,700	
田谷	1,700	540.00	918,000	
ラウンドワン	31,700	812.00	25,740,400	
リゾートトラスト	52,200	1,457.00	76,055,400	
オービック	40,600	20,990.00	852,194,000	
ジャストシステム	19,000	7,090.00	134,710,000	
ＴＤＣソフト	10,400	999.00	10,389,600	
Ｚホールディングス	1,606,500	692.30	1,112,179,950	
ビー・エム・エル	14,600	3,395.00	49,567,000	
ワタベウェディング	1,700	274.00	465,800	
トレンドマイクロ	62,500	5,780.00	361,250,000	
りらいあコミュニケーションズ	19,700	1,346.00	26,516,200	
ＩＤホールディングス	4,600	1,237.00	5,690,200	
リソー教育	52,100	303.00	15,786,300	
日本オラクル	23,800	13,940.00	331,772,000	
早稲田アカデミー	5,100	1,006.00	5,130,600	
アルファシステムズ	3,800	3,770.00	14,326,000	
フューチャー	14,100	1,762.00	24,844,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,500	1,389.00	10,417,500	
ＳＢテクノロジー	4,300	3,445.00	14,813,500	
トーセ	3,400	802.00	2,726,800	
ユー・エス・エス	127,600	2,125.00	271,150,000	
オービックビジネスコンサルタント	12,000	6,740.00	80,880,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	53,300	3,695.00	196,943,500	
アイティフォー	14,100	927.00	13,070,700	
東京個別指導学院	4,200	599.00	2,515,800	
東計電算	1,700	4,115.00	6,995,500	
サイバーエージェント	70,200	7,190.00	504,738,000	
楽天	531,000	985.00	523,035,000	
エックスネット	2,200	978.00	2,151,600	
クリーク・アンド・リバー社	5,900	1,121.00	6,613,900	
モーニングスター	12,700	469.00	5,956,300	
テー・オー・ダブリュー	18,200	262.00	4,768,400	
大塚商会	63,300	5,100.00	322,830,000	
サイボウズ	13,600	2,613.00	35,536,800	
山田コンサルティンググループ	7,300	963.00	7,029,900	
セントラルスポーツ	4,400	2,138.00	9,407,200	
パラカ	3,400	1,595.00	5,423,000	
電通国際情報サービス	14,500	3,470.00	50,315,000	
ＡＣＣＥＳＳ	11,000	745.00	8,195,000	
デジタルガレージ	21,200	4,015.00	85,118,000	
イーエムシステムズ	16,700	998.00	16,666,600	
ウェザーニューズ	4,100	5,090.00	20,869,000	
ＣＩＪ	7,900	879.00	6,944,100	

ビジネスエンジニアリング	1,300	3,180.00	4,134,000	
日本エンタープライズ	11,800	213.00	2,513,400	
WOWOW	5,700	2,863.00	16,319,100	
スカラ	7,600	818.00	6,216,800	
インテリジェント　ウェイブ	7,000	706.00	4,942,000	
フルキャストホールディングス	10,000	1,589.00	15,890,000	
エン・ジャパン	20,200	3,115.00	62,923,000	
富士フイルムホールディングス	228,600	6,022.00	1,376,629,200	
コニカミノルタ	260,000	404.00	105,040,000	
資生堂	237,000	6,578.00	1,558,986,000	
ライオン	155,000	2,455.00	380,525,000	
高砂香料工業	7,400	2,604.00	19,269,600	
マンダム	26,800	1,646.00	44,112,800	
ミルボン	16,000	6,440.00	103,040,000	
ファンケル	48,200	3,745.00	180,509,000	
コーセー	22,500	16,150.00	363,375,000	
コタ	7,100	1,458.00	10,351,800	
シーボン	1,300	1,905.00	2,476,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	50,900	2,158.00	109,842,200	
ノエビアホールディングス	10,200	4,495.00	45,849,000	
アジュバンコスメジャパン	2,300	1,030.00	2,369,000	
エステー	7,700	1,988.00	15,307,600	
アグロ　カネショウ	4,600	1,752.00	8,059,200	
コニシ	19,600	1,670.00	32,732,000	
長谷川香料	20,600	2,128.00	43,836,800	
星光ＰＭＣ	7,000	779.00	5,453,000	
小林製薬	33,500	12,330.00	413,055,000	
荒川化学工業	10,700	1,278.00	13,674,600	
メック	8,100	2,306.00	18,678,600	
日本高純度化学	2,900	2,777.00	8,053,300	
タカラバイオ	31,100	2,856.00	88,821,600	
ＪＣＵ	14,500	3,800.00	55,100,000	
新田ゼラチン	7,900	665.00	5,253,500	
ＯＡＴアグリオ	2,300	1,307.00	3,006,100	
デクセリアルズ	30,800	1,360.00	41,888,000	
アース製薬	9,100	5,790.00	52,689,000	
北興化学工業	11,100	1,182.00	13,120,200	
大成ラミック	3,500	2,952.00	10,332,000	
クミアイ化学工業	49,300	908.00	44,764,400	
日本農薬	21,600	497.00	10,735,200	
富士興産	3,700	1,064.00	3,936,800	
ニチレキ	14,000	1,592.00	22,288,000	
ユシロ化学工業	6,300	1,165.00	7,339,500	
ビーピー・カストロール	4,500	1,242.00	5,589,000	
富士石油	32,300	183.00	5,910,900	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,800	1,067.00	5,121,600	
出光興産	132,200	2,366.00	312,785,200	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,793,100	416.80	747,364,080	
コスモエネルギーホールディングス	34,500	2,060.00	71,070,000	
横浜ゴム	68,900	1,588.00	109,413,200	

ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	62,800	1,610.00	101,108,000	
ブリヂストン	317,100	3,650.00	1,157,415,000	
住友ゴム工業	106,900	940.00	100,486,000	
藤倉コンポジット	11,300	387.00	4,373,100	
オカモト	7,200	4,065.00	29,268,000	
アキレス	8,200	1,479.00	12,127,800	
フコク	4,500	673.00	3,028,500	
ニッタ	13,400	2,293.00	30,726,200	
クリエートメディック	3,500	1,004.00	3,514,000	
住友理工	23,300	590.00	13,747,000	
三ツ星ベルト	15,800	1,782.00	28,155,600	
バンドー化学	21,300	675.00	14,377,500	
ＡＧＣ	109,400	3,720.00	406,968,000	
日本板硝子	56,800	491.00	27,888,800	
石塚硝子	2,100	1,888.00	3,964,800	
有沢製作所	18,900	1,004.00	18,975,600	
日本山村硝子	5,400	865.00	4,671,000	
日本電気硝子	44,100	2,302.00	101,518,200	
オハラ	4,800	1,935.00	9,288,000	
住友大阪セメント	22,600	3,065.00	69,269,000	
太平洋セメント	75,200	2,753.00	207,025,600	
リソルホールディングス	900	3,860.00	3,474,000	
日本ヒューム	12,200	796.00	9,711,200	
日本コンクリート工業	25,900	318.00	8,236,200	
三谷セキサン	5,500	4,590.00	25,245,000	
アジアパイルホールディングス	17,400	481.00	8,369,400	
東海カーボン	116,500	1,359.00	158,323,500	
日本カーボン	6,500	3,975.00	25,837,500	
東洋炭素	7,000	1,998.00	13,986,000	
ノリタケカンパニーリミテド	6,500	3,165.00	20,572,500	
ＴＯＴＯ	85,100	6,060.00	515,706,000	
日本碍子	142,900	1,760.00	251,504,000	
日本特殊陶業	90,700	1,865.00	169,155,500	
ダントーホールディングス	8,800	465.00	4,092,000	
ＭＡＲＵＷＡ	4,700	11,780.00	55,366,000	
品川リフラクトリーズ	3,400	2,637.00	8,965,800	
黒崎播磨	2,300	4,810.00	11,063,000	
ヨータイ	9,800	835.00	8,183,000	
イソライト工業	6,200	550.00	3,410,000	
東京窯業	16,000	356.00	5,696,000	
ニッカトー	4,600	888.00	4,084,800	
フジミインコーポレーテッド	10,700	3,975.00	42,532,500	
クニミネ工業	5,000	1,259.00	6,295,000	
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,048.00	1,781,600	
ニチアス	32,700	2,510.00	82,077,000	
日本製鉄	527,600	1,466.50	773,725,400	
神戸製鋼所	215,300	569.00	122,505,700	
中山製鋼所	17,500	405.00	7,087,500	
合同製鐵	6,300	2,025.00	12,757,500	

ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	318,200	1,086.00	345,565,200	
東京製鐵	57,500	687.00	39,502,500	
共英製鋼	13,400	1,481.00	19,845,400	
大和工業	25,000	2,924.00	73,100,000	
東京鐵鋼	4,900	2,151.00	10,539,900	
大阪製鐵	6,400	1,263.00	8,083,200	
淀川製鋼所	16,000	2,189.00	35,024,000	
丸一鋼管	38,200	2,344.00	89,540,800	
モリ工業	3,100	2,451.00	7,598,100	
大同特殊鋼	19,200	4,630.00	88,896,000	
日本高周波鋼業	4,100	345.00	1,414,500	
日本冶金工業	9,900	1,811.00	17,928,900	
山陽特殊製鋼	8,000	1,470.00	11,760,000	
愛知製鋼	6,600	3,485.00	23,001,000	
日立金属	127,100	1,567.00	199,165,700	
日本金属	2,700	1,338.00	3,612,600	
大平洋金属	7,800	2,340.00	18,252,000	
新日本電工	75,600	293.00	22,150,800	
栗本鐵工所	5,900	1,711.00	10,094,900	
虹　技	1,300	1,106.00	1,437,800	
日本鋳鉄管	1,200	1,267.00	1,520,400	
日本製鋼所	35,700	3,185.00	113,704,500	
三菱製鋼	9,000	687.00	6,183,000	
日亜鋼業	16,500	296.00	4,884,000	
日本精線	1,900	3,820.00	7,258,000	
エンビプロ・ホールディングス	5,200	680.00	3,536,000	
大紀アルミニウム工業所	19,500	794.00	15,483,000	
日本軽金属ホールディングス	29,900	2,022.00	60,457,800	
三井金属鉱業	31,800	4,045.00	128,631,000	
東邦亜鉛	6,000	2,534.00	15,204,000	
三菱マテリアル	77,900	2,391.00	186,258,900	
住友金属鉱山	150,600	5,037.00	758,572,200	
ＤＯＷＡホールディングス	29,800	4,125.00	122,925,000	
古河機械金属	21,100	1,294.00	27,303,400	
エス・サイエンス	45,200	37.00	1,672,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,200	890.00	10,858,000	
東邦チタニウム	21,100	993.00	20,952,300	
ＵＡＣＪ	17,900	2,003.00	35,853,700	
ＣＫサンエツ	2,100	3,760.00	7,896,000	
古河電気工業	36,500	2,945.00	107,492,500	
住友電気工業	440,500	1,490.00	656,345,000	
フジクラ	142,300	489.00	69,584,700	
昭和電線ホールディングス	13,700	1,854.00	25,399,800	
東京特殊電線	1,500	2,500.00	3,750,000	
タツタ電線	23,600	787.00	18,573,200	
カナレ電気	1,700	1,698.00	2,886,600	
平河ヒューテック	6,000	1,459.00	8,754,000	
リョービ	14,500	1,254.00	18,183,000	
アーレスティ	16,000	371.00	5,936,000	

アサヒホールディングス	20,700	3,940.00	81,558,000	
東洋製罐グループホールディングス	75,100	1,156.00	86,815,600	
ホッカンホールディングス	6,600	1,446.00	9,543,600	
コロナ	6,900	982.00	6,775,800	
横河ブリッジホールディングス	22,000	2,122.00	46,684,000	
ＯＳＪＢホールディングス	58,700	281.00	16,494,700	
駒井ハルテック	1,900	2,482.00	4,715,800	
高田機工	800	2,560.00	2,048,000	
三和ホールディングス	111,300	1,223.00	136,119,900	
文化シヤッター	34,900	982.00	34,271,800	
三協立山	15,300	843.00	12,897,900	
アルインコ	8,800	955.00	8,404,000	
東洋シヤッター	2,500	655.00	1,637,500	
ＬＩＸＩＬ	173,900	2,416.00	420,142,400	
日本フイルコン	8,700	535.00	4,654,500	
ノーリツ	24,400	1,610.00	39,284,000	
長府製作所	12,100	2,205.00	26,680,500	
リンナイ	23,000	11,870.00	273,010,000	
ユニプレス	23,200	1,017.00	23,594,400	
ダイニチ工業	6,600	1,004.00	6,626,400	
日東精工	15,400	453.00	6,976,200	
三洋工業	1,300	1,974.00	2,566,200	
岡部	24,300	778.00	18,905,400	
ジーテクト	14,600	1,529.00	22,323,400	
東プレ	22,100	1,587.00	35,072,700	
高周波熱錬	22,800	505.00	11,514,000	
東京製綱	8,400	870.00	7,308,000	
サンコール	9,500	471.00	4,474,500	
モリテックスチール	9,500	447.00	4,246,500	
パイオラックス	17,400	1,568.00	27,283,200	
エイチワン	11,800	814.00	9,605,200	
日本発条	126,200	752.00	94,902,400	
中央発條	1,000	2,923.00	2,923,000	
アドバネクス	1,600	1,306.00	2,089,600	
三浦工業	51,100	6,100.00	311,710,000	
タクマ	40,000	2,100.00	84,000,000	
テクノプロ・ホールディングス	22,800	9,130.00	208,164,000	
アトラ	2,600	313.00	813,800	
インターワークス	1,900	351.00	666,900	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,700	16,690.00	78,443,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	8,300	2,298.00	19,073,400	
ファーストロジック	2,200	766.00	1,685,200	
三機サービス	2,300	975.00	2,242,500	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,900	737.00	5,085,300	
デザインワン・ジャパン	3,600	204.00	734,400	
イー・ガーディアン	4,900	2,970.00	14,553,000	
リブセンス	6,300	246.00	1,549,800	
ジャパンマテリアル	35,000	1,497.00	52,395,000	
ベクトル	14,100	1,002.00	14,128,200	

ウチヤマホールディングス	5,900	341.00	2,011,900	
チャーム・ケア・コーポレーション	9,800	1,300.00	12,740,000	
キャリアリンク	3,800	2,151.00	8,173,800	
ＩＢＪ	9,300	783.00	7,281,900	
アサンテ	4,900	1,614.00	7,908,600	
Ｎ・フィールド	7,600	837.00	6,361,200	
バリューＨＲ	4,600	1,672.00	7,691,200	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	9,300	5,300.00	49,290,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	2,192.00	9,864,000	
ＥＲＩホールディングス	2,900	616.00	1,786,400	
アビスト	1,800	2,900.00	5,220,000	
シグマクシス	7,700	1,664.00	12,812,800	
ウィルグループ	7,400	989.00	7,318,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,900	302.00	5,103,800	
メドピア	5,300	8,020.00	42,506,000	
リクルートホールディングス	816,000	4,376.00	3,570,816,000	
エラン	15,800	1,476.00	23,320,800	
ツガミ	24,300	1,587.00	38,564,100	
オークマ	13,700	6,040.00	82,748,000	
芝浦機械	13,300	2,327.00	30,949,100	
アマダ	146,100	1,194.00	174,443,400	
アイダエンジニアリング	30,900	1,020.00	31,518,000	
滝澤鉄工所	4,500	1,018.00	4,581,000	
ＦＵＪＩ	50,700	2,818.00	142,872,600	
牧野フライス製作所	13,700	4,115.00	56,375,500	
オーエスジー	58,100	2,019.00	117,303,900	
ダイジェット工業	1,000	1,385.00	1,385,000	
旭ダイヤモンド工業	31,000	482.00	14,942,000	
ＤＭＧ森精機	74,500	1,669.00	124,340,500	
ソディック	25,800	911.00	23,503,800	
ディスコ	16,000	37,050.00	592,800,000	
日東工器	6,500	1,792.00	11,648,000	
日進工具	4,800	2,547.00	12,225,600	
パンチ工業	10,800	435.00	4,698,000	
冨士ダイス	4,500	670.00	3,015,000	
土木管理総合試験所	5,800	333.00	1,931,400	
ネットマーケティング	4,400	626.00	2,754,400	
日本郵政	934,200	845.80	790,146,360	
ベルシステム２４ホールディングス	19,100	1,721.00	32,871,100	
鎌倉新書	8,600	1,007.00	8,660,200	
ＳＭＮ	2,500	768.00	1,920,000	
一蔵	1,700	339.00	576,300	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	4,000	3,885.00	15,540,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,100	912.00	1,915,200	
エアトリ	6,000	1,251.00	7,506,000	
アトラエ	3,600	2,697.00	9,709,200	
ストライク	4,400	4,695.00	20,658,000	
ソラスト	31,500	1,515.00	47,722,500	
セラク	3,700	2,419.00	8,950,300	

インソース	9,600	1,799.00	17,270,400	
豊田自動織機	96,500	8,460.00	816,390,000	
豊和工業	6,600	912.00	6,019,200	
ＯＫＫ	4,900	421.00	2,062,900	
石川製作所	2,900	1,827.00	5,298,300	
東洋機械金属	8,600	426.00	3,663,600	
津田駒工業	2,500	909.00	2,272,500	
エンシュウ	2,500	915.00	2,287,500	
島精機製作所	18,500	1,766.00	32,671,000	
オプトラン	14,700	2,192.00	32,222,400	
ＮＣホールディングス	3,200	599.00	1,916,800	
イワキ	7,600	838.00	6,368,800	
フリュー	11,500	1,113.00	12,799,500	
ヤマシンフィルタ	26,300	1,087.00	28,588,100	
日阪製作所	14,800	896.00	13,260,800	
やまびこ	22,900	1,378.00	31,556,200	
平田機工	5,500	7,990.00	43,945,000	
ペガサスミシン製造	12,400	326.00	4,042,400	
マルマエ	4,500	1,402.00	6,309,000	
タツモ	5,000	1,508.00	7,540,000	
ナブテスコ	69,500	4,940.00	343,330,000	
三井海洋開発	12,500	2,067.00	25,837,500	
レオン自動機	11,600	1,257.00	14,581,200	
ＳＭＣ	37,400	67,580.00	2,527,492,000	
ホソカワミクロン	4,300	6,530.00	28,079,000	
ユニオンツール	4,600	3,115.00	14,329,000	
オイレス工業	15,400	1,669.00	25,702,600	
日精エー・エス・ビー機械	3,500	6,540.00	22,890,000	
サトーホールディングス	16,800	2,310.00	38,808,000	
技研製作所	10,400	4,270.00	44,408,000	
日本エアーテック	3,900	1,653.00	6,446,700	
カワタ	3,700	992.00	3,670,400	
日精樹脂工業	10,300	930.00	9,579,000	
オカダアイヨン	4,000	1,178.00	4,712,000	
ワイエイシイホールディングス	5,000	1,145.00	5,725,000	
小松製作所	539,900	3,010.00	1,625,099,000	
住友重機械工業	68,200	2,781.00	189,664,200	
日立建機	47,700	3,090.00	147,393,000	
日工	16,400	728.00	11,939,200	
巴工業	4,900	2,010.00	9,849,000	
井関農機	12,000	1,410.00	16,920,000	
ＴＯＷＡ	12,000	2,200.00	26,400,000	
丸山製作所	2,400	1,536.00	3,686,400	
北川鉄工所	5,600	1,379.00	7,722,400	
シンニッタン	19,300	211.00	4,072,300	
ローツェ	5,200	7,390.00	38,428,000	
タカキタ	4,700	742.00	3,487,400	
クボタ	626,300	2,286.00	1,431,721,800	
荏原実業	3,100	4,085.00	12,663,500	
東洋エンジニアリング	15,700	466.00	7,316,200	

三菱化工機	4,200	3,315.00	13,923,000	
月島機械	22,000	1,468.00	32,296,000	
帝国電機製作所	10,000	1,209.00	12,090,000	
東京機械製作所	4,400	283.00	1,245,200	
新東工業	28,500	785.00	22,372,500	
澁谷工業	10,500	3,680.00	38,640,000	
アイチコーポレーション	20,600	920.00	18,952,000	
小森コーポレーション	30,300	735.00	22,270,500	
鶴見製作所	9,300	1,782.00	16,572,600	
住友精密工業	1,800	2,042.00	3,675,600	
日本ギア工業	6,100	297.00	1,811,700	
酒井重工業	1,900	2,247.00	4,269,300	
荏原製作所	49,400	3,565.00	176,111,000	
石井鐵工所	1,200	2,889.00	3,466,800	
酉島製作所	12,400	861.00	10,676,400	
北越工業	12,500	1,100.00	13,750,000	
ダイキン工業	151,900	23,950.00	3,638,005,000	
オルガノ	4,400	6,040.00	26,576,000	
トーヨーカネツ	5,200	2,300.00	11,960,000	
栗田工業	64,400	4,410.00	284,004,000	
椿本チエイン	17,000	2,853.00	48,501,000	
大同工業	4,700	735.00	3,454,500	
日機装	38,600	1,045.00	40,337,000	
木村化工機	10,000	613.00	6,130,000	
レイズネクスト	20,100	1,241.00	24,944,100	
アネスト岩田	18,600	1,112.00	20,683,200	
ダイフク	61,000	13,360.00	814,960,000	
サムコ	3,100	3,905.00	12,105,500	
加藤製作所	6,500	983.00	6,389,500	
油研工業	1,700	1,560.00	2,652,000	
タダノ	57,500	949.00	54,567,500	
フジテック	43,400	2,313.00	100,384,200	
ＣＫＤ	32,800	2,416.00	79,244,800	
キトー	9,200	1,557.00	14,324,400	
平和	33,300	1,456.00	48,484,800	
理想科学工業	10,600	1,410.00	14,946,000	
ＳＡＮＫＹＯ	26,400	2,840.00	74,976,000	
日本金銭機械	13,500	525.00	7,087,500	
マースグループホールディングス	7,600	1,557.00	11,833,200	
フクシマガリレイ	7,300	4,405.00	32,156,500	
オーイズミ	5,500	413.00	2,271,500	
ダイコク電機	5,700	889.00	5,067,300	
竹内製作所	19,800	2,669.00	52,846,200	
アマノ	31,100	2,460.00	76,506,000	
ＪＵＫＩ	16,800	528.00	8,870,400	
サンデンホールディングス	15,600	363.00	5,662,800	
蛇の目ミシン工業	10,800	838.00	9,050,400	
ブラザー工業	145,600	2,301.00	335,025,600	
マックス	18,200	1,431.00	26,044,200	
モリタホールディングス	21,000	1,795.00	37,695,000	

グローリー	30,500	2,085.00	63,592,500	
新晃工業	11,200	1,824.00	20,428,800	
大和冷機工業	19,100	1,025.00	19,577,500	
セガサミーホールディングス	118,300	1,594.00	188,570,200	
日本ピストンリング	4,600	939.00	4,319,400	
リケン	5,500	2,118.00	11,649,000	
ＴＰＲ	16,000	1,499.00	23,984,000	
ツバキ・ナカシマ	22,800	1,187.00	27,063,600	
ホシザキ	37,500	9,280.00	348,000,000	
大豊工業	10,200	774.00	7,894,800	
日本精工	224,100	937.00	209,981,700	
ＮＴＮ	274,300	266.00	72,963,800	
ジェイテクト	113,900	863.00	98,295,700	
不二越	11,100	4,560.00	50,616,000	
ミネベアミツミ	221,200	2,200.00	486,640,000	
日本トムソン	34,900	430.00	15,007,000	
ＴＨＫ	74,200	3,660.00	271,572,000	
ユーシン精機	9,500	984.00	9,348,000	
前澤給装工業	4,300	2,337.00	10,049,100	
イーグル工業	14,800	1,008.00	14,918,400	
前澤工業	8,600	551.00	4,738,600	
日本ピラー工業	12,100	1,579.00	19,105,900	
キッツ	43,600	639.00	27,860,400	
日立製作所	572,900	4,352.00	2,493,260,800	
三菱電機	1,192,000	1,637.50	1,951,900,000	
富士電機	71,900	4,185.00	300,901,500	
東洋電機製造	4,600	1,191.00	5,478,600	
安川電機	128,400	5,420.00	695,928,000	
シンフォニア　テクノロジー	15,500	1,531.00	23,730,500	
明電舎	22,000	2,743.00	60,346,000	
オリジン	2,700	1,391.00	3,755,700	
山洋電気	5,700	5,900.00	33,630,000	
デンヨー	10,200	2,223.00	22,674,600	
ベイカレント・コンサルティング	6,800	18,050.00	122,740,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,300	2,028.00	4,664,400	
アイモバイル	4,100	1,358.00	5,567,800	
キャリアインデックス	4,700	561.00	2,636,700	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,900	1,088.00	4,243,200	
船場	1,600	839.00	1,342,400	
グレイステクノロジー	5,200	6,190.00	32,188,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	26,300	2,467.00	64,882,100	
フルテック	1,300	1,356.00	1,762,800	
グリーンズ	2,900	436.00	1,264,400	
ツナググループ・ホールディングス	1,700	304.00	516,800	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	3,600	574.00	2,066,400	
ソウルドアウト	2,700	1,525.00	4,117,500	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,200	590.00	1,298,000	
エル・ティー・エス	800	3,710.00	2,968,000	

ミダック	1,400	3,140.00	4,396,000	
日総工産	7,500	701.00	5,257,500	
キュービーネットホールディングス	4,800	1,396.00	6,700,800	
ＲＰＡホールディングス	8,600	696.00	5,985,600	
三櫻工業	15,100	912.00	13,771,200	
マキタ	155,400	4,990.00	775,446,000	
東芝テック	15,000	3,855.00	57,825,000	
芝浦メカトロニクス	2,100	5,100.00	10,710,000	
マブチモーター	33,100	4,305.00	142,495,500	
日本電産	286,800	14,305.00	4,102,674,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,100	448.00	3,180,800	
トレックス・セミコンダクター	6,900	1,479.00	10,205,100	
東光高岳	6,700	1,748.00	11,711,600	
ダブル・スコープ	19,400	1,017.00	19,729,800	
宮越ホールディングス	4,800	695.00	3,336,000	
ダイヘン	13,000	5,080.00	66,040,000	
ヤーマン	19,400	2,006.00	38,916,400	
ＪＶＣケンウッド	96,500	175.00	16,887,500	
ミマキエンジニアリング	11,200	492.00	5,510,400	
Ｉ－ＰＥＸ	5,500	2,000.00	11,000,000	
日新電機	28,000	1,349.00	37,772,000	
大崎電気工業	23,900	606.00	14,483,400	
オムロン	106,900	9,550.00	1,020,895,000	
日東工業	17,500	2,110.00	36,925,000	
ＩＤＥＣ	17,200	1,836.00	31,579,200	
正興電機製作所	2,700	2,313.00	6,245,100	
不二電機工業	2,000	1,309.00	2,618,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	39,800	3,315.00	131,937,000	
サクサホールディングス	3,100	1,399.00	4,336,900	
メルコホールディングス	4,200	3,530.00	14,826,000	
テクノメディカ	2,600	1,610.00	4,186,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	2,500	1,600.00	4,000,000	
日本電気	144,500	5,910.00	853,995,000	
富士通	114,900	16,010.00	1,839,549,000	
沖電気工業	48,500	1,018.00	49,373,000	
岩崎通信機	4,500	846.00	3,807,000	
電気興業	5,700	2,715.00	15,475,500	
サンケン電気	13,000	5,060.00	65,780,000	
ナカヨ	1,900	1,447.00	2,749,300	
アイホン	6,800	1,665.00	11,322,000	
ルネサスエレクトロニクス	510,900	1,209.00	617,678,100	
セイコーエプソン	147,900	1,558.00	230,428,200	
ワコム	80,200	958.00	76,831,600	
アルバック	22,000	4,625.00	101,750,000	
アクセル	5,000	759.00	3,795,000	
ＥＩＺＯ	9,300	3,610.00	33,573,000	
ジャパンディスプレイ	345,100	49.00	16,909,900	
日本信号	30,300	956.00	28,966,800	
京三製作所	27,900	427.00	11,913,300	

能美防災	15,800	2,279.00	36,008,200	
ホーチキ	8,800	1,289.00	11,343,200	
星和電機	6,000	698.00	4,188,000	
エレコム	13,700	5,150.00	70,555,000	
パナソニック	1,361,900	1,292.50	1,760,255,750	
シャープ	137,900	1,728.00	238,291,200	
アンリツ	76,700	2,504.00	192,056,800	
富士通ゼネラル	32,400	2,798.00	90,655,200	
ソニー	746,800	10,850.00	8,102,780,000	
ＴＤＫ	57,600	16,400.00	944,640,000	
帝国通信工業	4,500	1,039.00	4,675,500	
タムラ製作所	39,800	578.00	23,004,400	
アルプスアルパイン	105,300	1,437.00	151,316,100	
池上通信機	3,400	899.00	3,056,600	
日本電波工業	10,900	642.00	6,997,800	
鈴木	6,000	1,188.00	7,128,000	
日本トリム	1,600	4,275.00	6,840,000	
ローランド　ディー．ジー．	7,000	1,869.00	13,083,000	
フォスター電機	12,500	1,399.00	17,487,500	
ＳＭＫ	3,200	3,025.00	9,680,000	
ヨコオ	7,600	3,085.00	23,446,000	
ティアック	9,300	110.00	1,023,000	
ホシデン	32,700	1,000.00	32,700,000	
ヒロセ電機	18,300	15,630.00	286,029,000	
日本航空電子工業	27,300	1,627.00	44,417,100	
ＴＯＡ	12,900	914.00	11,790,600	
マクセルホールディングス	25,500	1,371.00	34,960,500	
古野電気	15,400	1,261.00	19,419,400	
ユニデンホールディングス	3,400	2,215.00	7,531,000	
スミダコーポレーション	10,200	1,054.00	10,750,800	
アイコム	6,600	2,774.00	18,308,400	
リオン	5,000	3,440.00	17,200,000	
本多通信工業	10,500	488.00	5,124,000	
船井電機	12,300	429.00	5,276,700	
横河電機	109,300	2,269.00	248,001,700	
新電元工業	4,300	2,840.00	12,212,000	
アズビル	75,200	5,900.00	443,680,000	
東亜ディーケーケー	6,200	840.00	5,208,000	
日本光電工業	49,300	3,180.00	156,774,000	
チノー	3,700	1,526.00	5,646,200	
共和電業	10,600	405.00	4,293,000	
日本電子材料	4,800	2,274.00	10,915,200	
堀場製作所	23,600	6,400.00	151,040,000	
アドバンテスト	88,700	8,260.00	732,662,000	
小野測器	4,400	518.00	2,279,200	
エスペック	10,600	2,083.00	22,079,800	
キーエンス	108,000	58,520.00	6,320,160,000	
日置電機	5,700	4,340.00	24,738,000	
シスメックス	85,200	13,170.00	1,122,084,000	
日本マイクロニクス	20,900	1,417.00	29,615,300	

メガチップス	11,100	3,240.00	35,964,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,900	4,170.00	28,773,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	10,500	339.00	3,559,500	
澤藤電機	1,400	2,203.00	3,084,200	
デンソー	262,500	6,065.00	1,592,062,500	
原田工業	4,800	855.00	4,104,000	
コーセル	15,900	1,297.00	20,622,300	
イリソ電子工業	10,100	4,250.00	42,925,000	
オプテックスグループ	19,500	2,000.00	39,000,000	
千代田インテグレ	5,200	1,782.00	9,266,400	
アイ・オー・データ機器	4,100	1,042.00	4,272,200	
レーザーテック	52,400	14,450.00	757,180,000	
スタンレー電気	83,500	3,355.00	280,142,500	
岩崎電気	4,800	1,452.00	6,969,600	
ウシオ電機	65,800	1,366.00	89,882,800	
岡谷電機産業	9,100	385.00	3,503,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	11,800	313.00	3,693,400	
エノモト	3,800	1,554.00	5,905,200	
日本セラミック	12,100	3,020.00	36,542,000	
遠藤照明	6,800	524.00	3,563,200	
古河電池	8,400	1,805.00	15,162,000	
双信電機	5,900	469.00	2,767,100	
山一電機	8,600	1,615.00	13,889,000	
図研	7,700	2,749.00	21,167,300	
日本電子	23,500	4,945.00	116,207,500	
カシオ計算機	105,500	1,871.00	197,390,500	
ファナック	112,100	26,845.00	3,009,324,500	
日本シイエムケイ	28,000	426.00	11,928,000	
エンプラス	6,000	4,140.00	24,840,000	
大真空	4,500	2,637.00	11,866,500	
ローム	49,500	10,770.00	533,115,000	
浜松ホトニクス	85,500	6,100.00	521,550,000	
三井ハイテック	13,100	4,530.00	59,343,000	
新光電気工業	40,100	2,577.00	103,337,700	
京セラ	167,700	6,629.00	1,111,683,300	
協栄産業	1,000	1,510.00	1,510,000	
太陽誘電	53,000	5,220.00	276,660,000	
村田製作所	350,200	10,110.00	3,540,522,000	
双葉電子工業	18,900	1,003.00	18,956,700	
日東電工	82,200	9,430.00	775,146,000	
北陸電気工業	4,300	918.00	3,947,400	
東海理化電機製作所	31,400	1,765.00	55,421,000	
ニチコン	40,400	1,441.00	58,216,400	
日本ケミコン	9,500	2,077.00	19,731,500	
ＫＯＡ	17,900	1,521.00	27,225,900	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	43,000	394.00	16,942,000	
日立造船	94,600	669.00	63,287,400	
三菱重工業	199,700	3,310.00	661,007,000	
川崎重工業	92,500	2,562.00	236,985,000	
ＩＨＩ	85,700	2,062.00	176,713,400	

