

【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】	2022年2月10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<隔月分配型>
【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<隔月分配型>

（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。

「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、公表されません。

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】

各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。

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：2022年2月11日から2022年8月10日まで

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。

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。

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <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、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、

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】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

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】

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。

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11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 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

●決算ごとに分配することを重視します。隔月(奇数月)に利子・配当等収益を中心とした分配と、さらに5月・11月に売買益(評価益を含みます。)等を加えた分配をめざします。

※決算は原則として年6回(毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各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。

収益分配金に関する留意事項

◆投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が支払われるイメージ



◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

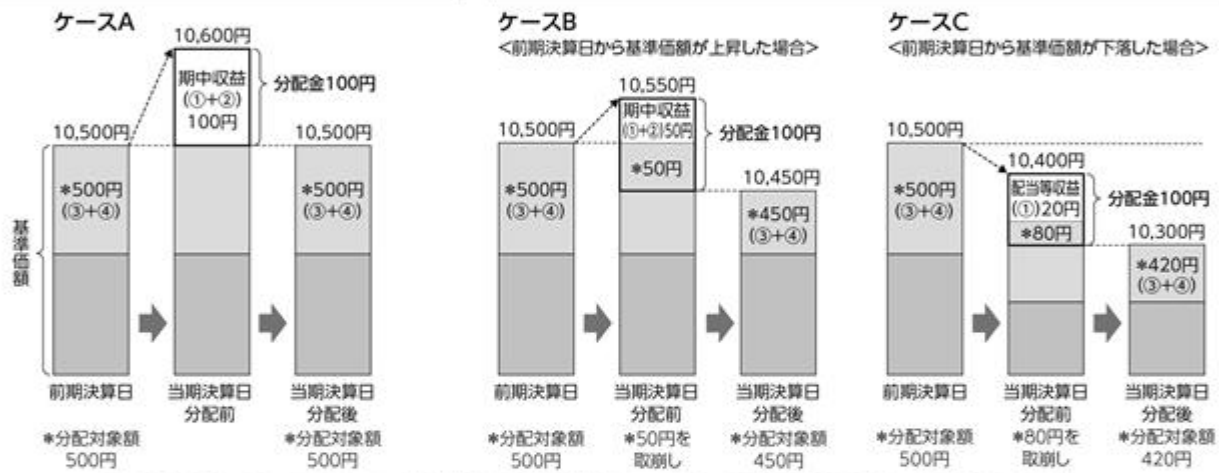
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後）、②有価証券売買益・評価益（経費控除後）、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上記のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

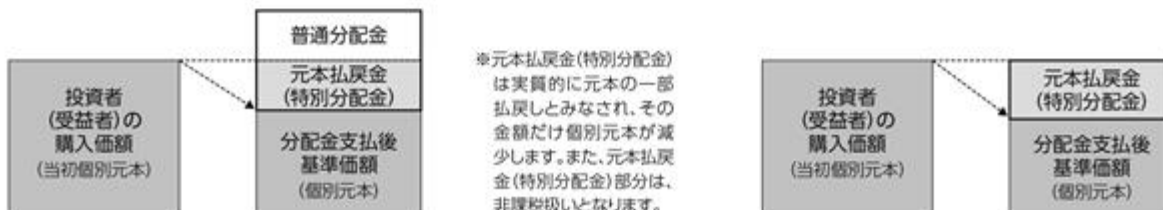
ケースA：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
 ケースB：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
 ケースC：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。
 ※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご留意ください。

◆投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	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 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア オセアニア		
	日々	中南米		なし
不動産投信	その他 ()	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	
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))		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

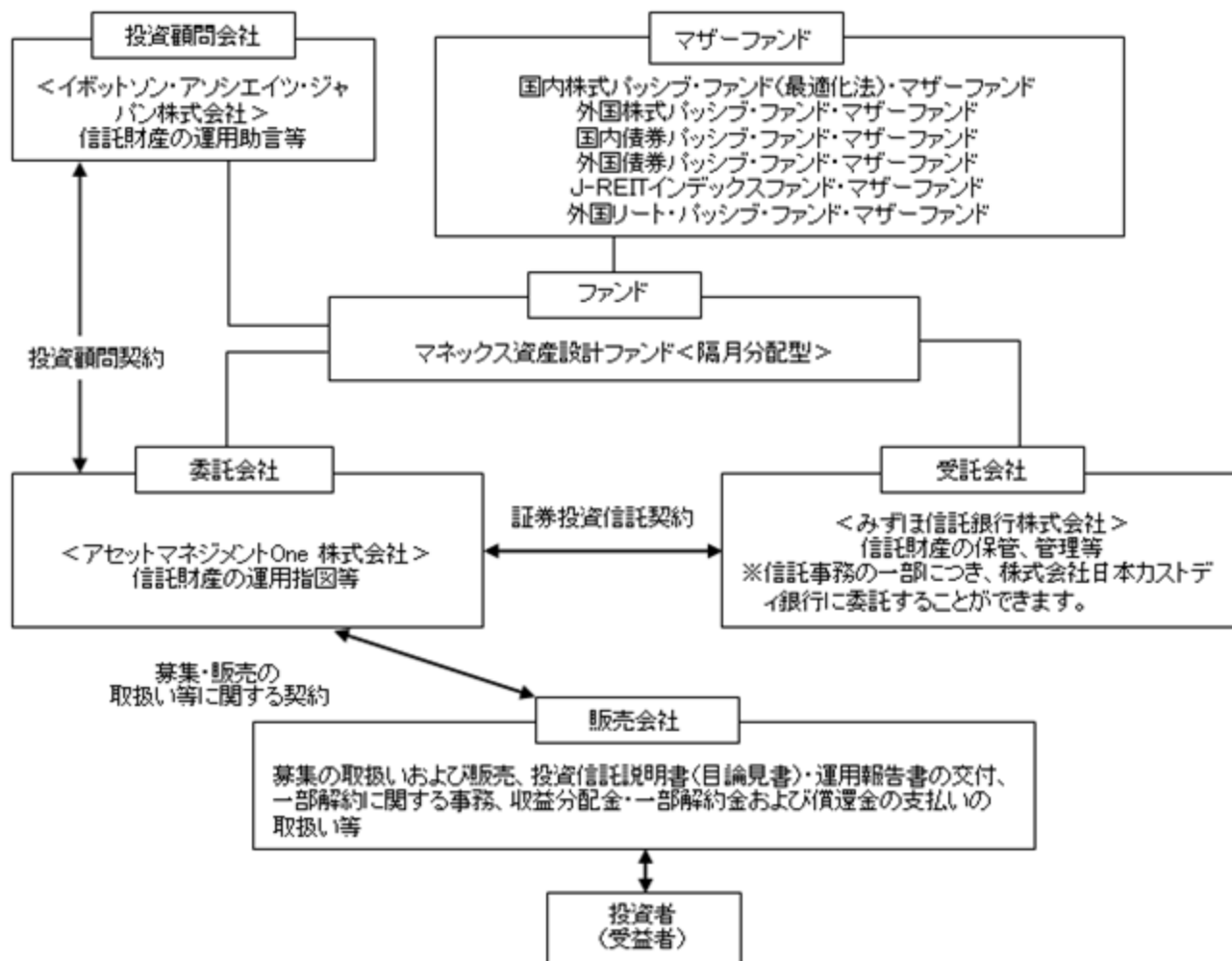
その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、 債券、不動産投信） 資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年6回（隔月）	目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
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/>）をご覧ください。

（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、一部解約に関する事務、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

・ 「投資顧問契約」の概要

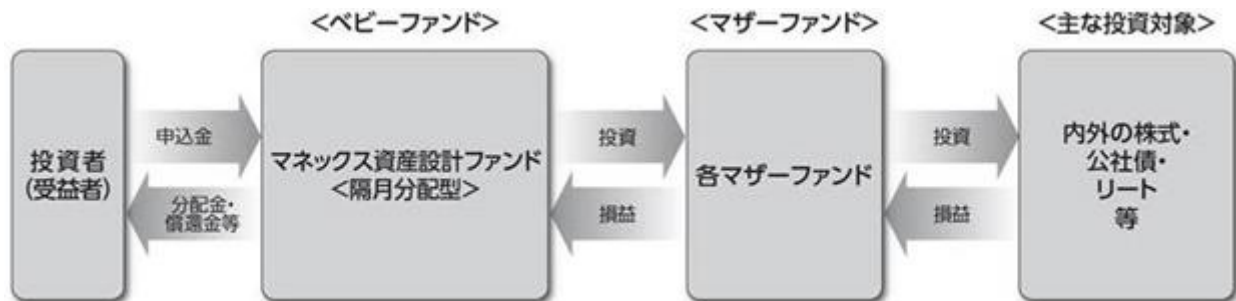
委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）の間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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11月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2021年11月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²

第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²
------------------	--------------------	---------	--------------------

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<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>

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。

基本資産配分比率は原則として年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。

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。

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。

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(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せん。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

2.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券
- 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せん。)
- 23) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 24) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
- 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せん。)
- 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、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は、委託会社は信託金を上記3. の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

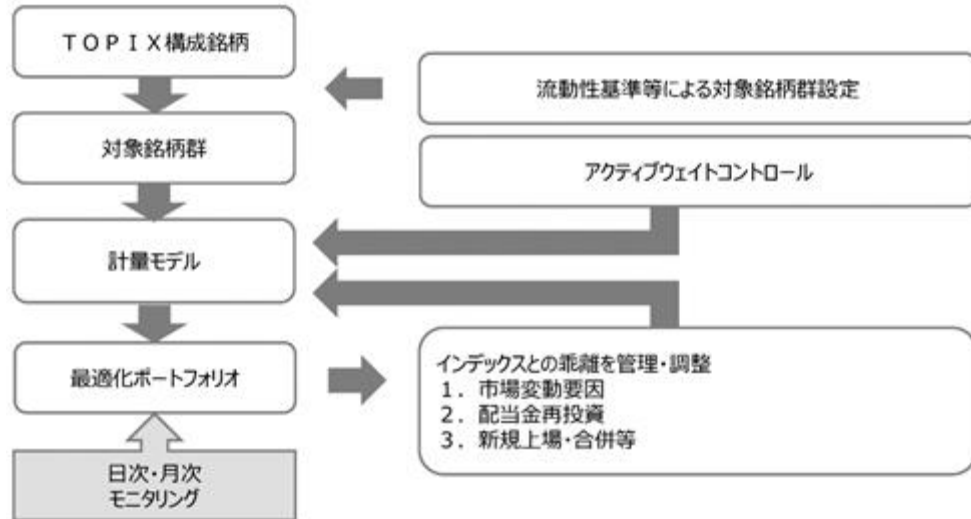
(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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	<p>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）^{（注）}に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>（注） 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「株東京証券取引所」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株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、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。</p> <p>株東京証券取引所は、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。</p> <p>株東京証券取引所は、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、株東京証券取引所は、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。</p> <p>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、株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。</p> <p>株東京証券取引所は、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。</p> <p>株東京証券取引所は、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。</p> <p>以上の項目に限らず、株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。</p> <p>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。</p>
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	<ol style="list-style-type: none">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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"><p>* 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。</p></div>
------	---

運用プロセス



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。

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。

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

株式への投資割合には、制限を設けません。

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。

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。

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	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) ^(注) に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

(注)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。

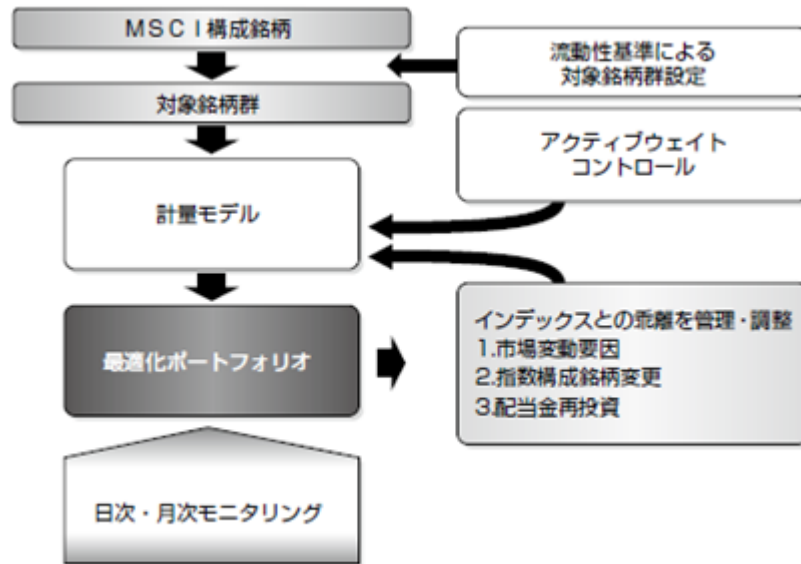
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝す

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。

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。

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。

運用プロセス



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。

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。

インデックスとの乖離を管理

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

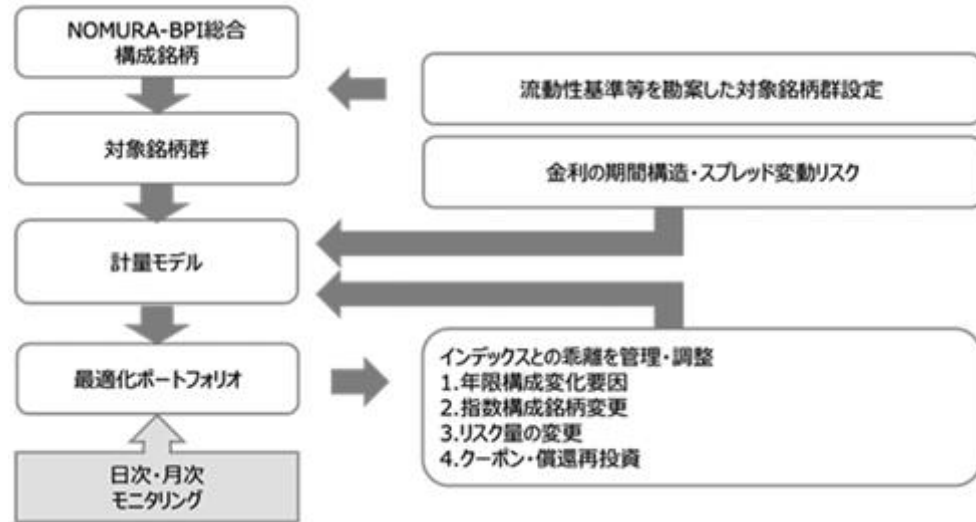
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

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

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合^(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>(注) NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村証券株式会社</p> <p>に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、</p> <p>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</p> <p>切責任を負いません。</p> </div>
<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

運用プロセス



流動性基準等による対象銘柄群設定

NOMURA - B P I 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。

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。

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。

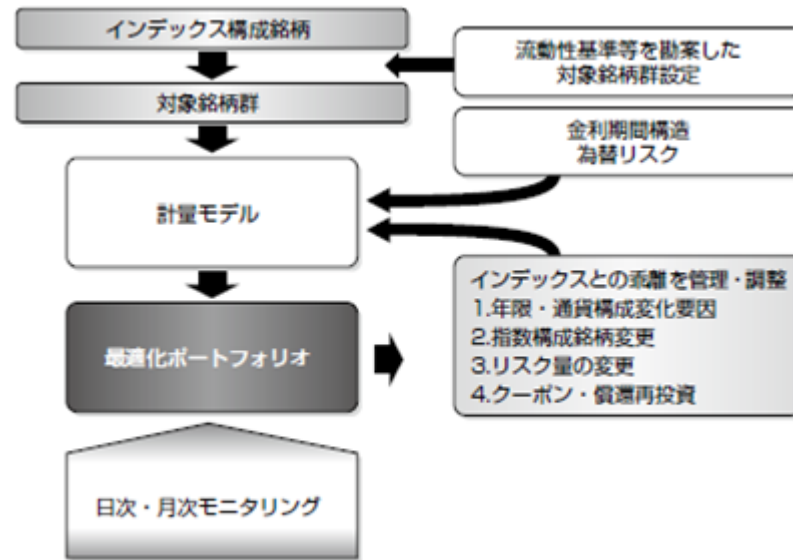
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 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	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>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がい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--------	---

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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)^(注)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div data-bbox="347 1413 1385 1805" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>(注) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div> <p>外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>

運用プロセス



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。

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。

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。

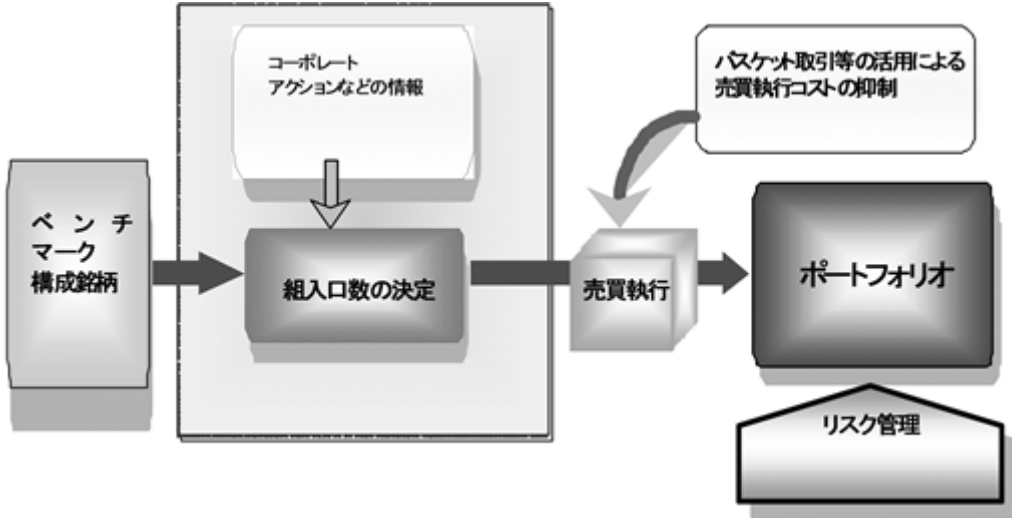
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 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
- ・ クーボン・償還再投資

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

ファンド名	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
-------	--------------------------

基本方針	<p>この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）^(注)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注) 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「株東京証券取引所」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株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、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。</p> <p>株東京証券取引所は、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。</p> <p>株東京証券取引所は、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、株東京証券取引所は、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。</p> <p>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、株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。</p> <p>株東京証券取引所は、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。</p> <p>株東京証券取引所は、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。</p> <p>以上の項目に限らず、株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。</p>
主な投資対象	<p>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。</p>

<p>投資態度</p>	<p>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ないます。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>運用プロセス</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> 

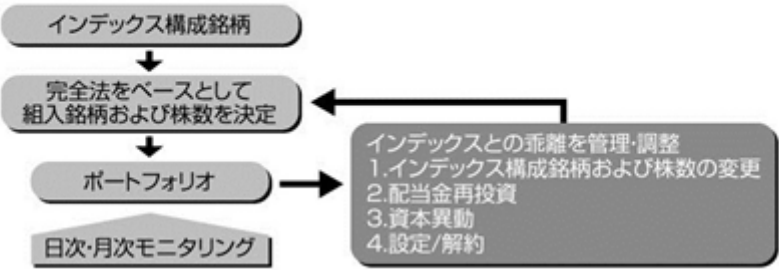
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--------	--

ファンド名	外国リート・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) ^(注) に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

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

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

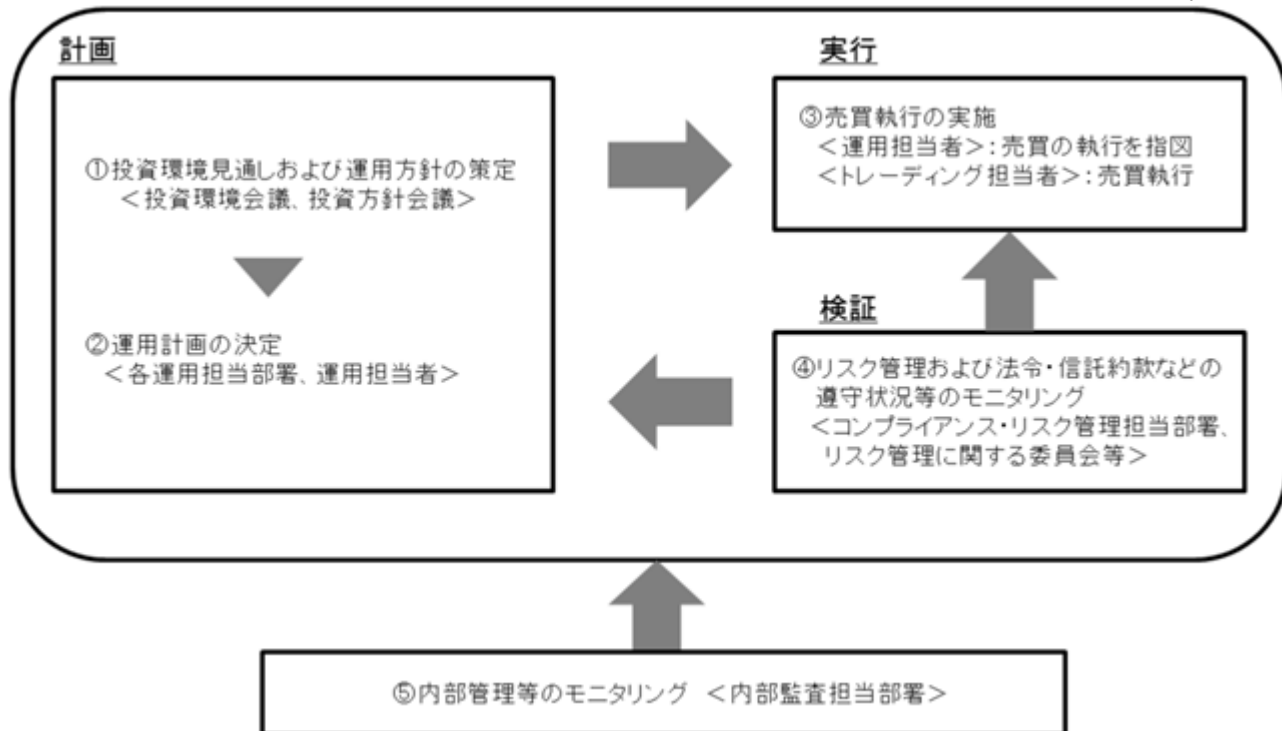
	<p>はS & P 先進国 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indices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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
<p>運用プロセス</p>	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する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。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日々・月次モニタリング] D --> E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] E --> B </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 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



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として奇数月の各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、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、利子配当等収益に売買益(評価益を含みます。)等を加えた額から分配を行います。分配金額については、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。

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するものとします。

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」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、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。

収益分配金の支払い

収益分配金は、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てします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(5)【投資制限】

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)

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)

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)

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)

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

同一銘柄の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)

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)

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)

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。

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

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

先物取引等の運用指図・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。

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行うものとします。

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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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。

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るときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売りの指図および範囲（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、当該売り付けに係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)の売り付けに係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。

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るときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 上記1)の指図は、当該借入れに係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)の借入れに係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)の借入に係る品借料は信託財産中から支弁します。

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。

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、信託財産に係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、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係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係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係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第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、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)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑧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場合があります。

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もあり、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。

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

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

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。

当ファンドは、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、受益者のため有利と認める場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

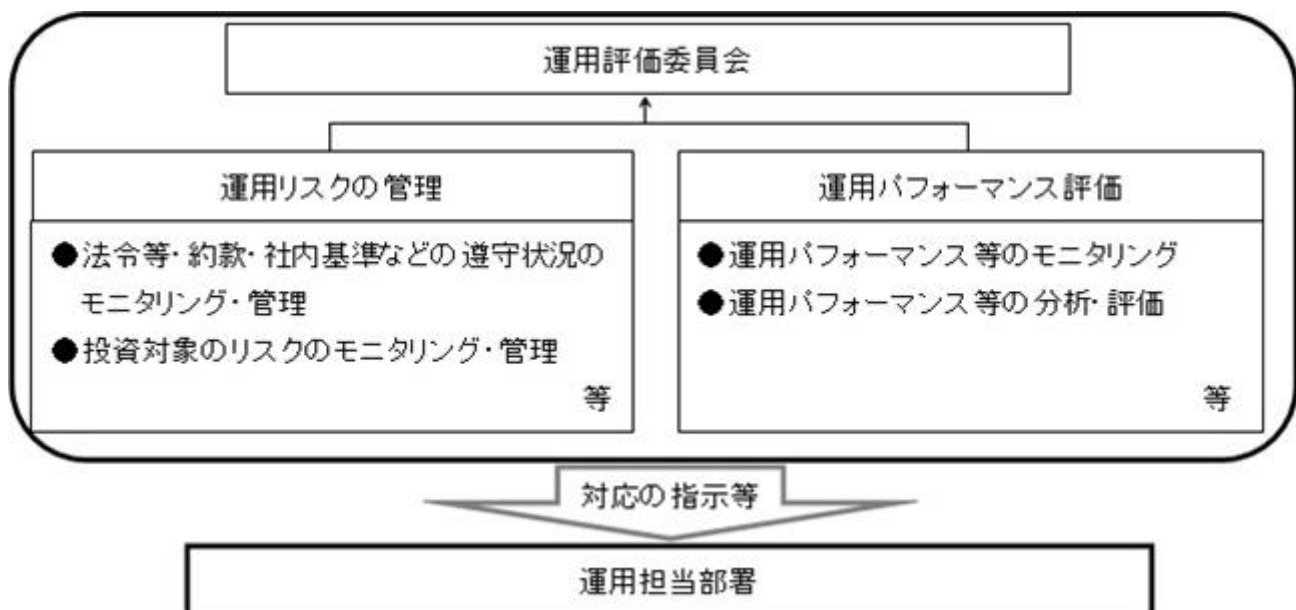
注意事項

- ・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ます、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

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



リスク管理体制は2021年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

流動性リスク管理体制

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

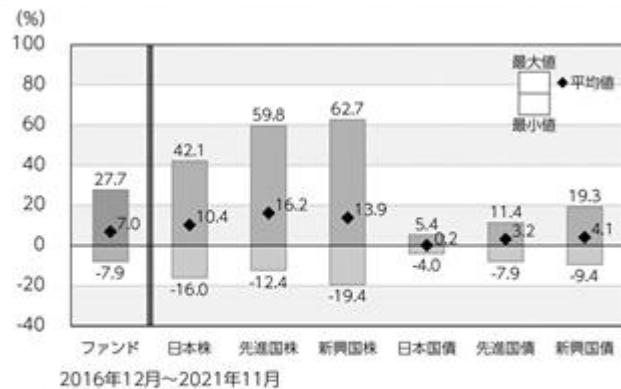
流動性リスク管理体制は2022年1月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX)* (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケットベンチマークです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)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、後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・ディバースファイド(円ベース)	[JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド]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）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。

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

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

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

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および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

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2021年11月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	420,893,228	98.71
内 日本	420,893,228	98.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,482,376	1.29
純資産総額	426,375,604	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11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	384,114,626,670	84.81
内 日本	384,114,626,670	84.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	68,802,304,124	15.19
純資産総額	452,916,930,794	100.00

その他資産の投資状況

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	4,721,040,000	1.04
内 日本	4,721,040,000	1.04

(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11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	646,717,226,006	94.25
内 アメリカ	460,731,703,433	67.14
内 イギリス	26,061,459,867	3.80
内 カナダ	23,328,267,773	3.40
内 スイス	21,620,697,847	3.15
内 フランス	20,421,037,841	2.98
内 ドイツ	16,901,133,310	2.46
内 オランダ	13,086,172,232	1.91
内 アイルランド	12,071,521,865	1.76
内 オーストラリア	11,971,595,000	1.74
内 スウェーデン	6,730,947,746	0.98
内 デンマーク	5,231,907,415	0.76
内 スペイン	4,485,473,306	0.65
内 香港	4,308,292,438	0.63
内 イタリア	3,500,424,136	0.51
内 ジャージー	2,566,040,035	0.37
内 フィンランド	2,420,756,466	0.35

内 シンガポール	1,713,223,671	0.25
内 バミューダ	1,576,002,900	0.23
内 ベルギー	1,530,163,606	0.22
内 ノルウェー	1,204,248,442	0.18
内 イスラエル	1,185,122,249	0.17
内 ケイマン諸島	1,129,857,664	0.16
内 ルクセンブルグ	594,070,512	0.09
内 ニュージーランド	557,794,344	0.08
内 オランダ領キュラソー	498,061,492	0.07
内 オーストリア	408,672,562	0.06
内 ポルトガル	297,024,218	0.04
内 パナマ	182,435,446	0.03
内 リベリア	181,943,598	0.03
内 マン島	153,815,206	0.02
内 パプアニューギニア	67,359,386	0.01
投資信託受益証券	1,172,700,330	0.17
内 オーストラリア	893,246,892	0.13
内 シンガポール	279,453,438	0.04
投資証券	14,070,643,386	2.05
内 アメリカ	13,092,616,323	1.91
内 イギリス	422,108,477	0.06
内 フランス	258,304,825	0.04
内 香港	228,130,990	0.03
内 カナダ	69,482,771	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	24,233,072,859	3.53
純資産総額	686,193,642,581	100.00

その他資産の投資状況

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	20,998,897,186	3.06
内 アメリカ	15,927,242,527	2.32
内 ドイツ	3,000,060,807	0.44
内 イギリス	873,463,014	0.13
内 カナダ	728,989,990	0.11
内 オーストラリア	469,140,848	0.07

（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11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	431,323,024,300	84.44
内 日本	431,323,024,300	84.44
地方債証券	27,597,435,048	5.40
内 日本	27,597,435,048	5.40
特殊債券	28,388,317,142	5.56
内 日本	28,388,317,142	5.56

社債券		21,312,140,880	4.17
	内 日本	20,505,879,880	4.01
	内 フランス	806,261,000	0.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,184,470,268	0.43
純資産総額		510,805,387,638	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11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
国債証券	147,039,166,420	98.59	
	内 アメリカ	69,402,068,839	46.54
	内 フランス	14,593,115,896	9.78
	内 イタリア	13,261,484,846	8.89
	内 ドイツ	10,705,433,042	7.18
	内 イギリス	9,065,702,134	6.08
	内 スペイン	8,599,323,802	5.77
	内 ベルギー	3,340,566,562	2.24
	内 カナダ	2,927,743,221	1.96
	内 オランダ	2,808,374,191	1.88
	内 オーストラリア	2,521,024,451	1.69
	内 オーストリア	2,158,756,687	1.45
	内 アイルランド	1,161,964,734	0.78
	内 メキシコ	968,528,869	0.65
	内 フィンランド	882,048,350	0.59
	内 デンマーク	770,976,760	0.52
	内 マレーシア	745,512,886	0.50
	内 ポーランド	720,834,939	0.48
	内 イスラエル	668,363,385	0.45
	内 シンガポール	641,831,236	0.43
	内 スウェーデン	433,849,739	0.29
	内 ノルウェー	354,807,629	0.24
	内 中国	306,854,222	0.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,099,523,319	1.41	
純資産総額	149,138,689,739	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11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
投資証券	191,006,573,850	90.65	
	内 日本	191,006,573,850	90.65
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	19,700,723,376	9.35	
純資産総額	210,707,297,226	100.00	

その他資産の投資状況

2021年11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)	5,102,370,000	2.42

内 日本	5,102,370,000	2.42
------	---------------	------

（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11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	7,657,557,542	9.07
内 オーストラリア	5,095,344,661	6.03
内 シンガポール	2,494,125,145	2.95
内 香港	68,087,736	0.08
投資証券	67,989,504,416	80.49
内 アメリカ	57,716,963,658	68.33
内 イギリス	4,113,927,739	4.87
内 カナダ	1,433,427,922	1.70
内 フランス	1,299,638,693	1.54
内 ベルギー	1,012,952,459	1.20
内 香港	1,003,602,343	1.19
内 スペイン	307,775,137	0.36
内 ニュージーランド	272,761,811	0.32
内 ドイツ	220,159,091	0.26
内 ガーンジィ	197,711,354	0.23
内 韓国	135,670,421	0.16
内 オランダ	117,272,364	0.14
内 アイルランド	80,598,383	0.10
内 イスラエル	57,106,452	0.07
内 イタリア	19,936,589	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,823,215,169	10.45
純資産総額	84,470,277,127	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2021年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	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	20,636,202	5.9406 122,593,485	5.8620 120,969,416	- -	28.37
2	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	88,189,996	1.3071 115,281,962	1.3086 115,405,428	- -	27.07
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	30,491,676	3.3308 101,564,723	3.1886 97,225,758	- -	22.80

4	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	18,050,217	1.6969 30,631,218	1.6840 30,396,565	- -	7.13
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	13,972,311	2.0816 29,086,159	2.0647 28,848,630	- -	6.77
6	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	11,755,986	2.4568 28,883,282	2.3858 28,047,431	- -	6.58

(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11月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.71
合計	98.71

(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。

(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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	7,363,700	1,773.42 13,058,942,263	2,001.00 14,734,763,700	- -	3.25
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	910,700	11,866.41 10,806,748,623	13,825.00 12,590,427,500	- -	2.78
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	131,700	58,581.74 7,715,215,429	70,330.00 9,262,461,000	- -	2.05
4	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービ ス業	1,071,600	5,777.42 6,191,088,854	6,901.00 7,395,111,600	- -	1.63
5	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	9,195,400	583.54 5,365,901,401	601.40 5,530,113,560	- -	1.22
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	92,200	45,389.86 4,184,945,308	59,840.00 5,517,248,000	- -	1.22
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	1,668,600	2,895.68 4,831,743,720	3,125.00 5,214,375,000	- -	1.15
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	855,400	8,293.53 7,094,289,924	6,030.00 5,158,062,000	- -	1.14
9	HOYA 日本	株式 精密機器	283,700	14,539.90 4,124,971,650	18,020.00 5,112,274,000	- -	1.13

10	日本電産 日本	株式 電気機器	376,800	13,151.70 4,955,564,073	13,000.00 4,898,400,000	- -	1.08
11	日立製作所 日本	株式 電気機器	699,200	5,637.46 3,941,713,366	6,688.00 4,676,249,600	- -	1.03
12	信越化学工業 日本	株式 化学	244,500	18,452.03 4,511,523,489	19,000.00 4,645,500,000	- -	1.03
13	ダイキン工業 日本	株式 機械	185,200	23,406.17 4,334,822,921	23,150.00 4,287,380,000	- -	0.95
14	任天堂 日本	株式 その他製品	82,100	59,802.34 4,909,772,558	50,100.00 4,113,210,000	- -	0.91
15	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	992,500	3,777.26 3,748,940,242	3,703.00 3,675,227,500	- -	0.81
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,072,900	3,201.27 3,434,653,299	3,391.00 3,638,203,900	- -	0.80
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	427,000	9,051.58 3,865,026,819	8,380.00 3,578,260,000	- -	0.79
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,144,600	3,256.36 3,727,238,705	3,101.00 3,549,404,600	- -	0.78
19	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,142,600	3,640.52 4,159,659,227	3,031.00 3,463,220,600	- -	0.76
20	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,040,000	3,470.91 3,609,750,638	3,300.00 3,432,000,000	- -	0.76
21	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,160,700	1,489.02 3,217,336,838	1,562.50 3,376,093,750	- -	0.75
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,001,500	3,230.55 3,235,400,480	3,260.00 3,264,890,000	- -	0.72
23	第一三共 日本	株式 医薬品	1,142,400	2,920.55 3,336,437,126	2,824.50 3,226,708,800	- -	0.71
24	S M C 日本	株式 機械	42,600	65,332.99 2,783,185,671	72,650.00 3,094,890,000	- -	0.68
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	164,200	17,322.41 2,844,340,929	17,840.00 2,929,328,000	- -	0.65
26	三井物産 日本	株式 卸売業	1,111,900	2,284.96 2,540,654,456	2,557.00 2,843,128,300	- -	0.63
27	ファナック 日本	株式 電気機器	127,600	26,437.90 3,373,476,490	22,245.00 2,838,462,000	- -	0.63
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	472,200	5,579.87 2,634,815,674	5,708.00 2,695,317,600	- -	0.60
29	デンソー 日本	株式 輸送用機器	320,100	7,226.08 2,313,069,697	8,331.00 2,666,753,100	- -	0.59
30	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,833,700	1,568.33 2,875,848,876	1,402.00 2,570,847,400	- -	0.57

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	84.81
合計	84.81

（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11月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	16.80
情報・通信業		7.31
輸送用機器		6.85
化学		5.76
サービス業		5.44
機械		4.55
卸売業		4.32
医薬品		4.09
銀行業		3.95
小売業		3.56
食料品		2.76
精密機器		2.56
陸運業		2.53
建設業		1.85
その他製品		1.85
保険業		1.62
不動産業		1.59
その他金融業		0.96
電気・ガス業		0.92
ガラス・土石製品		0.66
証券、商品先物取引業		0.62
鉄鋼		0.60
非鉄金属		0.59
ゴム製品		0.56
金属製品		0.54
繊維製品		0.39
海運業		0.36
石油・石炭製品		0.34
空運業		0.32
鉱業		0.19
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業	0.07	
合計	84.81	