名村造船所	38,800	182.00	7,061,600	
サノヤスホールディングス	15,800	164.00	2,591,200	
スプリックス	3,300	811.00	2,676,300	
マネジメントソリューションズ	5,500	2,130.00	11,715,000	
プロレド・パートナーズ	1,500	3,540.00	5,310,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	1,000	723.00	723,000	
フロンティア・マネジメント	1,800	2,201.00	3,961,800	
ピアラ	600	2,031.00	1,218,600	
コプロ・ホールディングス	700	3,560.00	2,492,000	
ギークス	1,200	1,216.00	1,459,200	
カーブスホールディングス	31,200	703.00	21,933,600	
フォーラムエンジニアリング	5,900	897.00	5,292,300	
日本車輌製造	4,500	2,506.00	11,277,000	
三菱ロジスネクスト	15,800	1,254.00	19,813,200	
近畿車輌	1,600	1,280.00	2,048,000	
ＦＰＧ	36,000	503.00	18,108,000	
島根銀行	3,500	659.00	2,306,500	
じもとホールディングス	8,000	834.00	6,672,000	
全国保証	33,200	4,580.00	152,056,000	
めぶきフィナンシャルグループ	609,400	215.00	131,021,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,800	1,260.00	7,308,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,900	1,136.00	18,062,400	
九州フィナンシャルグループ	257,100	446.00	114,666,600	
かんぽ生命保険	41,600	2,240.00	93,184,000	
ゆうちょ銀行	333,700	890.00	296,993,000	
富山第一銀行	29,200	288.00	8,409,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	670,700	380.00	254,866,000	
ジェイリース	3,400	654.00	2,223,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	78,200	662.00	51,768,400	
マーキュリアインベストメント	4,900	744.00	3,645,600	
イントラスト	4,300	810.00	3,483,000	
日本モーゲージサービス	4,900	1,207.00	5,914,300	
ＣＡＳＡ	4,200	1,027.00	4,313,400	
アルヒ	18,600	1,714.00	31,880,400	
プレミアグループ	6,300	2,557.00	16,109,100	
日産自動車	1,406,000	546.00	767,676,000	
いすゞ自動車	345,400	1,009.00	348,508,600	
トヨタ自動車	1,330,200	7,892.00	10,497,938,400	
日野自動車	148,800	917.00	136,449,600	
三菱自動車工業	440,300	232.00	102,149,600	
エフテック	8,300	642.00	5,328,600	
レシップホールディングス	4,700	504.00	2,368,800	
ＧＭＢ	1,700	1,002.00	1,703,400	
ファルテック	1,700	649.00	1,103,300	
武蔵精密工業	26,500	1,740.00	46,110,000	
日産車体	23,400	867.00	20,287,800	
新明和工業	32,200	914.00	29,430,800	

極東開発工業	22,200	1,435.00	31,857,000	
トピー工業	10,000	1,274.00	12,740,000	
ティラド	4,600	1,334.00	6,136,400	
曙ブレーキ工業	65,400	127.00	8,305,800	
タチエス	19,500	1,205.00	23,497,500	
ＮＯＫ	64,000	1,172.00	75,008,000	
フタバ産業	33,300	528.00	17,582,400	
ＫＹＢ	13,300	2,400.00	31,920,000	
市光工業	18,000	685.00	12,330,000	
大同メタル工業	23,200	519.00	12,040,800	
プレス工業	59,000	314.00	18,526,000	
ミクニ	16,800	273.00	4,586,400	
太平洋工業	24,900	1,160.00	28,884,000	
河西工業	16,500	394.00	6,501,000	
アイシン精機	98,200	3,230.00	317,186,000	
マツダ	350,300	750.00	262,725,000	
今仙電機製作所	10,800	736.00	7,948,800	
本田技研工業	938,600	2,888.00	2,710,676,800	
スズキ	236,300	5,316.00	1,256,170,800	
ＳＵＢＡＲＵ	370,000	2,108.50	780,145,000	
安永	5,800	1,242.00	7,203,600	
ヤマハ発動機	168,400	2,169.00	365,259,600	
小糸製作所	71,500	6,980.00	499,070,000	
ＴＢＫ	12,000	459.00	5,508,000	
エクセディ	16,100	1,363.00	21,944,300	
ミツバ	22,100	472.00	10,431,200	
豊田合成	38,600	2,955.00	114,063,000	
愛三工業	18,900	548.00	10,357,200	
盟和産業	1,600	895.00	1,432,000	
日本プラスト	9,900	504.00	4,989,600	
ヨロズ	11,300	1,120.00	12,656,000	
エフ・シー・シー	19,400	1,801.00	34,939,400	
新家工業	2,700	1,267.00	3,420,900	
シマノ	44,600	24,950.00	1,112,770,000	
テイ・エス　テック	27,700	3,235.00	89,609,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	69,200	542.00	37,506,400	
三十三フィナンシャルグループ	11,100	1,284.00	14,252,400	
第四北越フィナンシャルグループ	20,400	2,304.00	47,001,600	
ひろぎんホールディングス	173,500	612.00	106,182,000	
ダイレクトマーケティングミックス	4,600	2,747.00	12,636,200	
ジャムコ	6,200	631.00	3,912,200	
小野建	11,000	1,269.00	13,959,000	
はるやまホールディングス	6,200	684.00	4,240,800	
南陽	2,100	1,666.00	3,498,600	
ノジマ	21,000	2,801.00	58,821,000	
佐鳥電機	8,300	778.00	6,457,400	
カッパ・クリエイト	16,500	1,429.00	23,578,500	
エコートレーディング	3,400	682.00	2,318,800	
伯東	7,200	1,144.00	8,236,800	
コンドーテック	9,400	1,106.00	10,396,400	

中山福	7,200	583.00	4,197,600	
ライトオン	9,000	650.00	5,850,000	
ナガイレーベン	15,600	2,946.00	45,957,600	
ジーンズメイト	3,700	297.00	1,098,900	
三菱食品	13,000	2,877.00	37,401,000	
良品計画	155,800	2,486.00	387,318,800	
三城ホールディングス	10,600	310.00	3,286,000	
松田産業	8,700	1,851.00	16,103,700	
第一興商	17,400	3,465.00	60,291,000	
メディパルホールディングス	126,600	2,053.00	259,909,800	
アドヴァン	18,000	1,270.00	22,860,000	
ＳＰＫ	5,300	1,273.00	6,746,900	
萩原電気ホールディングス	4,600	2,621.00	12,056,600	
アルビス	4,600	2,518.00	11,582,800	
アズワン	7,600	17,350.00	131,860,000	
スズデン	3,600	1,245.00	4,482,000	
尾家産業	3,100	1,279.00	3,964,900	
シモジマ	6,600	1,426.00	9,411,600	
ドウシシャ	11,100	1,948.00	21,622,800	
小津産業	2,300	1,923.00	4,422,900	
コナカ	14,400	294.00	4,233,600	
高速	7,000	1,634.00	11,438,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,200	1,668.00	2,001,600	
Ｇ－７ホールディングス	6,900	2,383.00	16,442,700	
たけびし	3,600	1,581.00	5,691,600	
イオン北海道	15,900	988.00	15,709,200	
コジマ	20,300	693.00	14,067,900	
ヒマラヤ	4,700	950.00	4,465,000	
コーナン商事	16,700	3,295.00	55,026,500	
ネットワンシステムズ	44,600	3,460.00	154,316,000	
エコス	4,500	2,061.00	9,274,500	
ワタミ	13,800	850.00	11,730,000	
マルシェ	3,100	500.00	1,550,000	
リックス	2,200	1,565.00	3,443,000	
システムソフト	26,000	91.00	2,366,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	258,200	2,288.00	590,761,600	
丸文	11,000	530.00	5,830,000	
西松屋チェーン	25,700	1,575.00	40,477,500	
ゼンショーホールディングス	56,200	2,665.00	149,773,000	
ハピネット	9,900	1,600.00	15,840,000	
幸楽苑ホールディングス	7,400	1,553.00	11,492,200	
ハークスレイ	2,000	889.00	1,778,000	
橋本総業ホールディングス	2,000	2,719.00	5,438,000	
日本ライフライン	34,700	1,659.00	57,567,300	
サイゼリヤ	17,300	1,850.00	32,005,000	
タカショー	7,600	885.00	6,726,000	
ＶＴホールディングス	48,900	442.00	21,613,800	
マルカ	4,000	2,049.00	8,196,000	
アルゴグラフィックス	10,000	3,055.00	30,550,000	

魚力	3,600	1,792.00	6,451,200	
ＩＤＯＭ	31,800	605.00	19,239,000	
日本エム・ディ・エム	6,800	2,393.00	16,272,400	
ポプラ	3,400	365.00	1,241,000	
フジ・コーポレーション	3,300	2,303.00	7,599,900	
ユナイテッドアローズ	12,200	1,447.00	17,653,400	
進和	7,000	2,164.00	15,148,000	
エスケイジャパン	2,400	492.00	1,180,800	
ダイトロン	5,000	1,625.00	8,125,000	
ハイデイ日高	16,900	1,620.00	27,378,000	
シークス	15,000	1,566.00	23,490,000	
京都きもの友禅	6,500	216.00	1,404,000	
コロワイド	39,000	1,554.00	60,606,000	
ピーシーデポコーポレーション	15,600	584.00	9,110,400	
田中商事	3,200	703.00	2,249,600	
オーハシテクニカ	6,300	1,488.00	9,374,400	
壱番屋	8,200	5,040.00	41,328,000	
白銅	3,700	1,466.00	5,424,200	
トップカルチャー	4,900	349.00	1,710,100	
ＰＬＡＮＴ	3,200	746.00	2,387,200	
スギホールディングス	23,500	6,880.00	161,680,000	
ダイコー通産	800	1,596.00	1,276,800	
薬王堂ホールディングス	5,100	2,741.00	13,979,100	
島津製作所	142,400	4,045.00	576,008,000	
ＪＭＳ	10,200	981.00	10,006,200	
クボテック	2,700	365.00	985,500	
長野計器	8,700	995.00	8,656,500	
ブイ・テクノロジー	5,500	6,530.00	35,915,000	
スター精密	18,300	1,608.00	29,426,400	
東京計器	7,700	945.00	7,276,500	
愛知時計電機	1,200	4,420.00	5,304,000	
インターアクション	6,300	1,952.00	12,297,600	
オーバル	11,600	340.00	3,944,000	
東京精密	21,700	5,190.00	112,623,000	
マニー	47,400	2,873.00	136,180,200	
ニコン	181,800	756.00	137,440,800	
トプコン	60,000	1,449.00	86,940,000	
オリンパス	659,600	2,146.50	1,415,831,400	
理研計器	10,600	3,235.00	34,291,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	20,700	8,110.00	167,877,000	
キヤノン電子	11,100	1,504.00	16,694,400	
タムロン	9,700	1,942.00	18,837,400	
ＨＯＹＡ	236,600	14,255.00	3,372,733,000	
シード	5,300	609.00	3,227,700	
ノーリツ鋼機	7,900	2,270.00	17,933,000	
エー・アンド・デイ	10,900	1,343.00	14,638,700	
朝日インテック	135,100	3,650.00	493,115,000	
キヤノン	592,300	2,015.50	1,193,780,650	
リコー	303,200	700.00	212,240,000	
シチズン時計	138,800	316.00	43,860,800	

リズム	3,200	660.00	2,112,000	
大研医器	8,700	566.00	4,924,200	
メニコン	16,900	6,580.00	111,202,000	
シンシア	1,200	642.00	770,400	
中本パックス	2,600	1,657.00	4,308,200	
スノーピーク	6,900	1,709.00	11,792,100	
パラマウントベッドホールディングス	12,600	4,730.00	59,598,000	
トランザクション	6,500	957.00	6,220,500	
粧美堂	3,100	399.00	1,236,900	
ニホンフラッシュ	11,200	1,301.00	14,571,200	
前田工繊	13,100	2,828.00	37,046,800	
永大産業	17,100	282.00	4,822,200	
アートネイチャー	12,900	656.00	8,462,400	
バンダイナムコホールディングス	123,300	8,993.00	1,108,836,900	
アイフィスジャパン	3,600	717.00	2,581,200	
共立印刷	16,400	119.00	1,951,600	
ＳＨＯＥＩ	10,500	4,040.00	42,420,000	
フランスベッドホールディングス	17,200	952.00	16,374,400	
マーベラス	17,800	940.00	16,732,000	
パイロットコーポレーション	21,100	3,010.00	63,511,000	
萩原工業	6,600	1,518.00	10,018,800	
エイベックス	20,100	1,154.00	23,195,400	
トッパン・フォームズ	25,500	1,051.00	26,800,500	
フジシールインターナショナル	26,800	2,019.00	54,109,200	
タカラトミー	53,300	903.00	48,129,900	
廣済堂	8,300	752.00	6,241,600	
エステールホールディングス	4,100	620.00	2,542,000	
レック	12,700	1,342.00	17,043,400	
タカノ	4,600	598.00	2,750,800	
三光合成	14,400	398.00	5,731,200	
プロネクサス	10,500	1,068.00	11,214,000	
ホクシン	6,500	114.00	741,000	
ウッドワン	3,500	1,070.00	3,745,000	
大建工業	8,000	1,747.00	13,976,000	
きもと	21,800	178.00	3,880,400	
凸版印刷	168,300	1,506.00	253,459,800	
大日本印刷	155,900	1,891.00	294,806,900	
共同印刷	3,100	3,250.00	10,075,000	
ＮＩＳＳＨＡ	24,400	1,466.00	35,770,400	
光村印刷	800	1,798.00	1,438,400	
藤森工業	10,700	4,800.00	51,360,000	
ヴィア・ホールディングス	14,500	230.00	3,335,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	5,700	1,757.00	10,014,900	
前澤化成工業	8,000	989.00	7,912,000	
未来工業	6,000	1,699.00	10,194,000	
アシックス	105,300	1,968.00	207,230,400	
ツツミ	3,900	2,173.00	8,474,700	
ウェーブロックホールディングス	4,300	760.00	3,268,000	
ＪＳＰ	6,900	1,772.00	12,226,800	
ニチハ	16,600	3,365.00	55,859,000	

エフピコ	25,000	4,230.00	105,750,000	
小松ウオール工業	4,000	1,818.00	7,272,000	
ヤマハ	70,900	6,080.00	431,072,000	
河合楽器製作所	3,800	3,000.00	11,400,000	
クリナップ	11,600	486.00	5,637,600	
ピジョン	76,500	4,325.00	330,862,500	
天馬	7,900	2,164.00	17,095,600	
オリバー	2,500	2,513.00	6,282,500	
兼松サステック	600	1,795.00	1,077,000	
キングジム	10,400	867.00	9,016,800	
象印マホービン	32,200	1,866.00	60,085,200	
リンテック	28,400	2,364.00	67,137,600	
信越ポリマー	21,500	966.00	20,769,000	
東リ	31,700	245.00	7,766,500	
イトーキ	23,800	345.00	8,211,000	
任天堂	73,000	66,550.00	4,858,150,000	
三菱鉛筆	19,600	1,354.00	26,538,400	
松風	5,400	1,855.00	10,017,000	
タカラスタンダード	24,600	1,570.00	38,622,000	
コクヨ	57,200	1,434.00	82,024,800	
ナカバヤシ	12,300	630.00	7,749,000	
ニフコ	43,700	4,085.00	178,514,500	
立川ブラインド工業	5,500	1,365.00	7,507,500	
グローブライド	5,300	4,385.00	23,240,500	
オカムラ	41,700	999.00	41,658,300	
バルカー	9,800	2,151.00	21,079,800	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,200	1,514.00	1,816,800	
伊藤忠商事	821,300	3,106.00	2,550,957,800	
丸紅	1,221,800	737.00	900,466,600	
スクロール	17,900	838.00	15,000,200	
高島	1,600	1,642.00	2,627,200	
ヨンドシーホールディングス	12,000	2,040.00	24,480,000	
三陽商会	6,100	628.00	3,830,800	
長瀬産業	66,100	1,582.00	104,570,200	
ナイガイ	3,900	340.00	1,326,000	
蝶理	7,500	1,590.00	11,925,000	
豊田通商	131,000	4,300.00	563,300,000	
オンワードホールディングス	69,600	219.00	15,242,400	
三共生興	18,400	475.00	8,740,000	
兼松	43,700	1,361.00	59,475,700	
美津濃	10,800	2,058.00	22,226,400	
ツカモトコーポレーション	1,700	1,516.00	2,577,200	
ルックホールディングス	4,100	954.00	3,911,400	
三井物産	1,016,500	1,960.00	1,992,340,000	
日本紙パルプ商事	6,700	3,650.00	24,455,000	
東京エレクトロン	75,600	40,800.00	3,084,480,000	
カメイ	15,300	1,196.00	18,298,800	
東都水産	1,500	3,830.00	5,745,000	
ＯＵＧホールディングス	1,800	2,868.00	5,162,400	
スターゼン	4,500	4,310.00	19,395,000	

セイコーホールディングス	16,700	1,376.00	22,979,200	
山善	45,800	1,048.00	47,998,400	
椿本興業	1,700	3,815.00	6,485,500	
住友商事	740,700	1,415.00	1,048,090,500	
日本ユニシス	36,500	4,095.00	149,467,500	
内田洋行	4,700	4,305.00	20,233,500	
三菱商事	769,800	2,630.00	2,024,574,000	
第一実業	5,800	4,220.00	24,476,000	
キヤノンマーケティングジャパン	29,100	2,306.00	67,104,600	
西華産業	6,700	1,390.00	9,313,000	
佐藤商事	10,200	917.00	9,353,400	
菱洋エレクトロ	12,000	3,360.00	40,320,000	
東京産業	11,200	646.00	7,235,200	
ユアサ商事	11,200	3,430.00	38,416,000	
神鋼商事	2,900	1,884.00	5,463,600	
トルク	5,900	252.00	1,486,800	
阪和興業	22,000	2,925.00	64,350,000	
正栄食品工業	7,500	3,690.00	27,675,000	
カナデン	9,900	1,308.00	12,949,200	
菱電商事	8,600	1,585.00	13,631,000	
ニプロ	82,500	1,258.00	103,785,000	
フルサト工業	6,200	1,291.00	8,004,200	
岩谷産業	30,300	7,170.00	217,251,000	
ナイス	5,100	1,521.00	7,757,100	
昭光通商	3,500	626.00	2,191,000	
ニチモウ	1,600	1,921.00	3,073,600	
極東貿易	3,100	1,369.00	4,243,900	
イワキ	15,500	541.00	8,385,500	
兼松エレクトロニクス	6,400	4,155.00	26,592,000	
三愛石油	28,900	1,160.00	33,524,000	
稲畑産業	25,900	1,461.00	37,839,900	
ＧＳＩクレオス	2,900	1,814.00	5,260,600	
明和産業	11,000	458.00	5,038,000	
クワザワホールディングス	3,700	610.00	2,257,000	
キムラタン	74,500	24.00	1,788,000	
ヤマエ久野	8,700	1,141.00	9,926,700	
ゴールドウイン	21,200	6,650.00	140,980,000	
ユニ・チャーム	252,800	4,846.00	1,225,068,800	
デサント	22,800	1,874.00	42,727,200	
キング	4,700	599.00	2,815,300	
ワキタ	25,000	1,013.00	25,325,000	
ヤマトインターナショナル	10,800	331.00	3,574,800	
東邦ホールディングス	37,700	1,878.00	70,800,600	
サンゲツ	31,700	1,593.00	50,498,100	
ミツウロコグループホールディングス	17,300	1,460.00	25,258,000	
シナネンホールディングス	4,900	3,070.00	15,043,000	
伊藤忠エネクス	26,300	1,060.00	27,878,000	
サンリオ	32,900	1,429.00	47,014,100	
サンワ　テクノス	8,300	1,007.00	8,358,100	
リョーサン	13,000	2,002.00	26,026,000	

新光商事	17,900	779.00	13,944,100	
トーホー	5,400	1,916.00	10,346,400	
三信電気	6,400	2,049.00	13,113,600	
東陽テクニカ	12,500	1,206.00	15,075,000	
モスフードサービス	15,400	2,977.00	45,845,800	
加賀電子	11,700	2,407.00	28,161,900	
三益半導体工業	9,300	2,880.00	26,784,000	
都築電気	3,900	1,688.00	6,583,200	
ソーダニッカ	11,500	543.00	6,244,500	
立花エレテック	9,000	1,623.00	14,607,000	
木曽路	15,300	2,347.00	35,909,100	
ＳＲＳホールディングス	14,000	814.00	11,396,000	
千趣会	21,300	318.00	6,773,400	
タカキュー	11,600	159.00	1,844,400	
リテールパートナーズ	15,600	1,451.00	22,635,600	
ケーヨー	24,100	751.00	18,099,100	
上新電機	13,700	2,888.00	39,565,600	
日本瓦斯	18,500	5,630.00	104,155,000	
ロイヤルホールディングス	20,400	1,677.00	34,210,800	
東天紅	600	908.00	544,800	
いなげや	14,600	1,815.00	26,499,000	
チヨダ	12,500	891.00	11,137,500	
ライフコーポレーション	9,000	3,600.00	32,400,000	
リンガーハット	14,500	2,277.00	33,016,500	
ＭｒＭａｘＨＤ	16,200	820.00	13,284,000	
テンアライド	11,900	316.00	3,760,400	
ＡＯＫＩホールディングス	23,600	522.00	12,319,200	
オークワ	18,400	1,315.00	24,196,000	
コメリ	18,100	3,020.00	54,662,000	
青山商事	23,800	593.00	14,113,400	
しまむら	13,600	11,880.00	161,568,000	
はせがわ	5,300	297.00	1,574,100	
高島屋	85,200	889.00	75,742,800	
松屋	23,600	773.00	18,242,800	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	55,400	703.00	38,946,200	
近鉄百貨店	4,600	3,140.00	14,444,000	
丸井グループ	107,600	1,794.00	193,034,400	
クレディセゾン	82,200	1,229.00	101,023,800	
アクシアル　リテイリング	9,800	5,300.00	51,940,000	
井筒屋	5,600	179.00	1,002,400	
イオン	451,800	3,387.00	1,530,246,600	
イズミ	23,900	3,820.00	91,298,000	
フォーバル	4,900	817.00	4,003,300	
平和堂	23,900	2,197.00	52,508,300	
フジ	14,300	2,058.00	29,429,400	
ヤオコー	13,300	7,040.00	93,632,000	
ゼビオホールディングス	14,300	826.00	11,811,800	
ケーズホールディングス	113,200	1,405.00	159,046,000	
ＰＡＬＴＡＣ	18,800	5,720.00	107,536,000	
三谷産業	15,900	472.00	7,504,800	

Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6,100	944.00	5,758,400	
日産東京販売ホールディングス	14,600	267.00	3,898,200	
新生銀行	86,200	1,398.00	120,507,600	
あおぞら銀行	69,900	1,978.00	138,262,200	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,042,700	494.30	3,975,506,610	
りそなホールディングス	1,278,000	388.00	495,864,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	222,300	3,328.00	739,814,400	
三井住友フィナンシャルグループ	813,100	3,480.00	2,829,588,000	
千葉銀行	392,000	592.00	232,064,000	
群馬銀行	225,700	335.00	75,609,500	
武蔵野銀行	17,500	1,565.00	27,387,500	
千葉興業銀行	32,400	252.00	8,164,800	
筑波銀行	49,400	191.00	9,435,400	
七十七銀行	39,700	1,442.00	57,247,400	
青森銀行	9,200	2,470.00	22,724,000	
秋田銀行	7,500	1,413.00	10,597,500	
山形銀行	13,300	1,049.00	13,951,700	
岩手銀行	7,600	2,027.00	15,405,200	
東邦銀行	105,200	207.00	21,776,400	
東北銀行	5,400	1,144.00	6,177,600	
みちのく銀行	7,700	1,033.00	7,954,100	
ふくおかフィナンシャルグループ	99,000	1,972.00	195,228,000	
静岡銀行	286,100	783.00	224,016,300	
十六銀行	14,700	1,943.00	28,562,100	
スルガ銀行	119,400	345.00	41,193,000	
八十二銀行	283,500	358.00	101,493,000	
山梨中央銀行	13,600	790.00	10,744,000	
大垣共立銀行	23,300	2,105.00	49,046,500	
福井銀行	10,200	1,965.00	20,043,000	
北國銀行	11,700	2,660.00	31,122,000	
清水銀行	4,900	1,763.00	8,638,700	
富山銀行	1,900	2,913.00	5,534,700	
滋賀銀行	23,600	2,138.00	50,456,800	
南都銀行	19,600	1,772.00	34,731,200	
百五銀行	106,500	301.00	32,056,500	
京都銀行	42,100	5,880.00	247,548,000	
紀陽銀行	41,700	1,479.00	61,674,300	
ほくほくフィナンシャルグループ	78,100	1,005.00	78,490,500	
山陰合同銀行	69,800	509.00	35,528,200	
中国銀行	101,400	846.00	85,784,400	
鳥取銀行	4,200	1,157.00	4,859,400	
伊予銀行	167,900	673.00	112,996,700	
百十四銀行	12,500	1,510.00	18,875,000	
四国銀行	18,000	694.00	12,492,000	
阿波銀行	19,200	2,338.00	44,889,600	
大分銀行	6,800	2,110.00	14,348,000	
宮崎銀行	7,900	2,230.00	17,617,000	
佐賀銀行	7,200	1,387.00	9,986,400	
沖縄銀行	10,800	2,814.00	30,391,200	
琉球銀行	27,300	767.00	20,939,100	

セブン銀行	392,100	227.00	89,006,700	
みずほフィナンシャルグループ	1,597,500	1,425.00	2,276,437,500	
高知銀行	4,300	740.00	3,182,000	
山口フィナンシャルグループ	146,400	613.00	89,743,200	
芙蓉総合リース	12,300	7,240.00	89,052,000	
みずほリース	18,100	3,285.00	59,458,500	
東京センチュリー	23,700	8,770.00	207,849,000	
ＳＢＩホールディングス	135,000	2,675.00	361,125,000	
日本証券金融	52,000	533.00	27,716,000	
アイフル	178,600	255.00	45,543,000	
日本アジア投資	10,300	251.00	2,585,300	
長野銀行	4,200	1,329.00	5,581,800	
名古屋銀行	8,800	2,744.00	24,147,200	
北洋銀行	177,400	219.00	38,850,600	
愛知銀行	4,400	3,045.00	13,398,000	
中京銀行	5,000	2,018.00	10,090,000	
大光銀行	3,600	1,279.00	4,604,400	
愛媛銀行	16,800	995.00	16,716,000	
トマト銀行	4,600	1,053.00	4,843,800	
京葉銀行	50,200	421.00	21,134,200	
栃木銀行	57,200	174.00	9,952,800	
北日本銀行	3,800	2,018.00	7,668,400	
東和銀行	20,900	665.00	13,898,500	
福島銀行	11,300	205.00	2,316,500	
大東銀行	6,400	641.00	4,102,400	
リコーリース	9,400	3,190.00	29,986,000	
イオンフィナンシャルサービス	72,000	1,308.00	94,176,000	
アコム	236,400	457.00	108,034,800	
ジャックス	12,900	1,924.00	24,819,600	
オリエントコーポレーション	317,500	125.00	39,687,500	
日立キャピタル	27,700	2,649.00	73,377,300	
オリックス	729,400	1,836.50	1,339,543,100	
三菱ＵＦＪリース	297,600	527.00	156,835,200	
ジャフコ　グループ	18,000	5,540.00	99,720,000	
九州リースサービス	6,100	619.00	3,775,900	
トモニホールディングス	90,800	316.00	28,692,800	
大和証券グループ本社	943,400	502.20	473,775,480	
野村ホールディングス	2,068,500	581.20	1,202,212,200	
岡三証券グループ	99,800	401.00	40,019,800	
丸三証券	34,800	499.00	17,365,200	
東洋証券	41,900	138.00	5,782,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	134,100	323.00	43,314,300	
光世証券	3,100	662.00	2,052,200	
水戸証券	34,200	252.00	8,618,400	
いちよし証券	21,900	492.00	10,774,800	
松井証券	67,200	809.00	54,364,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	221,000	4,260.00	941,460,000	
日本取引所グループ	337,400	2,655.50	895,965,700	
マネックスグループ	86,200	473.00	40,772,600	

極東証券	15,800	747.00	11,802,600	
岩井コスモホールディングス	11,100	1,399.00	15,528,900	
藍澤證券	21,500	768.00	16,512,000	
フィデアホールディングス	116,300	110.00	12,793,000	
池田泉州ホールディングス	134,300	153.00	20,547,900	
アニコム　ホールディングス	39,100	1,189.00	46,489,900	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	307,500	3,265.00	1,003,987,500	
マネーパートナーズグループ	13,700	225.00	3,082,500	
スパークス・グループ	54,200	274.00	14,850,800	
小林洋行	3,100	271.00	840,100	
第一生命ホールディングス	665,200	1,775.00	1,180,730,000	
東京海上ホールディングス	415,700	5,573.00	2,316,696,100	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,800	660.00	3,828,000	
イー・ギャランティ	13,400	2,285.00	30,619,000	
アサックス	6,600	722.00	4,765,200	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,900	1,988.00	9,741,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	351,200	1,386.00	486,763,200	
アドバンスクリエイト	2,500	1,909.00	4,772,500	
三井不動産	571,400	2,074.50	1,185,369,300	
三菱地所	823,800	1,669.50	1,375,334,100	
平和不動産	21,700	3,830.00	83,111,000	
東京建物	115,900	1,481.00	171,647,900	
ダイビル	30,300	1,265.00	38,329,500	
京阪神ビルディング	18,800	1,922.00	36,133,600	
住友不動産	264,300	3,162.00	835,716,600	
太平洋興発	4,200	636.00	2,671,200	
テーオーシー	23,100	741.00	17,117,100	
東京楽天地	1,600	4,385.00	7,016,000	
レオパレス２１	153,900	143.00	22,007,700	
スターツコーポレーション	16,000	2,865.00	45,840,000	
フジ住宅	13,900	653.00	9,076,700	
空港施設	12,300	491.00	6,039,300	
明和地所	6,500	589.00	3,828,500	
ゴールドクレスト	9,300	1,623.00	15,093,900	
リログループ	62,400	2,430.00	151,632,000	
エスリード	4,700	1,468.00	6,899,600	
日神グループホールディングス	18,000	421.00	7,578,000	
日本エスコン	21,300	802.00	17,082,600	
タカラレーベン	53,300	314.00	16,736,200	
ＡＶＡＮＴＩＡ	6,700	877.00	5,875,900	
イオンモール	58,800	1,776.00	104,428,800	
毎日コムネット	4,000	677.00	2,708,000	
ファースト住建	5,100	1,069.00	5,451,900	
ランド	637,400	9.00	5,736,600	
カチタス	29,100	2,951.00	85,874,100	
東祥	7,000	1,493.00	10,451,000	
トーセイ	16,200	1,095.00	17,739,000	
穴吹興産	2,900	1,637.00	4,747,300	
サンフロンティア不動産	16,100	889.00	14,312,900	

エフ・ジェー・ネクスト	10,400	1,028.00	10,691,200	
インテリックス	3,900	552.00	2,152,800	
ランドビジネス	4,500	332.00	1,494,000	
サンネクスタグループ	3,900	957.00	3,732,300	
グランディハウス	9,600	428.00	4,108,800	
東武鉄道	124,200	2,980.00	370,116,000	
相鉄ホールディングス	38,100	2,434.00	92,735,400	
東急	300,700	1,229.00	369,560,300	
京浜急行電鉄	153,100	1,770.00	270,987,000	
小田急電鉄	177,400	3,120.00	553,488,000	
京王電鉄	61,900	7,830.00	484,677,000	
京成電鉄	82,900	3,335.00	276,471,500	
富士急行	16,300	4,355.00	70,986,500	
新京成電鉄	3,100	2,232.00	6,919,200	
東日本旅客鉄道	209,800	6,644.00	1,393,911,200	
西日本旅客鉄道	106,200	5,372.00	570,506,400	
東海旅客鉄道	99,100	14,325.00	1,419,607,500	
西武ホールディングス	155,500	976.00	151,768,000	
鴻池運輸	19,100	1,015.00	19,386,500	
西日本鉄道	33,200	3,010.00	99,932,000	
ハマキョウレックス	9,300	2,962.00	27,546,600	
サカイ引越センター	6,200	5,130.00	31,806,000	
近鉄グループホールディングス	112,900	4,395.00	496,195,500	
阪急阪神ホールディングス	150,400	3,375.00	507,600,000	
南海電気鉄道	53,500	2,517.00	134,659,500	
京阪ホールディングス	50,300	4,915.00	247,224,500	
神戸電鉄	2,500	3,580.00	8,950,000	
名古屋鉄道	92,900	2,702.00	251,015,800	
山陽電気鉄道	8,100	1,962.00	15,892,200	
トランコム	3,300	9,440.00	31,152,000	
日本通運	39,100	7,100.00	277,610,000	
ヤマトホールディングス	187,100	2,705.00	506,105,500	
山九	31,400	4,095.00	128,583,000	
日新	9,900	1,232.00	12,196,800	
丸運	7,800	252.00	1,965,600	
丸全昭和運輸	9,300	3,615.00	33,619,500	
センコーグループホールディングス	62,700	1,014.00	63,577,800	
トナミホールディングス	2,300	5,940.00	13,662,000	
ニッコンホールディングス	40,500	2,173.00	88,006,500	
日本石油輸送	900	2,640.00	2,376,000	
福山通運	14,500	4,325.00	62,712,500	
セイノーホールディングス	84,500	1,501.00	126,834,500	
エスライン	3,100	908.00	2,814,800	
神奈川中央交通	2,600	3,880.00	10,088,000	
日立物流	20,900	3,180.00	66,462,000	
丸和運輸機関	23,800	2,217.00	52,764,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	11,400	2,182.00	24,874,800	
日本郵船	94,400	2,582.00	243,740,800	
商船三井	71,500	3,225.00	230,587,500	
川崎汽船	34,700	2,160.00	74,952,000	

ＮＳユナイテッド海運	6,300	1,479.00	9,317,700	
明治海運	12,600	395.00	4,977,000	
飯野海運	53,900	452.00	24,362,800	
共栄タンカー	2,200	900.00	1,980,000	
九州旅客鉄道	98,800	2,191.00	216,470,800	
ＳＧホールディングス	237,200	2,877.00	682,424,400	
日本航空	253,400	1,907.00	483,233,800	
ＡＮＡホールディングス	281,100	2,256.50	634,302,150	
パスコ	2,200	1,401.00	3,082,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,700	2,498.00	6,744,600	
シルバーライフ	1,600	2,105.00	3,368,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,607.00	1,285,600	
一家ダイニングプロジェクト	1,100	514.00	565,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	5,100	4,180.00	21,318,000	
コーア商事ホールディングス	2,200	1,407.00	3,095,400	
国際紙パルプ商事	28,800	238.00	6,854,400	
ナルミヤ・インターナショナル	2,700	789.00	2,130,300	
ブックオフグループホールディングス	6,900	845.00	5,830,500	
ギフト	1,100	1,816.00	1,997,600	
三菱倉庫	35,700	3,095.00	110,491,500	
三井倉庫ホールディングス	12,900	2,346.00	30,263,400	
住友倉庫	40,700	1,349.00	54,904,300	
澁澤倉庫	6,300	2,240.00	14,112,000	
ヤマタネ	6,100	1,368.00	8,344,800	
東陽倉庫	17,100	328.00	5,608,800	
乾汽船	6,600	965.00	6,369,000	
日本トランスシティ	25,200	548.00	13,809,600	
ケイヒン	1,700	1,329.00	2,259,300	
中央倉庫	6,500	1,128.00	7,332,000	
川西倉庫	2,100	1,143.00	2,400,300	
安田倉庫	9,800	973.00	9,535,400	
ファイズホールディングス	2,400	1,055.00	2,532,000	
東洋埠頭	3,100	1,423.00	4,411,300	
宇徳	7,800	493.00	3,845,400	
上組	62,900	1,903.00	119,698,700	
サンリツ	2,300	672.00	1,545,600	
キムラユニティー	4,000	1,105.00	4,420,000	
キユーソー流通システム	3,100	1,578.00	4,891,800	
近鉄エクスプレス	24,000	2,571.00	61,704,000	
東海運	8,100	314.00	2,543,400	
エーアイテイー	8,000	970.00	7,760,000	
内外トランスライン	4,200	1,231.00	5,170,200	
ショーエイコーポレーション	1,800	1,038.00	1,868,400	
日本コンセプト	3,900	1,620.00	6,318,000	
ＴＢＳホールディングス	71,100	1,923.00	136,725,300	
日本テレビホールディングス	97,300	1,156.00	112,478,800	
朝日放送グループホールディングス	12,300	705.00	8,671,500	
テレビ朝日ホールディングス	32,100	1,847.00	59,288,700	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	77,000	486.00	37,422,000	

テレビ東京ホールディングス	9,700	2,444.00	23,706,800	
日本ＢＳ放送	4,400	1,158.00	5,095,200	
ビジョン	14,500	905.00	13,122,500	
スマートバリュー	3,200	945.00	3,024,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,500	1,458.00	6,561,000	
ワイヤレスゲート	4,900	611.00	2,993,900	
コネクシオ	6,600	1,457.00	9,616,200	
日本通信	90,800	171.00	15,526,800	
クロップス	2,300	750.00	1,725,000	
日本電信電話	1,563,700	2,745.00	4,292,356,500	
ＫＤＤＩ	852,900	3,206.00	2,734,397,400	
ソフトバンク	1,063,200	1,352.50	1,437,978,000	
光通信	12,100	20,700.00	250,470,000	
エムティーアイ	11,400	820.00	9,348,000	
GMOインターネット	41,900	3,175.00	133,032,500	
ファイバーゲート	3,900	2,388.00	9,313,200	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,800	431.00	1,637,800	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	31,500	3,350.00	105,525,000	
学研ホールディングス	15,700	1,681.00	26,391,700	
ゼンリン	23,300	1,273.00	29,660,900	
昭文社ホールディングス	4,500	457.00	2,056,500	
インプレスホールディングス	10,200	174.00	1,774,800	
東京電力ホールディングス	949,600	328.00	311,468,800	
中部電力	364,800	1,344.00	490,291,200	
関西電力	451,600	1,057.00	477,341,200	
中国電力	172,000	1,287.00	221,364,000	
北陸電力	108,900	721.00	78,516,900	
東北電力	297,600	904.00	269,030,400	
四国電力	107,300	741.00	79,509,300	
九州電力	245,600	978.00	240,196,800	
北海道電力	111,200	412.00	45,814,400	
沖縄電力	23,200	1,450.00	33,640,000	
電源開発	94,600	1,780.00	168,388,000	
エフオン	6,400	1,241.00	7,942,400	
イーレックス	17,200	1,803.00	31,011,600	
レノバ	20,000	4,560.00	91,200,000	
東京瓦斯	229,200	2,448.50	561,196,200	
大阪瓦斯	231,300	2,171.00	502,152,300	
東邦瓦斯	58,600	6,910.00	404,926,000	
北海道瓦斯	6,700	1,577.00	10,565,900	
広島ガス	25,900	390.00	10,101,000	
西部瓦斯	13,400	3,315.00	44,421,000	
静岡ガス	33,900	1,086.00	36,815,400	
メタウォーター	11,600	2,330.00	27,028,000	
アイネット	6,100	1,625.00	9,912,500	
松竹	7,600	14,700.00	111,720,000	
東宝	69,000	4,455.00	307,395,000	
エイチ・アイ・エス	16,500	1,648.00	27,192,000	

東映	4,500	17,180.00	77,310,000	
ラックランド	3,400	2,353.00	8,000,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	311,600	1,495.00	465,842,000	
共立メンテナンス	18,800	3,755.00	70,594,000	
イチネンホールディングス	12,800	1,286.00	16,460,800	
建設技術研究所	7,300	2,393.00	17,468,900	
スペース	7,900	800.00	6,320,000	
長　大	4,600	1,648.00	7,580,800	
アインホールディングス	14,500	6,520.00	94,540,000	
燦ホールディングス	4,800	1,190.00	5,712,000	
ピー・シー・エー	2,000	4,380.00	8,760,000	
スバル興業	500	9,050.00	4,525,000	
東京テアトル	4,900	1,285.00	6,296,500	
タナベ経営	2,200	1,330.00	2,926,000	
ビジネスブレイン太田昭和	4,200	1,675.00	7,035,000	
ナガワ	3,700	10,050.00	37,185,000	
よみうりランド	2,400	6,020.00	14,448,000	
東京都競馬	7,400	4,540.00	33,596,000	
常磐興産	4,800	1,389.00	6,667,200	
カナモト	20,100	2,302.00	46,270,200	
東京ドーム	45,400	1,299.00	58,974,600	
ＤＴＳ	26,100	2,149.00	56,088,900	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49,900	6,000.00	299,400,000	
シーイーシー	12,500	1,519.00	18,987,500	
カプコン	55,100	6,730.00	370,823,000	
西尾レントオール	10,500	2,167.00	22,753,500	
アイ・エス・ビー	5,400	1,399.00	7,554,600	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	72,700	23.00	1,672,100	
日本空港ビルデング	37,500	6,170.00	231,375,000	
トランス・コスモス	10,900	2,600.00	28,340,000	
乃村工藝社	48,800	843.00	41,138,400	
ジャステック	7,300	1,355.00	9,891,500	
ＳＣＳＫ	27,000	5,700.00	153,900,000	
藤田観光	4,600	1,301.00	5,984,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	7,000	927.00	6,489,000	
日本管財	12,400	2,075.00	25,730,000	
トーカイ	11,100	2,015.00	22,366,500	
白洋舎	1,000	2,461.00	2,461,000	
セコム	120,900	9,619.00	1,162,937,100	
日本システムウエア	4,000	2,134.00	8,536,000	
セントラル警備保障	5,400	3,705.00	20,007,000	
アイネス	11,500	1,402.00	16,123,000	
丹青社	21,500	814.00	17,501,000	
メイテック	13,900	5,320.00	73,948,000	
ＴＫＣ	10,000	7,630.00	76,300,000	
富士ソフト	12,500	5,130.00	64,125,000	
応用地質	13,300	1,340.00	17,822,000	
船井総研ホールディングス	23,600	2,422.00	57,159,200	

ＮＳＤ	37,600	2,158.00	81,140,800	
進学会ホールディングス	5,000	469.00	2,345,000	
丸紅建材リース	900	1,701.00	1,530,900	
オオバ	8,100	745.00	6,034,500	
コナミホールディングス	42,500	6,110.00	259,675,000	
いであ	2,700	1,820.00	4,914,000	
学究社	3,700	1,305.00	4,828,500	
ベネッセホールディングス	37,900	2,004.00	75,951,600	
イオンディライト	14,000	2,655.00	37,170,000	
ナック	6,600	970.00	6,402,000	
福井コンピュータホールディングス	4,700	3,775.00	17,742,500	
ダイセキ	19,000	3,340.00	63,460,000	
ステップ	4,500	1,544.00	6,948,000	
日鉄物産	8,300	3,915.00	32,494,500	
泉州電業	3,500	3,440.00	12,040,000	
元気寿司	3,100	2,287.00	7,089,700	
トラスコ中山	26,900	2,813.00	75,669,700	
ヤマダホールディングス	357,500	553.00	197,697,500	
オートバックスセブン	43,500	1,456.00	63,336,000	
モリト	9,200	618.00	5,685,600	
アークランドサカモト	18,300	1,660.00	30,378,000	
ニトリホールディングス	50,900	22,270.00	1,133,543,000	
グルメ杵屋	8,600	965.00	8,299,000	
愛眼	7,800	234.00	1,825,200	
ケーユーホールディングス	6,100	824.00	5,026,400	
吉野家ホールディングス	38,600	1,942.00	74,961,200	
加藤産業	17,000	3,550.00	60,350,000	
北恵	3,300	851.00	2,808,300	
イノテック	6,200	1,065.00	6,603,000	
イエローハット	22,200	1,697.00	37,673,400	
松屋フーズホールディングス	5,600	3,370.00	18,872,000	
ＪＢＣＣホールディングス	7,800	1,473.00	11,489,400	
ＪＫホールディングス	10,900	830.00	9,047,000	
サガミホールディングス	15,700	1,171.00	18,384,700	
日伝	10,700	2,321.00	24,834,700	
関西スーパーマーケット	9,900	1,203.00	11,909,700	
ミロク情報サービス	10,400	2,086.00	21,694,400	
北沢産業	7,400	269.00	1,990,600	
杉本商事	6,400	2,490.00	15,936,000	
因幡電機産業	33,500	2,662.00	89,177,000	
王将フードサービス	8,600	5,680.00	48,848,000	
プレナス	13,400	1,734.00	23,235,600	
ミニストップ	9,100	1,406.00	12,794,600	
アークス	24,000	2,439.00	58,536,000	
バローホールディングス	26,000	2,695.00	70,070,000	
東テク	4,100	2,787.00	11,426,700	
ミスミグループ本社	147,200	3,270.00	481,344,000	
藤久	2,500	789.00	1,972,500	
アルテック	9,000	322.00	2,898,000	
ベルク	5,800	6,010.00	34,858,000	

大　庄	6,200	963.00	5,970,600	
タキヒヨー	3,800	1,910.00	7,258,000	
ファーストリテイリング	15,700	91,110.00	1,430,427,000	
ソフトバンクグループ	928,200	8,097.00	7,515,635,400	
蔵王産業	1,900	1,363.00	2,589,700	
スズケン	49,700	3,880.00	192,836,000	
サンドラッグ	44,100	4,030.00	177,723,000	
サックスバー　ホールディングス	10,200	555.00	5,661,000	
ジェコス	8,400	976.00	8,198,400	
ヤマザワ	2,700	1,740.00	4,698,000	
やまや	2,600	2,201.00	5,722,600	
グローセル	9,900	475.00	4,702,500	
ベルーナ	25,000	1,080.00	27,000,000	
合計	126,384,500		306,704,606,970	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年1月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	7,464,047,754
コール・ローン	321,532,412
株式	413,694,693,256
新株予約権証券	2,777,126
投資信託受益証券	801,904,260
投資証券	7,899,305,735
派生商品評価勘定	324,003,640
未収配当金	388,247,388
差入委託証拠金	3,242,650,660
流動資産合計	434,139,162,231
資産合計	434,139,162,231
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	957,992
未払解約金	58,272,000
流動負債合計	59,229,992
負債合計	59,229,992
純資産の部	
元本等	
元本	96,044,539,510
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	338,035,392,729
元本等合計	434,079,932,239
純資産合計	434,079,932,239
負債純資産合計	434,139,162,231

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1月15日 至　2021年1月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基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	2021年1月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	88,107,131,248円
同期中追加設定元本額	40,837,724,511円
同期中一部解約元本額	32,900,316,249円

元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,186,019,066円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,310,337円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	6,547,566円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	6,887,657円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	19,766,073円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	18,099,211円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	10,397,325円
たわらノーロード　先進国株式	18,815,801,320円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	191,270,277円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,346,738,967円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	391,555,648円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	43,928,433円
たわらノーロード　バランス（標準型）	341,717,519円
たわらノーロード　バランス（積極型）	401,759,550円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	846,925円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	120,518,165円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	281,414,753円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	215,617,339円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	334,713,675円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,447円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	640,791円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,583,496円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,189,180円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	4,433,393円
たわらノーロード　全世界株式	82,191,080円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	46,456,913,324円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	444,534,187円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	184,508,333円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	935,988,345円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,113,289,327円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	114,324,429円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	348,651,329円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	294,453,629円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	26,718,430円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	819,611,278円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	170,332,957円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	209,064,901円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	175,357,524円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	288,109,510円
投資のソムリエ	1,817,814,279円
クルーズコントロール	266,660,680円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	116,508,256円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	195,280,389円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	115,309,505円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,933,827円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	4,496,311円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	88,595,451円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	976,522,475円
ワールドアセットバランス（基本コース）	350,685,901円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	981,188,349円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	5,978,918円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	2,828,526円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	843,618円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	4,039,220円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	32,357,241円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	567,453,432円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	177,065,719円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	2,884,771円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	1,543,909円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	1,531,535円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,181,643円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	669,780円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	865,695円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	6,645,402円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	459,973円
ＭＳＣＩコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	265,020,321円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	63,040,405円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,445,846,262円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,157,006,291円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	862,809,835円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,890,390円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,335,902円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	48,886,739円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	86,081,654円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,410,089円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,253,128円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,903,571円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,905,358円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,429,369円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	48,312,373円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	311,017,754円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	427,495,860円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,385,656,849円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	509,331,902円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	78,407,483円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	502,296,818円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	23,178,568円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,789,472円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	210,110,226円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,090,320円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	66,338,444円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	105,375,591円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	221,167,035円

計	96,044,539,510円
２．　受益権の総数	96,044,539,510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　2020年1月15日 至　2021年1月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2021年1月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年1月12日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	47,700,349,141
新株予約権証券	698,074
投資信託受益証券	△131,154,903
投資証券	△1,205,969,973
合計	46,363,922,339

（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（2020年2月18日から2021年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年1月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,661,080,871	－	1,661,414,690	333,819
アメリカ・ドル	1,233,924,160	－	1,234,381,680	457,520
イギリス・ポンド	75,815,394	－	75,820,340	4,946
オーストラリア・ドル	41,547,079	－	41,530,610	△16,469
カナダ・ドル	54,094,317	－	54,067,650	△26,667
ユーロ	255,699,921	－	255,614,410	△85,511
合計	1,661,080,871	－	1,661,414,690	333,819

（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	2021年1月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				

買建	12,663,300,536	－	12,986,012,365	322,711,829
合計	12,663,300,536	－	12,986,012,365	322,711,829

（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）

	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.5196円 (45,196円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2021年1月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	35,926	3,114.210	111,881,108.460	
	ABBOTT LABORATORIES	149,801	110.840	16,603,942.840	
	AES CORP	56,735	25.460	1,444,473.100	
	ABIOMED INC	3,574	324.590	1,160,084.660	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,521	128.580	9,710,490.180	
	ADVANCED MICRO DEVICES	98,091	97.250	9,539,349.750	
	ADOBE INC	40,386	474.240	19,152,656.640	
	CHUBB LTD	37,740	154.130	5,816,866.200	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,422	283.130	5,215,820.860	
	ALLEGHANY CORP	1,263	628.260	793,492.380	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	89.760	543,227.520	
	ALLSTATE CORP	26,342	109.150	2,875,229.300	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	59,490	208.360	12,395,336.400	
	AMGEN INC	49,267	237.570	11,704,361.190	
	HESS CORP	21,951	60.940	1,337,693.940	
	AMERICAN EXPRESS CO	57,244	121.060	6,929,958.640	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	41,980	78.775	3,306,974.500	
	AFLAC INC	58,283	44.510	2,594,176.330	
	AMERICAN INTL GROUP	72,425	40.280	2,917,279.000	
	AMERCO	929	474.370	440,689.730	
	ANALOG DEVICES	30,783	158.300	4,872,948.900	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,098	156.500	2,832,337.000	

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	62,634	50.990	3,193,707.660	
VALERO ENERGY CORP	34,554	58.640	2,026,246.560	
ANSYS INC	7,234	373.330	2,700,669.220	
APPLE INC	1,442,893	128.980	186,104,339.140	
APPLIED MATERIALS INC	78,202	97.960	7,660,667.920	
ALBEMARLE CORP	9,536	177.290	1,690,637.440	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,360	52.040	2,464,614.400	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	76.690	711,529.820	
AMEREN CORP	22,273	75.040	1,671,365.920	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	104.000	691,704.000	
AUTOLIV INC	7,570	92.130	697,424.100	
AUTODESK INC	18,325	317.810	5,823,868.250	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,986	168.510	6,064,000.860	
AUTOZONE INC	1,972	1,265.460	2,495,487.120	
AVERY DENNISON CORP	6,549	161.340	1,056,615.660	
BALL CORP	27,293	90.560	2,471,654.080	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	118,499	233.430	27,661,221.570	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,597	45.560	3,034,159.320	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,746	82.470	3,525,262.620	
BECTON DICKINSON & CO	24,739	257.110	6,360,644.290	
AMETEK INC	20,008	124.150	2,483,993.200	
VERIZON COMM INC	349,755	57.460	20,096,922.300	
WR BERKLEY CORP	12,511	66.370	830,355.070	
BEST BUY CO INC	19,639	110.780	2,175,608.420	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,859	615.790	1,144,753.610	
YUM! BRANDS INC	25,420	107.670	2,736,971.400	
FIRSTENERGY CORP	47,800	30.200	1,443,560.000	
BOEING CO	45,095	206.790	9,325,195.050	
ROBERT HALF INTL INC	11,111	63.080	700,881.880	
BORGWARNER INC	21,938	40.180	881,468.840	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,401	36.440	4,350,972.440	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	96.530	1,131,235.070	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,642	206.540	1,991,458.680	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,015	1,245.020	2,508,715.300	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	189,828	64.970	12,333,125.160	
ONEOK INC	36,226	41.230	1,493,597.980	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	90.140	531,826.000	
UNITED RENTALS INC	6,181	257.450	1,591,298.450	

SEMPRA ENERGY	24,590	118.410	2,911,701.900	
FEDEX CORP	20,793	245.310	5,100,730.830	
VERISIGN INC	8,762	199.150	1,744,952.300	
AMPHENOL CORP	24,857	135.680	3,372,597.760	
BROWN-FORMAN CORP	26,085	77.240	2,014,805.400	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	5.940	576,987.840	
CSX CORP	64,187	95.990	6,161,310.130	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	18.040	566,744.640	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	46.030	646,721.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	58.720	1,153,319.520	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,036	226.880	3,184,487.680	
CARDINAL HEALTH INC	24,718	55.740	1,377,781.320	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	40,534	20.140	816,354.760	
CATERPILLAR INC	45,357	193.860	8,792,908.020	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	133.910	1,321,022.150	
CITRIX SYSTEMS INC	9,933	129.650	1,287,813.450	
CENTURYLINK INC	80,424	10.540	847,668.960	
CERNER CORP	25,177	78.880	1,985,961.760	
JPMORGAN CHASE & CO	257,801	138.050	35,589,428.050	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,287	84.920	1,807,692.040	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	88.670	1,141,360.240	
CINTAS CORP	7,465	339.500	2,534,367.500	
CISCO SYSTEMS INC	354,537	45.360	16,081,798.320	
CLOROX COMPANY	10,683	193.730	2,069,617.590	
COCA-COLA CO/THE	345,110	50.200	17,324,522.000	
COPART INC	17,304	120.870	2,091,534.480	
COGNEX CORP	14,677	85.710	1,257,965.670	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,311	82.140	5,611,065.540	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	23,920	128.660	3,077,547.200	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	241.800	1,258,085.400	
NRG ENERGY, INC.	21,039	39.720	835,669.080	
COMCAST CORP-CL A	385,078	51.520	19,839,218.560	
CONAGRA BRANDS INC	40,291	33.100	1,333,632.100	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,587	68.730	1,896,054.510	
CMS ENERGY CORP	25,936	57.130	1,481,723.680	
COOPER COS INC	4,523	359.650	1,626,696.950	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	49.680	820,365.840	
CORNING INC	64,157	37.540	2,408,453.780	
SEALED AIR CORP	13,870	46.400	643,568.000	
HEICO CORP-CL A	6,236	122.210	762,101.560	
CUMMINS INC	12,578	236.680	2,976,961.040	
DR HORTON INC	29,267	68.060	1,991,912.020	
DANAHER CORP	54,073	244.120	13,200,300.760	
MOODY'S CORP	13,994	276.350	3,867,241.900	

COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,078	80.140	3,612,550.920	
TARGET CORP	42,591	195.280	8,317,170.480	
DEERE & CO	24,809	294.920	7,316,670.280	
MORGAN STANLEY	113,219	76.060	8,611,437.140	
REPUBLIC SERVICES INC	19,136	95.750	1,832,272.000	
COSTAR GROUP INC	3,294	904.370	2,978,994.780	
THE WALT DISNEY CO	152,680	179.090	27,343,461.200	
DOLLAR TREE INC	20,057	112.430	2,255,008.510	
DOVER CORP	12,652	128.780	1,629,324.560	
OMNICOM GROUP	17,365	63.700	1,106,150.500	
DTE ENERGY CO	16,340	117.980	1,927,793.200	
DUKE ENERGY CORP	61,714	89.290	5,510,443.060	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,902	125.260	1,365,584.520	
EBAY INC	58,445	53.930	3,151,938.850	
BANK OF AMERICA CORP	660,162	33.070	21,831,557.340	
CITIGROUP INC	176,952	66.440	11,756,690.880	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,903	107.170	1,168,474.510	
EATON CORP PLC	33,610	126.960	4,267,125.600	
CADENCE DESIGN SYS INC	23,585	134.690	3,176,663.650	
DISH NETWORK CORP	21,420	32.730	701,076.600	
ECOLAB INC	21,930	221.060	4,847,845.800	
PERKINELMER INC	9,755	159.250	1,553,483.750	
ELECTRONIC ARTS INC	23,979	141.220	3,386,314.380	
SALESFORCE.COM INC	76,963	218.250	16,797,174.750	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	257.140	576,765.020	
EMERSON ELECTRIC CO	49,931	82.620	4,125,299.220	
ATMOS ENERGY CORP	9,937	87.670	871,176.790	
ENTERGY CORP	17,195	94.390	1,623,036.050	
EOG RESOURCES INC	50,062	59.610	2,984,195.820	
EQUIFAX INC	10,322	184.690	1,906,370.180	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,144	258.110	4,941,257.840	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	13,942	93.970	1,310,129.740	
EXXON MOBIL CORP	359,028	46.840	16,816,871.520	
FMC CORP	11,416	119.370	1,362,727.920	
NEXTERA ENERGY INC	166,332	79.690	13,254,997.080	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,246	332.250	1,078,483.500	
FAIR ISAAC CORP	2,482	495.670	1,230,252.940	
ASSURANT INC	4,594	137.810	633,099.140	
FASTENAL CO	47,962	50.480	2,421,121.760	
FIFTH THIRD BANCORP	58,016	31.380	1,820,542.080	
M&T BANK CORP	11,432	146.700	1,677,074.400	
FISERV INC	47,512	115.050	5,466,255.600	
FORD MOTOR CO	331,318	9.300	3,081,257.400	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	25.750	610,609.750	
FREEPORT-MCMORAN INC	126,973	30.320	3,849,821.360	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,963	118.460	1,890,976.980	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	58.500	1,075,581.000	

GENERAL DYNAMICS CORP	20,458	151.780	3,105,115.240	
GENERAL MILLS INC	50,541	55.570	2,808,563.370	
GENUINE PARTS CO	11,605	105.110	1,219,801.550	
GILEAD SCIENCES INC	106,388	62.510	6,650,313.880	
GARTNER INC	7,522	167.180	1,257,527.960	
MCKESSON CORP	13,579	183.400	2,490,388.600	
NVIDIA CORP	52,112	544.860	28,393,744.320	
GENERAL ELECTRIC CO	733,755	11.450	8,401,494.750	
WW GRAINGER INC	3,745	391.710	1,466,953.950	
HALLIBURTON CO	69,816	20.570	1,436,115.120	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,991	92.940	3,066,183.540	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,310	293.830	8,024,497.300	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,168	183.490	3,333,646.320	
HASBRO INC	11,383	96.850	1,102,443.550	
HENRY SCHEIN INC	11,516	72.380	833,528.080	
HEICO CORP	3,623	137.650	498,705.950	
HERSHEY FOODS CORP	12,450	150.110	1,868,869.500	
HP INC	119,285	25.780	3,075,167.300	
F5 NETWORKS INC	4,874	190.350	927,765.900	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,024	100.040	1,202,880.960	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	23.810	665,227.590	
HOLOGIC INC	21,939	78.520	1,722,650.280	
HOME DEPOT INC	91,018	271.230	24,686,812.140	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,288	81.240	1,323,237.120	
HORMEL FOODS CORP	26,254	44.430	1,166,465.220	
CENTERPOINT ENERGY INC	42,899	20.790	891,870.210	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	273.900	797,870.700	
HUMANA INC	11,307	433.540	4,902,036.780	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	148.140	1,117,568.160	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	80,847	14.730	1,190,876.310	
BIOGEN INC	13,713	267.520	3,668,501.760	
IDEX CORP	6,154	208.570	1,283,539.780	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,927	208.070	5,602,700.890	
INTUIT INC	21,859	372.340	8,138,980.060	
IDEXX LABORATORIES INC	7,088	506.550	3,590,426.400	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	62.100	680,616.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,182	152.250	3,072,709.500	
INTEL CORP	359,405	51.540	18,523,733.700	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,206	122.450	882,374.700	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,983	52.100	1,666,314.300	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	24.420	862,441.140	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,033	113.010	1,246,839.330	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,050	164.980	998,129.000	
INCYTE CORP	15,942	93.320	1,487,707.440	
JOHNSON & JOHNSON	222,470	159.370	35,455,043.900	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,620	50.250	1,488,405.000	
KLA CORPORATION	12,667	289.110	3,662,156.370	
DEVON ENERGY CORP	45,000	18.330	824,850.000	
KELLOGG CO	21,954	59.370	1,303,408.980	
KEYCORP	87,597	18.480	1,618,792.560	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,127	131.450	3,828,744.150	
BLACKROCK INC/NEW YORK	12,773	766.680	9,792,803.640	
KROGER CO	65,605	31.760	2,083,614.800	
LAM RESEARCH CORP	12,392	516.480	6,400,220.160	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,302	372.190	1,228,971.380	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	145.830	1,230,513.540	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,153	102.370	1,448,842.610	
LENNAR CORP	23,570	75.880	1,788,491.600	
ELI LILLY & CO	72,340	185.940	13,450,899.600	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,344	51.480	789,909.120	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	59,835	161.860	9,684,893.100	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	26,084	128.150	3,342,664.600	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,201	337.680	7,159,153.680	
LOEWS CORP	21,759	46.550	1,012,881.450	
LOWE'S COS INC	64,054	166.320	10,653,461.280	
DOMINION ENERGY INC	71,579	72.670	5,201,645.930	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	30.790	1,187,662.670	
MCCORMICK & CO INC	21,514	93.630	2,014,355.820	
MCDONALD'S CORPORATION	62,868	214.230	13,468,211.640	
S&P GLOBAL INC	20,168	319.200	6,437,625.600	
EVEREST RE GROUP LTD	3,416	237.250	810,446.000	
MARKEL CORPORATION	1,201	1,032.610	1,240,164.610	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	51,562	89.370	4,608,095.940	
MARSH & MCLENNAN COS	42,507	112.590	4,785,863.130	
MASCO CORP	23,151	55.850	1,292,983.350	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,258	310.060	1,630,295.480	
METLIFE INC	64,392	49.400	3,180,964.800	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,874	95.380	2,086,342.120	
MEDTRONIC PLC	113,880	118.500	13,494,780.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	65,735	90.910	5,975,968.850	

CVS HEALTH CORP	109,529	76.070	8,331,871.030	
MERCK & CO.INC.	214,091	85.000	18,197,735.000	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	36.050	1,178,330.300	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,070	217.000	1,751,190.000	
MICROSOFT CORP	606,756	217.490	131,963,362.440	
MICRON TECH INC	92,874	78.670	7,306,397.580	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,681	147.810	3,056,858.610	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	57,179	50.240	2,872,672.960	
3M CO	48,271	165.200	7,974,369.200	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	147.580	734,358.080	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,255	173.690	2,475,950.950	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,737	214.240	1,657,574.880	
ILLUMINA INC	12,225	372.480	4,553,568.000	
XCEL ENERGY INC	43,530	64.400	2,803,332.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,058	110.300	888,797.400	
NETAPP INC	17,963	65.220	1,171,546.860	
NEWELL BRANDS INC	33,317	23.070	768,623.190	
NEWMONT CORP	68,379	61.950	4,236,079.050	
NVR INC	305	3,986.870	1,215,995.350	
NIKE INC-CL B	105,334	147.050	15,489,364.700	
NORDSON CORP	4,644	204.230	948,444.120	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,392	254.370	5,441,483.040	
EVERSOURCE ENERGY	28,269	89.210	2,521,877.490	
NISOURCE INC	31,427	21.880	687,622.760	
NORTHERN TRUST CORP	17,365	97.890	1,699,859.850	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,148	294.740	3,875,241.520	
WELLS FARGO & CO	332,238	33.240	11,043,591.120	
NUCOR CORP	25,118	56.800	1,426,702.400	
CHENIERE ENERGY INC	19,190	67.070	1,287,073.300	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,027	109.310	4,266,041.370	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,641	20.080	1,538,951.280	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,813	202.340	1,580,882.420	
OGE ENERGY CORP	16,028	31.630	506,965.640	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,256	483.830	3,026,840.480	
ORACLE CORP	168,897	63.030	10,645,577.910	
PACCAR INC	28,876	88.220	2,547,440.720	
PTC INC	9,433	129.160	1,218,366.280	
EXELON CORP	81,082	41.860	3,394,092.520	
PARKER HANNIFIN CORP	11,059	284.020	3,140,977.180	
PAYCHEX INC	27,450	91.000	2,497,950.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,181	557.040	3,443,064.240	
PPL CORPORATION	64,630	27.770	1,794,775.100	