（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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,705,503	15,598.85 26,603,887,991	18,230.50 31,092,180,627	- -	4.53
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	731,048	29,293.84 21,415,209,899	38,298.39 27,997,965,141	- -	4.08
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	46,395	375,457.98 17,419,373,270	405,199.81 18,799,245,597	- -	2.74
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	83,707	88,437.64 7,402,850,367	129,355.35 10,827,948,474	- -	1.58
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	30,705	259,341.79 7,963,089,928	331,140.09 10,167,656,761	- -	1.48
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	29,781	260,575.34 7,760,194,460	332,467.79 9,901,223,420	- -	1.44
7	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	254,793	18,836.33 4,799,365,424	37,971.87 9,674,967,997	- -	1.41
8	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	244,886	33,452.08 8,191,946,604	38,457.67 9,417,745,734	- -	1.37
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	308,951	16,822.52 5,197,337,175	18,343.13 5,667,130,550	- -	0.83
10	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	108,641	33,476.59 3,636,930,753	46,283.91 5,028,330,418	- -	0.73

11	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	96,311	40,549.60 3,905,372,625	51,424.03 4,952,700,716	- -	0.72
12	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	269,091	18,994.03 5,111,123,255	18,174.75 4,890,663,670	- -	0.71
13	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	293,570	12,890.05 3,784,133,807	14,802.32 4,345,518,550	- -	0.63
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	134,892	29,064.97 3,920,632,006	32,096.79 4,329,600,520	- -	0.63
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	249,556	14,995.47 3,742,211,565	16,954.00 4,230,973,771	- -	0.62
16	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	787,107	4,127.18 3,248,534,028	5,186.77 4,082,546,358	- -	0.59
17	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	42,901	69,228.89 2,969,988,898	90,503.36 3,882,684,990	- -	0.57
18	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	172,598	24,714.57 4,265,686,527	22,331.91 3,854,443,571	- -	0.56
19	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	48,790	60,021.54 2,928,450,965	78,215.73 3,816,145,822	- -	0.56
20	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	45,351	62,976.12 2,856,030,157	75,525.07 3,425,137,757	- -	0.50
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	572,642	4,264.89 2,442,255,249	5,961.54 3,413,832,769	- -	0.50
22	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア	99,310	27,739.60 2,754,820,406	33,760.10 3,352,716,504	- -	0.49
23	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	90,347	39,701.19 3,586,883,983	36,748.84 3,320,148,143	- -	0.48
24	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	71,500	39,856.05 2,849,708,009	44,061.87 3,150,424,062	- -	0.46
25	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	185,703	20,962.15 3,892,735,247	16,816.34 3,122,845,474	- -	0.46
26	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	432,803	6,107.34 2,643,279,247	7,007.09 3,032,691,434	- -	0.44

27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサイエンス・ツール/サービス	40,184	58,639.02 2,356,350,665	73,810.56 2,966,003,659	- -	0.43
28	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品 小売り	45,099	42,771.28 1,928,942,107	63,128.69 2,847,041,133	- -	0.41
29	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	468,764	6,203.12 2,907,800,151	5,862.56 2,748,160,872	- -	0.40
30	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	430,080	5,687.84 2,446,228,963	6,343.81 2,728,348,041	- -	0.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	94.25
投資信託受益証券	0.17
投資証券	2.05
合計	96.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	8.15
銀行		5.67
半導体・半導体製造装置		5.40
コンピュータ・周辺機器		4.79
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.61
医薬品		4.37
情報技術サービス		4.04
インターネット販売・通信販売		3.26
資本市場		3.24
石油・ガス・消耗燃料		3.03
保険		2.79
ヘルスケア機器・用品		2.40
自動車		2.26
化学		2.02
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.87
専門小売り		1.79
ホテル・レストラン・レジャー		1.67
バイオテクノロジー		1.64
電力		1.62
機械		1.60
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.56
繊維・アパレル・贅沢品		1.53

飲料	1.51
食品	1.46
食品・生活必需品小売り	1.41
娯楽	1.35
金属・鉱業	1.28
航空宇宙・防衛	1.23
各種電気通信サービス	1.17
家庭用品	1.05
陸運・鉄道	1.04
コングロマリット	1.00
メディア	0.95
電気設備	0.86
各種金融サービス	0.84
専門サービス	0.80
総合公益事業	0.76
通信機器	0.66
建設関連製品	0.61
航空貨物・物流サービス	0.60
電子装置・機器・部品	0.60
パーソナル用品	0.58
タバコ	0.54
複合小売り	0.50
商業サービス・用品	0.45
消費者金融	0.43
不動産管理・開発	0.37
商社・流通業	0.33
家庭用耐久財	0.33
容器・包装	0.25
建設資材	0.24
自動車部品	0.24
無線通信サービス	0.23
建設・土木	0.18
エネルギー設備・サービス	0.14
ガス	0.13
ヘルスケア・テクノロジー	0.13
運送インフラ	0.12
水道	0.11
紙製品・林産品	0.10
販売	0.10
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08
海運業	0.08
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.04
合計	94.25

(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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,710,000,000	101.05 5,770,260,000	101.20 5,778,691,300	0.1 2028/3/20	1.13
2	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,730,000,000	101.90 4,820,236,000	101.72 4,811,450,600	0.4 2025/3/20	0.94
3	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	101.85 4,726,072,000	0.6 2024/6/20	0.93
4	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,610,000,000	102.07 4,705,587,000	101.98 4,701,554,600	0.4 2025/9/20	0.92
5	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,610,000,000	100.74 4,644,319,000	101.11 4,661,355,400	0.1 2030/6/20	0.91
6	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,590,000,000	101.09 4,640,235,400	101.01 4,636,588,500	0.1 2026/12/20	0.91
7	147回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,600,000,000	100.50 4,623,040,000	100.47 4,621,804,000	0.005 2026/3/20	0.90
8	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,540,000,000	101.02 4,586,655,000	101.26 4,597,431,000	0.1 2028/9/20	0.90
9	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	101.85 4,491,761,400	0.4 2025/6/20	0.88
10	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,400,000,000	101.11 4,449,029,200	101.21 4,453,592,000	0.1 2028/6/20	0.87
11	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,390,000,000	101.09 4,437,900,000	101.06 4,436,753,500	0.1 2027/3/20	0.87
12	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,390,000,000	100.95 4,432,096,000	100.96 4,432,363,500	0.1 2026/9/20	0.87
13	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,350,000,000	100.98 4,392,955,000	100.96 4,391,760,000	0.1 2026/6/20	0.86
14	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	100.82 4,385,713,500	0.1 2025/9/20	0.86
15	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,330,000,000	101.08 4,376,933,100	101.18 4,381,353,800	0.1 2027/12/20	0.86
16	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,230,000,000	102.07 4,317,681,000	101.67 4,300,683,300	0.6 2024/3/20	0.84

17	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,210,000,000	101.19 4,260,490,500	101.31 4,265,235,200	0.1 2028/12/20	0.84
18	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	102.10 4,186,330,000	101.75 4,172,037,000	0.5 2024/9/20	0.82
19	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	100.78 4,132,144,000	0.1 2025/6/20	0.81
20	356回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,040,000,000	101.11 4,085,098,800	101.29 4,092,277,600	0.1 2029/9/20	0.80
21	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,020,000,000	101.81 4,093,158,900	101.68 4,087,897,800	0.3 2025/12/20	0.80
22	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,940,000,000	100.49 3,959,628,000	101.01 3,979,912,200	0.1 2030/9/20	0.78
23	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,950,000,000	100.54 3,971,616,000	100.74 3,979,309,000	0.1 2031/3/20	0.78
24	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,910,000,000	101.23 3,958,173,800	101.32 3,961,924,800	0.1 2029/6/20	0.78
25	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,900,000,000	100.92 3,935,902,000	100.85 3,933,306,000	0.1 2025/12/20	0.77
26	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,850,000,000	101.85 3,921,410,200	101.43 3,905,324,500	0.8 2023/6/20	0.76
27	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,810,000,000	100.99 3,847,928,000	101.32 3,860,330,100	0.1 2029/3/20	0.76
28	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,790,000,000	101.08 3,831,274,000	101.25 3,837,488,700	0.1 2029/12/20	0.75
29	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,790,000,000	101.09 3,831,379,000	101.13 3,833,092,300	0.1 2027/9/20	0.75
30	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	100.56 3,821,388,000	100.57 3,821,660,000	0.1 2031/6/20	0.75

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	84.44
地方債証券	5.40
特殊債券	5.56
社債券	4.17
合計	99.57

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	880,579,800	101.43 893,197,566	101.16 890,795,897	1.625 2031/5/15	0.60
2	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	780,462,200	95.88 748,330,890	96.91 756,347,134	1.125 2031/2/15	0.51
3	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	796,390,000	95.66 761,856,949	94.91 755,917,204	0.875 2030/11/15	0.51
4	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	663,279,100	107.22 711,218,541	105.28 698,360,341	2.25 2027/8/15	0.47
5	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	700,823,200	97.84 685,696,932	97.59 683,987,014	1.25 2031/8/15	0.46
6	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	628,010,400	107.02 672,118,314	104.39 655,608,511	2.75 2023/11/15	0.44
7	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	639,387,400	102.61 656,096,389	101.36 648,104,046	1.625 2022/11/15	0.43
8	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証券	635,974,300	103.34 657,234,920	101.78 647,327,433	2 2022/11/30	0.43
9	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	628,010,400	103.73 651,462,663	102.04 640,864,987	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	605,256,400	107.55 650,981,625	104.76 634,124,290	2.75 2024/2/15	0.43
11	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	591,604,000	109.02 644,986,021	105.91 626,591,826	2.375 2027/5/15	0.42
12	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	673,518,400	93.21 627,832,968	93.01 626,451,033	0.625 2030/8/15	0.42
13	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	589,328,600	106.80 629,430,565	103.61 610,645,716	2 2025/8/15	0.41
14	US T N/B 0.125 11/30/22 アメリカ	国債証券	607,531,800	100.02 607,697,916	99.91 607,033,429	0.125 2022/11/30	0.41
15	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	566,574,600	103.17 584,589,898	101.73 576,423,258	1.75 2023/1/31	0.39
16	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証券	568,850,000	100.10 569,469,187	99.33 565,094,696	0.375 2024/4/15	0.38
17	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証券	568,850,000	99.57 566,440,419	99.07 563,605,914	0.125 2024/1/15	0.38
18	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証券	542,682,900	105.67 573,463,194	103.26 560,426,084	2 2024/5/31	0.38
19	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	533,581,300	108.07 576,683,997	104.66 558,488,703	2.25 2025/11/15	0.37
20	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	533,581,300	107.10 571,473,905	104.19 555,987,541	2.25 2024/11/15	0.37

21	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	504,001,100	113.13 570,190,615	109.24 550,621,201	2.875 2028/5/15	0.37
22	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証券	489,211,000	106.30 520,056,920	111.27 544,361,892	2.375 2051/5/15	0.37
23	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証券	547,233,700	99.75 545,871,088	99.17 542,723,295	0.25 2024/3/15	0.36
24	US T N/B 1.875 02/15/51 アメリカ	国債証券	542,682,900	92.64 502,780,294	99.65 540,817,426	1.875 2051/2/15	0.36
25	US T N/B 2.25 05/15/41 アメリカ	国債証券	499,450,300	106.07 529,803,691	105.00 524,461,831	2.25 2041/5/15	0.35
26	US T N/B 1.625 10/31/23 アメリカ	国債証券	511,965,000	103.06 527,657,296	102.18 523,144,231	1.625 2023/10/31	0.35
27	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	416,048,400	124.58 518,341,326	122.73 510,655,309	2.5 2030/5/25	0.34
28	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証券	492,624,100	105.81 521,257,875	103.54 510,096,860	2.5 2023/8/15	0.34
29	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	497,174,900	103.72 515,702,429	102.09 507,603,918	2 2023/2/15	0.34
30	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	288,922,500	178.64 516,141,817	175.35 506,646,406	4.5 2041/4/25	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11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.59
合計	98.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

2021年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	19,737	712,460.60 14,061,834,984	700,000.00 13,815,900,000	- -	6.56
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	17,416	688,907.35 11,998,010,484	655,000.00 11,407,480,000	- -	5.41
3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	27,591	355,688.41 9,813,798,966	369,500.00 10,194,874,500	- -	4.84
4	G L P 投資法人 日本	投資証券	56,405	188,733.45 10,645,510,807	180,300.00 10,169,821,500	- -	4.83
5	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	56,318	176,956.83 9,965,854,892	161,400.00 9,089,725,200	- -	4.31

6	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	87,871	115,872.23 10,181,808,866	97,800.00 8,593,783,800	- -	4.08
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	26,150	328,796.57 8,598,030,309	323,500.00 8,459,525,000	- -	4.01
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	34,700	207,435.69 7,198,018,443	180,500.00 6,263,350,000	- -	2.97
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	17,413	368,104.86 6,409,810,094	348,500.00 6,068,430,500	- -	2.88
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	39,206	158,202.90 6,202,503,050	144,600.00 5,669,187,600	- -	2.69
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	24,724	208,248.37 5,148,732,714	202,800.00 5,014,027,200	- -	2.38
12	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	11,445	431,515.13 4,938,690,693	404,500.00 4,629,502,500	- -	2.20
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	52,866	92,893.92 4,910,930,444	82,500.00 4,361,445,000	- -	2.07
14	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	9,282	498,370.96 4,625,879,329	432,000.00 4,009,824,000	- -	1.90
15	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	21,320	186,015.04 3,965,840,863	187,200.00 3,991,104,000	- -	1.89
16	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	6,474	592,080.21 3,833,127,287	583,000.00 3,774,342,000	- -	1.79
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	6,013	646,077.21 3,884,862,285	620,000.00 3,728,060,000	- -	1.77
18	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	5,387	793,493.03 4,274,546,972	689,000.00 3,711,643,000	- -	1.76
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	11,379	330,866.79 3,764,933,246	314,000.00 3,573,006,000	- -	1.70
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	53,354	67,663.44 3,610,115,680	58,600.00 3,126,544,400	- -	1.48
21	イオンリート投資法人 日本	投資証券	20,481	159,863.87 3,274,172,074	152,000.00 3,113,112,000	- -	1.48
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	20,479	162,742.39 3,332,801,609	150,400.00 3,080,041,600	- -	1.46
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,105	509,141.51 3,108,308,944	497,000.00 3,034,185,000	- -	1.44
24	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	76,653	44,059.02 3,377,256,698	38,050.00 2,916,646,650	- -	1.38

25	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	16,247	185,536.50 3,014,411,593	166,700.00 2,708,374,900	- -	1.29
26	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	3,682	779,976.68 2,871,874,152	714,000.00 2,628,948,000	- -	1.25
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	23,533	118,981.08 2,799,981,799	109,400.00 2,574,510,200	- -	1.22
28	NTT都市開発リート投資法人 日本	投資証券	16,693	162,005.53 2,704,358,451	150,200.00 2,507,288,600	- -	1.19
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	7,841	349,245.91 2,738,437,248	319,000.00 2,501,279,000	- -	1.19
30	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	11,895	232,239.66 2,762,490,789	206,100.00 2,451,559,500	- -	1.16

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	90.65
合計	90.65

(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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	306,240	14,673.16 4,493,510,894	17,438.66 5,340,416,953	- -	6.32
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	37,172	91,915.61 3,416,687,295	93,291.39 3,467,827,920	- -	4.11
3	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	136,075	15,392.93 2,094,593,465	18,196.37 2,476,071,564	- -	2.93
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	63,125	35,277.99 2,226,923,686	37,759.12 2,383,544,784	- -	2.82
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	117,008	17,465.74 2,043,632,113	19,203.23 2,246,932,507	- -	2.66
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	228,075	7,574.88 1,727,642,562	7,941.14 1,811,176,873	- -	2.14
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	174,911	9,388.96 1,642,233,336	9,333.69 1,632,565,191	- -	1.93
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	57,789	25,075.43 1,449,084,599	27,393.54 1,583,045,317	- -	1.87

9	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	695,740	1,747.91 1,216,094,020	1,995.66 1,388,467,097	- -	1.64
10	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	141,015	9,271.59 1,307,433,788	9,809.24 1,383,251,304	- -	1.64
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	57,377	22,122.47 1,269,321,146	23,352.43 1,339,892,387	- -	1.59
12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	55,367	19,692.05 1,090,290,056	23,100.99 1,279,032,983	- -	1.51
13	MID AMERICA アメリカ	投資証券	47,998	20,833.89 999,985,346	23,891.69 1,146,753,816	- -	1.36
14	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	238,497	4,422.50 1,054,753,301	4,695.28 1,119,812,078	- -	1.33
15	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	47,947	21,210.18 1,016,964,511	22,384.24 1,073,257,514	- -	1.27
16	SEGRO PLC イギリス	投資証券	496,506	1,802.88 895,145,307	2,148.36 1,066,675,119	- -	1.26
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	26,902	36,201.02 973,879,986	39,421.30 1,060,511,947	- -	1.26
18	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	156,503	5,725.69 896,088,340	6,763.62 1,058,527,838	- -	1.25
19	VENTAS INC アメリカ	投資証券	162,725	6,406.84 1,042,553,101	5,588.38 909,369,526	- -	1.08
20	LINK REIT 香港	投資証券	865,020	1,064.54 920,856,720	1,002.33 867,038,091	- -	1.03
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	222,864	3,900.02 869,175,794	3,875.00 863,599,381	- -	1.02
22	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	253,829	3,489.91 885,840,792	3,200.35 812,341,665	- -	0.96
23	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	41,580	16,457.56 684,305,550	19,210.06 798,754,481	- -	0.95
24	UDR INC アメリカ	投資証券	115,338	5,882.02 678,420,605	6,538.36 754,121,584	- -	0.89
25	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	58,745	13,303.01 781,485,677	12,553.38 737,448,413	- -	0.87
26	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	76,149	8,722.95 664,243,942	8,959.38 682,248,398	- -	0.81
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	70,627	9,088.87 641,919,882	9,649.97 681,548,530	- -	0.81
28	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	253,533	2,465.32 625,041,372	2,648.56 671,498,782	- -	0.79
29	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	119,600	5,138.31 614,543,005	5,331.26 637,618,959	- -	0.75
30	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	246,097	2,318.19 570,500,211	2,444.91 601,686,812	- -	0.71

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	9.07
投資証券	80.49
合計	89.55

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

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。

【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11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0312月	買建	249	4,998,402,170	4,721,040,000	1.04

(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11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Dec21	買建	602	15,576,363,047	15,927,242,527	2.32

EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec21	買建	569	3,072,198,335	3,000,060,807	0.44
ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec21	買建	81	881,980,686	873,463,014	0.13
モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec21	買建	32	719,341,877	728,989,990	0.11
シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Dec21	買建	32	479,121,227	469,140,848	0.07

(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11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0312月	買建	2,548	5,434,099,260	5,102,370,000	2.42

(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】

【純資産の推移】

直近日(2021年11月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第11特定期間末 (2012年5月11日)	692	694	0.6202	0.6217
第12特定期間末 (2012年11月12日)	652	653	0.6218	0.6233
第13特定期間末 (2013年5月13日)	824	825	0.8225	0.8240
第14特定期間末 (2013年11月11日)	736	738	0.8118	0.8133
第15特定期間末 (2014年5月12日)	712	713	0.8414	0.8429
第16特定期間末 (2014年11月11日)	684	685	0.9368	0.9383

第17特定期間末 (2015年5月11日)	622	623	1.0095	1.0110
第18特定期間末 (2015年11月11日)	534	535	0.9947	0.9962
第19特定期間末 (2016年5月11日)	498	499	0.9354	0.9369
第20特定期間末 (2016年11月11日)	482	483	0.9205	0.9220
第21特定期間末 (2017年5月11日)	492	493	1.0090	1.0105
第22特定期間末 (2017年11月13日)	477	478	1.0570	1.0585
第23特定期間末 (2018年5月11日)	448	449	1.0565	1.0580
第24特定期間末 (2018年11月12日)	428	428	1.0434	1.0449
第25特定期間末 (2019年5月13日)	411	411	1.0361	1.0376
第26特定期間末 (2019年11月11日)	430	431	1.0940	1.0955
第27特定期間末 (2020年5月11日)	370	371	0.9993	1.0008
第28特定期間末 (2020年11月11日)	401	401	1.1046	1.1061
第29特定期間末 (2021年5月11日)	421	421	1.2325	1.2340
第30特定期間末 (2021年11月11日)	433	433	1.3083	1.3098
2020年11月末日	400	-	1.1153	-
12月末日	402	-	1.1380	-
2021年1月末日	402	-	1.1469	-
2月末日	406	-	1.1716	-
3月末日	423	-	1.2200	-
4月末日	420	-	1.2321	-
5月末日	420	-	1.2424	-
6月末日	427	-	1.2594	-
7月末日	427	-	1.2608	-
8月末日	430	-	1.2790	-
9月末日	422	-	1.2751	-
10月末日	432	-	1.3050	-
11月末日	426	-	1.2864	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第11特定期間	0.0045
第12特定期間	0.0045
第13特定期間	0.0045
第14特定期間	0.0045

第15特定期間	0.0045
第16特定期間	0.0045
第17特定期間	0.0045
第18特定期間	0.0045
第19特定期間	0.0045
第20特定期間	0.0045
第21特定期間	0.0045
第22特定期間	0.0045
第23特定期間	0.0045
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045

【収益率の推移】

	収益率（％）
第11特定期間	4.9
第12特定期間	1.0
第13特定期間	33.0
第14特定期間	0.8
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.9
第17特定期間	8.2
第18特定期間	1.0
第19特定期間	5.5
第20特定期間	1.1
第21特定期間	10.1
第22特定期間	5.2
第23特定期間	0.4
第24特定期間	0.8
第25特定期間	0.3
第26特定期間	6.0
第27特定期間	8.2
第28特定期間	11.0
第29特定期間	12.0
第30特定期間	6.5

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第11特定期間	10,800,000	90,460,000
第12特定期間	3,810,000	71,430,000
第13特定期間	22,800,000	69,530,000
第14特定期間	13,700,000	108,500,000
第15特定期間	52,399,738	112,932,769

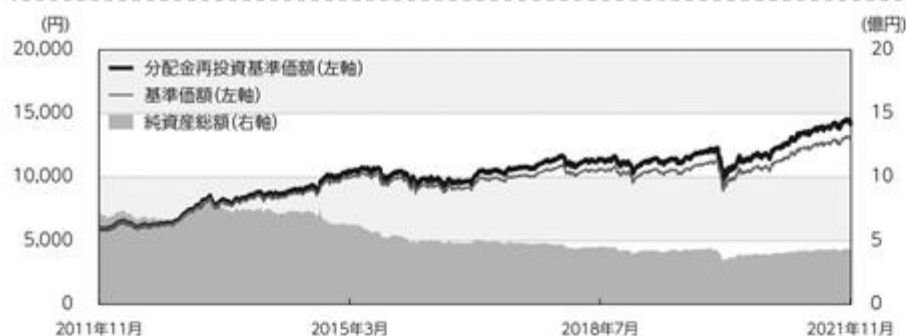
第16特定期間	31,449,359	147,724,782
第17特定期間	44,688,338	158,989,550
第18特定期間	22,117,058	100,883,651
第19特定期間	21,980,050	26,586,206
第20特定期間	10,137,344	18,761,221
第21特定期間	9,179,637	45,104,386
第22特定期間	6,636,994	43,222,568
第23特定期間	4,576,025	31,482,595
第24特定期間	6,951,749	21,627,662
第25特定期間	6,012,015	19,263,147
第26特定期間	13,077,272	16,654,903
第27特定期間	11,204,748	33,518,095
第28特定期間	4,242,197	12,089,221
第29特定期間	7,387,321	28,854,017
第30特定期間	7,665,051	18,275,352

(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11月30日

基準価額・純資産の推移 (2011年11月30日～2021年11月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、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)

2021年 3月	15円
2021年 5月	15円
2021年 7月	15円
2021年 9月	15円
2021年11月	15円
直近1年間累計	90円
設定来累計	1,830円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.37
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	27.07
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	22.80
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.13
5	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.77
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.58

■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	3.25
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.78
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.05
4	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.63
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.22

■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	4.53
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.08
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.74
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.58
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	1.48

○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11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	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.13
2	338回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/3/20	0.94
3	334回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/6/20	0.93
4	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	0.92
5	359回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2030/6/20	0.91

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.60
2	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.51
3	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.51
4	US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	アメリカ	2.25	2027/8/15	0.47
5	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.46

■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	6.56
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.41
3	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.84
4	GLP投資法人	投資証券	日本	4.83
5	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.31

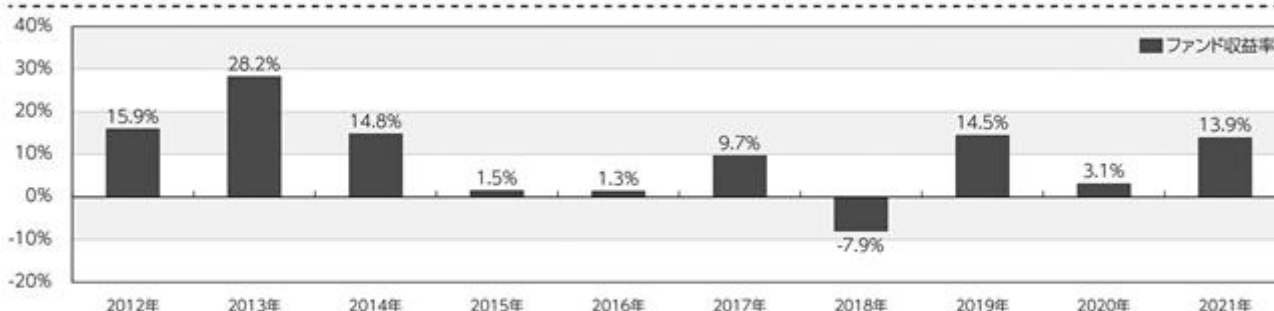
■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	6.32
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.11
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	2.93
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.82
5	DIGITAL REALTY TRUST 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。

○掲載データ等はい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

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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、Frankfurt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。

・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。

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各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。

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經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、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

・ 解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、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支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日 における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
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奇数月の12日から翌奇数月の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。受託会社は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」の規定に従い、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、この信託約款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。
- 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対し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.～e.の規定に従います。
- 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。

当ファンドの投資顧問契約について、委託会社とイボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社(投資顧問会社)との間の当該契約は、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ. 公告

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

(URL <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5月11日、11月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
 - ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。
- (URL <http://www.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

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

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て)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2021年5月12日から2021年11月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年5月11日現在	当期 2021年11月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,534,625	6,261,171
親投資信託受益証券	416,708,764	428,040,829
流動資産合計	422,243,389	434,302,000
資産合計	422,243,389	434,302,000
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	512,722	496,807
未払解約金	37,429	99,999
未払受託者報酬	30,917	30,487
未払委託者報酬	355,667	350,718
その他未払費用	2,732	2,686
流動負債合計	939,467	980,697
負債合計	939,467	980,697
純資産の部		
元本等		
元本	341,815,072	331,204,771
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	79,488,850	102,116,532
(分配準備積立金)	91,414,516	111,397,243
元本等合計	421,303,922	433,321,303
純資産合計	421,303,922	433,321,303
負債純資産合計	422,243,389	434,302,000

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年11月12日 至 2021年5月11日	当期 自 2021年5月12日 至 2021年11月11日
営業収益		
受取利息	3	8
有価証券売買等損益	47,454,278	28,078,065
営業収益合計	47,454,281	28,078,073
営業費用		
支払利息	449	619
受託者報酬	89,465	94,663
委託者報酬	1,029,180	1,089,218
その他費用	7,889	8,332
営業費用合計	1,126,983	1,192,832
営業利益又は営業損失()	46,327,298	26,885,241
経常利益又は経常損失()	46,327,298	26,885,241
当期純利益又は当期純損失()	46,327,298	26,885,241
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()	496,577	67,775
期首剰余金又は期首欠損金()	38,005,537	79,488,850
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,444,970	2,068,565
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	1,444,970	2,068,565
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,231,456	4,883,284
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,231,456	4,883,284
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	1,560,922	1,510,615
期末剰余金又は期末欠損金()	79,488,850	102,116,532

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	当期
	自 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	前期	当期
	2021年5月11日現在	2021年11月11日現在
1. 期首元本額	363,281,768円	341,815,072円
期中追加設定元本額	7,387,321円	7,665,051円
期中一部解約元本額	28,854,017円	18,275,352円
2. 受益権の総数	341,815,072口	331,204,771口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期	当期
	自 2020年11月12日 至 2021年5月11日	自 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 分配金の計算過程	<p>（自2020年11月12日 至2021年1月12日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（916,550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（8,954,869円）、信託約款に規定される収益調整金（11,068,659円）及び分配準備積立金（58,109,318円）より分配対象収益は79,049,396円（1万口当たり2,243.55円）であり、うち528,510円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（自2021年1月13日 至2021年3月11日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（875,075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（15,026,128円）、信託約款に規定される収益調整金（11,309,704円）及び分配準備積立金（65,901,838円）より分配対象収益は93,112,745円（1万口当たり2,687.54円）であり、うち519,690円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2021年5月12日 至2021年7月12日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（964,694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（11,015,378円）、信託約款に規定される収益調整金（12,883,362円）及び分配準備積立金（90,138,017円）より分配対象収益は115,001,451円（1万口当たり3,383.05円）であり、うち509,900円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（自2021年7月13日 至2021年9月13日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（875,062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（7,704,684円）、信託約款に規定される収益調整金（13,386,787円）及び分配準備積立金（99,760,270円）より分配対象収益は121,726,803円（1万口当たり3,623.48円）であり、うち503,908円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>

	(自2021年3月12日 至2021年5月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,726,465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(11,020,595円)、信託約款に規定される収益調整金(12,175,430円)及び分配準備積立金(79,180,178円)より分配対象収益は104,102,668円(1万口当たり3,045.58円)であり、うち512,722円(1万口当たり15円)を分配金額としております。	(自2021年9月14日 至2021年11月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,427,884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(4,965,314円)、信託約款に規定される収益調整金(14,016,693円)及び分配準備積立金(105,500,852円)より分配対象収益は125,910,743円(1万口当たり3,801.59円)であり、うち496,807円(1万口当たり15円)を分配金額としております。
--	---	--

(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	前期	当期
	自 2020年11月12日 至 2021年5月11日	自 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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	前期	当期
	2021年5月11日現在	2021年11月11日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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	前期 2021年5月11日現在	当期 2021年11月11日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	13,246,184	6,777,496
合計	13,246,184	6,777,496

（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）

	前期 2021年5月11日現在	当期 2021年11月11日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2325円 (12,325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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	30,491,676	101,564,723	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	88,189,996	115,281,962	
	J-REITインデックスファン ド・マザーファンド	11,755,986	28,883,282	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	20,636,202	122,593,485	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	13,972,311	29,086,159	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	18,050,217	30,631,218	
親投資信託受益証券 合計		183,096,388	428,040,829	
合計			428,040,829	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,494,933,378
株式	463,236,644,110
派生商品評価勘定	116,735,620
未収配当金	3,101,816,309
差入委託証拠金	345,030,000
流動資産合計	472,295,159,417
資産合計	472,295,159,417
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,458,130
前受金	71,785,000
未払解約金	191,436,000
流動負債合計	277,679,130
負債合計	277,679,130
純資産の部	
元本等	
元本	141,707,381,255
剰余金	
剰余金又は欠損金()	330,310,099,032
元本等合計	472,017,480,287
純資産合計	472,017,480,287
負債純資産合計	472,295,159,417

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5月12日 至 2021年11月11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11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	111,968,253,392円
同期中追加設定元本額	87,509,573,071円
同期中一部解約元本額	57,770,445,208円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	561,857,238円
MHAM TOPIXオープン	2,732,492,604円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	6,921,083,643円
One DC 国内株式インデックスファンド	19,070,587,075円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	5,074,055,495円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,076,645円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	17,107,191円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	30,979,669円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,689,484円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,954,705円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,982,758円
たわらノーロード TOPIX	1,147,453,027円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	919,755,069円
たわらノーロード バランス(堅実型)	35,188,203円
たわらノーロード バランス(標準型)	223,975,910円
たわらノーロード バランス(積極型)	342,778,782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)	2,504,887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)	154,959,134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)	387,064,492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)	256,327,289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)	374,632,832円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	617,001円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,710,582円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	31,771,039円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,019,320円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	17,159,746円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,738,370,220円
Oneグローバルバランス	2,088,112円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,011,457,046円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,369,357,517円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,630,990,473円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	327,336,061円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,117,623,397円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,108,643,119円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,491,676円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,044,999,679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)	300,531,320円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	292,227,832円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	521,135,993円
投資のソムリエ	25,773,578,600円
クルーズコントロール	646,262,631円
投資のソムリエ<DC年金>	1,297,586,409円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	309,774,130円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	488,726,781円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	7,137,157円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	17,321,468円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	848,964,044円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	7,693,453,481円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	32,337,934円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	16,899,236円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	8,397,924円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	86,588,591円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	319,039,152円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,092,293,809円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	266,452,056円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	25,216,885円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	12,542,802円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	9,913,856円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	75,228,079円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	469,621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)	29,593,871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)	30,093,117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)	49,670,055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)	18,379,245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)	28,971,148円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	82,846,631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)	87,019,592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)	128,882,818円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	141,510,213円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	99,299,386円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	29,074,996円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	98,338,624円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	690,947,490円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	33,949,148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)	418,052,171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)	49,345,848円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(F O F s用)(適格機関投資家専用)	10,942,329円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	57,556,354円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	99,770,630円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,860,843円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,204,318円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,357,787円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,293,093円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,056,636円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	33,673,923円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	565,345,122円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	642,468,786円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,835,115,710円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	32,514,670円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	32,315,756円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	301,697,978円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	75,660,772円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,544,954円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	352,703,500円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	21,259,688円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	72,328,663円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	171,306,067円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	254,481,743円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	38,284,674円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	17,810,193円
D I A M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)	291,737,796円
D I A M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)	936,557,239円
D I A M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)	1,240,495,959円
D I A M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)	49,936,951円
動的パッケージファンド<DC年金>	18,755,714円

コア資産形成ファンド	14,351,821円
MHAMトピックスファンド	675,879,930円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	66,323,962円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,659,425,997円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,151,844,145円
計	141,707,381,255円
2. 受益権の総数	141,707,381,255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 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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11月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	15,907,515,409	
合計	15,907,515,409	

(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(2021年2月9日から2021年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年11月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	8,911,330,000	-		9,013,755,000	102,425,000
合計	8,911,330,000	-		9,013,755,000	102,425,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3309円 (33,309円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年11月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	

極洋	8,300	3,045.00	25,273,500
日本水産	227,800	621.00	141,463,800
マルハニチロ	35,700	2,422.00	86,465,400
ハウスイ	700	917.00	641,900
雪国まいたけ	16,700	1,376.00	22,979,200
カネコ種苗	5,100	1,418.00	7,231,800
サカタのタネ	27,300	3,385.00	92,410,500
ホクト	19,400	1,968.00	38,179,200
ホクリヨウ	3,700	751.00	2,778,700
ヒノキヤグループ	5,000	2,263.00	11,315,000
ショーボンドホールディングス	32,500	5,000.00	162,500,000
ミライト・ホールディングス	73,300	2,114.00	154,956,200
タマホーム	13,800	2,281.00	31,477,800
サンヨーホームズ	2,500	730.00	1,825,000
日本アクア	9,300	647.00	6,017,100
ファーストコーポレーション	7,400	775.00	5,735,000
ベステラ	4,600	1,397.00	6,426,200
Robot Home	37,600	272.00	10,227,200
キャンディル	4,200	510.00	2,142,000
スペースバリューホールディングス	24,200	970.00	23,474,000
住石ホールディングス	39,300	138.00	5,423,400
日鉄鉱業	5,200	6,280.00	32,656,000
三井松島ホールディングス	9,500	1,446.00	13,737,000
I N P E X	914,100	952.00	870,223,200
石油資源開発	26,700	2,338.00	62,424,600
K & Oエナジーグループ	11,200	1,533.00	17,169,600
ダイセキ環境ソリューション	4,400	1,897.00	8,346,800
第一カッター興業	5,800	1,389.00	8,056,200
明豊ファシリティワークス	7,400	890.00	6,586,000
安藤・間	125,100	892.00	111,589,200
東急建設	66,900	677.00	45,291,300
コムシスホールディングス	73,400	2,753.00	202,070,200
ピーアールホールディングス	30,900	417.00	12,885,300
高松コンストラクショングループ	14,300	1,915.00	27,384,500
東建コーポレーション	7,000	9,450.00	66,150,000
ソネック	2,800	1,091.00	3,054,800
ヤマウラ	11,600	923.00	10,706,800
オリエンタル白石	76,800	267.00	20,505,600
大成建設	152,100	3,625.00	551,362,500
大林組	526,000	914.00	480,764,000
清水建設	493,000	763.00	376,159,000
飛島建設	14,100	1,041.00	14,678,100
長谷工コーポレーション	156,600	1,472.00	230,515,200
松井建設	21,100	722.00	15,234,200
銭高組	1,700	3,970.00	6,749,000
鹿島建設	385,600	1,380.00	532,128,000
不動テトラ	11,200	1,749.00	19,588,800
大末建設	6,000	1,209.00	7,254,000
鉄建建設	11,500	1,781.00	20,481,500
西松建設	31,800	3,440.00	109,392,000