PEPSICO INC	116,370	142.090	16,535,013.300	
PENTAIR PLC	12,511	56.810	710,749.910	
PFIZER INC	470,026	37.770	17,752,882.020	
ESSENTIAL UTILITIES INC	18,952	48.180	913,107.360	
CONOCOPHILLIPS	90,684	45.360	4,113,426.240	
PG&E CORP	123,999	12.210	1,514,027.790	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,898	131.420	1,826,475.160	
ALTRIA GROUP INC	155,809	41.350	6,442,702.150	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,537	159.380	5,663,887.060	
BROWN & BROWN INC	20,308	46.980	954,069.840	
GARMIN LTD	12,365	121.230	1,499,008.950	
PPG INDUSTRIES INC	19,812	149.450	2,960,903.400	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	245.510	823,195.030	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,416	364.010	13,619,798.160	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,161	155.380	2,977,236.180	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	123.630	1,345,465.290	
PROCTER & GAMBLE CO	210,355	137.850	28,997,436.750	
PROGRESSIVE CORP	49,891	95.090	4,744,135.190	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,278	56.980	2,409,000.440	
PULTE GROUP INC	21,209	42.080	892,474.720	
GLOBAL PAYMENTS INC	24,956	201.270	5,022,894.120	
QUALCOMM INC	95,333	156.110	14,882,434.630	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	103.310	1,109,962.640	
EXACT SCIENCES CORP	12,799	144.000	1,843,056.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,052	167.210	677,534.920	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,892	502.920	4,471,964.640	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,097	114.920	700,667.240	
RESMED INC	12,197	220.300	2,686,999.100	
US BANCORP	113,752	49.340	5,612,523.680	
SEAGEN INC	10,296	179.040	1,843,395.840	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,383	36.170	1,243,633.110	
ROSS STORES INC	29,874	120.870	3,610,870.380	
ROLLINS INC	18,567	40.910	759,575.970	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,746	438.530	3,835,383.380	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,811	262.590	2,576,270.490	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,879	72.120	1,145,193.480	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	88.230	970,882.920	
ACCENTURE PLC-CL A	53,439	260.350	13,912,843.650	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	121,361	57.090	6,928,499.490	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,744	199.230	2,140,527.120	

THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,167	137.430	2,908,980.810	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	52,647	136.060	7,163,150.820	
BOOKING HOLDINGS INC	3,430	2,221.270	7,618,956.100	
SCHLUMBERGER LTD	118,219	24.990	2,954,292.810	
SCHWAB (CHARLES) CORP	127,865	60.250	7,703,866.250	
POOL CORP	3,532	385.250	1,360,703.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,440	159.000	2,772,960.000	
BUNGE LTD	13,304	69.720	927,554.880	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	61.180	651,750.540	
ANTHEM INC	21,162	338.770	7,169,050.740	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,641	107.350	1,357,011.350	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,175	51.800	1,148,665.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,848	734.940	5,032,869.120	
CENTENE CORP	48,565	68.680	3,335,444.200	
SVB FINANCIAL GROUP	4,532	434.060	1,967,159.920	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	56.900	645,871.900	
SNAP-ON INC	4,129	171.390	707,669.310	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,814	80.780	2,731,494.920	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	171.020	1,064,770.520	
EDISON INTERNATIONAL	31,683	61.670	1,953,890.610	
SOUTHERN CO	89,102	61.210	5,453,933.420	
TRUIST FINANCIAL CORP	112,243	50.940	5,717,658.420	
SOUTHWEST AIRLINES	11,791	47.440	559,365.040	
AT&T INC	602,677	28.870	17,399,284.990	
CHEVRON CORP	162,830	91.600	14,915,228.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,127	176.350	2,314,946.450	
STATE STREET CORP	29,758	78.140	2,325,290.120	
STARBUCKS CORP	97,667	104.600	10,215,968.200	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	40.010	702,055.470	
STRYKER CORP	28,236	241.850	6,828,876.600	
NETFLIX INC	37,238	499.100	18,585,485.800	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	21.030	1,029,523.650	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	42.710	418,259.030	
SYNOPSYS INC	12,716	260.430	3,311,627.880	
SYSCO CORP	40,230	77.550	3,119,836.500	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,960	813.650	8,103,954.000	
TELEFLEX INC	4,002	403.860	1,616,247.720	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	11.380	1,005,104.360	
TERADYNE INC	14,284	135.700	1,938,338.800	
TEXAS INSTRUMENTS INC	76,972	171.310	13,186,073.320	
TEXTRON INC	19,486	48.590	946,824.740	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,469	513.350	17,181,311.150	
GLOBE LIFE INC	8,088	95.360	771,271.680	
DAVITA INC	6,497	123.120	799,910.640	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	149.500	1,431,163.500	
TRIMBLE INC	20,073	73.080	1,466,934.840	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,473	429.650	1,492,174.450	
TYSON FOODS INC	24,980	64.770	1,617,954.600	
UGI CORP	16,326	35.580	580,879.080	
UNION PACIFIC CORP	57,642	217.350	12,528,488.700	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	129,750	69.800	9,056,550.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,435	360.750	29,016,926.250	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	135.120	831,393.360	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	175.750	1,269,969.500	
VF CORP	28,712	87.080	2,500,240.960	
VIACOMCBS INC	45,361	41.060	1,862,522.660	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,766	234.640	5,107,174.240	
VULCAN MATERIALS CO	11,057	163.000	1,802,291.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,849	47.700	2,997,897.300	
WALMART INC	118,990	147.290	17,526,037.100	
WASTE MANAGEMENT INC	36,101	117.040	4,225,261.040	
WATERS CORP	5,211	266.050	1,386,386.550	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,271	302.410	1,896,413.110	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	114.100	1,046,981.600	
VAIL RESORTS INC	3,109	281.850	876,271.650	
WESTERN DIGITAL CORP	25,867	51.560	1,333,702.520	
WABTEC CORP	16,257	81.670	1,327,709.190	
WHIRLPOOL CORP	5,029	180.180	906,125.220	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,165	162.050	2,295,438.250	
WYNN RESORTS LTD	8,639	108.030	933,271.170	
NASDAQ INC	10,097	140.900	1,422,667.300	
CME GROUP INC	30,562	198.940	6,080,004.280	
WILLIAMS COS INC	102,608	21.510	2,207,098.080	
LKQ CORP	23,691	37.960	899,310.360	
ALLIANT ENERGY CORP	22,829	48.550	1,108,347.950	
WEC ENERGY GROUP INC	26,631	86.960	2,315,831.760	
CARMAX INC	14,209	104.640	1,486,829.760	
XILINX INC	20,586	151.080	3,110,132.880	
TJX COMPANIES INC	100,155	68.370	6,847,597.350	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,561	413.790	1,887,296.190	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.400	478,280.000	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,800	57.680	1,026,704.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	25.880	442,548.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,381	156.630	1,469,346.030	
CBRE GROUP INC	29,617	62.240	1,843,362.080	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	25.580	325,684.560	
REGIONS FINANCIAL CORP	77,232	17.880	1,380,908.160	
DOMINO'S PIZZA INC	3,212	390.540	1,254,414.480	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,737	392.460	1,466,623.020	
T-MOBILE US INC	46,391	132.930	6,166,755.630	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,755	56.410	1,565,659.550	
MOSAIC CO/THE	28,249	26.770	756,225.730	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,209	543.720	1,744,797.480	
CELANESE CORP	9,803	136.990	1,342,912.970	
DEXCOM INC	8,162	370.640	3,025,163.680	
DISCOVERY INC-A	10,423	35.130	366,159.990	
EXPEDIA GROUP INC	11,508	142.960	1,645,183.680	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	43.110	796,457.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,614	201.580	2,139,570.120	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	25.110	854,317.530	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,643	117.650	5,487,548.950	
LIVE NATION	13,804	72.240	997,200.960	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,229	1,402.620	3,126,439.980	
TRANSDIGM GROUP INC	4,416	612.920	2,706,654.720	
MASTERCARD INC	75,542	348.200	26,303,724.400	
WESTERN UNION CO	35,367	22.580	798,586.860	
OWENS CORNING	8,324	80.970	673,994.280	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,057	103.990	1,149,817.430	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	18.020	312,647.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,959	155.010	1,543,744.590	
DELTA AIR LINES INC	14,723	39.410	580,233.430	
INSULET CORP	5,566	254.650	1,417,381.900	
DISCOVER FINANCIAL	24,889	95.230	2,370,179.470	
TE CONNECTIVITY LTD	27,872	130.470	3,636,459.840	
MASIMO CORP	4,505	279.920	1,261,039.600	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	16,401	66.200	1,085,746.200	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,304	361.660	3,726,544.640	
VMWARE INC	6,532	141.500	924,278.000	
MERCADOLIBRE INC	3,718	1,761.550	6,549,442.900	

ULTA BEAUTY INC	4,538	290.180	1,316,836.840	
INVESCO LTD	33,443	18.940	633,410.420	
MSCI INC	7,090	451.790	3,203,191.100	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	130,662	82.310	10,754,789.220	
VISA INC	142,567	212.890	30,351,088.630	
KEURIG DR PEPPER INC	48,480	31.360	1,520,332.800	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,412	156.640	2,414,135.680	
DISCOVERY INC-C	30,421	30.590	930,578.390	
MARATHON PETROLEUM CORP	55,102	43.590	2,401,896.180	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,744	87.540	1,028,069.760	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	172,897	14.740	2,548,501.780	
XYLEM INC	15,151	106.020	1,606,309.020	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	22,598	96.980	2,191,554.040	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	169.200	589,492.800	
SPLUNK INC	13,312	166.510	2,216,581.120	
EPAM SYSTEMS INC	4,783	342.840	1,639,803.720	
ZILLOW GROUP INC	5,366	149.270	800,982.820	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	47.460	703,072.440	
HCA HEALTHCARE INC	22,479	171.370	3,852,226.230	
VERISK ANALYTICS INC	12,967	197.870	2,565,780.290	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	161.900	691,798.700	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,095	270.370	1,918,275.150	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,975	163.630	2,286,729.250	
NXP SEMICONDUCTOR NV	23,392	173.210	4,051,728.320	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	91.390	1,066,247.130	
LEAR CORP	4,681	163.690	766,232.890	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	99.800	860,475.600	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,243	70.780	1,432,799.540	
DOLLAR GENERAL CORP	20,975	215.260	4,515,078.500	
FORTINET INC	10,939	148.170	1,620,831.630	
HORIZON PHARMA PLC	18,986	78.690	1,494,008.340	
TESLA INC	62,949	811.190	51,063,599.310	
GENERAC HOLDINGS INC	5,402	260.800	1,408,841.600	
ENPHASE ENERGY INC	10,163	201.680	2,049,673.840	
GENERAL MOTORS CO	108,381	45.010	4,878,228.810	
XPO LOGISTICS INC	7,614	124.330	946,648.620	
ALLY FINANCIAL INC	30,122	37.480	1,128,972.560	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	59.800	614,325.400	

APTIV PLC	22,755	145.080	3,301,295.400	
PHILLIPS 66	37,121	72.270	2,682,734.670	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	130.440	935,515.680	
FACEBOOK INC	203,005	256.840	52,139,804.200	
IQVIA HOLDINGS INC	16,071	191.440	3,076,632.240	
SERVICENOW INC	16,258	523.060	8,503,909.480	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,043	364.800	2,934,086.400	
WORKDAY INC	14,623	228.830	3,346,181.090	
ABBVIE INC	149,126	109.020	16,257,716.520	
ZOETIS INC	39,683	169.390	6,721,903.370	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	18.660	564,707.580	
CDW CORP	11,563	133.650	1,545,394.950	
HOWMET AEROSPACE INC	30,749	28.210	867,429.290	
TWILIO INC	11,117	362.010	4,024,465.170	
COUPA SOFTWARE INC	5,637	342.580	1,931,123.460	
SNAP INC	75,279	54.380	4,093,672.020	
TRADE DESK INC A	3,466	779.290	2,701,019.140	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	19,546	40.380	789,267.480	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	43.190	359,513.560	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	42.790	607,831.950	
OKTA INC	9,766	252.200	2,462,985.200	
BLACK KNIGHT INC	13,042	86.690	1,130,610.980	
BAKER HUGHES CO	57,274	22.650	1,297,256.100	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	76.010	1,001,887.810	
ALTICE USA INC-A	13,646	36.000	491,256.000	
BROADCOM INC	34,036	445.760	15,171,887.360	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,207	383.920	2,382,991.440	
MONGODB INC	4,188	361.460	1,513,794.480	
BURLINGTON STORES INC	5,602	263.880	1,478,255.760	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	31.540	1,129,888.960	
VEEVA SYSTEMS INC	11,332	287.870	3,262,142.840	
TWITTER INC	66,138	48.180	3,186,528.840	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	55.910	738,794.740	
EVERGY INC	18,388	52.440	964,266.720	
ALLEGION PLC	7,469	120.330	898,744.770	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,454	102.160	1,170,140.640	
STERIS PLC	7,390	200.460	1,481,399.400	
DOCUSIGN INC	14,553	240.960	3,506,690.880	
WIX.COM LTD	4,454	266.110	1,185,253.940	
DROPBOX INC	28,170	23.350	657,769.500	
KKR & CO INC	43,097	40.580	1,748,876.260	
PERRIGO CO PLC	10,553	44.600	470,663.800	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	14,630	337.710	4,940,697.300	
MODERNA INC	23,007	117.260	2,697,800.820	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	24,001	113.180	2,716,433.180	

ARAMARK	18,632	37.490	698,513.680	
CIGNA CORP	30,953	219.920	6,807,183.760	
DELL TECHNOLOGIES INC	20,586	75.630	1,556,919.180	
DOW INC	61,890	58.860	3,642,845.400	
AMCOR PLC	130,000	11.540	1,500,200.000	
PINTEREST INC	39,407	71.700	2,825,481.900	
PELOTON INTERACTIVE INC	16,480	152.340	2,510,563.200	
FOX CORP-A	31,751	30.330	963,007.830	
FOX CORP-B	13,009	29.700	386,367.300	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	12,052	232.240	2,798,956.480	
CHEWY INC	6,586	97.150	639,829.900	
AVANTOR INC	44,509	30.490	1,357,079.410	
DYNATRACE INC	15,949	42.020	670,176.980	
CLOUDFLARE INC	13,218	76.500	1,011,177.000	
TRADEWEB MARKETS INC	7,065	64.640	456,681.600	
CARRIER GLOBAL CORP	69,248	41.570	2,878,639.360	
OTIS WORLDWIDE CORP	34,448	66.360	2,285,969.280	
UBER TECHNOLOGIES INC	79,977	54.590	4,365,944.430	
CORTEVA INC	62,843	43.620	2,741,211.660	
MATCH GROUP INC	20,510	151.900	3,115,469.000	
SLACK TECHNOLOGIES INC	32,512	42.070	1,367,779.840	
BLACKSTONE GROUP INC	55,746	62.690	3,494,716.740	
CARLYLE GROUP INC	12,509	32.610	407,918.490	
10X GENOMICS INC	5,312	167.500	889,760.000	
DATADOG INC	13,021	104.250	1,357,439.250	
INGERSOLL RAND INC	28,361	46.490	1,318,502.890	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,330	427.160	1,849,602.800	
PPD INC	10,828	36.720	397,604.160	
AON PLC	19,716	202.130	3,985,195.080	
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	188.590	1,200,186.760	
ZENDESK INC	10,021	152.260	1,525,797.460	
ROYALTY PHARMA PLC	10,361	51.320	531,726.520	
VIATRIS INC	102,403	18.470	1,891,383.410	
DRAFTKINGS INC	14,671	53.600	786,365.600	
SNOWFLAKE INC	2,805	293.190	822,397.950	
ARISTA NETWORKS INC	5,042	302.960	1,527,524.320	
IHS MARKIT LTD	32,101	87.650	2,813,652.650	
FNF GROUP	21,372	40.130	857,658.360	
CATALENT INC	13,173	115.400	1,520,164.200	
SYNCHRONY FINANCIAL	45,491	36.290	1,650,868.390	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,959	39.830	1,392,416.970	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	154.180	533,000.260	
WAYFAIR INC	5,543	259.180	1,436,634.740	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,869	150.150	2,382,730.350	
HUBSPOT INC	3,741	402.460	1,505,602.860	
QORVO INC	10,168	182.760	1,858,303.680	

	LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,947	151.740	447,177.780	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	12,307	153.920	1,894,293.440	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	30.180	513,603.240	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,257	352.050	1,498,676.850	
	GODADDY INC	14,540	81.220	1,180,938.800	
	ETSY INC	10,237	183.040	1,873,780.480	
	TRANSUNION	16,760	93.470	1,566,557.200	
	SQUARE INC	31,463	225.500	7,094,906.500	
	DUPONT DE NEMOURS INC	61,404	83.980	5,156,707.920	
	CARVANA CO	5,347	274.130	1,465,773.110	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	18,296	50.140	917,361.440	
	TELADOC HEALTH INC	9,773	220.860	2,158,464.780	
	WESTROCK CO	22,778	46.450	1,058,038.100	
	KRAFT HEINZ CO	56,879	32.850	1,868,475.150	
	NOVOCURE LTD	7,408	170.090	1,260,026.720	
	FORTIVE CORP	25,981	71.090	1,846,989.290	
	WASTE CONNECTIONS INC	22,342	103.790	2,318,876.180	
	ALPHABET INC-CL A	25,277	1,756.290	44,393,742.330	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	105,599	11.970	1,264,020.030	
	PAYPAL HOLDINGS INC	94,303	237.500	22,396,962.500	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	26.820	946,129.140	
	SUNRUN INC	10,000	95.620	956,200.000	
	ZILLOW GROUP INC-C	12,061	143.190	1,727,014.590	
	ALPHABET INC-CL C	25,271	1,766.720	44,646,781.120	
	ZSCALER INC	6,193	198.700	1,230,549.100	
	CABLE ONE INC	392	2,060.350	807,657.200	
	LINDE PLC	44,547	267.530	11,917,658.910	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	44.450	526,599.150	
	ROKU INC	8,597	403.130	3,465,708.610	
	AVALARA INC	6,312	158.260	998,937.120	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,030	641.130	7,712,793.900	
	VISTRA CORP	38,032	21.170	805,137.440	
アメリカ・ドル　小計		26,294,768		2,835,816,030.230 (295,577,104,829)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	15.505	493,027.990	
	ASHTEAD GROUP	38,916	36.500	1,420,434.000	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	23.400	513,232.200	
	BHP GROUP PLC	176,526	21.645	3,820,905.270	
	BARCLAYS PLC	1,493,804	1.512	2,258,631.640	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	7.010	576,803.830	
	BT GROUP PLC	723,199	1.427	1,032,004.970	

BUNZL PLC	28,834	24.830	715,948.220	
AVIVA PLC	318,596	3.457	1,101,386.370	
CRODA INTERNATIONAL	12,568	66.220	832,252.960	
DIAGEO PLC	198,891	29.565	5,880,212.410	
SCHRODERS PLC	11,354	35.190	399,547.260	
DCC PLC	7,898	55.080	435,021.840	
NATIONAL GRID PLC	290,859	8.776	2,552,578.580	
KINGFISHER PLC	165,680	2.795	463,075.600	
BAE SYSTEMS PLC	273,749	4.964	1,358,890.030	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	194,304	27.795	5,400,679.680	
HALMA PLC	31,901	25.950	827,830.950	
NEXT PLC	11,467	76.040	871,950.680	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,235	16.110	1,260,365.850	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	26.460	397,349.820	
ANGLO AMERICAN PLC	107,554	27.585	2,966,877.090	
COMPASS GROUP PLC	149,561	14.100	2,108,810.100	
HSBC HOLDINGS PLC	1,709,168	4.082	6,976,823.770	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	514,692	2.754	1,417,461.760	
UNILEVER PLC	220,637	44.160	9,743,329.920	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	1.832	421,748.380	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	9.312	507,382.940	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.784	548,581.370	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	22.200	691,885.200	
PEARSON PLC	65,009	6.770	440,110.930	
PERSIMMON PLC	28,126	28.080	789,778.080	
PRUDENTIAL PLC	217,400	14.205	3,088,167.000	
RIO TINTO PLC	93,813	61.940	5,810,777.220	
VODAFONE GROUP PLC	2,224,388	1.283	2,853,889.800	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	59,219	65.560	3,882,397.640	
RELX PLC	165,948	18.680	3,099,908.640	
RENTOKIL INITIAL PLC	146,366	5.384	788,034.540	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	670,969	1.057	709,214.230	
NATWEST GROUP PLC	423,054	1.619	684,924.420	
ST JAMES'S PLACE PLC	49,789	11.775	586,265.470	
SSE PLC	88,646	15.945	1,413,460.470	
BP PLC	1,733,483	2.988	5,179,647.200	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	5.802	505,418.020	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.565	493,721.800	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	116.400	765,213.600	
STANDARD CHARTERED PLC	220,443	5.068	1,117,205.120	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,109,041	0.361	2,205,363.800	

	TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.671	579,492.770	
	TESCO PLC	816,229	2.444	1,994,863.670	
	3I GROUP PLC	77,445	11.570	896,038.650	
	SMITH & NEPHEW PLC	76,928	15.770	1,213,154.560	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	420,949	13.950	5,872,238.550	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,272	92.040	2,418,074.880	
	WPP PLC	111,598	8.136	907,961.320	
	ASTRAZENECA PLC	111,291	75.560	8,409,147.960	
	WHITBREAD PLC	18,594	30.270	562,840.380	
	INTERTEK GROUP PLC	13,842	57.220	792,039.240	
	BURBERRY GROUP PLC	31,686	18.065	572,407.590	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	13,315	47.390	630,997.850	
	SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.365	324,513.470	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,893	29.750	472,816.750	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,581	46.370	537,010.970	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	346,240	14.624	5,063,413.760	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	309,765	14.074	4,359,632.610	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,010	26.570	345,675.700	
	AVEVA GROUP PLC	10,408	35.010	364,384.080	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.982	615,225.360	
	EXPERIAN PLC	75,976	28.330	2,152,400.080	
	MONDI PLC	39,767	18.515	736,286.000	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	16.280	456,019.080	
	FRESNILLO PLC NPR	17,385	11.790	204,969.150	
	OCADO GROUP PLC	39,210	25.000	980,250.000	
	INFORMA PLC	120,480	5.454	657,097.920	
	GLENCORE PLC	836,468	2.705	2,262,645.940	
	ENTAIN PLC	49,618	14.380	713,506.840	
	EVRAZ PLC	48,765	5.064	246,945.960	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.380	380,905.720	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	23.500	357,388.000	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,721	7.190	371,873.990	
	FERGUSON PLC	18,896	91.660	1,732,007.360	
	M&G PLC	204,940	1.965	402,707.100	
	JD SPORTS FASHION PLC	32,086	8.832	283,383.550	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.912	451,369.370	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.835	779,278.620	
イギリス・ポンド　小計		25,034,868		142,509,493.460 (20,085,288,008)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	23.110	2,365,516.490	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	19.930	2,604,910.790	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	416.000	732,160.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	13.190	1,347,147.460	
	ICL GROUP LTD	49,411	17.700	874,574.700	
	NICE LTD	5,535	865.500	4,790,542.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	78.890	823,927.160	
	AZRIELI GROUP	2,291	217.000	497,147.000	
イスラエル・シュケル　小計		404,637		14,035,926.100 (461,080,172)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	60.200	1,014,610.800	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	235,974	23.850	5,627,979.900	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	304,650	20.290	6,181,348.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,206	25.210	3,585,013.260	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.000	1,093,227.000	
	AMP LTD	302,414	1.600	483,862.400	
	ASX LTD	15,573	72.410	1,127,640.930	
	BHP GROUP LTD	247,453	46.500	11,506,564.500	
	AMPOL LTD	20,946	27.930	585,021.780	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	14.080	535,603.200	
	CSL LIMITED	38,115	275.950	10,517,834.250	
	REA GROUP LTD	4,119	145.880	600,879.720	
	TRANSURBAN GROUP	230,892	13.080	3,020,067.360	
	COCA-COLA AMATIL LTD	52,693	12.980	683,955.140	
	COCHLEAR LTD	5,533	182.900	1,011,985.700	
	ORIGIN ENERGY LTD	132,860	5.110	678,914.600	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	149,393	85.160	12,722,307.880	
	RIO TINTO LIMITED	31,595	122.400	3,867,228.000	
	APA GROUP	94,106	9.810	923,179.860	
	ARISTOCRAT LEISU	51,717	31.540	1,631,154.180	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225,180	4.900	1,103,382.000	
	TPG TELECOM LTD	28,719	6.930	199,022.670	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,839	36.250	1,444,163.750	
	ORICA LTD	41,311	15.250	629,992.750	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	25.080	218,421.720	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	13.090	813,098.440	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	18.450	681,561.450	
	SYDNEY AIRPORT	116,056	6.250	725,350.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	29,821	140.010	4,175,238.210	
	SUNCORP GROUP LTD	117,454	10.390	1,220,347.060	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	282,507	23.210	6,556,987.470	
	NEWCREST MINING LTD	66,127	26.320	1,740,462.640	

	OIL SEARCH LTD	197,895	4.230	837,095.850	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	4.910	305,804.620	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	117,359	8.470	994,030.730	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	63,404	12.780	810,303.120	
	SANTOS LTD	132,862	7.200	956,606.400	
	SONIC HEALTHCARE	40,148	33.540	1,346,563.920	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	28.940	243,269.640	
	TABCORP HOLDINGS LTD	205,649	4.020	826,708.980	
	WESFARMERS LTD	95,839	51.390	4,925,166.210	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	25.460	2,194,550.160	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	106,718	39.910	4,259,115.380	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	51.400	513,743.000	
	SEEK LTD	25,899	27.870	721,805.130	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.800	297,118.800	
	AGL ENERGY LTD	49,076	12.230	600,199.480	
	BRAMBLES LTD	127,166	10.580	1,345,416.280	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	10.180	334,524.980	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	4.720	665,350.080	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	3.850	578,077.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	9.250	533,419.750	
	XERO LTD	10,498	135.930	1,426,993.140	
	AFTERPAY LTD	18,322	113.990	2,088,524.780	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	2.970	614,522.700	
	SOUTH32 LTD(AUD)	412,345	2.600	1,072,097.000	
	COLES GROUP LTD	109,456	18.500	2,024,936.000	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,000	27.740	221,920.000	
オーストラリア・ドル　小計		6,175,455		117,644,270.750 (9,451,540,712)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,578	88.640	1,824,033.920	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	72,789	42.250	3,075,335.250	
	BARRICK GOLD CORP	148,244	30.030	4,451,767.320	
	ATCO LTD	7,193	37.020	266,284.860	
	BANK OF MONTREAL	53,729	99.870	5,365,915.230	
	BANK OF NOVA SCOTIA	100,955	68.060	6,870,997.300	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,132	73.060	2,128,383.920	
	BCE INC	14,959	55.110	824,390.490	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	109,524	49.190	5,387,485.560	
	BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	30.000	845,760.000	
	SAPUTO INC	18,601	37.150	691,027.150	
	BLACKBERRY LTD	39,652	9.750	386,607.000	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	46,369	21.530	998,324.570	

CGI INC	19,859	100.670	1,999,205.530	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	60.270	683,461.800	
CAE INC	25,006	34.580	864,707.480	
CAMECO CORP	32,627	18.120	591,201.240	
ROGERS COMM-CL B	31,543	60.950	1,922,545.850	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,542	112.880	4,237,740.960	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,758	33.800	3,405,620.400	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	176.000	855,712.000	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	31.440	286,701.360	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	59,874	145.680	8,722,444.320	
YAMANA GOLD INC	84,317	6.900	581,787.300	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	35.460	564,204.060	
OPEN TEXT CORP	21,795	56.550	1,232,507.250	
EMPIRE CO LTD	15,093	35.640	537,914.520	
KINROSS GOLD CORP	99,741	9.220	919,612.020	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	84.270	839,582.010	
FORTIS INC	38,963	50.970	1,985,944.110	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	49,694	24.680	1,226,447.920	
TELUS CORP	31,890	26.620	848,911.800	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	30.780	777,195.000	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	27.550	593,482.100	
ENBRIDGE INC	172,385	42.470	7,321,190.950	
IGM FINANCIAL INC	6,069	35.320	214,357.080	
MANULIFE FINANCIAL CORP	162,090	23.960	3,883,676.400	
LOBLAW CO LTD	15,136	64.470	975,817.920	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,678	95.340	2,257,460.520	
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,404	60.400	2,923,601.600	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	471.310	976,554.320	
METRO INC	20,760	58.230	1,208,854.800	
EMERA INC	22,433	52.260	1,172,348.580	
ONEX CORP	6,646	73.070	485,623.220	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	43.720	820,449.520	
POWER CORP OF CANADA	46,551	29.890	1,391,409.390	
QUEBECOR INC-B	16,042	32.110	515,108.620	
ROYAL BANK OF CANADA	119,582	107.840	12,895,722.880	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,496	465.520	5,351,617.920	
SHAW COMM INC-B	43,484	22.820	992,304.880	
SUNCOR ENERGY INC	130,806	23.400	3,060,860.400	
LUNDIN MINING CORP	43,480	11.420	496,541.600	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	24.480	1,004,071.680	
THOMSON REUTERS CORP	15,049	101.840	1,532,590.160	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	86.950	644,908.150	

	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	151,245	74.200	11,222,379.000	
	TC ENERGY CORP	78,459	53.950	4,232,863.050	
	WESTON (GEORGE) LTD	6,184	97.960	605,784.640	
	INTACT FINANCIAL CORP	12,515	143.050	1,790,270.750	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,085	54.540	1,968,075.900	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,731	1,623.390	2,810,088.090	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,165	161.470	2,610,162.550	
	B2GOLD CORP	101,675	6.720	683,256.000	
	CI FINANCIAL CORP	20,285	16.440	333,485.400	
	KEYERA CORP	16,668	24.460	407,699.280	
	PARKLAND CORP	10,583	44.480	470,731.840	
	ALTAGAS LTD	23,944	18.890	452,302.160	
	PEMBINA PIPELINE CORP	43,740	33.800	1,478,412.000	
	DOLLARAMA INC	23,536	54.010	1,271,179.360	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	8.220	663,526.620	
	NORTHLAND POWER INC	17,568	49.180	863,994.240	
	TMX GROUP LTD	5,058	125.710	635,841.180	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	21,840	51.850	1,132,404.000	
	INTER PIPELINE LTD	41,863	13.140	550,079.820	
	NUTRIEN LTD	47,550	65.610	3,119,755.500	
	SSR MINING INC	18,000	23.440	421,920.000	
	WSP GLOBAL INC	10,194	122.680	1,250,599.920	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,104	56.230	455,687.920	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	37.430	617,033.550	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	75.880	822,918.600	
	AIR CANADA	10,722	22.390	240,065.580	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	80.830	2,034,976.080	
	SHOPIFY INC	9,164	1,502.410	13,768,085.240	
	FIRSTSERVICE CORP	3,503	175.880	616,107.640	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	40.140	747,968.760	
	HYDRO ONE LTD	27,340	29.020	793,406.800	
カナダ・ドル　小計		3,325,550		175,989,373.660 (14,353,693,316)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.930	491,250.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	155,700	26.920	4,191,444.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.190	261,716.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	10.040	691,756.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.430	701,486.450	
	GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.860	367,048.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.640	760,836.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	271,653	10.600	2,879,521.800	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	676,822	2.500	1,692,055.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	160,850	4.300	691,655.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	23.790	2,436,096.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.780	315,090.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	20.110	422,310.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	5.040	717,192.000	
シンガポール・ドル　小計		2,567,740		16,619,456.250 (1,302,300,592)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	208,841	12.180	2,543,683.380	
	LOGITECH INTL-REG	14,429	90.780	1,309,864.620	
	NESTLE SA-REGISTERED	243,473	100.600	24,493,383.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	43,922	83.700	3,676,271.400	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	59,521	312.850	18,621,144.850	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	242.100	839,360.700	
	SIKA INHABER	11,880	255.500	3,035,340.000	
	SGS SA-REG	492	2,699.000	1,327,908.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	186,615	83.800	15,638,337.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	158.800	676,329.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	2,066.000	547,490.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	19.255	384,695.640	
	SWISSCOM AG-REG	2,159	476.500	1,028,763.500	
	ABB LTD	152,415	26.720	4,072,528.800	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	60.200	779,228.800	
	GEBERIT AG	3,181	585.200	1,861,521.200	
	LONZA GROUP AG-REG	6,246	591.800	3,696,382.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	8,470.000	804,650.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	87,300.000	785,700.000	
	GIVAUDAN-REG	768	3,741.000	2,873,088.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,545	382.800	4,802,226.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	43,996	51.780	2,278,112.880	
	TEMENOS GROUP	5,723	122.500	701,067.500	
	SONOVA HOLDING AG	4,698	224.400	1,054,231.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,518	199.050	899,307.900	
	STRAUMANN HOLDING AG	919	996.000	915,324.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,441	244.700	597,312.700	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	47.020	215,915.840	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	242.800	403,776.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,761	431.100	1,190,267.100	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	95.800	239,500.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	135.550	469,680.750	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	855.000	541,215.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.300	516,937.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,515	1,051.000	1,592,265.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	54.160	966,701.840	