三井住友建設	118,500	412.00	48,822,000
大豊建設	7,700	3,755.00	28,913,500
佐田建設	12,500	485.00	6,062,500
ナカノフード建設	13,700	333.00	4,562,100
奥村組	31,000	2,948.00	91,388,000
東鉄工業	24,500	2,353.00	57,648,500
イチケン	4,000	1,924.00	7,696,000
富士ピー・エス	7,600	516.00	3,921,600
浅沼組	5,900	4,540.00	26,786,000
戸田建設	218,600	709.00	154,987,400
熊谷組	26,800	2,730.00	73,164,000
北野建設	3,600	2,181.00	7,851,600
植木組	5,200	1,458.00	7,581,600
矢作建設工業	23,700	695.00	16,471,500
ピーエス三菱	17,300	633.00	10,950,900
日本ハウスホールディングス	36,100	377.00	13,609,700
大東建託	53,900	13,290.00	716,331,000
新日本建設	22,700	831.00	18,863,700
N I P P O	43,500	4,075.00	177,262,500
東亜道路工業	2,700	5,060.00	13,662,000
日本道路	5,100	7,970.00	40,647,000
東亜建設工業	12,900	2,509.00	32,366,100
日本国土開発	51,900	575.00	29,842,500
若築建設	8,800	1,910.00	16,808,000
東洋建設	59,100	550.00	32,505,000
五洋建設	208,400	734.00	152,965,600
世紀東急工業	25,500	793.00	20,221,500
福田組	5,700	4,320.00	24,624,000
日本ドライケミカル	4,300	1,973.00	8,483,900
住友林業	134,600	2,303.00	309,983,800
日本基礎技術	14,800	483.00	7,148,400
巴コーポレーション	23,800	455.00	10,829,000
大和ハウス工業	486,100	3,419.00	1,661,975,900
ライト工業	33,100	1,942.00	64,280,200
積水ハウス	570,800	2,369.50	1,352,510,600
日特建設	11,200	690.00	7,728,000
北陸電気工事	9,400	1,025.00	9,635,000
ユアテック	30,300	645.00	19,543,500
日本リーテック	11,000	1,526.00	16,786,000
四電工	5,900	1,580.00	9,322,000
中電工	24,300	2,152.00	52,293,600
関電工	85,600	866.00	74,129,600
きんでん	117,600	1,791.00	210,621,600
東京エネシス	17,700	1,080.00	19,116,000
トーエネック	5,400	3,130.00	16,902,000
住友電設	13,000	2,045.00	26,585,000
日本電設工業	28,900	1,700.00	49,130,000
エクシオグループ	79,700	2,580.00	205,626,000
新日本空調	14,000	2,256.00	31,584,000
日本工営	9,500	3,475.00	33,012,500

九電工	40,600	3,470.00	140,882,000
三機工業	34,100	1,442.00	49,172,200
日揮ホールディングス	162,000	1,091.00	176,742,000
中外炉工業	5,400	1,700.00	9,180,000
ヤマト	15,800	764.00	12,071,200
太平電業	11,800	2,615.00	30,857,000
高砂熱学工業	47,600	2,048.00	97,484,800
三晃金属工業	2,100	2,416.00	5,073,600
N E C ネットズエスアイ	54,500	1,887.00	102,841,500
朝日工業社	3,700	3,325.00	12,302,500
明星工業	34,300	641.00	21,986,300
大気社	25,600	2,842.00	72,755,200
ダイダン	11,800	2,161.00	25,499,800
日比谷総合設備	17,300	1,921.00	33,233,300
ニッポン	49,700	1,610.00	80,017,000
日清製粉グループ本社	190,500	1,724.00	328,422,000
日東富士製粉	1,600	3,420.00	5,472,000
昭和産業	16,100	2,794.00	44,983,400
鳥越製粉	15,700	754.00	11,837,800
中部飼料	19,100	1,037.00	19,806,700
フィード・ワン	23,200	805.00	18,676,000
東洋精糖	1,900	1,164.00	2,211,600
日本甜菜製糖	9,300	1,647.00	15,317,100
D M 三井製糖ホールディングス	15,500	1,971.00	30,550,500
塩水港精糖	16,100	218.00	3,509,800
日新製糖	8,700	1,693.00	14,729,100
L I F U L L	48,900	352.00	17,212,800
ミクシィ	36,700	2,203.00	80,850,100
ジェイエイシーリクルートメント	12,900	2,197.00	28,341,300
日本M & A センターホールディングス	263,100	3,550.00	934,005,000
メンバーズ	4,800	2,706.00	12,988,800
中広	1,300	396.00	514,800
U T グループ	23,100	4,125.00	95,287,500
アイティメディア	7,600	2,250.00	17,100,000
E ・ J ホールディングス	8,400	1,264.00	10,617,600
夢真ビーネックスグループ	42,700	1,649.00	70,412,300
コシダカホールディングス	42,700	742.00	31,683,400
アルトナー	4,100	873.00	3,579,300
パソナグループ	17,400	3,620.00	62,988,000
C D S	2,600	1,633.00	4,245,800
リンクアンドモチベーション	35,400	1,073.00	37,984,200
エス・エム・エス	54,500	4,565.00	248,792,500
サニーサイドアップグループ	5,900	791.00	4,666,900
パーソルホールディングス	160,300	3,000.00	480,900,000
リニカル	9,200	856.00	7,875,200
クックパッド	50,600	263.00	13,307,800
エスクリ	7,000	559.00	3,913,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,500	659.00	5,601,500
森永製菓	39,600	3,985.00	157,806,000
中村屋	2,700	3,730.00	10,071,000

江崎グリコ	46,400	3,905.00	181,192,000
名糖産業	7,800	1,702.00	13,275,600
井村屋グループ	9,700	2,293.00	22,242,100
不二家	9,600	2,319.00	22,262,400
山崎製パン	126,400	1,653.00	208,939,200
第一屋製パン	4,800	700.00	3,360,000
モロゾフ	1,900	5,430.00	10,317,000
亀田製菓	9,800	4,430.00	43,414,000
寿スピリッツ	16,200	6,960.00	112,752,000
カルビー	76,800	2,808.00	215,654,400
森永乳業	31,200	6,130.00	191,256,000
六甲バター	12,500	1,611.00	20,137,500
ヤクルト本社	124,800	5,870.00	732,576,000
明治ホールディングス	111,400	6,990.00	778,686,000
雪印メグミルク	40,600	2,039.00	82,783,400
プリマハム	21,100	2,521.00	53,193,100
日本ハム	64,400	4,090.00	263,396,000
林兼産業	4,000	561.00	2,244,000
丸大食品	16,900	1,640.00	27,716,000
S Foods	15,100	3,365.00	50,811,500
柿安本店	6,000	2,627.00	15,762,000
伊藤ハム米久ホールディングス	109,100	679.00	74,078,900
学情	6,500	1,276.00	8,294,000
スタジオアリス	7,200	2,157.00	15,530,400
クロスキャット	4,400	1,259.00	5,539,600
シミックホールディングス	9,100	1,580.00	14,378,000
エプコ	3,600	842.00	3,031,200
システナ	58,700	2,001.00	117,458,700
NJS	3,000	2,014.00	6,042,000
デジタルアーツ	8,800	10,380.00	91,344,000
日鉄ソリューションズ	23,800	3,555.00	84,609,000
総合警備保障	63,800	4,595.00	293,161,000
キューブシステム	8,400	977.00	8,206,800
いちご	184,300	329.00	60,634,700
WOW WORLD	2,400	1,595.00	3,828,000
日本駐車場開発	180,600	143.00	25,825,800
コア	7,200	1,653.00	11,901,600
カカクコム	118,500	3,480.00	412,380,000
アイロムグループ	5,700	1,889.00	10,767,300
セントケア・ホールディング	10,400	822.00	8,548,800
サイネックス	2,500	672.00	1,680,000
ルネサンス	11,000	1,480.00	16,280,000
ディップ	28,200	4,420.00	124,644,000
SBSホールディングス	12,400	3,570.00	44,268,000
デジタルホールディングス	11,200	1,605.00	17,976,000
新日本科学	19,500	1,617.00	31,531,500
キャリアデザインセンター	4,200	1,234.00	5,182,800
ベネフィット・ワン	58,400	5,930.00	346,312,000
エムスリー	283,000	6,319.00	1,788,277,000
ツカダ・グローバルホールディング	10,600	330.00	3,498,000

プラス	2,100	762.00	1,600,200
アウトソーシング	91,800	1,548.00	142,106,400
ウェルネット	16,400	502.00	8,232,800
ワールドホールディングス	6,400	2,726.00	17,446,400
ディー・エヌ・エー	61,000	1,845.00	112,545,000
博報堂DYホールディングス	223,300	1,903.00	424,939,900
ぐるなび	26,100	609.00	15,894,900
タカミヤ	20,400	441.00	8,996,400
ジャパンベストレスキューシステム	10,800	932.00	10,065,600
ファンコミュニケーションズ	40,400	428.00	17,291,200
ライク	4,300	1,865.00	8,019,500
ビジネス・ブレークスルー	6,500	437.00	2,840,500
エスプール	45,200	1,248.00	56,409,600
WDBホールディングス	7,400	3,560.00	26,344,000
手間いらず	2,000	6,000.00	12,000,000
ティア	10,400	482.00	5,012,800
CDG	1,400	1,490.00	2,086,000
アドウェイズ	23,800	847.00	20,158,600
バリューコマース	12,600	4,820.00	60,732,000
インフォマート	175,700	1,223.00	214,881,100
サッポロホールディングス	57,500	2,320.00	133,400,000
アサヒグループホールディングス	396,300	4,725.00	1,872,517,500
麒麟ホールディングス	619,200	1,899.00	1,175,860,800
宝ホールディングス	114,400	1,395.00	159,588,000
オエノンホールディングス	49,700	372.00	18,488,400
養命酒製造	5,800	1,802.00	10,451,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	118,200	1,533.00	181,200,600
サントリー食品インターナショナル	112,800	4,335.00	488,988,000
ダイドーグループホールディングス	8,700	5,410.00	47,067,000
伊藤園	51,200	7,420.00	379,904,000
キーコーヒー	16,800	2,193.00	36,842,400
ユニカフェ	6,000	1,082.00	6,492,000
ジャパンフーズ	1,700	1,216.00	2,067,200
日清オイリオグループ	21,200	3,000.00	63,600,000
不二製油グループ本社	36,600	2,528.00	92,524,800
かどや製油	1,100	4,080.00	4,488,000
J-オイルミルズ	16,100	1,746.00	28,110,600
ローソン	36,600	5,980.00	218,868,000
サンエー	12,500	4,305.00	53,812,500
カワチ薬品	12,800	2,262.00	28,953,600
エービーシー・マート	25,800	5,560.00	143,448,000
ハードオフコーポレーション	8,000	759.00	6,072,000
高千穂交易	6,900	1,243.00	8,576,700
アスクル	26,700	1,537.00	41,037,900
ゲオホールディングス	22,100	1,206.00	26,652,600
アダストリア	17,800	2,090.00	37,202,000
ジーフット	11,900	398.00	4,736,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,200	402.00	884,400
オルパヘルスケアホールディングス	1,800	1,548.00	2,786,400

伊藤忠食品	3,200	5,120.00	16,384,000	
くら寿司	17,200	3,770.00	64,844,000	
キャンドウ	7,900	2,560.00	20,224,000	
エレマテック	13,400	1,087.00	14,565,800	
アイケイ	4,700	496.00	2,331,200	
パルグループホールディングス	14,500	1,642.00	23,809,000	
JALUX	4,800	2,552.00	12,249,600	
エディオン	75,600	1,060.00	80,136,000	
あらた	13,200	4,060.00	53,592,000	
サーラコーポレーション	34,100	615.00	20,971,500	
ワッツ	8,200	751.00	6,158,200	
トーメンデバイス	2,500	6,370.00	15,925,000	
ハローズ	7,600	2,732.00	20,763,200	
J Pホールディングス	41,100	257.00	10,562,700	
フジオフードグループ本社	14,000	1,372.00	19,208,000	
あみやき亭	4,100	3,000.00	12,300,000	
東京エレクトロン デバイス	4,900	7,300.00	35,770,000	
ひらまつ	34,900	204.00	7,119,600	
フィールズ	14,500	523.00	7,583,500	
双日	182,400	1,688.00	307,891,200	
アルフレッサ ホールディングス	183,600	1,654.00	303,674,400	
大黒天物産	5,300	6,580.00	34,874,000	
ハニーズホールディングス	13,000	1,104.00	14,352,000	
ファーマライズホールディングス	3,700	796.00	2,945,200	
キッコーマン	121,300	9,350.00	1,134,155,000	
味の素	372,100	3,553.00	1,322,071,300	
ブルドックソース	7,100	2,130.00	15,123,000	
キュービー	88,600	2,492.00	220,791,200	
ハウス食品グループ本社	63,100	3,015.00	190,246,500	
カゴメ	64,000	2,957.00	189,248,000	
焼津水産化学工業	5,400	986.00	5,324,400	
アリアケジャパン	15,400	6,730.00	103,642,000	
ピエトロ	1,300	1,771.00	2,302,300	
エバラ食品工業	2,600	2,450.00	6,370,000	
やまみ	1,200	2,086.00	2,503,200	
ニチレイ	80,300	2,648.00	212,634,400	
横浜冷凍	47,200	874.00	41,252,800	
東洋水産	80,900	4,820.00	389,938,000	
イトアンドホールディングス	6,400	2,150.00	13,760,000	
大冷	2,500	1,921.00	4,802,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,800	769.00	6,767,200	
日清食品ホールディングス	66,100	8,910.00	588,951,000	
永谷園ホールディングス	8,000	2,030.00	16,240,000	
一正蒲鉾	7,100	906.00	6,432,600	
フジッコ	18,700	1,885.00	35,249,500	
ロック・フィールド	18,200	1,731.00	31,504,200	
日本たばこ産業	903,600	2,310.00	2,087,316,000	
ケンコーマヨネーズ	9,600	1,465.00	14,064,000	
わらべや日洋ホールディングス	11,100	2,057.00	22,832,700	
なとり	10,000	1,957.00	19,570,000	

イフジ産業	2,600	943.00	2,451,800
ピククルスコーポレーション	8,100	1,816.00	14,709,600
ファーマフーズ	15,900	2,514.00	39,972,600
北の達人コーポレーション	58,500	416.00	24,336,000
ユージェナ	85,600	842.00	72,075,200
紀文食品	9,800	1,114.00	10,917,200
スター・マイカ・ホールディングス	8,900	1,423.00	12,664,700
S R Eホールディングス	4,000	8,910.00	35,640,000
A Dワークスグループ	34,800	162.00	5,637,600
片倉工業	18,400	2,270.00	41,768,000
グンゼ	11,100	4,110.00	45,621,000
ヒューリック	395,000	1,117.00	441,215,000
神栄	2,300	1,008.00	2,318,400
ラサ商事	9,600	916.00	8,793,600
アルペン	12,700	2,420.00	30,734,000
ハブ	5,300	724.00	3,837,200
ラクーンホールディングス	11,600	1,638.00	19,000,800
クオールホールディングス	20,300	1,539.00	31,241,700
アルコニックス	17,500	1,616.00	28,280,000
神戸物産	128,300	4,175.00	535,652,500
ソリトンシステムズ	8,200	1,280.00	10,496,000
ジンズホールディングス	11,300	7,250.00	81,925,000
ビックカメラ	97,800	1,025.00	100,245,000
D C Mホールディングス	102,000	1,113.00	113,526,000
ペッパーフードサービス	22,200	379.00	8,413,800
ハイパー	2,200	552.00	1,214,400
Monotaro	209,000	2,385.00	498,465,000
東京一番フーズ	5,400	590.00	3,186,000
D Dホールディングス	8,500	530.00	4,505,000
あいホールディングス	23,600	2,139.00	50,480,400
ディーブイエックス	6,000	1,086.00	6,516,000
きちりホールディングス	5,500	518.00	2,849,000
アークランドサービスホールディングス	12,000	2,313.00	27,756,000
J . フロント リテイリング	197,300	1,041.00	205,389,300
ドトール・日レスホールディングス	28,500	1,619.00	46,141,500
マツキヨココカラ&カンパニー	101,600	4,970.00	504,952,000
ブロンコビリー	9,500	2,418.00	22,971,000
Z O Z O	113,700	3,620.00	411,594,000
トレジャー・ファクトリー	4,900	991.00	4,855,900
物語コーポレーション	8,800	7,580.00	66,704,000
三越伊勢丹ホールディングス	289,100	877.00	253,540,700
東洋紡	64,900	1,311.00	85,083,900
ユニチカ	44,800	308.00	13,798,400
富士紡ホールディングス	7,300	4,045.00	29,528,500
日清紡ホールディングス	102,400	893.00	91,443,200
倉敷紡績	14,100	1,891.00	26,663,100
ダイワボウホールディングス	80,300	1,888.00	151,606,400
シキボウ	8,900	921.00	8,196,900
日東紡績	25,000	3,355.00	83,875,000

トヨタ紡織	68,400	2,256.00	154,310,400
マクニカ・富士エレホールディングス	39,400	2,664.00	104,961,600
H a m e e	4,200	1,222.00	5,132,400
マーケットエンタープライズ	1,100	683.00	751,300
ラクト・ジャパン	5,700	2,567.00	14,631,900
ウエルシアホールディングス	87,400	4,325.00	378,005,000
クリエイトSDホールディングス	24,500	3,440.00	84,280,000
グリムス	7,300	2,777.00	20,272,100
パイタルケーエスケー・ホールディングス	29,000	763.00	22,127,000
八洲電機	12,500	926.00	11,575,000
メディアスホールディングス	9,700	935.00	9,069,500
レスターホールディングス	15,700	1,900.00	29,830,000
ジューテックホールディングス	4,200	1,105.00	4,641,000
丸善CHIホールディングス	21,900	377.00	8,256,300
大光	7,600	715.00	5,434,000
OCHIホールディングス	3,900	1,264.00	4,929,600
TOKAIホールディングス	80,400	869.00	69,867,600
黒谷	4,500	641.00	2,884,500
ミサワ	3,400	675.00	2,295,000
ティーライフ	2,200	1,406.00	3,093,200
Cominix	1,900	723.00	1,373,700
エー・ピーホールディングス	2,100	456.00	957,600
三洋貿易	16,700	1,001.00	16,716,700
チムニー	5,200	1,432.00	7,446,400
シュッピン	13,700	1,143.00	15,659,100
ビューティガレージ	2,600	4,000.00	10,400,000
オイシックス・ラ・大地	23,800	4,385.00	104,363,000
ウイン・パートナーズ	12,400	925.00	11,470,000
ネクステージ	33,400	2,255.00	75,317,000
ジョイフル本田	48,400	1,569.00	75,939,600
鳥貴族ホールディングス	6,000	1,954.00	11,724,000
ホットランド	12,600	1,344.00	16,934,400
すかいらーくホールディングス	213,300	1,509.00	321,869,700
SFPホールディングス	8,100	1,455.00	11,785,500
綿半ホールディングス	12,600	1,211.00	15,258,600
日本毛織	49,600	902.00	44,739,200
ダイトウボウ	26,900	99.00	2,663,100
トーア紡コーポレーション	4,500	432.00	1,944,000
ダイドーリミテッド	18,500	167.00	3,089,500
ヨシックスホールディングス	3,200	2,067.00	6,614,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	48,100	1,027.00	49,398,700
三栄建築設計	6,600	1,753.00	11,569,800
野村不動産ホールディングス	85,500	2,640.00	225,720,000
三重交通グループホールディングス	34,200	486.00	16,621,200
サムティ	26,600	2,570.00	68,362,000
ディア・ライフ	21,400	561.00	12,005,400
コーセーアールイー	4,300	669.00	2,876,700
日本商業開発	10,700	1,763.00	18,864,100