	SWISS RE LTD	24,871	84.060	2,090,656.260	
	ALCON INC	41,312	60.100	2,482,851.200	
	UBS GROUP AG	306,864	13.470	4,133,458.080	
スイス・フラン　小計		1,463,815		115,086,478.340 (13,475,475,749)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	53,126	465.600	24,735,465.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	406.100	14,640,311.100	
	ERICSSON LM-B SHS	245,215	98.640	24,188,007.600	
	LUNDBERGS B	7,382	440.800	3,253,985.600	
	SKF AB-B SHS	34,849	229.300	7,990,875.700	
	SANDVIK AB	93,940	216.200	20,309,828.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	84.860	11,101,979.220	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	226.300	7,163,073.900	
	SWEDBANK AB	71,958	146.280	10,526,016.240	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	150.150	7,949,691.750	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,411	84.380	10,666,560.180	
	VOLVO AB-B SHS	121,239	210.300	25,496,561.700	
	SWEDISH MATCH AB	13,845	630.800	8,733,426.000	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	112.750	5,305,451.250	
	INDUSTRIVARDEN A	11,955	282.400	3,376,092.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	271.400	3,094,774.200	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	187.700	3,602,150.700	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	129.850	3,129,125.300	
	INVESTOR AB-B SHS	37,641	613.800	23,104,045.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	68,814	175.750	12,094,060.500	
	ASSA ABLOY AB-B	87,021	212.900	18,526,770.900	
	TELIA CO AB	210,477	34.130	7,183,580.010	
	LUNDIN ENERGY AB	14,739	237.000	3,493,143.000	
	BOLIDEN AB	21,855	310.000	6,775,050.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	230.900	5,389,898.700	
	KINNEVIK AB-B	21,722	421.450	9,154,736.900	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	404.400	3,626,254.800	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	411.100	3,703,599.900	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	107.150	3,610,097.800	
	NIBE INDUSTRIER AB	23,117	283.700	6,558,292.900	
	HEXAGON AB	24,223	753.600	18,254,452.800	
	EPIROC AB-A	60,750	163.000	9,902,250.000	
	EPIROC AB-B	30,899	149.700	4,625,580.300	
	ESSITY AB-B	52,143	260.100	13,562,394.300	
	EQT AB	20,934	212.500	4,448,475.000	
	EVOLUTION GAMING GROUP AB	13,641	810.000	11,049,210.000	
	NORDEA BANK ABP	273,625	68.530	18,751,521.250	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	191.500	2,861,967.500	
スウェーデン・クローナ　小計		2,184,700		381,938,758.400	

				(4,797,150,806)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,656	914.600	7,916,777.600	
	A P MOLLER A/S	568	14,415.000	8,187,720.000	
	AP MOLLER MAERSK A	255	13,360.000	3,406,800.000	
	DANSKE BANK A/S	59,305	106.550	6,318,947.750	
	GENMAB A/S	5,641	2,545.000	14,356,345.000	
	NOVOZYMES-B SHS	17,740	358.900	6,366,886.000	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,458.000	1,998,354.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	144,558	430.500	62,232,219.000	
	GN STORE NORD A/S	10,133	462.700	4,688,539.100	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	16,538	1,521.500	25,162,567.000	
	COLOPLAST-B	9,511	900.200	8,561,802.200	
	DSV PANALPINA A S	17,560	1,006.500	17,674,140.000	
	DEMANT A/S	7,244	227.300	1,646,561.200	
	H LUNDBECK A/S	4,840	213.000	1,030,920.000	
	TRYG A/S	11,107	198.700	2,206,960.900	
	PANDORA A/S	8,251	640.600	5,285,590.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	620.400	5,792,054.400	
	AMBU A/S B	14,156	244.100	3,455,479.600	
	ORSTED A/S	15,500	1,295.000	20,072,500.000	
デンマーク・クローネ　小計		361,712		206,361,164.350 (3,516,394,241)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.920	872,989.920	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	15.500	463,357.000	
	A2 MILK CO LTD	55,091	11.410	628,588.310	
	FISHER & PAYKEL	49,044	32.100	1,574,312.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.900	782,152.700	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	7.080	437,076.720	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	8.420	1,045,444.040	
ニュージーランド・ドル　小計		589,774		5,803,921.090 (433,901,141)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	189.300	6,660,141.900	
	DNB ASA	80,709	166.300	13,421,906.700	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	41.120	3,829,875.680	
	TELENOR ASA	63,038	146.000	9,203,548.000	
	SCHIBSTED ASA	7,537	345.700	2,605,540.900	
	ORKLA ASA	65,283	85.460	5,579,085.180	
	EQUINOR ASA	83,149	156.750	13,033,605.750	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	380.800	5,785,494.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	193.000	3,219,819.000	
	ADEVINTA ASA	22,265	135.600	3,019,134.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	300.000	2,233,500.000	
ノルウェー・クローネ　小計		489,624		68,591,651.510	

				(838,189,981)	
ユーロ	CRH PLC	66,036	37.530	2,478,331.080	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,105	172.750	2,263,888.750	
	KERRY GROUP PLC-A	13,475	117.900	1,588,702.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,452	65.950	887,159.400	
	UMICORE	17,654	44.350	782,954.900	
	AIR LIQUIDE	40,275	136.200	5,485,455.000	
	AIRBUS SE	49,650	89.780	4,457,577.000	
	AXA SA	162,082	20.250	3,282,160.500	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,117	21.700	957,338.900	
	ADIDAS AG	15,912	291.900	4,644,712.800	
	ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	14.420	1,406,944.980	
	DASSAULT AVIATION SA	295	882.000	260,190.000	
	DANONE	51,855	52.680	2,731,721.400	
	SAFRAN SA	26,914	116.500	3,135,481.000	
	INTESA SANPAOLO	1,394,419	1.942	2,707,961.690	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,642	69.300	1,984,890.600	
	ACCOR SA	17,380	29.410	511,145.800	
	BOUYGUES	17,572	35.130	617,304.360	
	BNP PARIBAS	96,130	44.980	4,323,927.400	
	THALES SA	8,549	75.200	642,884.800	
	CAPGEMINI SA	13,568	123.300	1,672,934.400	
	UNICREDIT SPA	173,574	8.036	1,394,840.660	
	NATIXIS	70,166	2.865	201,025.590	
	KONINKLIJKE DSM NV	14,438	143.500	2,071,853.000	
	COMMERZBANK AG	83,118	5.582	463,964.670	
	EIFFAGE	6,494	79.200	514,324.800	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	34,713	38.920	1,351,029.960	
	UNITED INTERNET	9,882	36.150	357,234.300	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	45.960	254,894.160	
	PUBLICIS GROUPE	18,595	43.000	799,585.000	
	FAURECIA	6,117	38.390	234,831.630	
	IBERDROLA SA	510,828	12.410	6,339,375.480	
	ENI SPA	219,331	8.978	1,969,153.710	
	JERONIMO MARTINS	19,517	14.785	288,558.840	
	KESKO OYJ-B	24,085	21.280	512,528.800	
	KBC GROUPE	21,038	59.520	1,252,181.760	
	HANNOVER RUECK SE	4,868	133.600	650,364.800	
	WARTSILA OYJ	34,935	8.554	298,833.990	
	L'OREAL	21,014	305.100	6,411,371.400	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,497	522.400	12,274,832.800	
	GEA GROUP AG	11,838	29.040	343,775.520	
	BOLLORE	71,347	3.346	238,727.060	
	MEDIOBANCA SPA	57,442	7.490	430,240.580	
	MICHELIN(CGDE)-B	14,802	107.250	1,587,514.500	
	CONTINENTAL AG	8,803	116.300	1,023,788.900	

DEUTSCHE POST AG-REG	83,086	40.950	3,402,371.700	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	37.160	788,014.960	
OMV AG	12,817	36.540	468,333.180	
VERBUND AG	4,908	75.300	369,572.400	
PERNOD-RICARD	17,811	156.800	2,792,764.800	
PEUGEOT SA	47,343	21.730	1,028,763.390	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	12,649	54.980	695,442.020	
RENAULT SA	14,917	36.265	540,965.000	
REPSOL SA	124,165	8.636	1,072,288.940	
REMY COINTREAU	1,860	147.000	273,420.000	
MERCK KGAA	10,841	144.900	1,570,860.900	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,560	42.930	1,912,960.800	
RWE AG	53,941	38.230	2,062,164.430	
SEB SA	1,551	151.700	235,286.700	
SOCIETE GENERALE-A	69,595	17.538	1,220,557.110	
VINCI S.A.	43,513	82.480	3,588,952.240	
SODEXO	7,075	74.880	529,776.000	
SOFINA	1,382	270.500	373,831.000	
SOLVAY SA	5,563	101.800	566,313.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,834	126.800	5,811,751.200	
VIVENDI SA	70,995	26.140	1,855,809.300	
SAP SE	87,580	106.040	9,286,983.200	
TELEFONICA S.A	403,880	3.554	1,435,389.520	
TOTAL SE	213,239	36.915	7,871,717.680	
VALEO	19,653	30.570	600,792.210	
E.ON SE	188,262	9.022	1,698,499.760	
VOEST-ALPINE AG	9,875	30.630	302,471.250	
HENKEL AG & CO KGAA	8,602	78.800	677,837.600	
SIEMENS AG-REG	65,228	123.980	8,086,967.440	
UPM-KYMMENE OYJ	44,829	31.320	1,404,044.280	
ING GROEP NV-CVA	329,234	8.052	2,650,992.160	
PUMA AG	7,534	87.900	662,238.600	
BAYER AG	84,197	50.990	4,293,205.030	
STORA ENSO OYJ-R SHS	53,250	16.340	870,105.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,859	90.560	1,345,631.040	
DAIMLER AG	72,434	57.150	4,139,603.100	
BASF SE	76,828	67.550	5,189,731.400	
BEIERSDORF AG	8,371	93.860	785,702.060	
HOCHTIEF AG	1,707	80.800	137,925.600	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	67.080	807,039.480	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,842	69.080	1,232,525.360	
ORANGE	169,379	10.065	1,704,799.630	
SAMPO OYJ-A SHS	40,512	34.520	1,398,474.240	
RANDSTAD NV	9,362	54.860	513,599.320	

ALLIANZ SE	35,019	203.300	7,119,362.700	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238,662	5.548	1,324,096.770	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	92,201	23.490	2,165,801.490	
HERMES INTL	2,667	888.200	2,368,829.400	
ENDESA S.A.	27,736	22.430	622,118.480	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	10.160	284,378.400	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	26.060	630,756.240	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,715	240.500	2,817,457.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	20.155	1,241,427.070	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,280	166.400	1,876,992.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,395	28.130	601,841.350	
HEINEKEN NV	22,683	91.700	2,080,031.100	
AKZO NOBEL	16,208	91.680	1,485,949.440	
ASML HOLDING NV	35,905	414.900	14,896,984.500	
AEGON NV	150,349	3.471	521,861.370	
VOLKSWAGEN AG	2,758	166.600	459,482.800	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,599	144.900	2,260,295.100	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	578,251	4.251	2,458,145.000	
KERING	6,306	583.100	3,677,028.600	
CNP ASSURANCES	13,987	13.510	188,964.370	
FORTUM OYJ	39,409	21.270	838,229.430	
AGEAS	14,365	45.860	658,778.900	
UCB SA	10,571	86.600	915,448.600	
NEMETSCHEK SE	5,095	58.050	295,764.750	
CARREFOUR SA	49,926	15.325	765,115.950	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	20.150	475,781.800	
ATOS SE	8,972	66.540	596,996.880	
NOKIA OYJ	476,230	3.145	1,497,743.350	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	76,388	45.060	3,442,043.280	
WOLTERS KLUWER-CVA	23,137	70.240	1,625,142.880	
SANOFI	96,107	79.240	7,615,518.680	
STMICROELECTRONICS NV	54,176	33.380	1,808,394.880	
ELISA OYJ	10,787	46.050	496,741.350	
BANCO SANTANDER SA	1,486,679	2.810	4,177,567.990	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	16.275	563,049.900	
QIAGEN N.V.	17,974	43.000	772,882.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	165,949	9.523	1,580,332.320	
BMW VORZUG	4,116	53.750	221,235.000	
ENEL SPA	675,152	8.948	6,041,260.090	
COLRUYT NV	4,673	48.800	228,042.400	
VOPAK (KON.)	5,364	41.820	224,322.480	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	285,762	15.190	4,340,724.780	
SARTORIUS AG	3,044	356.200	1,084,272.800	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	79.520	611,190.720	

INFINEON TECHNOLOGIES AG	111,890	33.550	3,753,909.500	
RATIONAL AG	479	734.000	351,586.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	113.400	427,631.400	
BECHTLE AG	2,511	174.400	437,918.400	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.659	773,846.110	
EUROFINS SCIENTIFIC	11,330	73.760	835,700.800	
TELEPERFORMANCE	4,699	270.100	1,269,199.900	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,851	137.050	2,172,379.550	
EURAZEO	2,748	57.350	157,597.800	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	84.500	836,888.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	78.450	784,813.800	
INDITEX	92,847	26.220	2,434,448.340	
ESSILORLUXOTTICA	23,967	129.350	3,100,131.450	
SNAM SPA	171,294	4.644	795,489.330	
CREDIT AGRICOLE SA	98,685	10.525	1,038,659.620	
ORPEA	4,932	108.550	535,368.600	
ENAGAS	23,477	18.150	426,107.550	
WENDEL	2,220	100.700	223,554.000	
TENARIS SA	36,959	6.954	257,012.880	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.387	295,155.220	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.430	213,966.280	
ATLANTIA SPA	37,690	13.930	525,021.700	
ILIAD SA	1,046	164.800	172,380.800	
PROXIMUS	13,739	16.770	230,403.030	
SES FDR	28,847	7.700	222,121.900	
TERNA SPA	113,654	6.212	706,018.640	
BIOMERIEUX	3,248	116.200	377,417.600	
GRIFOLS SA	23,518	23.630	555,730.340	
FERROVIAL SA	40,593	21.680	880,056.240	
LANXESS AG	6,856	63.100	432,613.600	
NESTE OYJ	36,796	61.500	2,262,954.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	17.520	168,910.320	
RECORDATI SPA	10,303	42.840	441,380.520	
GALAPAGOS NV	3,426	83.000	284,358.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	8.720	482,250.880	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	205.200	855,273.600	
KONE OYJ	28,383	66.640	1,891,443.120	
ELIA GROUP	2,862	99.100	283,624.200	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,387	295.800	706,074.600	
ENGIE	154,115	13.165	2,028,923.970	
ALSTOM	21,779	47.160	1,027,097.640	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	13.415	734,846.870	
IPSEN SA	3,646	69.450	253,214.700	
DEUTSCHE WOHNEN	29,097	41.880	1,218,582.360	
ARKEMA SA	6,393	94.920	606,823.560	
LEGRAND SA	21,521	80.320	1,728,566.720	

AMPLIFON SPA	11,372	33.680	383,008.960	
ADP	2,313	95.400	220,660.200	
ORION OYJ	8,051	37.420	301,268.420	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	9.218	369,531.180	
SYMRISE AG	11,308	106.800	1,207,694.400	
SCOR SE	15,667	27.680	433,662.560	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,870	40.240	839,808.800	
PRYSMIAN SPA	22,328	30.540	681,897.120	
DIASORIN SPA	2,223	159.500	354,568.500	
CAIXABANK	307,331	2.296	705,631.970	
BUREAU VERITAS SA	23,179	22.990	532,885.210	
GETLINK	37,646	13.990	526,667.540	
SUEZ SA	26,620	16.680	444,021.600	
AMADEUS IT GROUP SA	38,173	56.240	2,146,849.520	
BRENNTAG AG	12,353	67.640	835,556.920	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	27.040	462,816.640	
EDENRED	21,488	47.500	1,020,680.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.394	235,533.690	
LEG IMMOBILIEN AG	5,934	120.860	717,183.240	
KION GROUP AG	5,903	75.140	443,551.420	
VONOVIA SE	43,096	57.500	2,478,020.000	
KNORR-BREMSE AG	6,860	114.640	786,430.400	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,468	44.370	952,535.160	
FERRARI NV	10,596	179.750	1,904,631.000	
CNH INDUSTRIAL NV	89,378	11.040	986,733.120	
AROUNDTOWN SA	83,054	5.728	475,733.310	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	36.840	298,109.280	
MONCLER SPA	17,567	48.000	843,216.000	
NEXI SPA	33,176	15.715	521,360.840	
TEAMVIEWER AG	11,117	40.800	453,573.600	
PROSUS NV	40,543	87.240	3,536,971.320	
JDE PEET'S BV	7,308	33.480	244,671.840	
SIEMENS ENERGY AG	31,959	33.300	1,064,234.700	
WORLDLINE SA	20,129	74.800	1,505,649.200	
NN GROUP NV	25,274	36.400	919,973.600	
FINECOBANK SPA	53,818	13.735	739,190.230	
ARGENX SE	3,879	222.000	861,138.000	
ZALANDO SE	13,039	95.000	1,238,705.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	94,487	14.380	1,358,723.060	
AENA SME SA	5,338	138.900	741,448.200	
CELLNEX TELECOM SAU	27,234	48.580	1,323,027.720	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	10,836	100.400	1,087,934.400	
ABN AMRO BANK NV	34,251	8.904	304,970.900	
EXOR NV	7,971	66.000	526,086.000	
ALTICE EUROPE NV	56,763	5.324	302,206.210	

	SCOUT24 AG	9,670	64.400	622,748.000	
	COVESTRO AG	16,337	53.740	877,950.380	
	HELLOFRESH SE	12,838	63.000	808,794.000	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,579	56.610	3,599,207.190	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	8.534	341,488.010	
	AMUNDI SA	4,119	68.900	283,799.100	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	9.550	222,935.200	
	ADYEN NV	1,516	1,744.500	2,644,662.000	
	UNIPER SE	18,203	30.580	556,647.740	
	DELIVERY HERO SE	10,974	132.350	1,452,408.900	
ユーロ　小計		15,844,052		356,230,203.430 (45,145,053,681)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	94.800	3,118,920.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	20.650	3,386,600.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	17.000	1,765,620.000	
	CLP HOLDINGS LTD	134,500	72.300	9,724,350.000	
	PCCW LTD	331,000	4.470	1,479,570.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	41.900	2,074,050.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	102,640	450.200	46,208,528.000	
	MTR CORP	126,000	44.000	5,544,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,700	145.900	9,585,630.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	31.150	3,596,267.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	134,500	41.300	5,554,850.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	913,292	11.520	10,521,123.840	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	177,000	60.500	10,708,500.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	25.050	7,953,375.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	121,066	36.400	4,406,802.400	
	SINO LAND CO	255,400	10.420	2,661,268.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,500	108.000	11,718,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	46.000	2,277,000.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	116,500	116.000	13,514,000.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	19.840	3,293,440.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.380	1,307,280.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	12.520	1,557,488.000	
	AIA GROUP LTD	1,016,027	98.850	100,434,268.950	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	9.870	2,852,430.000	
	SANDS CHINA LTD	198,800	32.000	6,361,600.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.550	2,453,910.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	42.150	6,311,962.500	

	ESR CAYMAN LTD	147,400	27.150	4,001,910.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.700	1,771,000.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	25.650	3,862,890.000	
	WH GROUP LTD	731,500	6.700	4,901,050.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	228,332	56.650	12,935,007.800	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	39.750	8,937,072.000	
香港・ドル　小計		7,335,649		316,779,763.990 (4,257,520,028)	
合計		92,072,344		413,694,693,256 (413,694,693,256)	

（２）株式以外の有価証券

2021年1月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	スイス・フラン	CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23	87,844.000	23,717.880	
	スイス・フラン　小計		87,844.000	23,717.880 (2,777,126)	
新株予約権証券　合計			87,844	2,777,126 (2,777,126)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	84,575.000	761,175.000	
		GOODMAN GROUP	134,222.000	2,426,733.760	
		GPT GROUP	158,232.000	694,638.480	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	846,604.260	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,176,750.400	
		STOCKLAND	194,018.000	801,294.340	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	419,186.650	
	オーストラリア・ドル　小計		1,591,176.000	7,126,382.890 (572,533,601)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	889,522.240	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	347,536.000	785,431.360	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	419,214.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	542,901.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	290,071.000	
	シンガポール・ドル　小計		1,294,642.000	2,927,139.600 (229,370,659)	
投資信託受益証券　合計			2,885,818	801,904,260 (801,904,260)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	707,910.640	

	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,713.000	1,765,181.010	
	AMERICAN TOWER CORP	37,134.000	7,980,839.280	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127,559.000	1,043,432.620	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,329.000	1,940,338.020	
	BOSTON PROPERTIES INC	12,947.000	1,159,921.730	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,601.000	729,772.010	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	36,589.000	5,600,312.340	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	22,230.000	2,918,132.100	
	DUKE REALTY TRUST	31,929.000	1,224,157.860	
	EQUINIX INC	7,385.000	5,039,450.150	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,626.000	823,964.220	
	EQUITY RESIDENTIAL	32,078.000	1,862,127.900	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,504.000	1,272,965.120	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,566.000	1,176,524.100	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,543.000	1,296,609.210	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	792,016.920	
	INVITATION HOMES INC	46,060.000	1,338,043.000	
	IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	688,548.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	40,988.000	854,599.800	
	MID AMERICA	9,014.000	1,119,628.940	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17,771.000	625,006.070	
	PROLOGIS INC	61,657.000	5,836,451.620	
	PUBLIC STORAGE	13,090.000	2,896,162.500	
	REALTY INCOME CORP	29,466.000	1,750,869.720	
	REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	638,245.980	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,281.000	2,416,401.160	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	28,083.000	2,334,820.620	
	SUN COMMUNITIES INC	8,298.000	1,195,907.760	
	UDR INC	27,057.000	1,002,461.850	
	VENTAS INC	31,091.000	1,436,404.200	
	VEREIT INC	20,534.000	719,716.700	
	VICI PROPERTIES INC	47,083.000	1,193,083.220	
	VORNADO REALTY TRUST	12,714.000	448,422.780	
	WELLTOWER INC	35,270.000	2,157,818.600	
	WEYERHAEUSER CO	64,096.000	2,121,577.600	
	WP CAREY INC	15,529.000	1,030,659.730	
アメリカ・ドル　小計		1,071,049.000	69,138,485.080 (7,206,304,300)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	315,581.880	

		LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	367,502.780	
		SEGRO PLC	100,956.000	964,129.800	
	イギリス・ポンド　小計		226,618.000	1,647,214.460 (232,158,406)	
	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,954.000	394,757.020	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	230,689.710	
	カナダ・ドル　小計		21,421.000	625,446.730 (51,011,435)	
	ユーロ	COVIVIO	4,663.000	345,295.150	
		GECINA SA	3,670.000	453,245.000	
		KLEPIERRE	17,099.000	316,160.510	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	809,308.800	
	ユーロ　小計		38,352.000	1,924,009.460 (243,829,719)	
	香港・ドル	LINK REIT	176,700.000	12,351,330.000	
	香港・ドル　小計		176,700.000	12,351,330.000 (166,001,875)	
投資証券　合計			1,534,140	7,899,305,735 (7,899,305,735)	
合計				8,703,987,121 (8,703,987,121)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率(%)	組入新株予約権証券時価比率(%)	組入投資信託受益証券時価比率(%)	組入投資証券時価比率(%)	有価証券の合計金額に対する比率(%)
アメリカ・ドル	株式	593銘柄	68.09	－	－	－	71.68
	投資証券	37銘柄	－	－	－	1.66	
イギリス・ポンド	株式	85銘柄	4.63	－	－	－	4.81
	投資証券	3銘柄	－	－	－	0.05	
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	58銘柄	2.18	－	－	－	2.37
	投資信託受益証券	7銘柄	－	－	0.13	－	
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.31	－	－	－	3.41
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.30	－	－	－	0.36
	投資信託受益証券	5銘柄	－	－	0.05	－	
スイス・フラン	株式	39銘柄	3.10	－	－	－	3.19

	新株予約権証券	1銘柄	－	0.00	－	－	
スウェーデン・クローナ	株式	38銘柄	1.11	－	－	－	1.14
デンマーク・クローネ	株式	19銘柄	0.81	－	－	－	0.83
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.10	－	－	－	0.10
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.19	－	－	－	0.20
ユーロ	株式	234銘柄	10.40	－	－	－	10.75
	投資証券	4銘柄	－	－	－	0.06	
香港・ドル	株式	33銘柄	0.98	－	－	－	1.05
	投資証券	1銘柄	－	－	－	0.04	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年1月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,317,074,012
国債証券	213,152,046,900
地方債証券	16,113,604,500
特殊債券	15,980,519,438
社債券	9,895,396,100
未収利息	387,442,809
前払費用	49,121,047
流動資産合計	258,895,204,806
資産合計	258,895,204,806
負債の部	
流動負債	
未払金	959,439,000
未払解約金	68,886,000
流動負債合計	1,028,325,000
負債合計	1,028,325,000
純資産の部	
元本等	
元本	197,306,195,501
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	60,560,684,305
元本等合計	257,866,879,806
純資産合計	257,866,879,806
負債純資産合計	258,895,204,806

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1月15日 至　2021年1月12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	2021年1月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	170,923,484,775円
同期中追加設定元本額	155,889,910,871円
同期中一部解約元本額	129,507,200,145円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	20,041,295,338円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	75,739,659円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	64,284,684円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	14,202,257円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	652,219,885円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	177,741,188円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	21,439,092円
たわらノーロード　国内債券	13,161,703,195円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,268,065,062円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	445,512,539円
たわらノーロード　バランス（標準型）	712,303,060円
たわらノーロード　バランス（積極型）	85,921,753円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	31,252,569円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	781,419,146円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	766,906,996円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	211,812,212円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	38,563,522円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	11,210,746円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	7,179,666円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	14,876,543円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,239,862円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	2,489,855円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,665,466,888円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	7,804,221,372円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	10,361,906,621円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	4,113,685,947円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,915,452,310円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,035,461,254円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	313,798,716円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	70,521,204円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,195,480,384円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	9,343,546円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	3,767,427,886円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,182,359,486円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	232,754,283円
投資のソムリエ	15,183,788,401円
クルーズコントロール	1,676,879,346円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	973,568,234円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	3,520,445,658円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	446,419,633円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	6,045,972円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	14,181,500円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	1,481,047,522円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	16,333,200,250円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	19,990,477円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	9,459,861円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	14,119,780円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	33,795,633円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	563,959,018円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,736,851,130円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	4,449,702,289円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	10,336,037円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	5,167,605円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	5,119,345円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	9,865,462円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	297,451,247円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	364,781,170円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,523,777,573円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	183,002,621円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	7,795,676,025円
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,101,630,563円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	307,346,956円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	5,822,092,969円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	5,804,574,674円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	5,780,092,239円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	5,759,938,173円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅤ（適格機関投資家限定）	5,767,537,679円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	483,433,132円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	197,528,899円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	115,740,325円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,520,823円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	122,085,608円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	48,915,812円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,838,422円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	77,952,573円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	162,695,042円

ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,192,618,137円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,468,402,708円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,666,284,251円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	514,261,824円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	220,362,994円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,536,230,323円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	234,556,648円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,771,902円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,831,295,501円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,185,446円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	447,074,269円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	709,880,841円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,241,589,917円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	341,306,805円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,656,425円
Ｏｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドＩ（適格機関投資家限定）	814,043,918円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	382,409,178円
計	197,306,195,501円
２．　受益権の総数	197,306,195,501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　2020年1月15日 至　2021年1月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2021年1月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 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	2021年1月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△2,393,516,700
地方債証券	△113,994,500
特殊債券	△150,515,337
社債券	△75,485,530
合計	△2,733,512,067

（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（2020年2月15日から2021年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3069円 (13,069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

2021年1月12日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４１１回　利付国庫債券（２年）	900,000,000	902,511,000	
	４１２回　利付国庫債券（２年）	1,500,000,000	1,504,575,000	

４１３回　利付国庫債券（２年）	400,000,000	401,300,000	
４１４回　利付国庫債券（２年）	800,000,000	802,752,000	
４１５回　利付国庫債券（２年）	200,000,000	200,728,000	
４１６回　利付国庫債券（２年）	1,270,000,000	1,274,876,800	
４１８回　利付国庫債券（２年）	1,300,000,000	1,305,512,000	
４１９回　利付国庫債券（２年）	600,000,000	602,598,000	
１３２回　利付国庫債券（５年）	2,500,000,000	2,508,050,000	
１３３回　利付国庫債券（５年）	1,980,000,000	1,987,682,400	
１３４回　利付国庫債券（５年）	1,690,000,000	1,697,520,500	
１３５回　利付国庫債券（５年）	1,840,000,000	1,849,052,800	
１３６回　利付国庫債券（５年）	1,250,000,000	1,257,012,500	
１３７回　利付国庫債券（５年）	1,400,000,000	1,408,666,000	
１３８回　利付国庫債券（５年）	2,450,000,000	2,466,586,500	
１３９回　利付国庫債券（５年）	1,720,000,000	1,732,349,600	
１４０回　利付国庫債券（５年）	1,690,000,000	1,703,097,500	
１４１回　利付国庫債券（５年）	1,660,000,000	1,673,811,200	
１４２回　利付国庫債券（５年）	1,920,000,000	1,937,068,800	
１４３回　利付国庫債券（５年）	1,500,000,000	1,514,175,000	
１４４回　利付国庫債券（５年）	1,850,000,000	1,868,537,000	
１４５回　利付国庫債券（５年）	2,000,000,000	2,020,240,000	
２回　利付国庫債券（４０年）	280,000,000	394,648,800	
３回　利付国庫債券（４０年）	290,000,000	410,834,300	
４回　利付国庫債券（４０年）	550,000,000	782,870,000	
５回　利付国庫債券（４０年）	500,000,000	689,295,000	
６回　利付国庫債券（４０年）	470,000,000	639,110,700	
７回　利付国庫債券（４０年）	530,000,000	694,204,600	
８回　利付国庫債券（４０年）	620,000,000	760,684,200	
９回　利付国庫債券（４０年）	920,000,000	844,468,000	
１０回　利付国庫債券（４０年）	800,000,000	861,104,000	

１１回　利付国庫債券（４０年）	650,000,000	678,177,500	
１２回　利付国庫債券（４０年）	750,000,000	706,935,000	
１３回　利付国庫債券（４０年）	560,000,000	527,996,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	1,300,000,000	1,317,212,000	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	1,050,000,000	1,063,860,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	1,400,000,000	1,421,742,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	507,945,000	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	1,200,000,000	1,221,396,000	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	1,790,000,000	1,818,174,600	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	1,770,000,000	1,809,948,900	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	2,650,000,000	2,715,667,000	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	650,000,000	662,694,500	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	2,360,000,000	2,410,032,000	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	2,250,000,000	2,301,705,000	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	2,280,000,000	2,336,566,800	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	2,940,000,000	3,007,443,600	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	760,000,000	778,620,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,340,000,000	1,362,244,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	2,030,000,000	2,074,335,200	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	2,140,000,000	2,190,076,000	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	2,350,000,000	2,407,551,500	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	2,210,000,000	2,254,951,400	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	1,980,000,000	2,001,126,600	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	2,280,000,000	2,305,536,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	2,280,000,000	2,306,060,400	

３４５回　利付国庫債券（１０年）	2,110,000,000	2,135,172,300	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	2,470,000,000	2,499,936,400	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	2,010,000,000	2,034,702,900	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	1,980,000,000	2,004,611,400	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	2,060,000,000	2,086,574,000	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	2,700,000,000	2,735,100,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	1,960,000,000	1,985,636,800	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	2,220,000,000	2,248,282,800	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	1,840,000,000	1,863,460,000	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	1,870,000,000	1,893,038,400	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	1,920,000,000	1,942,732,800	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	1,580,000,000	1,597,869,800	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	1,660,000,000	1,677,064,800	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	1,600,000,000	1,615,424,000	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	2,060,000,000	2,078,437,000	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	2,090,000,000	2,106,155,700	
１回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	124,534,000	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	121,960,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	256,636,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	250,458,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	239,842,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	238,564,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	249,012,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	123,551,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	374,334,900	
１５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	261,714,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	196,872,000	
１７回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	260,530,000	

１８回　利付国庫債券（３０年）	320,000,000	413,520,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	259,098,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	265,434,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	260,338,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	220,000,000	293,469,000	
２３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	267,662,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	190,000,000	254,905,900	
２５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	262,826,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	532,916,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	420,000,000	569,079,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	480,000,000	653,601,600	
２９回　利付国庫債券（３０年）	560,000,000	756,856,800	
３０回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	763,247,100	
３１回　利付国庫債券（３０年）	460,000,000	609,780,600	
３２回　利付国庫債券（３０年）	610,000,000	823,060,800	
３３回　利付国庫債券（３０年）	930,000,000	1,208,144,400	
３４回　利付国庫債券（３０年）	920,000,000	1,233,839,600	
３５回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,176,219,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	950,000,000	1,245,583,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	990,000,000	1,282,475,700	
３８回　利付国庫債券（３０年）	690,000,000	882,309,900	
３９回　利付国庫債券（３０年）	610,000,000	793,457,500	
４０回　利付国庫債券（３０年）	650,000,000	832,331,500	
４１回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	630,585,000	
４２回　利付国庫債券（３０年）	710,000,000	896,289,800	

４３回　利付国庫債券（３０年）	520,000,000	657,087,600	
４４回　利付国庫債券（３０年）	590,000,000	746,249,700	
４５回　利付国庫債券（３０年）	580,000,000	707,762,400	
４６回　利付国庫債券（３０年）	750,000,000	915,742,500	
４７回　利付国庫債券（３０年）	710,000,000	883,893,200	
４８回　利付国庫債券（３０年）	710,000,000	852,276,900	
４９回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	720,516,000	
５０回　利付国庫債券（３０年）	610,000,000	646,587,800	
５１回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	583,463,400	
５２回　利付国庫債券（３０年）	680,000,000	670,833,600	
５３回　利付国庫債券（３０年）	550,000,000	554,977,500	
５４回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	739,200,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	738,675,000	
５６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	653,783,800	
５７回　利付国庫債券（３０年）	690,000,000	726,204,300	
５８回　利付国庫債券（３０年）	870,000,000	914,935,500	
５９回　利付国庫債券（３０年）	680,000,000	697,659,600	
６０回　利付国庫債券（３０年）	660,000,000	709,533,000	
６１回　利付国庫債券（３０年）	660,000,000	674,982,000	
６２回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	679,028,000	
６３回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	537,088,200	
６４回　利付国庫債券（３０年）	640,000,000	601,312,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	610,000,000	572,161,700	
６６回　利付国庫債券（３０年）	520,000,000	487,510,400	
６７回　利付国庫債券（３０年）	690,000,000	682,313,400	

６８回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	791,024,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	378,756,000	
７３回　利付国庫債券（２０年）	340,000,000	368,492,000	
７５回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	153,027,000	
７８回　利付国庫債券（２０年）	190,000,000	207,058,200	
８１回　利付国庫債券（２０年）	240,000,000	263,908,800	
８５回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	490,410,800	
８８回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	395,885,000	
９０回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	339,351,000	
９２回　利付国庫債券（２０年）	870,000,000	983,961,300	
９３回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	282,475,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	511,249,500	
９５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	404,124,000	
９７回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	576,810,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	518,584,500	
１００回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	698,544,000	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	426,438,000	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	466,704,000	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	411,068,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	468,692,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	462,316,000	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	220,000,000	255,239,600	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	330,000,000	388,281,300	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	344,963,700	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	649,588,500	

１１３回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	912,811,900	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	654,065,500	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	239,630,000	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	320,000,000	384,809,600	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	775,671,000	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	310,000,000	368,307,900	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	350,772,000	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	460,152,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	638,436,600	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	410,417,000	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	904,215,000	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	390,000,000	466,326,900	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	804,955,800	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	340,000,000	407,775,600	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	420,000,000	499,459,800	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	620,000,000	739,424,400	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	697,521,600	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	680,000,000	806,044,800	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	352,422,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	420,000,000	494,554,200	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	677,370,900	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	750,493,800	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	413,059,500	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	514,395,200	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	414,001,000	

１３８回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	440,879,800	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	527,193,000	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	1,090,000,000	1,292,173,200	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	890,992,500	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	479,912,000	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	895,568,800	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	501,539,100	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	1,010,000,000	1,204,748,200	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,254,928,500	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	1,180,000,000	1,397,969,600	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	990,000,000	1,161,992,700	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	1,130,000,000	1,328,247,200	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	1,230,000,000	1,431,363,300	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	1,110,000,000	1,263,035,700	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,218,387,600	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,234,234,300	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,174,416,300	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,144,505,100	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	940,000,000	960,614,200	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,039,878,000	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	980,000,000	1,013,908,000	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	997,129,500	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	970,000,000	1,032,264,300	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	890,630,000	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	920,000,000	963,083,600	

	１６３回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,119,016,700	
	１６４回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,193,025,200	
	１６５回　利付国庫債券（２０年）	890,000,000	914,181,300	
	１６６回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,113,052,500	
	１６７回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	973,218,000	
	１６８回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	854,343,500	
	１６９回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	837,564,500	
	１７０回　利付国庫債券（２０年）	820,000,000	806,437,200	
	１７１回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	745,962,800	
	１７２回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	759,323,600	
	１７３回　利付国庫債券（２０年）	1,220,000,000	1,217,804,000	
	１７４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	897,543,000	
国債証券　合計		198,350,000,000	213,152,046,900	
地方債証券	７０８回　東京都公募公債	500,000,000	506,355,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	306,321,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	408,528,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	108,799,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	225,956,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	338,847,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	300,000,000	302,010,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	250,240,000	
	１９４回　神奈川県公募公債	300,000,000	304,566,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	305,613,000	
	１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	117,873,000	
	３６４回　大阪府公募公債	300,000,000	303,939,000	
	３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	306,990,000	
	１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	234,616,000	
	１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	102,524,000	
	２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	356,485,500	
	２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	203,624,000	

１回　兵庫県公募公債（１２年)	300,000,000	311,166,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	213,156,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	110,188,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	351,219,000	
２３年度２０回　愛知県公募公債	500,000,000	506,505,000	
２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	306,069,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	200,324,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	101,760,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	408,576,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	350,247,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	204,304,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	349,167,000	
２４年度７回　千葉県公募公債	300,000,000	304,281,000	
２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	204,372,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	110,942,000	
１０９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,710,000	
１１１回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	708,974,000	
１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,420,000	
１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,445,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,637,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,850,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	407,804,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	409,552,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,415,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,455,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	200,998,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	459,837,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	113,969,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	303,753,000	
２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	408,836,000	
２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	203,872,000	

	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	201,450,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	116,484,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	209,290,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	303,291,000	
地方債証券　合計		15,550,000,000	16,113,604,500	
特殊債券	７８回　日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,676,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	98,794,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	221,971,500	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	272,276,000	
	９６回　高速道路機構債	700,000,000	709,338,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	101,900,000	
	１７２回　高速道路機構債	200,000,000	196,886,000	
	１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	583,035,000	
	１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	506,195,000	
	１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	510,860,000	
	１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	337,471,200	
	２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	337,245,000	
	２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	509,370,000	
	２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	235,378,000	
	３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	805,528,000	
	３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,596,000	
	２８回　日本道路・機構承継債	400,000,000	528,664,000	
	１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	230,928,000	
	１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	235,928,000	
	２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	354,945,000	
	１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	235,156,000	
	３６回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,753,000	
	２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	233,568,000	
	４４回　政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	406,744,000	
	５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,390,000	
	５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	554,157,060	

６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,928,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	226,708,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	400,420,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	233,876,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	214,288,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	234,900,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	417,721,500	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,346,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,276,000	
６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	34,086,000	34,789,194	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	23,990,000	24,629,333	
９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	35,874,000	36,834,346	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	38,223,000	39,524,875	
１３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	9,852,000	9,890,324	
１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	49,650,000	49,812,852	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,646,000	13,114,407	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,060,000	50,519,044	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,855,000	38,018,143	
１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,110,000	61,860,403	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,845,000	137,247,999	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	203,144,000	215,255,445	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	244,710,000	245,891,949	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	257,508,000	260,191,233	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	258,144,000	260,653,159	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	262,773,000	264,946,132	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	262,635,000	264,806,991	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	270,588,000	274,246,349	
い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,283,000	

	３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	400,368,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	116,992,000	
	７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	200,190,000	
	８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	300,213,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	509,025,000	
特殊債券　合計		15,009,693,000	15,980,519,438	
社債券	１回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	200,000,000	199,960,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	204,746,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	202,786,000	
	１９回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,653,000	
	６回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	102,483,000	
	１４回　ブリヂストン社債	200,000,000	201,170,000	
	２３回　ジェイ　エフ　イーホールディングス社債	100,000,000	99,913,000	
	１３回　パナソニック社債	100,000,000	100,534,000	
	１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	203,804,000	
	１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	203,358,000	
	９４回　丸紅社債	100,000,000	101,709,000	
	４５回　住友商事社債	100,000,000	101,232,000	
	４７回　住友商事社債	100,000,000	101,851,000	
	４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	102,341,000	
	５７回　東京三菱銀行社債	200,000,000	207,700,000	
	１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,230,000	
	１０回　セブン銀行社債	100,000,000	101,490,000	
	４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	203,178,000	
	５６回　三菱ＵＦＪリース社債	200,000,000	202,216,000	
	７２回　三菱地所社債	100,000,000	107,765,000	
	１０８回　住友不動産社債	200,000,000	200,504,000	
	８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	107,779,000	
	４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	100,598,000	
	１９回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,616,000	
	２１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,339,000	
	３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	325,902,000	
	４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	218,742,000	
	７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	236,286,000	
	９回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	205,386,000	
	１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	315,942,000	
	６回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,585,000	
	１１回　東海旅客鉄道社債	300,000,000	306,414,000	
	１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	211,468,000	
	１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,759,000	
	４回　東京地下鉄社債	120,000,000	134,636,400	
	５１８回　中部電力社債	200,000,000	200,528,000	
	５０８回　関西電力社債	300,000,000	303,705,000	

	３７７回　中国電力社債	400,000,000	410,872,000	
	３０１回　北陸電力社債	100,000,000	102,361,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	104,721,000	
	４７１回　東北電力社債	400,000,000	412,396,000	
	２５３回　四国電力社債	200,000,000	204,512,000	
	４２４回　九州電力社債	200,000,000	206,450,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	411,784,000	
	３２１回　北海道電力社債	161,000,000	165,620,700	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	304,170,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	216,602,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	307,548,000	
	２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	306,918,000	
	１８回　大阪ガス社債	100,000,000	102,757,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	100,000,000	101,906,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,470,000	
社債券　合計		9,581,000,000	9,895,396,100	
合計			255,141,566,938	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年1月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	517,394,474
コール・ローン	281,673,497
国債証券	131,168,163,320
未収入金	1,119,421,706
未収利息	848,862,249
前払費用	30,225,778
流動資産合計	133,965,741,024
資産合計	133,965,741,024
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,253
未払解約金	68,829,000
流動負債合計	68,851,253
負債合計	68,851,253
純資産の部	
元本等	
元本	67,292,412,269
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	66,604,477,502
元本等合計	133,896,889,771
純資産合計	133,896,889,771
負債純資産合計	133,965,741,024

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1月15日 至　2021年1月12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	2021年1月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	70,038,452,021円
同期中追加設定元本額	20,299,096,407円
同期中一部解約元本額	23,045,136,159円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	7,263,834,664円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	6,005,013円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	17,901,375円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	16,432,831円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	51,702,955円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	49,493,432円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	24,803,492円
たわらノーロード　先進国債券	9,587,808,987円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	199,885,864円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	870,226,090円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	24,814,217円
たわらノーロード　バランス（標準型）	113,586,233円
たわらノーロード　バランス（積極型）	22,627,590円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	5,164,445円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	289,655,504円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	344,271,794円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	116,641,834円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	50,560,829円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	245,881円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,588,460円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	3,796,228円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,446,828円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	1,085,800円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,018,717,822円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	276,941,040円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	618,391,372円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,829,222,992円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,940,179,801円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	359,075,405円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	767,057,750円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	611,013,997円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	16,865,357円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	519,649,244円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	28,446,399円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	125,346,778円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	92,906,091円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	153,658,111円
クルーズコントロール	1,651,019,109円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	112,880,979円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	212,309,531円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	5,980,535円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	13,931,927円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	106,741,154円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	155,407,271円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	2,632,210円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,153,273,300円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	1,877,665円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	2,427,012円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	272,122,830円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	1,344,425円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	6,087,051,489円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	3,570,111,529円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,326,295,592円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,689,634,902円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	61,237,844円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	3,726,071円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	517,819,623円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	303,563,922円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,849,953円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,296,388円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,811,251円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,099,999円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,053,750円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	71,023,898円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,402,543,935円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,751,409,201円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,056,112,400円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	562,136,680円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	202,304,327円

ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,214,054,544円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	563,042,726円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,529,717円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	463,399,679円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	464,929,238円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	650,451,266円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	67,921,892円
計	67,292,412,269円
２．　受益権の総数	67,292,412,269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　2020年1月15日 至　2021年1月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2021年1月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年1月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,026,083,289
合計	1,026,083,289

（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（2020年2月22日から2021年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年1月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	468,820,000	－	468,842,253	△22,253
アメリカ・ドル	136,170,000	－	136,170,000	－
イギリス・ポンド	27,570,000	－	27,570,586	△586
ユーロ	305,080,000	－	305,101,667	△21,667
合計	468,820,000	－	468,842,253	△22,253

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9898円 (19,898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

2021年1月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 04/30/22	1,000,000.000	1,000,000.000	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,000,000.000	2,996,835.930	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,597,812.490	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,000,000.000	1,996,640.620	
		US T N/B 0.125 08/31/22	4,000,000.000	3,999,218.720	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,996,171.860	
		US T N/B 0.125 11/30/22	5,340,000.000	5,338,539.830	
		US T N/B 0.125 12/15/23	1,000,000.000	997,304.680	
		US T N/B 0.25 04/15/23	2,000,000.000	2,003,945.200	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,470,000.000	4,438,221.070	
		US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,805,359.360	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,000,000.000	2,976,562.500	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	991,562.500	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,000,000.000	990,781.250	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,000,000.000	2,970,000.000	
		US T N/B 0.375 03/31/22	1,500,000.000	1,504,628.850	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,000,000.000	1,997,656.240	
		US T N/B 0.375 07/31/27	2,000,000.000	1,951,250.000	
		US T N/B 0.375 09/30/27	1,700,000.000	1,654,578.120	
		US T N/B 0.375 11/30/25	2,590,000.000	2,576,240.620	
		US T N/B 0.5 03/15/23	2,000,000.000	2,014,687.400	
		US T N/B 0.5 03/31/25	800,000.000	803,656.240	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,000,000.000	1,974,179.680	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,500,000.000	1,478,554.680	
		US T N/B 0.5 06/30/27	1,700,000.000	1,674,632.800	
		US T N/B 0.625 03/31/27	1,800,000.000	1,792,195.300	
		US T N/B 0.625 05/15/30	4,000,000.000	3,835,000.000	
		US T N/B 0.625 08/15/30	4,210,000.000	4,022,194.510	
		US T N/B 0.875 11/15/30	5,000,000.000	4,880,468.750	
		US T N/B 1.125 02/28/25	1,000,000.000	1,030,781.250	
		US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,129,433.580	
		US T N/B 1.125 05/15/40	2,100,000.000	1,915,757.790	
		US T N/B 1.125 08/15/40	4,100,000.000	3,726,835.900	
		US T N/B 1.25 05/15/50	4,180,000.000	3,585,329.700	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,523,112.500	
		US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,413,250.000	
		US T N/B 1.375 02/15/23	4,000,000.000	4,102,031.240	

		US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,562,178.120	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,540,000.000	4,020,028.120	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,147,265.620	
		US T N/B 1.375 09/30/23	1,500,000.000	1,548,046.870	
		US T N/B 1.375 11/15/40	2,300,000.000	2,184,281.250	
		US T N/B 1.5 01/31/27	2,490,000.000	2,614,305.450	
		US T N/B 1.5 02/15/30	3,970,000.000	4,122,907.000	
		US T N/B 1.5 02/28/23	1,000,000.000	1,028,515.620	
		US T N/B 1.5 03/31/23	2,000,000.000	2,059,375.000	
		US T N/B 1.5 08/15/22	1,210,000.000	1,236,232.410	
		US T N/B 1.5 08/15/26	3,090,000.000	3,245,948.430	
		US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	767,021.480	
		US T N/B 1.5 10/31/24	2,200,000.000	2,297,109.360	
		US T N/B 1.5 11/30/24	2,000,000.000	2,089,218.740	
		US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,414,145.290	
		US T N/B 1.625 04/30/23	3,000,000.000	3,100,078.110	
		US T N/B 1.625 05/15/26	3,090,000.000	3,267,675.000	
		US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	3,000,140.620	
		US T N/B 1.625 08/15/22	3,980,000.000	4,074,835.910	
		US T N/B 1.625 08/15/29	2,380,000.000	2,503,276.540	
		US T N/B 1.625 09/30/26	1,900,000.000	2,008,953.120	
		US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,484,207.010	
		US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,773,013.260	
		US T N/B 1.625 11/15/50	2,000,000.000	1,885,468.730	
		US T N/B 1.625 11/30/26	1,020,000.000	1,078,251.550	
		US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,143,017.160	
		US T N/B 1.75 03/31/22	6,990,000.000	7,126,523.430	
		US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,517,070.260	
		US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,715,793.750	
		US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	849,096.480	
		US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,407,837.500	
		US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,879,977.320	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,396,835.930	
		US T N/B 1.75 11/15/29	3,440,000.000	3,653,118.720	
		US T N/B 1.75 12/31/24	1,600,000.000	1,688,000.000	
		US T N/B 1.75 12/31/26	740,000.000	787,695.300	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,713,468.740	
		US T N/B 1.875 06/30/26	4,670,000.000	4,998,359.370	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,538,492.180	
		US T N/B 1.875 08/31/22	3,680,000.000	3,784,650.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,297,206.230	
		US T N/B 2.0 02/15/22	8,470,000.000	8,645,024.580	
		US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,538,313.250	
		US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,652,781.250	
		US T N/B 2.0 02/15/50	2,570,000.000	2,652,922.630	
		US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	5,046,883.560	
		US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,548,265.620	
		US T N/B 2.0 11/15/26	2,640,000.000	2,847,487.500	
		US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,820,135.120	

		US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,376,171.870	
		US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,325,118.720	
		US T N/B 2.125 05/15/25	5,150,000.000	5,531,824.190	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,221,207.020	
		US T N/B 2.125 06/30/22	4,530,000.000	4,662,714.820	
		US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	3,125,485.930	
		US T N/B 2.125 12/31/21	9,160,000.000	9,338,906.250	
		US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,733,900.000	
		US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	371,656.250	
		US T N/B 2.25 02/15/27	3,550,000.000	3,886,972.630	
		US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,364,237.500	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,515,531.250	
		US T N/B 2.25 08/15/27	2,690,000.000	2,950,173.430	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,370,000.000	2,584,040.620	
		US T N/B 2.25 08/15/49	2,400,000.000	2,614,500.000	
		US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	5,034,055.440	
		US T N/B 2.25 11/15/25	5,190,000.000	5,633,177.310	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,588,314.060	
		US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	3,224,531.250	
		US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,928,850.000	
		US T N/B 2.375 05/15/27	3,100,000.000	3,422,351.540	
		US T N/B 2.375 05/15/29	2,810,000.000	3,125,246.870	
		US T N/B 2.375 08/15/24	3,920,000.000	4,213,387.500	
		US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	3,097,206.250	
		US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	3,942,791.000	
		US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,158,957.010	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,080,000.000	2,374,450.000	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,249,339.820	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,806,593.750	
		US T N/B 2.5 03/31/23	3,020,000.000	3,176,190.620	
		US T N/B 2.5 05/15/24	4,240,000.000	4,556,012.500	
		US T N/B 2.5 05/15/46	1,810,000.000	2,067,642.090	
		US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,589,461.690	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,410,943.750	
		US T N/B 2.625 02/15/29	4,110,000.000	4,647,189.810	
		US T N/B 2.625 02/28/23	1,800,000.000	1,894,500.000	
		US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,351,394.520	
		US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,929,768.750	
		US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,277,785.920	
		US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,529,913.260	
		US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,735,209.340	
		US T N/B 2.75 02/15/28	4,370,000.000	4,951,073.430	
		US T N/B 2.75 02/28/25	1,660,000.000	1,821,850.000	
		US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,637,649.200	
		US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,469,010.130	
		US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	871,530.460	
		US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,484,082.810	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,430,000.000	1,703,375.770	
		US T N/B 2.75 08/15/47	1,880,000.000	2,251,887.490	

		US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,315,966.390	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,812,968.750	
		US T N/B 2.75 11/15/23	5,520,000.000	5,920,200.000	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,220,000.000	1,452,562.500	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,140,000.000	2,564,489.030	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	5,063,697.630	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,200,000.000	2,672,484.360	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,090,000.000	3,805,286.690	
		US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,800,986.700	
		US T N/B 2.875 07/31/25	1,860,000.000	2,064,454.670	
		US T N/B 2.875 08/15/28	3,680,000.000	4,217,625.000	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,890,000.000	2,302,846.870	
		US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	900,900.000	
		US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	3,965,308.570	
		US T N/B 2.875 11/15/46	2,020,000.000	2,468,345.290	
		US T N/B 3.0 02/15/47	1,640,000.000	2,050,896.850	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,540,000.000	3,185,517.170	
		US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	3,865,082.000	
		US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,212,903.120	
		US T N/B 3.0 05/15/45	1,630,000.000	2,026,293.750	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,290,000.000	1,615,624.210	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,210,000.000	4,030,556.250	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,576,776.560	
		US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,150,549.990	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,790,000.000	2,221,557.810	
		US T N/B 3.0 11/15/45	1,440,000.000	1,794,374.990	
		US T N/B 3.125 02/15/42	680,000.000	858,128.120	
		US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,816,762.490	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,660,000.000	3,409,995.290	
		US T N/B 3.125 08/15/44	1,750,000.000	2,214,433.580	
		US T N/B 3.125 11/15/28	2,840,000.000	3,314,812.490	
		US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	957,006.250	
		US T N/B 3.375 05/15/44	2,030,000.000	2,665,802.320	
		US T N/B 3.375 11/15/48	2,660,000.000	3,570,218.750	
		US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,182,164.050	
		US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	2,219,346.870	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,670,000.000	2,267,807.810	
		US T N/B 3.75 08/15/41	710,000.000	972,755.450	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,883,068.740	
		US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,536,135.930	
		US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,163,805.450	
		US T N/B 4.25 11/15/40	510,000.000	740,137.500	
		US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	792,945.310	
		US T N/B 4.375 05/15/40	1,200,000.000	1,760,250.000	
		US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,539,281.240	
		US T N/B 4.375 11/15/39	910,000.000	1,331,230.460	
		US T N/B 4.5 02/15/36	730,000.000	1,042,360.140	
		US T N/B 4.5 05/15/38	540,000.000	790,678.120	
		US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,170,002.330	

	US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,130,449.200	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,852,312.500	
	US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	761,367.180	
	US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	655,221.870	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,130,566.400	
	US T N/B 5.375 02/15/31	700,000.000	988,093.750	
	US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	871,152.340	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,072,181.250	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,222,382.800	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	1,041,703.120	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,157,851.560	
アメリカ・ドル　小計		498,850,000.000 (51,995,135,500)	538,345,675.280 (56,111,769,736)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,200,000.000	1,205,520.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,500,000.000	1,505,925.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,000,000.000	997,900.000	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	250,000.000	246,487.160	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,450,000.000	1,456,878.220	
	UK TREASURY 0.5 07/22/22	1,920,000.000	1,938,382.840	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	470,000.000	418,650.500	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,250,000.000	1,286,492.990	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	800,000.000	796,769.920	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	750,000.000	695,652.150	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,593,581.800	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,110,000.000	1,170,135.800	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,120,000.000	1,159,685.170	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,260,000.000	1,354,716.720	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	880,000.000	948,838.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	974,290.320	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	910,000.000	1,040,747.790	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	1,035,932.580	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	520,000.000	632,935.190	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	580,000.000	800,023.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	890,000.000	1,079,975.840	

		UK TREASURY 1.75 07/22/57	910,000.000	1,168,481.860	
		UK TREASURY 1.75 09/07/22	1,530,000.000	1,577,561.120	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,440,000.000	1,672,392.960	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	865,159.020	
		UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,253,360.120	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	980,000.000	1,596,504.160	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	529,435.580	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,310,000.000	1,960,758.220	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	2,006,568.820	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	1,982,014.830	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	940,000.000	1,684,068.280	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	870,000.000	1,789,299.230	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,130,000.000	1,721,046.500	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,110,000.000	1,584,188.110	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,479,713.280	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	1,003,277.800	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,570,763.520	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	1,884,826.280	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	990,000.000	1,840,219.020	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	2,060,981.080	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	760,000.000	1,156,221.440	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,280,000.000	2,219,834.240	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	940,000.000	1,347,061.360	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	880,000.000	1,478,538.410	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,410,000.000	1,706,794.560	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,106,081.200	
	イギリス・ポンド　小計		47,920,000.000 (6,753,844,800)	62,584,671.990 (8,820,683,670)	
	イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.75 07/31/22	300,000.000	302,951.700	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	950,000.000	957,638.000	

	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	1,000,000.000	1,021,683.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	500,000.000	493,785.500	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,160,035.710	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,844,662.490	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,892,008.600	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,260,000.000	1,709,052.660	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,920,000.000	3,186,058.720	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,500,000.000	2,512,218.000	
イスラエル・シュケル　小計		15,670,000.000 (514,759,500)	18,080,094.380 (593,931,100)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,440,000.000	1,442,695.960	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,441,519.370	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,180,000.000	1,179,424.570	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,600,000.000	1,575,249.660	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,540,000.000	1,530,279.830	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,390,000.000	1,398,428.400	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,640,000.000	1,703,868.160	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,100,000.000	995,500.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,740,000.000	1,925,136.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	2,190,000.000	2,278,566.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,050,000.000	2,324,267.640	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,150,615.010	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	740,000.000	847,884.600	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	619,409.190	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,330,000.000	1,514,604.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,780,000.000	2,043,222.840	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,860,000.000	2,141,418.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	1,036,026.270	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,720,000.000	3,063,352.120	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,440,000.000	2,904,110.690	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	520,000.000	641,809.160	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	993,976.030	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,410,909.370	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,130,000.000	1,550,954.710	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,670,000.000	2,099,686.650	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,510,000.000	2,817,264.160	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	680,000.000	738,378.740	
オーストラリア・ドル　小計		40,850,000.000 (3,281,889,000)	45,368,557.130 (3,644,909,880)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	200,000.000	197,340.000	

	CANADA 0.5 03/01/22	300,000.000	301,380.000	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,350,000.000	2,355,052.500	
	CANADA 0.5 12/01/30	700,000.000	675,332.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	719,495.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	1,500,000.000	1,521,105.000	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	724,241.000	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,810,000.000	1,880,553.800	
	CANADA 1.5 05/01/22	920,000.000	936,624.400	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,247,425.300	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	841,648.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	3,160,000.000	3,265,796.800	
	CANADA 2.0 06/01/28	720,000.000	791,366.400	
	CANADA 2.0 09/01/23	920,000.000	962,927.200	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,280,000.000	1,458,841.600	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	562,669.200	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,300,000.000	1,402,284.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	686,103.600	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,718,000.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,321,513.600	
	CANADA 2.75 12/01/48	850,000.000	1,112,225.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	498,410.500	
	CANADA 3.5 12/01/45	920,000.000	1,333,567.600	
	CANADA 4.0 06/01/41	680,000.000	1,010,983.200	
	CANADA 5.0 06/01/37	590,000.000	929,586.300	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,000,000.000	1,408,220.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	1,117,216.800	
カナダ・ドル　小計		28,660,000.000 (2,337,509,600)	31,979,908.800 (2,608,281,362)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.875 03/01/50	210,000.000	241,553.550	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	310,000.000	335,668.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	480,000.000	552,607.200	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	368,866.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	100,000.000	118,504.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	130,000.000	146,666.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	549,360.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	483,550.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	742,420.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	232,200.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	435,225.450	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	602,305.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	800,000.000	837,548.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	608,496.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	852,640.000	
シンガポール・ドル　小計		6,200,000.000 (485,832,000)	7,107,609.200 (556,952,257)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	2,200,000.000	2,209,161.460	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	1,540,000.000	1,635,557.000	

	SWEDEN 0.75 11/12/29	1,970,000.000	2,105,614.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,546,095.800	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	8,200,000.000	8,631,313.440	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,180,000.000	6,936,048.840	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	5,055,158.400	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	3,000,000.000	3,160,695.000	
スウェーデン・クローナ　小計		30,610,000.000 (384,461,600)	34,279,644.740 (430,552,338)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/22	3,660,000.000	3,713,436.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	1,650,000.000	1,774,575.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,635,937.670	
	DENMARK 0.5 11/15/29	2,670,000.000	2,895,267.900	
	DENMARK 1.5 11/15/23	2,300,000.000	2,441,466.100	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,931,072.220	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,050,000.000	15,261,190.000	
デンマーク・クローネ　小計		30,780,000.000 (524,491,200)	39,652,944.890 (675,686,181)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,858,050.900	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,928,113.800	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,000,000.000	1,057,865.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,985,090.400	
	NORWAY 1.75 09/06/29	1,700,000.000	1,813,279.500	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,240,775.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,000,000.000	1,039,117.500	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,699,757.200	
ノルウェー・クローネ　小計		23,270,000.000 (284,359,400)	24,622,049.300 (300,881,442)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 07/25/22	1,200,000.000	1,199,711.730	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,550,000.000	2,557,142.800	
	POLAND 2.25 04/25/22	1,600,000.000	1,647,176.640	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,850,000.000	2,993,228.740	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,465,904.280	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,080,000.000	2,301,520.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,280,000.000	2,538,003.880	
	POLAND 2.75 04/25/28	2,700,000.000	3,057,475.130	
	POLAND 2.75 10/25/29	210,000.000	239,188.020	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,686,201.750	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,940,000.000	4,368,805.960	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,997,640.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	1,720,000.000	1,887,768.800	
ポーランド・ズロチ　小計		27,240,000.000 (762,447,600)	29,939,767.730 (838,014,099)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,076,652.100	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,261,316.520	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,167,510.600	

	MALAYSIA 3.828 07/05/34	600,000.000	633,242.700	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,298,490.800	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	865,759.920	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,605,173.110	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,384,748.370	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	2,060,220.600	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,409,177.040	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,600,000.000	3,075,040.020	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,329,792.000	
マレーシア・リンギット　小計		21,930,000.000 (563,601,000)	24,167,123.780 (621,095,081)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	20,000,000.000	21,026,000.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	11,144,606.550	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	22,596,000.000	27,062,099.400	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	15,516,362.160	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	7,830,000.000	8,075,229.330	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	20,530,824.520	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	11,632,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	13,643,000.000	15,351,649.320	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	8,125,880.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	10,000,000.000	11,198,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	9,254,000.000	10,650,521.140	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	15,401,820.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	17,109,000.000	20,747,057.760	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	7,125,000.000	8,664,570.000	
メキシコ・ペソ　小計		179,572,000.000 (933,774,400)	205,126,820.180 (1,066,659,465)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	840,000.000	870,598.680	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	200,000.000	203,155.400	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	200,000.000	199,940.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	367,185.040	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	556,545.600	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	820,000.000	896,608.500	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	180,000.000	212,189.760	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	680,000.000	734,758.080	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	170,000.000	215,566.800	
	AUSTRIA 07/15/23	650,000.000	661,082.500	

		AUSTRIA 07/15/24	800,000.000	819,138.400	
		AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	475,572.790	
		AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	697,892.480	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	520,000.000	710,764.080	
		AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	245,790.000	
		AUSTRIA 1.65 10/21/24	540,000.000	588,388.320	
		AUSTRIA 1.75 10/20/23	750,000.000	801,207.750	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	380,000.000	823,201.220	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	480,000.000	650,698.410	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	370,000.000	643,976.670	
		AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	796,649.220	
		AUSTRIA 3.65 04/20/22	280,000.000	295,428.000	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	504,489.090	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,513,890.000	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	590,000.000	761,685.280	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	974,434.600	
		BELGIUM 0.0 10/22/27	500,000.000	517,869.500	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	834,880.000	
		BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	676,797.000	
		BELGIUM 0.4 06/22/40	320,000.000	336,027.520	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	553,779.350	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	1,140,000.000	1,214,402.100	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	850,000.000	925,029.500	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	880,000.000	966,240.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	1,010,000.000	1,123,444.210	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,020,000.000	1,110,148.620	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	810,000.000	920,589.300	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	710,000.000	837,310.100	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	30,000.000	37,062.160	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	640,000.000	846,372.480	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	490,000.000	672,210.660	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	726,456.830	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	420,000.000	702,912.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	890,369.220	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	420,000.000	675,927.420	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	1,050,000.000	1,170,183.000	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	470,000.000	668,968.060	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	650,000.000	1,186,428.100	
		BELGIUM 4.0 03/28/22	420,000.000	443,826.600	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	530,000.000	786,480.250	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	960,000.000	1,740,013.440	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,291,346.350	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	820,000.000	1,041,878.060	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,090,000.000	1,891,413.000	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,240,000.000	1,787,680.340	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,250,000.000	1,289,423.750	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,300,000.000	1,344,993.000	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	300,000.000	310,551.000	
		BUNDESOBL 04/05/24	1,540,000.000	1,577,345.000	