プレサンスコーポレーション	21,500	1,926.00	41,409,000
フィル・カンパニー	3,000	2,735.00	8,205,000
THEグローバル社	10,700	210.00	2,247,000
ハウスコム	1,300	1,261.00	1,639,300
日本管理センター	8,000	1,099.00	8,792,000
サンセイランディック	5,300	826.00	4,377,800
エストラスト	1,400	628.00	879,200
フージャースホールディングス	21,200	677.00	14,352,400
オープンハウス	52,600	6,950.00	365,570,000
東急不動産ホールディングス	487,500	626.00	305,175,000
飯田グループホールディングス	138,100	2,527.00	348,978,700
イーグランド	2,800	1,641.00	4,594,800
ムゲンエステート	11,300	483.00	5,457,900
帝国繊維	18,600	2,027.00	37,702,200
日本コークス工業	141,400	134.00	18,947,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,600	1,278.00	10,990,800
ミタチ産業	4,700	946.00	4,446,200
B E E N O S	8,300	2,505.00	20,791,500
あさひ	13,600	1,370.00	18,632,000
日本調剤	10,100	1,435.00	14,493,500
コスモス薬品	16,700	18,620.00	310,954,000
シップヘルスケアホールディングス	53,000	2,751.00	145,803,000
トーエル	8,300	787.00	6,532,100
ソフトクリエイトホールディングス	7,200	4,070.00	29,304,000
セブン&アイ・ホールディングス	646,800	4,962.00	3,209,421,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	79,000	732.00	57,828,000
明治電機工業	5,900	1,306.00	7,705,400
ツルハホールディングス	36,100	14,420.00	520,562,000
デリカフーズホールディングス	8,000	620.00	4,960,000
スターティアホールディングス	3,800	1,388.00	5,274,400
サンマルクホールディングス	13,000	1,534.00	19,942,000
フェリシモ	3,800	1,392.00	5,289,600
トリドールホールディングス	41,000	2,840.00	116,440,000
帝人	154,500	1,437.00	222,016,500
東レ	1,190,200	709.00	843,851,800
クラレ	240,200	1,027.00	246,685,400
旭化成	1,089,500	1,157.00	1,260,551,500
T O K Y O B A S E	15,100	753.00	11,370,300
稲葉製作所	9,600	1,347.00	12,931,200
宮地エンジニアリンググループ	5,100	2,597.00	13,244,700
トーカロ	42,700	1,344.00	57,388,800
アルファ	5,000	1,216.00	6,080,000
S U M C O	255,400	2,375.00	606,575,000
川田テクノロジーズ	3,400	3,880.00	13,192,000
R S T e c h n o l o g i e s	5,400	6,710.00	36,234,000
ジェイテックコーポレーション	1,800	2,107.00	3,792,600
信和	10,700	766.00	8,196,200
ビーロッド	11,400	541.00	6,167,400
ファーストブラザーズ	4,100	1,029.00	4,218,900

ハウストゥ	8,200	948.00	7,773,600
シーアールイー	4,600	1,710.00	7,866,000
プロパティエージェント	1,900	2,017.00	3,832,300
ケイアイスター不動産	7,400	8,150.00	60,310,000
アグレ都市デザイン	2,800	1,514.00	4,239,200
グッドコムアセット	7,100	1,300.00	9,230,000
ジェイ・エス・ビー	3,400	2,856.00	9,710,400
テンポイノベーション	4,800	909.00	4,363,200
グローバル・リンク・マネジメント	3,000	960.00	2,880,000
フェイスネットワーク	1,800	1,295.00	2,331,000
住江織物	2,300	1,743.00	4,008,900
日本フェルト	6,200	441.00	2,734,200
イチカワ	1,400	1,372.00	1,920,800
エコナックホールディングス	28,700	95.00	2,726,500
日東製網	1,400	1,465.00	2,051,000
芦森工業	2,600	976.00	2,537,600
アツギ	13,000	648.00	8,424,000
ウイルプラスホールディングス	2,600	1,036.00	2,693,600
JMホールディングス	11,100	1,843.00	20,457,300
コメダホールディングス	36,100	2,041.00	73,680,100
サツドラホールディングス	1,700	2,202.00	3,743,400
アレンザホールディングス	12,600	1,145.00	14,427,000
串カツ田中ホールディングス	4,300	2,295.00	9,868,500
パロックジャパンリミテッド	11,900	878.00	10,448,200
クスリのアオキホールディングス	16,400	7,680.00	125,952,000
ダイニック	4,000	753.00	3,012,000
共和レザー	10,700	655.00	7,008,500
ピーバンドットコム	2,400	664.00	1,593,600
力の源ホールディングス	8,800	617.00	5,429,600
FOOD & LIFE COMPANIES	96,800	4,835.00	468,028,000
アセンテック	5,600	1,351.00	7,565,600
セーレン	33,700	2,240.00	75,488,000
ソトー	7,100	847.00	6,013,700
東海染工	1,400	1,119.00	1,566,600
小松マテーレ	27,000	1,111.00	29,997,000
ワコールホールディングス	41,000	2,184.00	89,544,000
ホギメディカル	22,200	3,045.00	67,599,000
クラウドディアホールディングス	2,600	287.00	746,200
TSIホールディングス	54,500	370.00	20,165,000
マツオカコーポレーション	5,300	1,335.00	7,075,500
ワールド	21,400	1,479.00	31,650,600
TIS	157,100	3,260.00	512,146,000
JNSホールディングス	7,400	484.00	3,581,600
グリー	101,000	984.00	99,384,000
GMOペパボ	1,700	2,882.00	4,899,400
コーエーテクモホールディングス	52,600	5,160.00	271,416,000
三菱総合研究所	7,000	3,940.00	27,580,000
ボルテージ	4,200	394.00	1,654,800
電算	1,100	2,337.00	2,570,700

AGS	8,800	863.00	7,594,400
ファインデックス	13,900	937.00	13,024,300
ブレインパッド	4,300	5,920.00	25,456,000
KLab	30,000	706.00	21,180,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	23,900	1,015.00	24,258,500
イーブクイニシアティブジャパン	3,000	4,735.00	14,205,000
ネクソン	371,100	2,321.00	861,323,100
アイスタイル	49,900	333.00	16,616,700
エムアップホールディングス	4,700	3,865.00	18,165,500
エイチーム	11,300	1,827.00	20,645,100
エニグモ	17,700	1,110.00	19,647,000
テクノスジャパン	12,600	572.00	7,207,200
enish	9,900	404.00	3,999,600
コロブラ	54,000	761.00	41,094,000
オルトプラス	12,600	400.00	5,040,000
ブロードリーフ	81,600	580.00	47,328,000
クロス・マーケティンググループ	6,200	830.00	5,146,000
デジタルハーツホールディングス	7,500	2,297.00	17,227,500
システム情報	12,300	975.00	11,992,500
メディアドゥ	5,800	4,860.00	28,188,000
じげん	46,200	414.00	19,126,800
ブイキューブ	16,700	1,209.00	20,190,300
エンカレッジ・テクノロジー	4,100	643.00	2,636,300
サイバーリンクス	5,400	1,190.00	6,426,000
ディー・エル・イー	11,000	302.00	3,322,000
フィックスターズ	17,400	721.00	12,545,400
CARTA HOLDINGS	6,600	2,540.00	16,764,000
オプティム	11,500	1,691.00	19,446,500
セレス	6,000	2,404.00	14,424,000
SHIFT	8,300	27,420.00	227,586,000
特種東海製紙	10,200	4,225.00	43,095,000
ティーガイア	14,700	1,781.00	26,180,700
セック	2,500	2,470.00	6,175,000
テクマトリックス	27,800	1,849.00	51,402,200
プロシップ	5,500	1,659.00	9,124,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,600	2,232.00	99,547,200
GMOペイメントゲートウェイ	31,900	14,760.00	470,844,000
ザッパラス	6,600	526.00	3,471,600
システムリサーチ	4,900	1,920.00	9,408,000
インターネットイニシアティブ	43,900	4,700.00	206,330,000
さくらインターネット	17,800	580.00	10,324,000
ヴィンクス	4,800	954.00	4,579,200
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,600	4,510.00	16,236,000
SRAホールディングス	8,100	2,918.00	23,635,800
システムインテグレータ	5,400	625.00	3,375,000
朝日ネット	15,200	686.00	10,427,200
eBASE	19,700	703.00	13,849,100

アバント	17,700	1,379.00	24,408,300
アドソル日進	5,900	1,962.00	11,575,800
ODKソリューションズ	3,700	676.00	2,501,200
フリービット	9,800	1,287.00	12,612,600
コムチュア	18,400	3,390.00	62,376,000
サイバーコム	2,300	1,232.00	2,833,600
アステリア	11,800	703.00	8,295,400
アイル	9,200	1,624.00	14,940,800
王子ホールディングス	687,400	581.00	399,379,400
日本製紙	78,800	1,153.00	90,856,400
三菱製紙	25,000	338.00	8,450,000
北越コーポレーション	108,000	740.00	79,920,000
中越パルプ工業	6,600	1,136.00	7,497,600
巴川製紙所	5,200	853.00	4,435,600
大王製紙	79,500	2,030.00	161,385,000
阿波製紙	4,200	384.00	1,612,800
マークライNZ	8,300	3,235.00	26,850,500
メディカル・データ・ビジョン	20,800	1,407.00	29,265,600
gumi	22,700	879.00	19,953,300
ショーケース	3,500	549.00	1,921,500
モバイルファクトリー	3,600	1,040.00	3,744,000
テラスカイ	6,000	2,334.00	14,004,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,300	1,565.00	11,424,500
PCIホールディングス	7,400	1,032.00	7,636,800
パイブドHD	3,000	2,873.00	8,619,000
アイビーシー	2,700	904.00	2,440,800
ネオジャパン	4,700	1,295.00	6,086,500
PR TIMES	3,500	3,595.00	12,582,500
ラクス	56,700	3,575.00	202,702,500
ランドコンピュータ	2,500	814.00	2,035,000
ダブルスタンダード	4,900	3,590.00	17,591,000
オーブンドア	9,700	2,716.00	26,345,200
マイネット	5,700	635.00	3,619,500
アカツキ	7,300	3,220.00	23,506,000
ベネフィットジャパン	1,300	2,703.00	3,513,900
Ubicomホールディングス	4,300	2,872.00	12,349,600
カナミックネットワーク	17,500	594.00	10,395,000
ノムラシステムコーポレーション	8,700	282.00	2,453,400
レンゴー	155,500	819.00	127,354,500
トーモク	10,200	1,867.00	19,043,400
ザ・パック	12,500	2,831.00	35,387,500
チェンジ	30,200	1,864.00	56,292,800
シンクロ・フード	8,600	350.00	3,010,000
オークネット	8,800	1,800.00	15,840,000
キャピタル・アセット・プランニング	3,200	851.00	2,723,200
セグエグループ	4,300	752.00	3,233,600
エイトレッド	2,300	2,397.00	5,513,100
マクロミル	33,500	905.00	30,317,500
ピーグリー	3,900	1,622.00	6,325,800

オロ	5,200	3,790.00	19,708,000
ユーザーローカル	4,900	1,977.00	9,687,300
テモナ	3,400	693.00	2,356,200
ニーズウェル	3,800	679.00	2,580,200
マネーフォワード	25,000	7,720.00	193,000,000
サインポスト	5,300	1,686.00	8,935,800
昭和電工	142,500	2,917.00	415,672,500
住友化学	1,207,300	575.00	694,197,500
住友精化	7,400	3,230.00	23,902,000
日産化学	89,400	6,500.00	581,100,000
ラサ工業	5,700	1,870.00	10,659,000
クレハ	13,000	8,380.00	108,940,000
多木化学	6,400	5,950.00	38,080,000
テイカ	12,200	1,281.00	15,628,200
石原産業	27,300	1,269.00	34,643,700
片倉コープアグリ	2,600	1,165.00	3,029,000
日本曹達	21,000	3,330.00	69,930,000
東ソー	237,100	1,760.00	417,296,000
トクヤマ	52,400	1,989.00	104,223,600
セントラル硝子	26,900	2,058.00	55,360,200
東亜合成	93,500	1,251.00	116,968,500
大阪ソーダ	15,300	2,677.00	40,958,100
関東電化工業	35,900	1,071.00	38,448,900
デンカ	59,900	3,610.00	216,239,000
イビデン	88,100	6,840.00	602,604,000
信越化学工業	282,300	19,920.00	5,623,416,000
日本カーバイド工業	5,900	1,319.00	7,782,100
電算システムホールディングス	6,800	2,576.00	17,516,800
堺化学工業	11,400	2,231.00	25,433,400
第一稀元素化学工業	15,200	1,453.00	22,085,600
エア・ウォーター	155,600	1,827.00	284,281,200
日本酸素ホールディングス	158,000	2,685.00	424,230,000
日本化学工業	5,100	2,780.00	14,178,000
東邦アセチレン	2,800	1,222.00	3,421,600
日本パーカライジング	82,900	1,115.00	92,433,500
高圧ガス工業	26,400	766.00	20,222,400
チタン工業	1,900	1,809.00	3,437,100
四国化成工業	21,600	1,412.00	30,499,200
戸田工業	3,500	2,851.00	9,978,500
ステラ ケミファ	8,200	2,653.00	21,754,600
保土谷化学工業	5,200	5,170.00	26,884,000
日本触媒	27,600	5,490.00	151,524,000
大日精化工業	13,600	2,595.00	35,292,000
カネカ	42,500	4,125.00	175,312,500
協和キリン	197,000	3,675.00	723,975,000
三菱瓦斯化学	152,800	2,109.00	322,255,200
三井化学	149,200	3,280.00	489,376,000
J S R	153,200	4,170.00	638,844,000
東京応化工業	28,200	7,440.00	209,808,000
大阪有機化学工業	14,000	3,785.00	52,990,000

三菱ケミカルホールディングス	1,099,000	930.70	1,022,839,300	
KHネオケム	27,100	3,255.00	88,210,500	
ダイセル	236,800	824.00	195,123,200	
住友ベークライト	25,800	5,340.00	137,772,000	
積水化学工業	343,900	1,895.00	651,690,500	
日本ゼオン	148,200	1,317.00	195,179,400	
アイカ工業	45,800	3,410.00	156,178,000	
宇部興産	77,300	2,075.00	160,397,500	
積水樹脂	24,800	2,097.00	52,005,600	
タキロンシーアイ	35,600	558.00	19,864,800	
旭有機材	9,400	1,432.00	13,460,800	
ニチバン	9,800	1,829.00	17,924,200	
リケンテクノス	40,200	532.00	21,386,400	
大倉工業	8,500	2,130.00	18,105,000	
積水化成品工業	22,500	522.00	11,745,000	
群栄化学工業	3,900	3,140.00	12,246,000	
タイガースポリマー	10,100	415.00	4,191,500	
ミライアル	5,300	1,602.00	8,490,600	
ダイキアクシス	6,500	877.00	5,700,500	
ダイキョーニシカワ	34,900	647.00	22,580,300	
竹本容器	6,100	860.00	5,246,000	
森六ホールディングス	9,000	1,823.00	16,407,000	
恵和	4,100	4,930.00	20,213,000	
日本化薬	129,400	1,208.00	156,315,200	
カーリットホールディングス	16,200	751.00	12,166,200	
ソルクシーズ	14,000	492.00	6,888,000	
レグス	3,400	1,570.00	5,338,000	
プレステージ・インターナショナル	59,900	740.00	44,326,000	
フェイス	4,600	652.00	2,999,200	
プロトコーポレーション	17,500	1,360.00	23,800,000	
ハイマックス	4,500	1,149.00	5,170,500	
アミューズ	8,800	2,244.00	19,747,200	
野村総合研究所	318,300	4,695.00	1,494,418,500	
ドリームインキュベータ	4,400	776.00	3,414,400	
サイパネットシステム	11,700	691.00	8,084,700	
クイック	11,000	1,436.00	15,796,000	
TAC	10,000	237.00	2,370,000	
CEホールディングス	8,800	481.00	4,232,800	
日本システム技術	3,200	2,717.00	8,694,400	
電通グループ	165,300	4,230.00	699,219,000	
インテージホールディングス	20,600	1,913.00	39,407,800	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,500	1,225.00	9,187,500	
東邦システムサイエンス	4,900	999.00	4,895,100	
ぴあ	5,600	4,175.00	23,380,000	
イオンファンタジー	6,100	1,997.00	12,181,700	
ソースネクスト	70,500	202.00	14,241,000	
シーティーエス	18,100	815.00	14,751,500	
ネクシーズグループ	5,700	879.00	5,010,300	
インフォコム	18,000	2,150.00	38,700,000	
メディカルシステムネットワーク	16,000	692.00	11,072,000	

日本精化	13,300	1,993.00	26,506,900
扶桑化学工業	14,800	4,905.00	72,594,000
トリケミカル研究所	16,900	3,465.00	58,558,500
シンプレクス・ホールディングス	17,000	3,040.00	51,680,000
HEROZ	4,700	1,665.00	7,825,500
ラクスル	18,000	6,890.00	124,020,000
I P S	4,500	1,744.00	7,848,000
F I G	18,500	318.00	5,883,000
システムサポート	4,900	1,341.00	6,570,900
A D E K A	75,600	2,558.00	193,384,800
日油	56,100	5,970.00	334,917,000
ミヨシ油脂	7,200	1,304.00	9,388,800
新日本理化	27,000	289.00	7,803,000
ハリマ化成グループ	12,700	839.00	10,655,300
イーソル	10,100	773.00	7,807,300
アルテリア・ネットワークス	20,900	1,651.00	34,505,900
E D U L A B	1,600	1,525.00	2,440,000
東海ソフト	2,600	1,131.00	2,940,600
ウイングアーク1 s t	9,400	2,185.00	20,539,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,700	2,600.00	9,620,000
サーバーワークス	2,800	4,280.00	11,984,000
東名	1,700	1,205.00	2,048,500
ヴィッツ	1,500	1,545.00	2,317,500
トピラシステムズ	3,300	999.00	3,296,700
S a n s a n	14,600	13,590.00	198,414,000
L i n k - U	2,900	1,172.00	3,398,800
ギフトィ	14,300	3,555.00	50,836,500
花王	371,300	6,298.00	2,338,447,400
第一工業製薬	6,100	3,405.00	20,770,500
石原ケミカル	8,400	1,388.00	11,659,200
日華化学	5,700	881.00	5,021,700
ニイタカ	3,400	2,432.00	8,268,800
三洋化成工業	9,800	5,400.00	52,920,000
ベース	2,800	4,940.00	13,832,000
武田薬品工業	1,319,300	3,247.00	4,283,767,100
アステラス製薬	1,455,400	1,999.00	2,909,344,600
大日本住友製薬	103,700	1,524.00	158,038,800
塩野義製薬	211,100	7,296.00	1,540,185,600
わかもと製薬	19,800	316.00	6,256,800
日本新薬	43,900	8,620.00	378,418,000
中外製薬	525,000	4,112.00	2,158,800,000
科研製薬	26,300	4,270.00	112,301,000
エーザイ	200,900	8,155.00	1,638,339,500
理研ビタミン	17,600	1,757.00	30,923,200
ロート製薬	86,200	3,395.00	292,649,000
小野薬品工業	385,400	2,405.50	927,079,700
久光製薬	44,300	3,940.00	174,542,000
有機合成薬品工業	11,700	296.00	3,463,200
持田製薬	21,200	3,335.00	70,702,000