		BUNDESOBL 04/14/23	3,130,000.000	3,182,946.450	
		BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,417,683.400	
		BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,306,508.800	
		BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,161,838.880	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,777,677.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,600,000.000	1,677,776.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,000,000.000	2,103,580.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	500,000.000	527,705.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	970,000.000	997,964.790	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	600,000.000	627,480.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,960,000.000	2,075,659.600	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,900,000.000	2,036,765.800	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,539,460.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,860,000.000	1,955,659.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,810,000.000	1,924,645.400	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,430,000.000	1,550,463.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,300,000.000	2,483,795.760	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	1,680,000.000	1,748,377.680	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	1,910,000.000	2,008,683.190	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,425,373.140	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,770,000.000	1,913,016.000	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,620,000.000	2,246,073.300	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,420,000.000	1,487,310.840	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,737,491.250	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,010,000.000	1,086,881.200	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,710,738.640	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,300,000.000	1,401,823.800	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,595,853.490	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,550,000.000	1,661,536.450	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,860,000.000	3,080,978.400	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,750,000.000	2,975,727.820	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,100,000.000	1,955,503.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,590,000.000	2,730,313.020	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,140,000.000	2,129,782.200	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	850,404.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,420,000.000	2,446,177.200	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,180,000.000	2,376,048.000	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	2,012,334.000	

		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,160,000.000	1,686,512.400	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	1,017,954.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,161,446.400	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,050,423.700	
		FINLAND 0.0 09/15/24	180,000.000	184,762.200	
		FINLAND 0.0 09/15/30	170,000.000	176,266.880	
		FINLAND 0.125 04/15/36	210,000.000	218,212.680	
		FINLAND 0.25 09/15/40	170,000.000	179,370.230	
		FINLAND 0.5 04/15/26	430,000.000	456,662.150	
		FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	322,060.260	
		FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	259,082.400	
		FINLAND 0.5 09/15/29	570,000.000	617,458.770	
		FINLAND 0.75 04/15/31	380,000.000	424,457.720	
		FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	322,286.100	
		FINLAND 04/15/22	120,000.000	121,060.800	
		FINLAND 09/15/23	230,000.000	234,490.750	
		FINLAND 1.125 04/15/34	190,000.000	223,937.610	
		FINLAND 1.375 04/15/47	130,000.000	176,246.850	
		FINLAND 1.5 04/15/23	340,000.000	357,119.000	
		FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	415,902.000	
		FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	305,187.680	
		FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	553,057.750	
		FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	475,483.050	
		FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	522,166.630	
		FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,247,856.020	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/23	1,100,000.000	1,115,620.000	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	1,500,000.000	1,545,675.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,450,000.000	2,530,489.850	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	1,400,000.000	1,441,020.000	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,850,000.000	4,037,976.250	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,620,000.000	2,751,917.000	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,193,827.400	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,140,000.000	2,306,055.860	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	700,000.000	749,256.200	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,750,000.000	3,002,890.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,380,000.000	1,522,381.500	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,340,000.000	2,564,340.480	
		FRANCE OAT 02/25/22	690,000.000	695,084.330	
		FRANCE OAT 03/25/23	2,700,000.000	2,739,987.000	
		FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,778,474.560	
		FRANCE OAT 03/25/25	2,470,000.000	2,536,467.700	
		FRANCE OAT 05/25/22	2,190,000.000	2,209,977.180	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,650,000.000	1,815,330.000	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	1,720,000.000	1,857,956.040	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,340,000.000	2,770,801.020	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,190,000.000	2,624,934.000	

		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,590,000.000	4,263,010.120	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,670,000.000	2,205,485.500	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	2,730,000.000	2,888,176.200	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	740,000.000	1,109,779.480	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,990,000.000	2,610,521.800	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,680,000.000	2,932,742.760	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,490,000.000	2,152,537.440	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,177,312.940	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,030,000.000	2,137,355.730	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,740,000.000	3,485,048.730	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,480,000.000	3,042,994.720	
		FRANCE OAT 3.0 04/25/22	2,850,000.000	2,984,388.900	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,800,000.000	3,087,478.800	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,820,000.000	3,444,630.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,060,000.000	2,275,820.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,090,000.000	2,476,232.570	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,600,700.240	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	2,730,000.000	3,109,920.450	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,180,000.000	4,107,481.880	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,650,000.000	2,812,434.900	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,816,220.460	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	1,760,000.000	3,022,113.600	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,383,185.600	
		IRISH 0.2 05/15/27	280,000.000	292,787.600	
		IRISH 0.2 10/18/30	260,000.000	272,525.650	
		IRISH 0.4 05/15/35	240,000.000	255,853.440	
		IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	376,428.080	
		IRISH 0.9 05/15/28	430,000.000	473,172.590	
		IRISH 1.0 05/15/26	980,000.000	1,063,382.320	
		IRISH 1.1 05/15/29	380,000.000	427,608.680	
		IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	401,903.460	
		IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	245,124.810	
		IRISH 1.5 05/15/50	400,000.000	531,232.000	
		IRISH 1.7 05/15/37	400,000.000	510,330.000	
		IRISH 10/18/22	220,000.000	222,721.570	
		IRISH 2.0 02/18/45	560,000.000	798,936.320	
		IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	793,198.350	
		IRISH 3.4 03/18/24	510,000.000	576,277.050	
		IRISH 3.9 03/20/23	570,000.000	627,521.660	
		IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	1,003,217.600	
		ITALY BTPS 0.0 01/15/24	400,000.000	403,080.000	
		ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,000,000.000	1,016,800.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	2,080,000.000	2,122,388.320	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	300,000.000	307,443.810	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	1,006,659.820	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,400,000.000	1,460,550.000	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,000,000.000	1,032,929.000	
		ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	999,913.600	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	946,272.440	

		ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,100,923.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,170,000.000	1,219,959.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	600,000.000	629,280.000	
		ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	785,785.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,442,175.300	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,510,000.000	1,631,121.630	
		ITALY BTPS 1.35 04/15/22	980,000.000	1,002,126.930	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	1,097,622.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,643,728.240	
		ITALY BTPS 1.45 09/15/22	900,000.000	928,310.400	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,105,277.990	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,690,000.000	1,808,675.180	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000.000	1,192,620.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,790,000.000	1,985,199.500	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,480,000.000	1,638,421.860	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	700,000.000	744,366.000	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	500,000.000	534,121.250	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	600,000.000	664,500.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	866,700.000	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	900,000.000	977,940.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,390,000.000	1,560,408.440	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,066,998.060	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	940,000.000	1,054,219.400	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,630,000.000	1,813,730.340	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	920,000.000	1,039,232.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,216,044.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,323,917.100	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	870,000.000	1,086,369.000	
		ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	1,000,708.830	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,250,000.000	1,404,343.750	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,170,000.000	1,291,137.700	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,020,000.000	1,323,960.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	590,000.000	790,010.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,200,000.000	1,430,580.000	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,229,614.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,620,382.890	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	810,000.000	1,083,031.560	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,402,899.300	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,090,000.000	1,451,195.480	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,502,378.400	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	940,000.000	1,196,050.360	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,010,000.000	1,155,005.700	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	1,168,891.190	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,660,000.000	2,402,352.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,090,000.000	1,253,227.500	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	2,006,041.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,558,167.800	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,149,470.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,390,000.000	1,853,994.510	

		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,657,435.120	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,700,000.000	1,805,400.000	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,171,962.730	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,476,019.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	2,207,268.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,150,000.000	1,927,055.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,750,000.000	2,481,850.000	
		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	1,150,000.000	1,261,187.060	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,168,348.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	2,024,704.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,496,031.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,546,096.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,528,740.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,502,732.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	260,000.000	269,942.400	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	400,000.000	404,952.000	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	950,000.000	991,558.700	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,064,523.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	842,740.710	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	490,000.000	557,093.090	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	940,000.000	1,002,087.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,200,000.000	1,309,200.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	750,000.000	826,197.000	
		NETHERLANDS 01/15/22	460,000.000	463,205.510	
		NETHERLANDS 01/15/24	830,000.000	848,269.960	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,110,000.000	2,242,508.000	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	820,000.000	899,417.000	
		NETHERLANDS 2.25 07/15/22	980,000.000	1,024,037.070	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	780,000.000	1,057,079.400	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	960,000.000	1,693,009.510	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/23	390,000.000	425,217.000	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,060,000.000	1,958,984.940	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	950,000.000	1,617,470.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,211,335.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,425,410.000	
		SPAIN 0.0 04/30/23	990,000.000	1,002,177.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	940,000.000	965,025.620	
		SPAIN 0.35 07/30/23	1,120,000.000	1,144,600.800	
		SPAIN 0.4 04/30/22	1,570,000.000	1,589,562.200	
		SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,364,401.400	

		SPAIN 0.5 04/30/30	1,150,000.000	1,203,285.250	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,480,000.000	1,564,476.920	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,200,000.000	1,284,180.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	670,000.000	692,807.470	
		SPAIN 1.2 10/31/40	970,000.000	1,074,672.310	
		SPAIN 1.25 10/31/30	1,770,000.000	1,981,515.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,750,000.000	1,918,647.500	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,240,000.000	1,384,052.650	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,210,000.000	1,355,200.000	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,170,000.000	1,320,016.230	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,480,000.000	1,649,980.960	
		SPAIN 1.5 04/30/27	1,210,000.000	1,347,879.500	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,579,361.750	
		SPAIN 1.85 07/30/35	1,290,000.000	1,560,927.730	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,270,000.000	1,428,662.370	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,729,251.150	
		SPAIN 2.15 10/31/25	1,080,000.000	1,214,465.400	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,240,000.000	1,562,648.000	
		SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,262,854.690	
		SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,730,850.040	
		SPAIN 2.9 10/31/46	1,180,000.000	1,767,722.600	
		SPAIN 3.45 07/30/66	860,000.000	1,556,484.760	
		SPAIN 3.8 04/30/24	1,270,000.000	1,451,804.310	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,180,000.000	1,876,699.830	
		SPAIN 4.4 10/31/23	480,000.000	546,723.360	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,690,266.130	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,270,000.000	2,274,138.200	
		SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,314,548.210	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	2,114,073.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	1,180,000.000	1,672,178.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	830,000.000	1,639,311.420	
		SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,638,871.900	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,220,000.000	2,002,156.880	
		SPAIN 5.85 01/31/22	1,810,000.000	1,932,309.300	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,170,000.000	1,580,356.440	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,362,147.400	
	ユーロ　小計		356,780,000.000 (45,214,729,400)	433,194,560.950 (54,898,746,709)	
国債証券　合計			114,036,835,000 (114,036,835,000)	131,168,163,320 (131,168,163,320)	
合計				131,168,163,320 (131,168,163,320)	

（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	195銘柄	41.91	42.78
イギリス・ポンド	国債証券	47銘柄	6.59	6.72
イスラエル・シュケル	国債証券	10銘柄	0.44	0.45
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	2.72	2.78
カナダ・ドル	国債証券	27銘柄	1.95	1.99
シンガポール・ドル	国債証券	15銘柄	0.42	0.42
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.32	0.33
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.50	0.52
ノルウェー・クローネ	国債証券	8銘柄	0.22	0.23
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.63	0.64
マレーシア・リンギット	国債証券	12銘柄	0.46	0.47
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.80	0.81
ユーロ	国債証券	317銘柄	41.00	41.85

（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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年1月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,843,529,124
投資証券	62,460,500,070
派生商品評価勘定	55,413,180
未収配当金	439,373,744
差入委託証拠金	213,444,000
流動資産合計	66,012,260,118
資産合計	66,012,260,118
負債の部	
流動負債	
前受金	57,084,300
未払金	1,859,557,853
未払解約金	10,350,000
流動負債合計	1,926,992,153
負債合計	1,926,992,153
純資産の部	
元本等	
元本	31,200,083,619
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	32,885,184,346
元本等合計	64,085,267,965
純資産合計	64,085,267,965
負債純資産合計	66,012,260,118

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1月15日 至　2021年1月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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。
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	2021年1月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,388,243,328円
同期中追加設定元本額	40,367,493,940円
同期中一部解約元本額	26,555,653,649円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	330,523円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	929,550円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	982,645円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	2,829,084円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	2,571,050円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,485,533円
たわらノーロード　国内リート	4,333,673,456円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	901,728,666円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	855,272,787円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	16,259,939円
たわらノーロード　バランス（標準型）	278,688,753円
たわらノーロード　バランス（積極型）	286,443,788円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	93,790,458円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	223,020,640円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	129,632,677円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	166,009,532円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,372,245円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	5,077,590円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,049,268円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	5,280,116円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	11,153,764円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	343,607,543円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,701,541円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	130,509,613円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	147,057,515円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	275,698,878円
投資のソムリエ	7,799,393,359円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	502,601,104円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	118,464,447円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	281,800,365円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,106,813,172円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	9,042,752円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	4,280,394円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,686,917円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	21,890,224円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,514,896,076円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	116,357,525円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	4,465,379円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	2,392,118円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	2,316,568円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	35,269,208円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１２１２（適格機関投資家限定）	84,052,414円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１４０１（適格機関投資家限定）	755,216,340円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	74,877,656円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）２０－０４（適格機関投資家限定）	147,437,368円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	91,826,064円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	65,171,921円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	46,066,547円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	5,078,874,679円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	688,329,292円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	121,693,767円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,303,674,648円
計	31,200,083,619円
２．　受益権の総数	31,200,083,619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　2020年1月15日 至　2021年1月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

２． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信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、不動産投資信託証券の価格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	2021年1月12日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年1月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	1,878,089,725
合計	1,878,089,725

（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（2020年6月9日から2021年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2021年1月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	1,341,587,700	－	1,397,088,000	55,500,300
合計	1,341,587,700	－	1,397,088,000	55,500,300

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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）

	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0540円 (20,540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

2021年1月12日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	1,786	269,864,600	
	ＧＬＰ投資法人	20,450	3,474,455,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	8,008	734,333,600	
	Ｏｎｅリート投資法人	1,020	265,506,000	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	1,721	217,878,600	
	いちごオフィスリート投資法人	5,430	407,250,000	
	いちごホテルリート投資法人	1,144	78,135,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	3,279	1,401,772,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	6,217	1,973,897,500	
	イオンリート投資法人	6,638	887,500,600	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	42,047	601,692,570	
	インヴィンシブル投資法人	27,366	890,763,300	

エスコンジャパンリート投資法人	1,070	130,326,000	
オリックス不動産投資法人	13,040	2,128,128,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	4,545	475,407,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,025	1,368,900,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	4,270	783,545,000	
ケネディクス商業リート投資法人	2,407	600,065,100	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,856	839,378,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,260	139,482,000	
サンケイリアルエステート投資法人	1,602	164,044,800	
ザイマックス・リート投資法人	1,003	98,294,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	21,084	1,094,259,600	
ジャパンエクセレント投資法人	6,073	754,266,600	
ジャパンリアルエステイト投資法人	6,545	3,848,460,000	
スターアジア不動産投資法人	6,724	330,484,600	
スターツプロシード投資法人	1,019	199,010,700	
タカラレーベン不動産投資法人	1,967	183,521,100	
トーセイ・リート投資法人	1,448	163,768,800	
ヒューリックリート投資法人	5,269	793,511,400	
フロンティア不動産投資法人	2,172	864,456,000	
プレミア投資法人	5,911	738,875,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	1,396	184,272,000	
マリモ地方創生リート投資法人	613	68,839,900	
ユナイテッド・アーバン投資法人	13,997	1,788,816,600	
ラサールロジポート投資法人	7,293	1,234,704,900	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,539	339,210,400	
阪急阪神リート投資法人	2,956	370,386,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,284	1,178,544,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,473	624,552,000	
産業ファンド投資法人	9,251	1,840,949,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,417	159,979,300	
森トラスト総合リート投資法人	4,678	614,221,400	
森ヒルズリート投資法人	7,688	1,137,055,200	
星野リゾート・リート投資法人	996	505,968,000	
積水ハウス・リート投資法人	19,250	1,432,200,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,056	72,652,800	
大和ハウスリート投資法人	9,338	2,456,827,800	

	大和証券オフィス投資法人	1,394	900,524,000	
	大和証券リビング投資法人	8,546	812,724,600	
	投資法人みらい	7,068	272,824,800	
	東急リアル・エステート投資法人	4,388	700,324,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	2,256	1,303,968,000	
	日本ビルファンド投資法人	7,366	4,345,940,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	4,075	1,383,462,500	
	日本プロロジスリート投資法人	9,903	3,272,941,500	
	日本リート投資法人	2,126	761,108,000	
	日本リテールファンド投資法人	12,296	2,251,397,600	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	4,276	1,342,664,000	
	福岡リート投資法人	3,385	515,197,000	
	平和不動産リート投資法人	4,016	520,875,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	21,164	3,166,134,400	
投資証券　合計		395,880	62,460,500,070	
合計			62,460,500,070	

（注）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。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年1月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	3,578,504,497
コール・ローン	149,348,000
投資信託受益証券	6,575,423,611
投資証券	46,681,444,826
派生商品評価勘定	8,337
未収配当金	194,619,182
流動資産合計	57,179,348,453
資産合計	57,179,348,453
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,335
未払金	3,518,581,982
未払解約金	6,014,000
流動負債合計	3,524,598,317
負債合計	3,524,598,317
純資産の部	
元本等	
元本	45,737,709,443
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,917,040,693
元本等合計	53,654,750,136
純資産合計	53,654,750,136
負債純資産合計	57,179,348,453

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1月15日 至　2021年1月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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	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	2021年1月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	29,640,253,704円
同期中追加設定元本額	73,990,639,755円
同期中一部解約元本額	57,893,184,016円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	60,101,369円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	29,451,195円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,415,600円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	15,337,787円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	16,120,619円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	46,339,968円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	42,386,409円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	24,313,134円
たわらノーロード　先進国リート	7,628,789,207円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,435,869,390円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	321,297,973円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,469,864,376円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	14,077,529円

たわらノーロード　バランス（標準型）	241,276,752円
たわらノーロード　バランス（積極型）	458,361,267円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	64,602,172円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	288,016,310円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	219,800,089円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	338,374,993円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	126,975円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,589,085円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,422,849円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	5,454,607円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	387,634,212円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	19,764,302円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	611,915,400円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	54,446,524円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	229,297,790円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	258,547,175円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	477,072,977円
投資のソムリエ	8,522,368,607円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	546,614,146円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	208,590,169円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	415,716,099円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,587,730,833円
ワールドアセットバランス（基本コース）	812,123,062円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,416,620,572円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	20,840,207円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	9,864,496円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,964,620円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	18,955,015円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,082,860,541円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	197,501,575円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	10,049,652円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	5,379,254円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	5,337,159円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	613,167,579円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	128,935,727円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	652,930,869円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）２０－０４（適格機関投資家限定）	367,335,093円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	800,383,071円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	108,687,459円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	401,315,132円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,060,965,629円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	171,261,444円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	387,764,386円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,976,918,080円
Ｐ－Ｏｎｅマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,879,914,082円
ＤＩＡＭ海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	555,546,850円
計	45,737,709,443円

２．　受益権の総数	45,737,709,443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　2020年1月15日 至　2021年1月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2021年1月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年1月12日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	249,717,606
投資証券	1,323,471,589
合計	1,573,189,195

（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（2020年6月23日から2021年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年1月12日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	25,751,550	－	25,752,500	△950
オーストラリア・ドル	12,048,540	－	12,049,500	△960
シンガポール・ドル	3,917,560	－	3,917,500	60
ニュージーランド・ドル	3,737,855	－	3,737,500	355
香港・ドル	6,047,595	－	6,048,000	△405
買建	46,159,848	－	46,166,800	6,952
アメリカ・ドル	31,266,390	－	31,266,000	△390
イギリス・ポンド	7,046,385	－	7,046,500	115
カナダ・ドル	3,262,580	－	3,262,000	△580
ユーロ	1,267,193	－	1,267,300	107
韓国・ウォン	3,317,300	－	3,325,000	7,700
合計	71,911,398	－	71,919,300	6,002

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.1731円

（1万口当たり純資産額）	(11,731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

2021年1月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	286,000.000	201,630.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	608,300.000	450,142.000	
		PRIME US REIT	167,500.000	134,000.000	
	アメリカ・ドル　小計		1,134,500.000	785,772.000 (81,901,016)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	168,599.000	482,193.140	
		APN INDUSTRIA REIT	48,347.000	142,623.650	
		ARENA REIT	138,744.000	395,420.400	
		AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	148,166.000	391,158.240	
		BWP TRUST	208,556.000	905,133.040	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	210,161.000	498,081.570	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	187,843.000	567,285.860	
		CENTURIA OFFICE REIT	167,422.000	351,586.200	
		CHARTER HALL GROUP	196,519.000	2,719,822.960	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	219,299.000	969,301.580	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	220,203.000	770,710.500	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	136,121.000	428,781.150	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	811,527.000	693,855.580	
		DEXUS	458,641.000	4,127,769.000	
		GDI PROPERTY GROUP	215,534.000	251,097.110	
		GOODMAN GROUP	706,115.000	12,766,559.200	
		GPT GROUP	820,814.000	3,603,373.460	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	127,935.000	428,582.250	
		HOME CONSORTIUM LTD	60,660.000	243,246.600	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	30,330.000	37,609.200	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,965.000	224,113.950	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	119,129.000	573,010.490	
		IRONGATE GROUP	238,761.000	292,482.220	
		MIRVAC GROUP	1,658,102.000	4,261,322.140	

	NATIONAL STORAGE REIT	401,586.000	754,981.680	
	RURAL FUNDS GROUP	140,175.000	357,446.250	
	SCENTRE GROUP	2,183,204.000	6,112,971.200	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	458,349.000	1,113,788.070	
	STOCKLAND	1,005,296.000	4,151,872.480	
	VICINITY CENTRES	1,633,863.000	2,532,487.650	
	WAYPOINT REIT LTD	335,427.000	855,338.850	
オーストラリア・ドル　小計		13,529,393.000	52,004,005.670 (4,178,001,815)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	190,795.000	244,217.600	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	409,680.000	270,388.800	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,334,160.000	4,055,846.400	
	ASCOTT TRUST	794,916.000	850,560.120	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,906,409.000	4,308,484.340	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	387,680.000	554,382.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	329,200.000	424,668.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	127,400.000	91,091.000	
	ESR REIT	1,036,630.000	404,285.700	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	430,600.000	264,819.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	300,800.000	75,200.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	566,700.000	1,462,086.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	286,700.000	151,951.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,127,064.000	1,656,784.080	
	IREIT GLOBAL	214,500.000	139,425.000	
	KEPPEL DC REIT	539,700.000	1,478,778.000	
	KEPPEL REIT	730,200.000	832,428.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	339,200.000	266,272.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,139,000.000	132,618.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST-RTS	3,422,400.000	3,422.400	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	923,400.000	2,013,012.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	705,320.000	2,017,215.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,187,720.000	2,387,317.200	

		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	813,400.000	784,931.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	901,255.000	346,983.170	
		PARKWAY LIFE REIT	166,800.000	647,184.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	313,200.000	112,752.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	189,200.000	158,928.000	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	342,600.000	183,291.000	
		SPH REIT	412,500.000	348,562.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	570,500.000	299,512.500	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	912,090.000	1,377,255.900	
	シンガポール・ドル　小計		24,051,719.000	28,344,652.310 (2,221,086,955)	
	ユーロ	CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	577,500.000	277,200.000	
	ユーロ　小計		577,500.000	277,200.000 (35,129,556)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	612,000.000	4,412,520.000	
	香港・ドル　小計		612,000.000	4,412,520.000 (59,304,269)	
投資信託受益証券　合計			39,905,112	6,575,423,611 (6,575,423,611)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	35,038.000	502,795.300	
		AGREE REALTY CORP	24,533.000	1,576,735.910	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	31,172.000	520,572.400	
		ALEXANDER'S INC.	892.000	237,566.360	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,022.000	8,571,664.940	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	21,487.000	598,842.690	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	58,044.000	2,408,245.560	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	44,862.000	331,081.560	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	112,972.000	3,327,025.400	
		AMERICOLD REALTY TRUST	86,313.000	3,008,008.050	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	62,790.000	2,316,951.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	55,313.000	266,608.660	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	88,065.000	1,091,125.350	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	24,198.000	270,775.620	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	58,646.000	9,229,707.480	

		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	10,643.000	123,565.230	
		BOSTON PROPERTIES INC	59,563.000	5,336,249.170	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	72,668.000	821,875.080	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	125,161.000	2,005,079.220	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	15,568.000	261,231.040	
		BRT APARTMENTS CORP	3,832.000	56,828.560	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	40,989.000	3,935,353.890	
		CARETRUST REIT INC	40,730.000	909,093.600	
		CENTERSPACE	5,275.000	373,892.000	
		CHATHAM LODGING TRUST	20,307.000	237,794.970	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	4,617.000	56,558.250	
		CITY OFFICE REIT INC	15,563.000	144,891.530	
		CLIPPER REALTY INC	5,086.000	36,314.040	
		COLONY CAPITAL INC	204,683.000	1,009,087.190	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	49,046.000	661,630.540	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,767.000	398,986.170	
		COREPOINT LODGING INC	13,648.000	90,486.240	
		CORESITE REALTY CORP	18,051.000	2,123,158.620	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	47,568.000	1,185,870.240	
		COUSINS PROPERTIES INC	62,715.000	1,968,623.850	
		CTO REALTY GROUTH INC	2,248.000	95,562.480	
		CUBESMART	82,306.000	2,753,958.760	
		CYRUSONE INC	50,705.000	3,501,180.250	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	85,195.000	703,710.700	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	117,625.000	15,440,633.750	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	97,816.000	416,696.160	
		DOUGLAS EMMETT INC	69,618.000	1,860,192.960	
		DUKE REALTY TRUST	156,369.000	5,995,187.460	
		EAST GROUP	16,690.000	2,248,977.500	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	34,647.000	763,619.880	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	54,493.000	500,790.670	
		EPR PROPERTIES	31,698.000	1,052,373.600	
		EQUINIX INC	37,397.000	25,519,338.830	
		EQUITY COMMONWEALTH	51,458.000	1,402,745.080	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	71,303.000	4,311,692.410	
		EQUITY RESIDENTIAL	143,885.000	8,352,524.250	

ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	44,522.000	915,817.540	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	27,408.000	6,338,922.240	
EXTRA SPACE STORAGE INC	54,332.000	6,049,868.200	
FARMLAND PARTNERS INC	9,378.000	88,715.880	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	29,028.000	2,397,132.240	
FIRST INDUSTRIAL RT	54,449.000	2,231,320.020	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	29,994.000	831,433.680	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	40,943.000	177,283.190	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	20,113.000	326,433.990	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	90,971.000	3,749,824.620	
GEO GROUP INC	46,767.000	403,131.540	
GETTY REALTY CORP	14,455.000	382,623.850	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14,506.000	259,802.460	
GLADSTONE LAND CORP	8,606.000	124,787.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17,764.000	229,333.240	
GLOBAL NET LEASE INC	36,141.000	590,543.940	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	57,522.000	1,619,244.300	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	92,167.000	2,442,425.500	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	226,281.000	6,442,220.070	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,618.000	127,958.600	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	43,923.000	1,640,524.050	
HOST HOTELS & RESORTS INC	296,757.000	4,264,398.090	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	64,372.000	1,496,005.280	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	38,365.000	506,418.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	28,021.000	615,901.580	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	9,374.000	1,775,529.340	
INVITATION HOMES INC	235,584.000	6,843,715.200	
IRON MOUNTAIN INC	121,334.000	3,397,352.000	
JBG SMITH PROPERTIES	47,098.000	1,419,062.740	
KILROY REALTY CORP	44,224.000	2,417,726.080	
KIMCO REALTY	182,282.000	2,774,332.040	
KITE REALTY GROUP TRUST	36,247.000	546,967.230	
LEXINGTON REALTY TRUST	117,439.000	1,184,959.510	
LIFE STORAGE INC	20,499.000	2,387,723.520	

		LTC PROPERTIES INC	16,792.000	653,880.480	
		MACK CALI	33,213.000	398,888.130	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	238,728.000	4,977,478.800	
		MID AMERICA	48,081.000	5,972,141.010	
		MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	41,922.000	680,394.060	
		NATIONAL HEALTH INVS INC	18,951.000	1,241,859.030	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	73,203.000	2,863,701.360	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	26,502.000	982,164.120	
		NETSTREIT CORP	5,677.000	98,098.560	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	33,944.000	180,242.640	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,985.000	366,318.450	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	20,853.000	494,424.630	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	95,582.000	3,361,618.940	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,480.000	107,846.400	
		PARAMOUNT GROUP INC	65,409.000	564,479.670	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	99,570.000	1,684,724.400	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	55,582.000	1,030,490.280	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	88,116.000	1,475,943.000	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	53,691.000	819,861.570	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,278.000	150,367.140	
		PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	20,886.000	152,467.800	
		PROLOGIS INC	310,236.000	29,366,939.760	
		PS BUSINESS PARKS	8,516.000	1,108,016.760	
		PUBLIC STORAGE	63,863.000	14,129,688.750	
		QTS REALTY TRUST INC	27,198.000	1,597,610.520	
		REALTY INCOME CORP	147,455.000	8,761,776.100	
		REGENCY CENTERS CORP	66,480.000	2,926,449.600	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	46,858.000	632,583.000	
		RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	91,340.000	780,043.600	
		RETAIL VALUE INC	5,389.000	84,553.410	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	55,032.000	2,572,195.680	
		RLJ LODGING TRUST	70,111.000	959,118.480	
		RPT REALTY	30,788.000	261,390.120	

	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	23,253.000	1,538,651.010	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	87,541.000	1,475,941.260	
	SAFEHOLD INC	5,688.000	420,172.560	
	SAUL CENTERS INC	5,164.000	165,557.840	
	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	15,439.000	217,998.680	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	70,229.000	789,373.960	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	137,700.000	11,448,378.000	
	SITE CENTERS CORP	64,604.000	655,084.560	
	SL GREEN	30,661.000	1,831,688.140	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	48,263.000	1,814,206.170	
	STAG INDUSTRIAL INC	63,028.000	1,913,530.080	
	STORE CAPITAL CORP	99,539.000	3,044,898.010	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	39,558.000	342,176.700	
	SUN COMMUNITIES INC	45,212.000	6,515,953.440	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	91,592.000	997,436.880	
	TANGER FACTORY OUTLET	40,424.000	443,047.040	
	TERRENO REALTY CORP	28,914.000	1,606,172.700	
	THE MACERICH COMPANY	48,242.000	550,923.640	
	UDR INC	123,872.000	4,589,457.600	
	UMH PROPERTIES INC	16,392.000	239,159.280	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,301.000	343,663.830	
	URBAN EDGE PROPERTIES	47,039.000	625,618.700	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	10,755.000	156,592.800	
	VENTAS INC	157,397.000	7,271,741.400	
	VEREIT INC	91,943.000	3,222,602.150	
	VICI PROPERTIES INC	225,646.000	5,717,869.640	
	VORNADO REALTY TRUST	66,142.000	2,332,828.340	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,926.000	87,150.280	
	WASHINGTON REIT	35,147.000	741,250.230	
	WEINGARTEN REALTY INVST	51,119.000	1,083,722.800	
	WELLTOWER INC	175,257.000	10,722,223.260	
	WHITESTONE REIT	17,850.000	141,907.500	
	WP CAREY INC	73,768.000	4,895,982.160	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	48,506.000	754,268.300	
アメリカ・ドル	小計	8,987,586.000	368,047,882.400 (38,361,630,778)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	54,933.000	43,012.530	
	ASSURA PLC	1,128,063.000	877,633.010	
	BIG YELLOW GROUP PLC	70,171.000	756,443.380	

	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	320,321.000	244,084.600	
	BRITISH LAND CO PLC	395,423.000	1,787,311.960	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	363,635.000	505,816.280	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	254,272.000	267,494.140	
	CUSTODIAN REIT PLC	170,414.000	150,645.970	
	DERWENT LONDON PLC	47,262.000	1,449,052.920	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	252,342.000	181,686.240	
	GCP STUDENT LIVING PLC	197,969.000	279,928.160	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	107,931.000	692,485.290	
	HAMMERSON PLC	1,647,374.000	364,069.650	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	120,448.000	130,686.080	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	1,848.320	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	316,532.000	2,083,097.090	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	385,064.000	889,497.840	
	LXI REIT PLC	201,812.000	240,156.280	
	NEWRIVER REIT PLC	132,864.000	105,626.880	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	207,754.000	161,217.100	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	557,440.000	860,687.360	
	RDI REIT PLC	114,891.000	101,104.080	
	REGIONAL REIT LTD	156,269.000	120,639.660	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	89,537.000	728,383.490	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	255,156.000	96,959.280	
	SEGRO PLC	500,835.000	4,782,974.250	
	SHAFTESBURY PLC	129,073.000	682,796.170	
	STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	179,591.000	105,779.090	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	288,145.000	311,196.600	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	148,874.000	161,528.290	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	721,679.000	1,201,595.530	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	304,490.000	201,876.870	
	UNITE GROUP PLC	167,968.000	1,665,402.720	
	WORKSPACE GROUP PLC	51,499.000	377,745.160	
イギリス・ポンド　小計		10,271,071.000	22,610,462.270 (3,186,718,552)	

イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	74,664.000	1,229,716.080	
イスラエル・シュケル　小計		74,664.000	1,229,716.080 (40,396,173)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	26,590.000	1,000,049.900	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,865.000	293,139.800	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,088.000	76,763.040	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,978.000	310,189.900	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	35,518.000	1,762,758.340	
	CHOICE PROPERTIES REIT	68,459.000	882,436.510	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	39,582.000	318,635.100	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	19,359.000	277,220.880	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,298.000	331,822.840	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	30,084.000	385,075.200	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	11,243.000	220,924.950	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,668.000	581,959.080	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,889.000	982,657.360	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	60,223.000	769,047.710	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	29,563.000	408,560.660	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,738.000	356,278.840	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,391.000	125,647.060	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,583.000	134,581.440	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,430.000	470,495.100	
	PLAZA RETAIL REIT	20,611.000	74,817.930	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	66,169.000	1,133,474.970	
	SLATE GROCERY REIT	10,657.000	122,662.070	
	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	49,211.820	
	SMARTCENTRES REIT	30,431.000	708,433.680	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	35,648.000	475,544.320	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	17,630.000	110,363.800	

	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,004.000	303,115.760	
カナダ・ドル　小計		721,333.000	12,665,868.060 (1,033,028,199)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	333,667.000	515,515.510	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	468,656.000	1,063,849.120	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	672,747.000	807,296.400	
	PRECINCT PROPERTIES	434,438.000	725,511.460	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	167,128.000	549,851.120	
ニュージーランド・ドル　小計		2,076,636.000	3,662,023.610 (273,772,885)	
ユーロ	AEDIFICA	13,950.000	1,344,780.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	75,304.000	1,056,515.120	
	ALTAREA	1,468.000	216,676.800	
	BEFIMMO	11,149.000	401,921.450	
	CARE PROPERTY INVEST NV	9,471.000	254,296.350	
	CARMILA SA	19,092.000	234,067.920	
	COFINIMMO SA	11,438.000	1,411,449.200	
	COVIVIO	20,354.000	1,507,213.700	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,231.000	242,477.520	
	GECINA SA	22,841.000	2,820,863.500	
	HAMBORNER REIT AG	27,972.000	251,188.560	
	HIBERNIA REIT PLC	286,682.000	323,377.290	
	ICADE	13,110.000	817,408.500	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	22,255.000	82,788.600	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	105,292.000	822,856.980	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10,092.000	226,565.400	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	171,288.000	253,506.240	
	KLEPIERRE	86,115.000	1,592,266.350	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	25,685.000	119,435.250	
	MERCIALYS	16,204.000	120,800.820	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	141,285.000	1,075,885.270	
	MONTEA SCA	4,073.000	382,047.400	
	NSI NV	7,583.000	252,513.900	
	RETAIL ESTATES	4,338.000	265,919.400	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	58,250.000	3,648,780.000	
	VASTNED RETAIL	7,759.000	181,172.650	
	WAREHOUSES DE PAUW	55,338.000	1,573,812.720	
	WERELDHAVE NV	16,192.000	180,055.040	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,815.000	287,842.500	

	ユーロ　小計		1,265,626.000	21,948,484.430 (2,781,531,432)	
	韓国・ウォン	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,958.000	46,802,600.000	
		JR REIT XXVII	43,485.000	219,164,400.000	
		LOTTE REIT CO LTD	38,732.000	203,730,320.000	
		MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	32,398.000	125,542,250.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	18,534.000	130,294,020.000	
	韓国・ウォン　小計		143,107.000	725,533,590.000 (68,925,691)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	820,070.000	3,813,325.500	
		LINK REIT	866,520.000	60,569,748.000	
		PROSPERITY REIT	519,000.000	1,255,980.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	453,000.000	1,694,220.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	600,000.000	2,268,000.000	
	香港・ドル　小計		3,258,590.000	69,601,273.500 (935,441,116)	
投資証券　合計			26,798,613	46,681,444,826 (46,681,444,826)	
合計				53,256,868,437 (53,256,868,437)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券　4銘柄 投資証券　152銘柄	0.15 －	－ 71.50	72.19
イギリス・ポンド	投資証券　34銘柄	－	5.94	5.98
イスラエル・シュケル	投資証券　1銘柄	－	0.08	0.08
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券　31銘柄	7.79	－	7.85
カナダ・ドル	投資証券　27銘柄	－	1.93	1.94
シンガポール・ドル	投資信託受益証券　32銘柄	4.14	－	4.17
ニュージーランド・ドル	投資証券　5銘柄	－	0.51	0.51
ユーロ	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　29銘柄	0.07 －	－ 5.18	5.29
韓国・ウォン	投資証券　5銘柄	－	0.13	0.13
香港・ドル	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　5銘柄	0.11 －	－ 1.74	1.87

（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15期中間計算期間（2021年1月13日から2021年7月12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】

【マネックス資産設計ファンド＜育成型＞】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 2021年1月12日現在	第15期中間計算期間末 2021年7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	153,512,422	370,954,404
親投資信託受益証券	12,398,753,036	13,611,778,369
未収入金	46,932,000	－
流動資産合計	12,599,197,458	13,982,732,773
資産合計	12,599,197,458	13,982,732,773
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,226,255	9,786,159
未払受託者報酬	2,621,498	2,880,142
未払委託者報酬	30,147,682	33,122,066
その他未払費用	234,615	256,242
流動負債合計	59,230,050	46,044,609
負債合計	59,230,050	46,044,609
純資産の部		
元本等		
元本	8,823,805,473	8,895,070,726
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,716,161,935	5,041,617,438
（分配準備積立金）	3,100,766,159	2,935,294,193
元本等合計	12,539,967,408	13,936,688,164
純資産合計	12,539,967,408	13,936,688,164
負債純資産合計	12,599,197,458	13,982,732,773

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自　2020年1月15日 至　2020年7月14日	第15期中間計算期間 自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
営業収益		
受取利息	－	29
有価証券売買等損益	△772,002,960	1,315,404,333
その他収益	15,518	－
営業収益合計	△771,987,442	1,315,404,362
営業費用		
支払利息	46,151	18,347
受託者報酬	2,464,188	2,880,142
委託者報酬	28,338,608	33,122,066
その他費用	222,305	256,242
営業費用合計	31,071,252	36,276,797
営業利益又は営業損失（△）	△803,058,694	1,279,127,565
経常利益又は経常損失（△）	△803,058,694	1,279,127,565
中間純利益又は中間純損失（△）	△803,058,694	1,279,127,565
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（△）	△74,252,193	26,376,884
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,308,358,470	3,716,161,935
剰余金増加額又は欠損金減少額	164,410,051	276,060,957
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	164,410,051	276,060,957
剰余金減少額又は欠損金増加額	235,854,677	203,356,135
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	235,854,677	203,356,135
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,508,107,343	5,041,617,438

（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15期中間計算期間 自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2021年1月12日、当中間計算期間末日を2021年7月12日としております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第14期 2021年1月12日現在	第15期中間計算期間末 2021年7月12日現在
１．　期首元本額	8,944,442,516円	8,823,805,473円
期中追加設定元本額	1,140,451,287円	553,026,442円
期中一部解約元本額	1,261,088,330円	481,761,189円
２．　受益権の総数	8,823,805,473口	8,895,070,726口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）
該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 2021年1月12日現在	第15期中間計算期間末 2021年7月12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14期 2021年1月12日現在	第15期中間計算期間末 2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4212円 (14,212円)	1.5668円 (15,668円)

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,151,559,802
株式	390,836,860,540
派生商品評価勘定	16,970,240
未収入金	32,222,584
未収配当金	411,350,881
前払金	85,952,000
差入委託証拠金	376,740,000
流動資産合計	400,911,656,047
資産合計	400,911,656,047
負債の部	
流動負債	
未払解約金	531,566,000
流動負債合計	531,566,000
負債合計	531,566,000
純資産の部	
元本等	
元本	125,027,618,245
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	275,352,471,802
元本等合計	400,380,090,047
純資産合計	400,380,090,047
負債純資産合計	400,911,656,047

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12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	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	104,131,508,084円
同期中追加設定元本額	66,237,772,333円
同期中一部解約元本額	45,341,662,172円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	638,707,013円
MHAM　ＴＯＰＩＸオープン	2,751,539,482円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	6,801,168,320円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	17,807,259,600円
ＤＩAM国内株式パッシブ・ファンド	4,436,726,433円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,203,380円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	12,388,917円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	11,430,432円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	28,863,380円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	21,768,510円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	15,095,593円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,065,876,218円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	804,262,507円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	30,882,023円
たわらノーロード　バランス（標準型）	187,456,934円
たわらノーロード　バランス（積極型）	287,180,584円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	2,212,375円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	123,083,901円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	291,070,839円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	199,668,217円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	285,143,158円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	647,447円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,808,515円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	16,212,960円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,445,906円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,083,472円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	34,240,725,007円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,011,265,097円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,353,144,978円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,497,163,456円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	330,695,046円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,126,818,055円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,095,150,957円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	31,447,514円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,023,706,018円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	18,322,288円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	302,674,443円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	281,189,463円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	502,891,013円
投資のソムリエ	16,950,643,065円
クルーズコントロール	466,515,120円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	885,241,507円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	287,321,539円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	430,444,520円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	5,192,490円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	13,570,602円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	491,370,494円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,969,476,714円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	27,147,702円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	13,059,857円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,650,838円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	61,188,009円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	136,203,297円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,075,376,269円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	263,259,339円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	20,598,174円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	9,974,549円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	8,477,428円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	33,560,966円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	91,224円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	78,660,950円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	95,654,616円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	68,715,256円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	48,500,722円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	76,838,015円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	243,059,805円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０５（適格機関投資家限定）	88,868,794円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	87,327,181円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	445,024,006円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,402,733円

日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	220,053,523円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	128,594,604円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	62,088,694円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,563,107円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,903,404円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,114,940円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,537,351円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,985,304円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,035,929円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	37,989,175円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	610,743,140円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	673,460,189円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,920,690,751円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	58,052,580円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	34,120,030円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	328,980,745円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	85,204,299円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,555,801円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	411,282,270円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,151,048円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	86,804,876円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	206,870,261円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	287,247,274円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	40,840,143円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,743,216円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１２１２）（適格機関投資家限定）	321,266,809円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	992,662,363円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,314,318,490円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	52,594,563円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	20,462,695円
コア資産形成ファンド	16,425,966円
ＭＨＡＭトピックスファンド	645,976,041円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	69,950,091円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	2,961,129,299円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	2,153,424,042円
計	125,027,618,245円
２．　受益権の総数	125,027,618,245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	2021年7月12日現在

１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	7,823,907,100	－	7,841,010,000	17,102,900
合計	7,823,907,100	－	7,841,010,000	17,102,900

（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）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2023円 (32,023円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	3,663,193,916
コール・ローン	555,414,417
株式	560,116,074,613
投資信託受益証券	1,052,095,927
投資証券	12,170,787,413
派生商品評価勘定	144,262,815
未収入金	77,753,865
未収配当金	408,719,032
差入委託証拠金	3,862,122,633
流動資産合計	582,050,424,631
資産合計	582,050,424,631
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,997,252
未払金	21,888,732
未払解約金	328,194,000
流動負債合計	365,079,984
負債合計	365,079,984
純資産の部	
元本等	
元本	106,771,439,533
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	474,913,905,114
元本等合計	581,685,344,647
純資産合計	581,685,344,647
負債純資産合計	582,050,424,631

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12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	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	96,044,539,510円
同期中追加設定元本額	33,205,284,128円
同期中一部解約元本額	22,478,384,105円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,642,621,984円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,917,968円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,358,643円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	9,898,037円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	25,446,418円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	14,742,203円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,076,354円
たわらノーロード　先進国株式	23,515,364,107円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	266,243,996円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,504,089,471円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	468,314,130円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	52,633,395円
たわらノーロード　バランス（標準型）	423,051,505円
たわらノーロード　バランス（積極型）	512,407,045円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	1,304,396円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	132,430,515円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	365,384,456円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	245,230,203円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	383,400,121円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,447円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	572,470円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	6,752,427円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,498,180円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	6,873,530円
たわらノーロード　全世界株式	119,044,205円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	48,913,966,711円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	1,266,817,556円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	155,901,022円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	849,633,152円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,040,670,055円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	97,521,957円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	303,097,115円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	272,336,437円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	21,200,412円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	668,457,892円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	131,955,592円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	183,554,879円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	171,716,522円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	295,063,878円
投資のソムリエ	6,272,856,818円
クルーズコントロール	146,215,612円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	328,706,467円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	181,643,617円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	120,557,877円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,089,845円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	2,828,371円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	163,938,516円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,657,515,116円
ワールドアセットバランス（基本コース）	256,115,887円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	821,968,793円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	21,367,464円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	10,244,039円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,551,710円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	41,406,989円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	39,286,878円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	693,868,629円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	153,922,765円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	16,161,718円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	7,839,488円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,687,155円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	9,693,367円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	72,023円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	2,575,078円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	3,022,645円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	6,873,573円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	1,479,914円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	2,392,306円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	3,601,644円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	174,194,922円
ＭＳＣＩコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	622,216,988円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	59,577,062円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,344,175,761円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,192,479,550円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,118,768,512円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	164,992,159円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,196,101円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	4,106,147円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,627,454円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	63,456,042円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,483,313円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,769,308円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,222,150円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	780,891円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,280,113円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,620,811円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	240,111,298円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	347,601,401円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,133,044,621円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	170,104,489円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	60,452,544円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	389,075,438円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	16,587,221円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,101,694円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	161,720,334円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,657,185円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,207,166円

ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	81,342,175円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	169,451,993円
計	106,771,439,533円
２．　受益権の総数	106,771,439,533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	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	11,974,352	－	12,035,532	△61,180
ユーロ	11,974,352	－	12,035,532	△61,180
買建	401,113,019	－	401,543,035	430,016
アメリカ・ドル	311,982,622	－	312,215,587	232,965
イギリス・ポンド	8,032,415	－	8,114,761	82,346
オーストラリア・ドル	12,128,174	－	12,190,694	62,520
カナダ・ドル	8,791,688	－	8,843,919	52,231
ユーロ	60,178,120	－	60,178,074	△46
合計	413,087,371	－	413,578,567	368,836

（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	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 　先物取引 　　買建	8,444,821,380	－	8,573,718,107	128,896,727
合計	8,444,821,380	－	8,573,718,107	128,896,727

（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）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.4479円 (54,479円)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,946,089,561
国債証券	426,492,683,100
地方債証券	26,894,257,824
特殊債券	25,966,555,375
社債券	19,066,493,310
未収利息	487,539,989
前払費用	260,607,560
流動資産合計	501,114,226,719
資産合計	501,114,226,719
負債の部	
流動負債	
未払金	1,779,490,000
未払解約金	1,119,630,000
流動負債合計	2,899,120,000
負債合計	2,899,120,000
純資産の部	
元本等	
元本	380,394,285,340
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	117,820,821,379
元本等合計	498,215,106,719
純資産合計	498,215,106,719
負債純資産合計	501,114,226,719

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12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	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	197,306,195,501円
同期中追加設定元本額	276,468,106,848円
同期中一部解約元本額	93,380,017,009円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	23,042,911,051円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	58,205,108円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	85,026,637円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	18,528,789円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	762,444,247円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	149,488,676円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	24,482,688円
たわらノーロード　国内債券	14,138,281,498円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,870,432,413円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	659,009,703円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,077,867,513円
たわらノーロード　バランス（積極型）	133,979,181円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	50,322,288円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	1,032,135,636円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	1,094,659,034円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	350,082,359円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	128,135,170円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	15,940,274円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	7,991,762円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	38,385,735円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,389,438円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	526,112円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,300,394,933円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	8,446,193,209円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	11,541,004,280円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	4,700,092,508円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,096,709,968円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,236,320,578円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	360,423,278円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	91,048,387円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,946,750,943円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	11,576,024円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	4,064,417,972円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,438,859,401円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	307,531,452円
投資のソムリエ	32,541,418,322円
クルーズコントロール	1,148,879,451円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,702,737,896円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	4,025,527,772円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	573,924,594円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	4,279,923円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	11,122,583円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	4,535,158,253円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	45,906,962,887円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	20,472,952円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	9,830,866円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	42,959,192円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	65,602,701円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	852,419,295円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	26,167,512,808円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	4,822,902,454円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	17,160,892円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	7,507,845円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,449,612円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	99,528,079円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	68,818円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	598,662,625円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	726,846,339円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,290,319,095円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	369,786,728円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	584,250,960円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	18,572,458円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	1,032,271,266円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	8,747,700,563円
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	812,343,091円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	856,370,636円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	291,849,892円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	5,162,992,260円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	5,175,030,109円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	5,126,419,429円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅤ（適格機関投資家限定）	5,167,905,553円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	976,865,132円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	181,734,833円

ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	104,852,782円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,643,737円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	106,538,607円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	45,970,685円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,457,241円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,354,539円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	139,011,046円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,974,703,712円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,464,392,923円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,684,787,849円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	212,578,555円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	207,933,824円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,416,796,840円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	207,888,215円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,392,745円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,675,704,471円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	56,466,864円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	423,619,050円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	672,898,045円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,168,050,833円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	327,450,906円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	106,712,438円
Ｏｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドＩ（適格機関投資家限定）	1,078,716,030円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	382,409,178円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	271,259,362円
コア資産形成ファンド	213,359,316円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	43,690,787,790円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	39,450,858,281円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	14,867,046,295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］	3,364,296,762円
計	380,394,285,340円
２．　受益権の総数	380,394,285,340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	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 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）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3097円 (13,097円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,271,114,534
国債証券	146,028,231,716
派生商品評価勘定	1,538,805
未収入金	568,929,855
未収利息	780,973,742
前払費用	56,195,863
流動資産合計	148,706,984,515
資産合計	148,706,984,515
負債の部	
流動負債	
前受金	272,506,046
未払金	341,908,724
未払解約金	683,114,000
流動負債合計	1,297,528,770
負債合計	1,297,528,770
純資産の部	
元本等	
元本	71,842,982,169
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	75,566,473,576
元本等合計	147,409,455,745
純資産合計	147,409,455,745
負債純資産合計	148,706,984,515

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12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	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	67,292,412,269円
同期中追加設定元本額	17,490,264,772円
同期中一部解約元本額	12,939,694,872円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	7,715,987,094円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,047,543円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	21,988,657円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	17,878,958円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	66,463,112円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	38,761,745円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	23,623,554円
たわらノーロード　先進国債券	11,267,773,877円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	201,424,928円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,239,932,035円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	35,475,903円
たわらノーロード　バランス（標準型）	165,839,781円
たわらノーロード　バランス（積極型）	34,127,377円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	5,520,606円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	263,898,827円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	264,718,017円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	58,376,863円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	2,643,196円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	167,554円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,948,809円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	11,896,549円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,980,312円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	2,018,394円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,083,009,322円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	515,325,396円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	663,734,175円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,972,794,733円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,170,948,617円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	384,724,603円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	787,046,970円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	678,554,234円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	14,398,368円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	454,142,483円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	33,315,532円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	125,346,778円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	114,366,554円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	194,932,054円
クルーズコントロール	1,109,737,016円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	115,575,378円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	265,165,979円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	4,103,295円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	10,754,086円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	156,582,122円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	163,045,599円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	25,699,646円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,203,086,501円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	205,033,934円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	251,290,165円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	102,319,415円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	126,767,407円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	199,972,627円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	1,416,645,424円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	437,840,710円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	5,559,625,058円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	4,209,961,849円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,520,707,571円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,411,703,058円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	56,754,364円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	334,724,185円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	464,917,474円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	268,367,779円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,502,317円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	45,392,835円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,750,032円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,030,980円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,826,852円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	59,228,066円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,222,754,066円

ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,706,576,784円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,994,581,503円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	226,528,926円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	186,201,216円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,063,037,702円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	489,025,340円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,639,854円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	427,416,843円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	430,059,350円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	597,241,983円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	63,673,368円
計	71,842,982,169円
２．　受益権の総数	71,842,982,169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	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	360,000,000	－	361,538,805	1,538,805
アメリカ・ドル	174,302,000	－	174,712,262	410,262
イギリス・ポンド	34,957,000	－	35,315,369	358,369
ユーロ	150,741,000	－	151,511,174	770,174

合計	360,000,000	－	361,538,805	1,538,805

（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）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	2.0518円
（1万口当たり純資産額）	(20,518円)

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,669,273,393
投資証券	225,543,871,920
派生商品評価勘定	25,235,650
未収入金	227,854,584
未収配当金	550,770,967
差入委託証拠金	106,122,500
流動資産合計	228,123,129,014
資産合計	228,123,129,014
負債の部	
流動負債	
前受金	18,793,500
未払解約金	386,598,000
流動負債合計	405,391,500
負債合計	405,391,500
純資産の部	
元本等	
元本	88,905,630,284
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	138,812,107,230
元本等合計	227,717,737,514
純資産合計	227,717,737,514
負債純資産合計	228,123,129,014

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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。
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	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	31,200,083,619円
同期中追加設定元本額	84,542,252,023円
同期中一部解約元本額	26,836,705,358円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	192,640円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	833,782円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	986,795円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	2,550,457円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	1,471,035円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,304,002円
たわらノーロード　国内リート	4,414,056,062円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	956,546,645円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,004,134,101円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	18,992,809円
たわらノーロード　バランス（標準型）	334,703,683円
たわらノーロード　バランス（積極型）	356,979,872円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	116,496,182円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	308,691,788円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	189,356,059円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	246,208,145円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,224,459円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	10,831,634円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,938,645円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	7,079,917円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,109,534円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	387,435,662円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,214,817円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	130,509,613円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	147,057,515円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	285,082,794円
投資のソムリエ	11,266,486,563円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	588,529,726円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	118,464,447円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	396,175,614円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,008,972,226円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	11,837,774円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	5,695,515円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,754,462円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	30,903,542円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,670,169,314円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	99,385,511円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	8,979,467円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	4,349,235円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	3,652,744円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	39,913円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	41,444,362円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１２１２（適格機関投資家限定）	82,472,566円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１４０１（適格機関投資家限定）	741,796,987円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	23,665,569円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）２０－０４（適格機関投資家限定）	318,933,557円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	28,811,478円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	171,767,818円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	14,548,333円
固定比率マルチアセット戦略ファンド（米ドル建日本政府保証債活用型）（適格機関投資家限定）	202,133,368円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	79,655,059円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）２１－０３（適格機関投資家限定）	249,553,186円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	23,107,305円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	133,666,329円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０５（適格機関投資家限定）	317,295,468円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,595,185,937円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	295,826,570円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	606,595,127円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	38,956,719円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,483,597,340円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,655,355,393円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	41,496,552,323円

ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	3,041,635,281円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ファンドラップ）	104,653,348円
計	88,905,630,284円
２．　受益権の総数	88,905,630,284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	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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）

不動産投信関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 　先物取引 　　買建	1,997,534,000	－	2,022,872,500	25,338,500
合計	1,997,534,000	－	2,022,872,500	25,338,500

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.5613円 (25,613円)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	808,753,760
コール・ローン	222,128,987
投資信託受益証券	7,988,019,602
投資証券	68,695,168,674
派生商品評価勘定	718,889
未収入金	859,725
未収配当金	256,355,250
流動資産合計	77,972,004,887
資産合計	77,972,004,887
負債の部	
流動負債	
未払金	811,040,177
未払解約金	32,142,000
流動負債合計	843,182,177
負債合計	843,182,177
純資産の部	
元本等	
元本	49,591,590,500
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	27,537,232,210
元本等合計	77,128,822,710
純資産合計	77,128,822,710
負債純資産合計	77,972,004,887

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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	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	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	45,737,709,443円
同期中追加設定元本額	54,960,779,150円
同期中一部解約元本額	51,106,898,093円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	91,990,088円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	49,238,929円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,083,509円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	13,470,885円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	15,934,138円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	40,885,716円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	23,759,753円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	21,049,235円
たわらノーロード　先進国リート	9,321,016,978円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,473,072,444円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	353,754,549円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,662,547,045円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	15,786,182円

たわらノーロード　バランス（標準型）	278,186,328円
たわらノーロード　バランス（積極型）	548,261,139円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	2,849,915円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	50,829,713円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	104,623,153円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	220,176,902円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	126,975円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	3,997,304円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,662,141円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	8,139,586円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	686,947,006円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	18,528,218円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	584,044,636円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	49,505,985円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	214,771,724円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	257,640,235円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	473,479,123円
投資のソムリエ	14,848,949,235円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	771,021,943円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	208,590,169円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	439,247,237円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,446,583,846円
ワールドアセットバランス（基本コース）	589,151,400円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,946,220,424円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	19,336,040円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	9,275,009円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,161,748円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	45,837,621円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,892,926,022円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	164,545,219円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	13,208,529円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	7,092,385円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,106,293円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	65,820円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	450,725,450円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	159,568,116円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	110,155,096円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）２０－０４（適格機関投資家限定）	155,649,285円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	133,490,763円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	149,211,411円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	68,299,457円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）２１－０３（適格機関投資家限定）	66,623,991円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	107,329,681円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	512,635,886円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	388,226,702円

インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	179,930,919円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	118,752,457円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	287,088,553円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,805,484,457円
Ｐ－Ｏｎｅマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	340,995,307円
ＤＩＡＭ海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	554,744,495円
計	49,591,590,500円
２．　受益権の総数	49,591,590,500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	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	22,033,600	－	22,033,480	120
アメリカ・ドル	22,033,600	－	22,033,480	120
買建	106,012,610	－	106,731,379	718,769
オーストラリア・ドル	58,750,560	－	59,306,184	555,624
シンガポール・ドル	30,059,170	－	30,165,619	106,449
ニュージーランド・ドル	3,052,880	－	3,079,576	26,696
香港・ドル	14,150,000	－	14,180,000	30,000
合計	128,046,210	－	128,764,859	718,889

（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）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5553円 (15,553円)

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	13,942,460,692円
Ⅱ　負債総額	15,758,482円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,926,702,210円
Ⅳ　発行済数量	8,929,230,014口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5597円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	392,193,140,759円
Ⅱ　負債総額	1,361,600,340円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	390,831,540,419円
Ⅳ　発行済数量	125,380,953,255口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1172円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	589,661,162,872円
Ⅱ　負債総額	84,312,984円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	589,576,849,888円
Ⅳ　発行済数量	107,610,515,657口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.4788円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	506,198,291,616円
Ⅱ　負債総額	1,399,333,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	504,798,958,616円
Ⅳ　発行済数量	384,611,486,906口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3125円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	146,152,098,738円
Ⅱ　負債総額	66,664,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	146,085,434,738円
Ⅳ　発行済数量	70,971,086,313口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0584円

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	228,876,787,254円
Ⅱ　負債総額	2,589,775,090円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	226,287,012,164円
Ⅳ　発行済数量	88,961,214,417口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5437円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	**78,078,551,203円**
Ⅱ　負債総額	**110,052,393円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**77,968,498,810円**
Ⅳ　発行済数量	**49,995,777,027口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.5595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（2021年7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（2021年7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。

2021年7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	1,421,929,893,732
追加型株式投資信託	834	15,898,581,758,577
単位型公社債投資信託	29	61,675,044,716
単位型株式投資信託	215	1,335,566,478,953
合計	1,104	18,717,753,175,978

３【委託会社等の経理状況】

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

2. 財務諸表の金額は、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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第36期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		第35期 （2020年3月31日現在）		第36期 （2021年3月31日現在）
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		32,932,013		36,734,502
金銭の信託		28,548,165		25,670,526
有価証券		996		－
未収委託者報酬		11,487,393		16,804,456
未収運用受託報酬		4,674,225		5,814,654
未収投資助言報酬		331,543		317,567
未収収益		11,674		7,412
前払費用		480,129		724,591
その他		2,815,351		2,419,487
流動資産計		81,281,494		88,493,198
固定資産				
有形固定資産		1,278,455		1,119,327
建物	※1	1,006,793	※1	915,815
器具備品	※1	270,768	※1	202,902
建設仮勘定		894		609
無形固定資産		3,524,781		3,991,834
ソフトウエア		3,299,065		2,878,179
ソフトウエア仮勘定		221,784		1,109,723
電話加入権		3,931		3,931
投資その他の資産		9,482,127		11,153,554
投資有価証券		261,361		261,360
関係会社株式		5,299,196		5,299,196
長期差入保証金		1,302,402		1,324,203
繰延税金資産		2,508,004		3,676,823
その他		111,162		591,970
固定資産計		14,285,364		16,264,717
資産合計		95,566,859		104,757,915

（単位：千円）

	第35期 （2020年3月31日現在）	第36期 （2021年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
（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	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△7	△6
評価・換算差額等計	△7	△6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第35期 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）		第36期 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

（単位：千円）

	第35期 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）		第36期 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		－	
為替差益	－		7,314	
金銭の信託運用益	－		1,229,697	
受取負担金	297,886		－	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		－	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		－	
システム解約料	31,680		－	
早期割増退職金	－		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		－	
特別利益計		1,169,758		－
特別損失				
固定資産除却損	※1　16,085		※1　1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		△385,835		△1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

（３）【株主資本等変動計算書】

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

第36期（自　2020年4月1日　至　2021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	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							△12,000,000	△12,000,000	△12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	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	△ 7	△ 7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			△12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	△ 6	△ 6	73,353,137

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。

（未適用の会計基準等）

1. 収益認識に関する会計基準等

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年３月31日　企業会計基準委員会）

・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号　2020年３月31日　企業会計基準委員会）

・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2020年３月31日　企業会計基準委員会）

（1）概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年５月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606）を公表しており、IFRS第15号は2018年１月１日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の１つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

（2）適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年４月１日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年７月４日　企業会計基準委員会）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号　2019年７月４日　企業会計基準委員会）

・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年７月４日　企業会計基準委員会）

・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2020年３月31日　企業会計基準委員会）

（1）概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

（2）適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年４月１日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

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35期 （2020年3月31日現在）	第36期 （2021年3月31日現在）
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

（損益計算書関係）

※1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウエア	6,475	-

（株主資本等変動計算書関係）

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

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					

第36期（自 2020年4月1日 至 2021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
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

2021年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2021年6月16日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17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	－

第36期（2021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	36,734,502	36,734,502	－
（2）金銭の信託	25,670,526	25,670,526	－
（3）未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	－
（4）未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	－
（5）投資有価証券			
その他有価証券	1,990	1,990	－
資産計	85,026,130	85,026,130	－
（1）未払手数料	6,889,193	6,889,193	－
負債計	6,889,193	6,889,193	－

（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

（千円）

区分	第35期 （2020年3月31日現在）	第36期 （2021年3月31日現在）
①非上場株式	259,369	259,369
②関係会社株式	5,299,196	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	―

第36期（2021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	36,734,502	―	―	―
（2）金銭の信託	25,670,526	―	―	―
（3）未収委託者報酬	16,804,456	―	―	―
（4）未収運用受託報酬	5,814,654	―	―	―
（5）投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	―	1,990	―	―

（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35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36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。

第36期（2021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	1,990	2,000	△ 9
小計	1,990	2,000	△ 9
合計	1,990	2,000	△ 9

（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

第36期（自 2020年4月1日 至 2021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）
投資信託	996	－	3

（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35期（自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	第36期（自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	△4,319
退職給付の支払額	△187,749	△245,143
過去勤務費用の発生額	－	△1,567
その他	△1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

（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35期（2020年3月31日現在）	第36期（2021年3月31日現在）
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	△130,155	△84,264
未認識過去勤務費用	△173,798	△102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	△11,303	△7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

（注）上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 （2020年3月31日現在）	第36期 （2021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%～3.76%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

（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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	―
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額（一括償却資産）	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額（税法上）	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
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	11,532	△5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	―	―
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	―	―
繰延税金負債合計	―	―
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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35期 （2020年3月31日現在）	第36期 （2021年3月31日現在）
流動資産	－千円	－千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	－千円	－千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円

（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	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

（2）損益計算書項目

	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
営業収益	－千円	－千円
営業利益	△8,954,439千円	△8,823,626千円
経常利益	△8,954,439千円	△8,823,626千円
税引前当期純利益	△9,111,312千円	△8,823,626千円
当期純利益	△7,536,465千円	△7,288,834千円
1株当たり当期純利益	△188,411円64銭	△182,220円85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	5,149,555千円	5,016,672千円

（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35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）及び第36期（自 2020年4月1日 至 2021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35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

第36期（自 2020年4月1日 至 2021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35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

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

第36期（自 2020年4月1日 至 2021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	6,435,839	未払手数料	1,457,765
	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	12,767,199	未払手数料	2,524,882

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

（東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

（1株当たり情報）

	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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	15,005,011千円	14,125,803千円
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。

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

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

2021年3月末日現在　　247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社静岡銀行	90,845	日本において銀行業務を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「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2021年3月末日現在

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

(3) 投資顧問会社

a.名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

b.資本金の額

2021年3月末日現在　　9,557.5万円

c.事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する収益分配金の再投資

(6)受益者に対する投資信託説明書(目論見書)・運用報告書の送付

(7)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。
イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用助言等を行います。

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

２０２１年5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

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２０２１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。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以　上

（注１）上記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

２０２１年2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

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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド＜育成型＞の２０２０年1月１５日から２０２１年1月１２日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド＜育成型＞の２０２１年1月１２日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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

２０２１年8月１３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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド＜育成型＞の２０２１年１月１３日から２０２１年７月１２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、マネックス資産設計ファンド＜育成型＞の２０２１年７月１２日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（２０２１年１月１３日から２０２１年７月１２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。