参天製薬	312,900	1,565.00	489,688,500
扶桑薬品工業	6,000	2,579.00	15,474,000
日本ケミファ	1,300	2,135.00	2,775,500
ツムラ	52,000	3,590.00	186,680,000
日医工	51,900	883.00	45,827,700
テルモ	475,000	4,858.00	2,307,550,000
H・U・グループホールディングス	41,900	2,652.00	111,118,800
キッセイ薬品工業	29,700	2,303.00	68,399,100
生化学工業	29,700	995.00	29,551,500
栄研化学	29,500	1,888.00	55,696,000
日水製薬	6,700	965.00	6,465,500
鳥居薬品	9,000	2,947.00	26,523,000
JCRファーマ	47,300	2,833.00	134,000,900
東和薬品	24,200	2,963.00	71,704,600
富士製薬工業	10,500	1,123.00	11,791,500
ゼリア新薬工業	30,600	2,058.00	62,974,800
第一三共	1,319,100	2,815.00	3,713,266,500
キョーリン製薬ホールディングス	33,700	1,776.00	59,851,200
大幸薬品	25,200	859.00	21,646,800
ダイト	10,700	3,070.00	32,849,000
大塚ホールディングス	348,900	4,395.00	1,533,415,500
大正製薬ホールディングス	40,000	5,900.00	236,000,000
ペプチドリーム	88,000	2,524.00	222,112,000
大日本塗料	20,400	836.00	17,054,400
日本ペイントホールディングス	617,700	1,240.00	765,948,000
関西ペイント	170,500	2,763.00	471,091,500
神東塗料	10,400	188.00	1,955,200
中国塗料	38,700	827.00	32,004,900
日本特殊塗料	12,500	974.00	12,175,000
藤倉化成	21,100	525.00	11,077,500
太陽ホールディングス	24,200	3,185.00	77,077,000
D I C	69,400	3,020.00	209,588,000
サカティンクス	32,800	1,084.00	35,555,200
東洋インキS Cホールディングス	34,800	2,007.00	69,843,600
T & K T O K A	13,600	796.00	10,825,600
アルプス技研	14,200	2,075.00	29,465,000
サニックス	27,900	331.00	9,234,900
ダイオーズ	4,400	1,027.00	4,518,800
日本空調サービス	17,500	794.00	13,895,000
オリエンタルランド	189,500	19,255.00	3,648,822,500
フォーカスシステムズ	11,100	1,036.00	11,499,600
ダスキン	37,200	2,678.00	99,621,600
パーク24	88,800	1,861.00	165,256,800
明光ネットワークジャパン	18,900	556.00	10,508,400
ファルコホールディングス	7,700	1,673.00	12,882,100
クレスコ	12,100	2,037.00	24,647,700
フジ・メディア・ホールディングス	158,400	1,281.00	202,910,400
秀英予備校	5,000	412.00	2,060,000
田谷	1,900	540.00	1,026,000
ラウンドワン	44,700	1,597.00	71,385,900

リゾートトラスト	73,500	2,181.00	160,303,500
オービック	51,900	20,400.00	1,058,760,000
ジャストシステム	23,400	5,660.00	132,444,000
TDCソフト	14,500	1,212.00	17,574,000
Zホールディングス	2,394,100	783.00	1,874,580,300
ビー・エム・エル	20,700	3,650.00	75,555,000
トレンドマイクロ	88,000	6,520.00	573,760,000
りらいあコミュニケーションズ	24,400	1,102.00	26,888,800
IDホールディングス	10,900	901.00	9,820,900
リソー教育	73,100	450.00	32,895,000
日本オラクル	33,400	10,210.00	341,014,000
早稲田アカデミー	9,200	1,031.00	9,485,200
アルファシステムズ	3,400	4,500.00	15,300,000
フューチャー	17,400	4,010.00	69,774,000
CAC Holdings	9,700	1,649.00	15,995,300
SBテクノロジー	7,100	2,977.00	21,136,700
トーセ	3,700	790.00	2,923,000
ユー・エス・エス	179,500	1,792.00	321,664,000
オービックビジネスコンサルタント	15,700	5,470.00	85,879,000
伊藤忠テクノソリューションズ	75,100	3,720.00	279,372,000
アイティフォー	19,900	880.00	17,512,000
東京個別指導学院	13,900	660.00	9,174,000
東計電算	2,000	4,840.00	9,680,000
サイバーエージェント	395,300	1,996.00	789,018,800
楽天グループ	823,600	1,181.00	972,671,600
エクスネット	3,300	996.00	3,286,800
クリーク・アンド・リバー社	8,400	2,007.00	16,858,800
モーニングスター	28,400	534.00	15,165,600
テー・オー・ダブリュー	28,600	352.00	10,067,200
大塚商会	89,100	5,200.00	463,320,000
サイボウズ	22,000	2,625.00	57,750,000
山田コンサルティンググループ	8,400	1,181.00	9,920,400
セントラルスポーツ	6,000	2,578.00	15,468,000
バラカ	4,600	1,602.00	7,369,200
電通国際情報サービス	23,800	3,960.00	94,248,000
ACCESS	18,600	861.00	16,014,600
デジタルガレージ	27,200	5,390.00	146,608,000
イーエムシステムズ	27,500	756.00	20,790,000
ウェザーニューズ	4,900	8,750.00	42,875,000
CIJ	11,300	840.00	9,492,000
ビジネスエンジニアリング	1,900	3,450.00	6,555,000
日本エンタープライズ	16,900	193.00	3,261,700
WOWOW	8,100	2,234.00	18,095,400
スカラ	14,600	712.00	10,395,200
インテリジェント ウェイブ	10,000	542.00	5,420,000
フルキャストホールディングス	13,700	2,918.00	39,976,600
エン・ジャパン	25,900	4,615.00	119,528,500
あすか製薬ホールディングス	19,200	1,001.00	19,219,200
サワイグループホールディングス	36,800	5,080.00	186,944,000
富士フイルムホールディングス	295,000	9,143.00	2,697,185,000

コニカミノルタ	366,400	500.00	183,200,000	
資生堂	312,700	7,298.00	2,282,084,600	
ライオン	202,600	1,821.00	368,934,600	
高砂香料工業	11,600	2,808.00	32,572,800	
マンダム	35,200	1,618.00	56,953,600	
ミルボン	20,700	6,930.00	143,451,000	
ファンケル	67,900	3,455.00	234,594,500	
コーセー	31,600	14,260.00	450,616,000	
コタ	10,800	1,552.00	16,761,600	
シーボン	1,400	1,802.00	2,522,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	71,600	2,299.00	164,608,400	
ノエビアホールディングス	14,300	5,640.00	80,652,000	
アジュバンホールディングス	4,000	1,226.00	4,904,000	
新日本製薬	4,600	1,624.00	7,470,400	
エステー	11,000	1,576.00	17,336,000	
アグロ カネショウ	5,700	1,310.00	7,467,000	
コニシ	27,600	1,711.00	47,223,600	
長谷川香料	29,000	2,804.00	81,316,000	
星光PMC	9,800	789.00	7,732,200	
小林製薬	47,000	9,330.00	438,510,000	
荒川化学工業	14,100	1,185.00	16,708,500	
メック	12,500	3,335.00	41,687,500	
日本高純度化学	4,800	2,801.00	13,444,800	
タカラバイオ	43,900	2,731.00	119,890,900	
JCU	18,900	4,715.00	89,113,500	
新田ゼラチン	11,900	618.00	7,354,200	
OATアグリオ	3,500	2,195.00	7,682,500	
デクセリアルズ	43,600	3,435.00	149,766,000	
アース製薬	13,800	6,600.00	91,080,000	
北興化学工業	15,500	944.00	14,632,000	
大成ラミック	4,100	2,833.00	11,615,300	
クミアイ化学工業	62,400	878.00	54,787,200	
日本農薬	30,600	526.00	16,095,600	
富士興産	4,200	1,070.00	4,494,000	
ニチレキ	21,400	1,262.00	27,006,800	
ユシロ化学工業	9,000	1,144.00	10,296,000	
ビービー・カストロール	6,400	1,401.00	8,966,400	
富士石油	44,700	249.00	11,130,300	
MORESCO	5,900	1,150.00	6,785,000	
出光興産	186,200	3,070.00	571,634,000	
ENEOSホールディングス	2,524,200	452.90	1,143,210,180	
コスモエネルギーホールディングス	48,500	2,344.00	113,684,000	
テスホールディングス	9,600	2,547.00	24,451,200	
インフロニア・ホールディングス	224,400	923.00	207,121,200	
横浜ゴム	97,200	1,868.00	181,569,600	
TOYO TIRE	88,300	1,875.00	165,562,500	
ブリヂストン	483,500	4,913.00	2,375,435,500	
住友ゴム工業	150,800	1,254.00	189,103,200	
藤倉コンポジット	13,400	728.00	9,755,200	
オカモト	10,000	4,065.00	40,650,000	

アキレス	10,900	1,293.00	14,093,700
フコク	7,600	981.00	7,455,600
ニッタ	17,400	2,647.00	46,057,800
クリエートメディック	4,600	980.00	4,508,000
住友理工	32,800	612.00	20,073,600
三ツ星ベルト	20,400	1,940.00	39,576,000
パンドー化学	27,500	885.00	24,337,500
A G C	154,100	5,660.00	872,206,000
日本板硝子	80,400	564.00	45,345,600
石塚硝子	3,200	2,061.00	6,595,200
有沢製作所	24,700	949.00	23,440,300
日本山村硝子	7,100	817.00	5,800,700
日本電気硝子	67,400	2,680.00	180,632,000
オハラ	6,600	1,508.00	9,952,800
住友大阪セメント	31,000	3,475.00	107,725,000
太平洋セメント	95,300	2,395.00	228,243,500
リソルホールディングス	1,900	4,150.00	7,885,000
日本ヒューム	17,500	720.00	12,600,000
日本コンクリート工業	33,300	282.00	9,390,600
三谷セキサン	7,800	7,190.00	56,082,000
アジアパイルホールディングス	26,200	445.00	11,659,000
東海カーボン	140,400	1,381.00	193,892,400
日本カーボン	8,600	4,340.00	37,324,000
東洋炭素	10,900	3,120.00	34,008,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,300	4,615.00	42,919,500
T O T O	119,900	5,440.00	652,256,000
日本碍子	181,800	1,965.00	357,237,000
日本特殊陶業	127,600	1,941.00	247,671,600
ダントーホールディングス	10,900	222.00	2,419,800
M A R U W A	5,800	13,420.00	77,836,000
品川リフラクトリーズ	3,900	3,615.00	14,098,500
黒崎播磨	2,900	4,160.00	12,064,000
ヨータイ	10,700	1,241.00	13,278,700
イソライト工業	7,500	854.00	6,405,000
東京窯業	22,300	319.00	7,113,700
ニッカトー	7,900	746.00	5,893,400
フジインコーポレーテッド	13,500	7,470.00	100,845,000
クニミネ工業	5,500	1,080.00	5,940,000
エーアンドエーマテリアル	2,600	947.00	2,462,200
ニチアス	38,800	2,643.00	102,548,400
日本製鉄	742,800	1,900.00	1,411,320,000
神戸製鋼所	309,500	601.00	186,009,500
中山製鋼所	26,200	449.00	11,763,800
合同製鐵	8,900	1,430.00	12,727,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	448,100	1,459.00	653,777,900
東京製鐵	56,500	1,252.00	70,738,000
共英製鋼	18,800	1,308.00	24,590,400
大和工業	31,700	3,540.00	112,218,000
東京鐵鋼	7,400	1,416.00	10,478,400

大阪製鐵	9,000	1,070.00	9,630,000
淀川製鋼所	21,900	2,380.00	52,122,000
丸一鋼管	58,800	2,550.00	149,940,000
モリ工業	4,900	2,562.00	12,553,800
大同特殊鋼	27,200	4,180.00	113,696,000
日本高周波鋼業	4,400	385.00	1,694,000
日本冶金工業	12,100	2,240.00	27,104,000
山陽特殊製鋼	17,100	1,961.00	33,533,100
愛知製鋼	9,400	2,599.00	24,430,600
日立金属	179,000	2,149.00	384,671,000
日本金属	4,200	1,010.00	4,242,000
大平洋金属	10,100	2,377.00	24,007,700
新日本電工	106,600	321.00	34,218,600
栗本鐵工所	7,700	1,537.00	11,834,900
虹 技	1,400	1,053.00	1,474,200
日本鑄鉄管	1,900	1,212.00	2,302,800
日本製鋼所	50,300	3,325.00	167,247,500
三菱製鋼	10,600	1,015.00	10,759,000
日亜鋼業	22,500	281.00	6,322,500
日本精線	2,700	4,470.00	12,069,000
エンビプロ・ホールディングス	7,000	2,197.00	15,379,000
大紀アルミニウム工業所	25,000	1,578.00	39,450,000
日本軽金属ホールディングス	42,000	1,758.00	73,836,000
三井金属鉱業	44,700	3,115.00	139,240,500
東邦亜鉛	9,200	2,450.00	22,540,000
三菱マテリアル	109,600	2,046.00	224,241,600
住友金属鉱山	212,100	4,436.00	940,875,600
DOWAホールディングス	45,200	4,760.00	215,152,000
古河機械金属	27,600	1,242.00	34,279,200
エス・サイエンス	80,600	30.00	2,418,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,100	927.00	17,705,700
東邦チタニウム	29,700	1,111.00	32,996,700
UACJ	25,200	2,645.00	66,654,000
CKサンエツ	3,500	3,275.00	11,462,500
古河電気工業	51,500	2,445.00	125,917,500
住友電気工業	620,400	1,532.50	950,763,000
フジクラ	184,900	575.00	106,317,500
昭和電線ホールディングス	14,400	1,831.00	26,366,400
東京特殊電線	1,700	2,754.00	4,681,800
タツタ電線	29,300	489.00	14,327,700
カナレ電気	2,500	1,714.00	4,285,000
平河ヒューテック	9,400	1,186.00	11,148,400
リョービ	20,300	1,134.00	23,020,200
アーレスティ	17,700	394.00	6,973,800
アサヒホールディングス	66,500	2,078.00	138,187,000
東洋製罐グループホールディングス	105,700	1,460.00	154,322,000
ホッカンホールディングス	9,400	1,470.00	13,818,000
コロナ	10,000	901.00	9,010,000
横河ブリッジホールディングス	28,500	2,163.00	61,645,500
駒井ハルテック	3,100	1,608.00	4,984,800

高田機工	800	2,695.00	2,156,000	
三和ホールディングス	156,400	1,293.00	202,225,200	
文化シャッター	52,800	1,053.00	55,598,400	
三協立山	21,500	747.00	16,060,500	
アルインコ	12,500	956.00	11,950,000	
東洋シャッター	2,600	635.00	1,651,000	
L I X I L	261,200	2,907.00	759,308,400	
日本ファイルコン	12,500	542.00	6,775,000	
ノーリツ	31,700	1,801.00	57,091,700	
長府製作所	17,000	2,045.00	34,765,000	
リンナイ	31,300	12,240.00	383,112,000	
ユニプレス	24,900	885.00	22,036,500	
ダイニチ工業	8,400	791.00	6,644,400	
日東精工	20,800	623.00	12,958,400	
三洋工業	1,400	1,872.00	2,620,800	
岡部	34,500	660.00	22,770,000	
ジーテクト	20,600	1,371.00	28,242,600	
東プレ	30,900	1,308.00	40,417,200	
高周波熱錬	29,600	576.00	17,049,600	
東京製綱	10,200	843.00	8,598,600	
サンコール	15,000	479.00	7,185,000	
モリテックスチール	12,900	407.00	5,250,300	
パイオラックス	24,600	1,651.00	40,614,600	
エイチワン	16,300	684.00	11,149,200	
日本発条	152,600	873.00	133,219,800	
中央発條	8,100	895.00	7,249,500	
アドバネクス	1,800	1,028.00	1,850,400	
三浦工業	71,800	4,295.00	308,381,000	
タクマ	56,200	1,520.00	85,424,000	
テクノプロ・ホールディングス	96,000	3,380.00	324,480,000	
アトラグループ	2,700	311.00	839,700	
インターワークス	3,900	406.00	1,583,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,400	8,280.00	61,272,000	
K e e P e r 技研	10,300	2,855.00	29,406,500	
ファーストロジック	3,400	771.00	2,621,400	
三機サービス	3,400	1,027.00	3,491,800	
G u n o s y	10,100	604.00	6,100,400	
デザインワン・ジャパン	3,900	223.00	869,700	
イー・ガーディアン	6,500	3,240.00	21,060,000	
リブセンス	10,100	228.00	2,302,800	
ジャパンマテリアル	49,300	1,527.00	75,281,100	
ベクトル	22,400	1,319.00	29,545,600	
ウチヤマホールディングス	8,600	362.00	3,113,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,900	1,447.00	17,219,300	
キャリアリンク	5,900	1,395.00	8,230,500	
I B J	13,100	1,088.00	14,252,800	
アサンテ	7,200	1,695.00	12,204,000	
バリューHR	6,500	2,024.00	13,156,000	
M & A キャピタルパートナーズ	13,200	5,660.00	74,712,000	

ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,437.00	8,909,400	
E R Iホールディングス	4,500	1,450.00	6,525,000	
アビスト	2,100	2,850.00	5,985,000	
シグマクシス・ホールディングス	9,600	3,220.00	30,912,000	
ウィルグループ	11,900	1,549.00	18,433,100	
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,500	192.00	4,128,000	
メドピア	12,300	3,055.00	37,576,500	
レアジョブ	3,000	1,182.00	3,546,000	
リクルートホールディングス	1,237,300	7,803.00	9,654,651,900	
エラン	22,000	1,255.00	27,610,000	
ツガミ	40,000	1,509.00	60,360,000	
オークマ	19,300	5,370.00	103,641,000	
芝浦機械	18,700	3,045.00	56,941,500	
アマダ	261,800	1,146.00	300,022,800	
アイダエンジニアリング	43,500	964.00	41,934,000	
滝澤鉄工所	4,400	1,124.00	4,945,600	
F U J I	76,500	2,503.00	191,479,500	
牧野フライス製作所	18,100	3,800.00	68,780,000	
オーエスジー	76,700	1,878.00	144,042,600	
ダイジェット工業	1,100	1,106.00	1,216,600	
旭ダイヤモンド工業	43,600	666.00	29,037,600	
D M G森精機	98,400	1,982.00	195,028,800	
ソディック	36,600	863.00	31,585,800	
ディスコ	24,500	33,100.00	810,950,000	
日東工器	9,200	1,868.00	17,185,600	
日進工具	13,200	1,575.00	20,790,000	
パンチ工業	13,900	569.00	7,909,100	
富士ダイス	7,100	642.00	4,558,200	
土木管理総合試験所	6,200	350.00	2,170,000	
ネットマーケティング	7,700	541.00	4,165,700	
日本郵政	2,094,500	849.50	1,779,277,750	
ベルシステム24ホールディングス	23,000	1,378.00	31,694,000	
鎌倉新書	18,200	976.00	17,763,200	
S M N	2,900	660.00	1,914,000	
一蔵	2,200	439.00	965,800	
グローバルキッズCOMPANY	3,000	890.00	2,670,000	
エアトリ	10,300	4,090.00	42,127,000	
アトラエ	11,200	2,567.00	28,750,400	
ストライク	6,000	5,880.00	35,280,000	
ソラスト	39,400	1,290.00	50,826,000	
セラク	5,000	2,028.00	10,140,000	
インソース	15,500	2,643.00	40,966,500	
豊田自動織機	135,900	9,800.00	1,331,820,000	
豊和工業	8,800	809.00	7,119,200	
O K K	6,800	383.00	2,604,400	
石川製作所	4,400	1,456.00	6,406,400	
東洋機械金属	11,700	546.00	6,388,200	
津田駒工業	2,600	795.00	2,067,000	
エンシュウ	4,300	701.00	3,014,300	

島精機製作所	24,200	2,146.00	51,933,200	
オプトラン	20,800	2,218.00	46,134,400	
NCホールディングス	4,700	1,609.00	7,562,300	
イワキ	11,100	1,064.00	11,810,400	
フリー	14,700	1,586.00	23,314,200	
ヤマシンフィルタ	33,400	618.00	20,641,200	
日阪製作所	21,200	836.00	17,723,200	
やまびこ	32,300	1,231.00	39,761,300	
野村マイクロ・サイエンス	4,400	4,925.00	21,670,000	
平田機工	7,800	6,890.00	53,742,000	
ペガサスミシン製造	17,200	513.00	8,823,600	
マルマエ	6,800	2,524.00	17,163,200	
タツモ	7,700	1,765.00	13,590,500	
ナプテスコ	94,600	3,790.00	358,534,000	
三井海洋開発	17,700	1,560.00	27,612,000	
レオン自動機	17,900	1,364.00	24,415,600	
S M C	49,200	71,560.00	3,520,752,000	
ホソカワミクロン	11,700	3,090.00	36,153,000	
ユニオンツール	6,300	4,110.00	25,893,000	
オイレス工業	23,500	1,669.00	39,221,500	
日精エー・エス・ビー機械	5,600	3,140.00	17,584,000	
サトーホールディングス	21,800	2,379.00	51,862,200	
技研製作所	14,700	4,430.00	65,121,000	
日本エアテック	7,600	1,199.00	9,112,400	
カワタ	5,300	961.00	5,093,300	
日精樹脂工業	11,800	1,087.00	12,826,600	
オカダアイヨン	5,600	1,259.00	7,050,400	
ワイエイシーホールディングス	6,600	939.00	6,197,400	
小松製作所	760,600	3,036.00	2,309,181,600	
住友重機械工業	96,000	2,859.00	274,464,000	
日立建機	67,200	3,670.00	246,624,000	
日工	23,400	656.00	15,350,400	
巴工業	6,700	2,230.00	14,941,000	
井関農機	15,500	1,671.00	25,900,500	
T O W A	14,300	3,050.00	43,615,000	
丸山製作所	2,600	1,494.00	3,884,400	
北川鉄工所	7,700	1,566.00	12,058,200	
シンニッタン	20,900	227.00	4,744,300	
ローツェ	8,300	12,380.00	102,754,000	
タカキタ	6,300	651.00	4,101,300	
クボタ	818,800	2,313.50	1,894,293,800	
荏原実業	7,700	2,623.00	20,197,100	
東洋エンジニアリング	22,000	785.00	17,270,000	
三菱化工機	5,400	2,490.00	13,446,000	
月島機械	31,100	1,150.00	35,765,000	
帝国電機製作所	12,000	1,406.00	16,872,000	
新東工業	37,500	723.00	27,112,500	
澁谷工業	14,700	2,986.00	43,894,200	
アイチコーポレーション	24,800	797.00	19,765,600	
小森コーポレーション	43,000	750.00	32,250,000	

鶴見製作所	13,100	1,731.00	22,676,100
住友精密工業	2,600	2,277.00	5,920,200
日本ギア工業	8,300	286.00	2,373,800
酒井重工業	3,000	2,557.00	7,671,000
荏原製作所	69,700	6,360.00	443,292,000
石井鐵工所	1,300	2,984.00	3,879,200
西島製作所	15,600	915.00	14,274,000
北越工業	16,100	995.00	16,019,500
ダイキン工業	213,800	25,385.00	5,427,313,000
オルガノ	4,800	7,030.00	33,744,000
トヨーカネツ	6,400	2,525.00	16,160,000
栗田工業	90,800	5,880.00	533,904,000
椿本チエイン	22,000	3,130.00	68,860,000
大同工業	7,600	1,026.00	7,797,600
日機装	50,400	1,002.00	50,500,800
木村化工機	14,000	738.00	10,332,000
レイズネクスト	25,600	1,239.00	31,718,400
アネスト岩田	26,400	903.00	23,839,200
ダイフク	92,400	9,590.00	886,116,000
サムコ	4,200	2,839.00	11,923,800
加藤製作所	8,100	818.00	6,625,800
油研工業	1,900	1,762.00	3,347,800
タダノ	87,700	1,150.00	100,855,000
フジテック	62,200	2,551.00	158,672,200
C K D	49,500	2,380.00	117,810,000
キトー	14,400	1,691.00	24,350,400
平和	46,900	2,000.00	93,800,000
理想科学工業	14,100	1,983.00	27,960,300
S A N K Y O	36,300	3,025.00	109,807,500
日本金銭機械	17,100	744.00	12,722,400
マースグループホールディングス	11,000	1,636.00	17,996,000
フクシマガリレイ	11,500	4,580.00	52,670,000
オーイズミ	6,800	387.00	2,631,600
ダイコク電機	7,800	1,232.00	9,609,600
竹内製作所	25,500	2,985.00	76,117,500
アマノ	43,900	2,673.00	117,344,700
J U K I	23,300	796.00	18,546,800
サンデンホールディングス	23,700	276.00	6,541,200
ジャノメ	14,300	680.00	9,724,000
ブラザー工業	205,000	2,136.00	437,880,000
マックス	22,500	1,855.00	41,737,500
モリタホールディングス	27,000	1,409.00	38,043,000
グローリー	43,100	2,295.00	98,914,500
新晃工業	15,700	1,942.00	30,489,400
大和冷機工業	24,300	1,289.00	31,322,700
セガサミーホールディングス	166,500	1,889.00	314,518,500
日本ピストンリング	6,200	1,287.00	7,979,400
リケン	7,200	2,604.00	18,748,800
T P R	22,600	1,453.00	32,837,800
ツバキ・ナカシマ	36,700	1,592.00	58,426,400

ホシザキ	49,100	9,050.00	444,355,000
大豊工業	13,700	771.00	10,562,700
日本精工	315,700	760.00	239,932,000
NTN	359,300	229.00	82,279,700
ジェイテクト	160,900	1,026.00	165,083,400
不二越	14,300	4,260.00	60,918,000
ミネベアミツミ	289,300	3,110.00	899,723,000
日本トムソン	45,600	609.00	27,770,400
THK	97,500	2,458.00	239,655,000
ユーシン精機	13,500	771.00	10,408,500
前澤給装工業	12,900	1,032.00	13,312,800
イーグル工業	20,800	1,110.00	23,088,000
前澤工業	10,100	664.00	6,706,400
日本ピラー工業	17,000	2,967.00	50,439,000
キッツ	56,800	762.00	43,281,600
日立製作所	807,300	7,109.00	5,739,095,700
東芝	293,400	4,937.00	1,448,515,800
三菱電機	1,678,500	1,525.50	2,560,551,750
富士電機	101,100	5,760.00	582,336,000
東洋電機製造	7,000	1,011.00	7,077,000
安川電機	180,600	5,130.00	926,478,000
シンフォニアテクノロジー	20,100	1,321.00	26,552,100
明電舎	28,400	2,745.00	77,958,000
オリジン	4,700	1,325.00	6,227,500
山洋電気	7,400	6,030.00	44,622,000
デンヨー	14,400	1,896.00	27,302,400
ベйкаレント・コンサルティング	11,300	52,700.00	595,510,000
Orchestra Holdings	3,100	4,945.00	15,329,500
アイモバイル	4,600	1,485.00	6,831,000
キャリアインデックス	5,500	1,018.00	5,599,000
MS-Japan	6,600	1,056.00	6,969,600
船場	1,800	782.00	1,407,600
グレイステクノロジー	20,700	550.00	11,385,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	50,900	2,296.00	116,866,400
フルテック	2,100	1,456.00	3,057,600
グリーンズ	6,000	538.00	3,228,000
ツナググループ・ホールディングス	3,500	315.00	1,102,500
GAMewith	4,800	524.00	2,515,200
ソールドアウト	3,900	1,310.00	5,109,000
MS&Consulting	2,400	787.00	1,888,800
ウェルビー	10,400	1,613.00	16,775,200
エル・ティー・エス	2,000	3,120.00	6,240,000
ミダックホールディングス	7,000	5,560.00	38,920,000
日総工産	12,400	780.00	9,672,000
キュービーネットホールディングス	7,400	1,921.00	14,215,400
RPAホールディングス	22,500	422.00	9,495,000
三櫻工業	23,100	964.00	22,268,400
マキタ	204,300	5,225.00	1,067,467,500

東芝テック	18,100	4,460.00	80,726,000
芝浦メカトロニクス	3,000	7,790.00	23,370,000
マブチモーター	39,300	3,800.00	149,340,000
日本電産	435,000	12,745.00	5,544,075,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,400	627.00	4,639,800
トレックス・セミコンダクター	8,400	2,652.00	22,276,800
東光高岳	9,300	1,419.00	13,196,700
ダブル・スコープ	48,200	872.00	42,030,400
宮越ホールディングス	6,300	1,146.00	7,219,800
ダイヘン	18,400	4,515.00	83,076,000
ヤーマン	27,300	1,320.00	36,036,000
JVCケンウッド	136,200	177.00	24,107,400
ミマキエンジニアリング	15,200	1,050.00	15,960,000
I - P E X	7,800	2,092.00	16,317,600
日新電機	39,400	1,459.00	57,484,600
大崎電気工業	31,000	508.00	15,748,000
オムロン	139,700	11,200.00	1,564,640,000
日東工業	22,300	1,575.00	35,122,500
I D E C	20,800	2,560.00	53,248,000
正興電機製作所	5,300	1,219.00	6,460,700
不二電機工業	2,600	1,268.00	3,296,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	56,000	2,139.00	119,784,000
サクサホールディングス	3,000	1,416.00	4,248,000
メルコホールディングス	4,700	4,335.00	20,374,500
テクノメディカ	4,200	1,699.00	7,135,800
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,700	2,004.00	9,418,800
日本電気	213,300	5,480.00	1,168,884,000
富士通	151,000	20,310.00	3,066,810,000
沖電気工業	68,100	976.00	66,465,600
岩崎通信機	7,000	877.00	6,139,000
電気興業	8,900	2,515.00	22,383,500
サンケン電気	15,700	5,650.00	88,705,000
ナカヨ	2,100	1,318.00	2,767,800
アイホン	9,600	2,249.00	21,590,400
ルネサスエレクトロニクス	908,600	1,448.00	1,315,652,800
セイコーエプソン	208,300	1,901.00	395,978,300
ワコム	130,100	817.00	106,291,700
アルバック	30,900	6,620.00	204,558,000
アクセル	7,100	791.00	5,616,100
E I Z O	13,000	4,145.00	53,885,000
ジャパンディスプレイ	571,400	37.00	21,141,800
日本信号	42,800	912.00	39,033,600
京三製作所	36,300	470.00	17,061,000
能美防災	22,300	2,027.00	45,202,100
ホーチキ	12,500	1,271.00	15,887,500
星和電機	6,600	526.00	3,471,600
エレコム	38,400	1,524.00	58,521,600
パナソニック	1,790,200	1,384.00	2,477,636,800
シャープ	191,300	1,330.00	254,429,000

アンリツ	108,000	1,942.00	209,736,000
富士通ゼネラル	45,600	2,752.00	125,491,200
ソニーグループ	1,051,500	13,800.00	14,510,700,000
T D K	243,100	4,495.00	1,092,734,500
帝国通信工業	7,700	1,363.00	10,495,100
タムラ製作所	64,600	750.00	48,450,000
アルプスアルパイン	148,400	1,102.00	163,536,800
池上通信機	4,900	766.00	3,753,400
日本電波工業	15,200	1,400.00	21,280,000
鈴木	7,600	962.00	7,311,200
メイコー	13,600	4,035.00	54,876,000
日本トリム	3,200	3,380.00	10,816,000
ローランド ディー . ジー .	9,900	2,829.00	28,007,100
フォスター電機	17,000	781.00	13,277,000
S M K	4,100	2,403.00	9,852,300
ヨコオ	12,400	2,350.00	29,140,000
ティアック	26,700	125.00	3,337,500
ホシデン	40,400	1,288.00	52,035,200
ヒロセ電機	25,900	18,880.00	488,992,000
日本航空電子工業	38,500	1,807.00	69,569,500
T O A	18,300	803.00	14,694,900
マクセル	33,400	1,339.00	44,722,600
古野電気	19,900	1,210.00	24,079,000
ユニデンホールディングス	3,700	3,390.00	12,543,000
スミダコーポレーション	15,700	1,295.00	20,331,500
アイコム	6,400	2,351.00	15,046,400
リオン	6,500	2,271.00	14,761,500
本多通信工業	13,800	441.00	6,085,800
横河電機	167,900	2,282.00	383,147,800
新電元工業	6,400	3,820.00	24,448,000
アズビル	98,300	4,965.00	488,059,500
東亜ディーケーケー	8,800	841.00	7,400,800
日本光電工業	69,400	3,395.00	235,613,000
チノー	5,700	1,501.00	8,555,700
共和電業	17,400	396.00	6,890,400
日本電子材料	8,100	2,373.00	19,221,300
堀場製作所	31,000	7,880.00	244,280,000
アドバンテスト	124,800	10,000.00	1,248,000,000
小野測器	4,700	512.00	2,406,400
エスベック	13,700	2,310.00	31,647,000
キーエンス	152,100	70,480.00	10,720,008,000
日置電機	8,000	8,860.00	70,880,000
シスメックス	141,900	13,660.00	1,938,354,000
日本マイクロニクス	29,100	1,566.00	45,570,600
メガチップス	15,600	4,200.00	65,520,000
O B A R A G R O U P	7,600	3,715.00	28,234,000
I M A G I C A G R O U P	14,300	675.00	9,652,500
澤藤電機	2,000	1,910.00	3,820,000
デンソー	369,600	8,380.00	3,097,248,000
原田工業	8,500	958.00	8,143,000

コーセル	20,500	928.00	19,024,000
イリソ電子工業	14,100	4,980.00	70,218,000
オブテックスグループ	27,500	1,481.00	40,727,500
千代田インテグレ	7,200	2,104.00	15,148,800
アイ・オー・データ機器	6,500	842.00	5,473,000
レーザーテック	73,700	27,305.00	2,012,378,500
スタンレー電気	117,400	3,075.00	361,005,000
岩崎電気	6,200	2,138.00	13,255,600
ウシオ電機	86,000	2,230.00	191,780,000
岡谷電機産業	9,900	340.00	3,366,000
ヘリオス テクノ ホールディング	15,300	301.00	4,605,300
エノモト	4,700	1,901.00	8,934,700
日本セラミック	15,600	2,886.00	45,021,600
遠藤照明	7,800	1,130.00	8,814,000
古河電池	11,900	1,520.00	18,088,000
双信電機	7,300	641.00	4,679,300
山一電機	12,200	2,015.00	24,583,000
図研	11,000	4,120.00	45,320,000
日本電子	34,900	9,080.00	316,892,000
カシオ計算機	121,400	1,600.00	194,240,000
ファナック	147,300	23,015.00	3,390,109,500
日本シイエムケイ	33,000	522.00	17,226,000
エンプラス	4,100	2,747.00	11,262,700
大真空	22,400	1,220.00	27,328,000
ローム	75,100	11,180.00	839,618,000
浜松ホトニクス	120,400	6,840.00	823,536,000
三井ハイテック	16,400	9,600.00	157,440,000
新光電気工業	49,300	5,040.00	248,472,000
京セラ	236,100	6,868.00	1,621,534,800
協栄産業	1,700	1,492.00	2,536,400
太陽誘電	81,400	6,120.00	498,168,000
村田製作所	493,000	8,439.00	4,160,427,000
双葉電子工業	28,900	735.00	21,241,500
日東電工	101,400	8,490.00	860,886,000
北陸電気工業	6,600	1,076.00	7,101,600
東海理化電機製作所	44,200	1,590.00	70,278,000
ニチコン	52,800	1,138.00	60,086,400
日本ケミコン	15,800	1,990.00	31,442,000
K O A	25,200	1,608.00	40,521,600
三井E & Sホールディングス	60,400	424.00	25,609,600
日立造船	141,800	856.00	121,380,800
三菱重工業	263,600	2,817.50	742,693,000
川崎重工業	122,400	2,032.00	248,716,800
I H I	104,700	2,645.00	276,931,500
名村造船所	49,600	216.00	10,713,600
サノヤスホールディングス	21,600	130.00	2,808,000
スプリックス	4,500	1,228.00	5,526,000
マネジメントソリューションズ	7,800	3,460.00	26,988,000
プロレド・パートナーズ	3,500	1,193.00	4,175,500
and factory	3,400	455.00	1,547,000

テノ・ホールディングス	2,000	784.00	1,568,000	
フロンティア・マネジメント	4,100	903.00	3,702,300	
ピアラ	2,600	709.00	1,843,400	
コプロ・ホールディングス	3,200	1,224.00	3,916,800	
ギークス	2,800	1,530.00	4,284,000	
カーブスホールディングス	43,900	895.00	39,290,500	
フォーラムエンジニアリング	11,300	856.00	9,672,800	
日本車輛製造	6,300	2,076.00	13,078,800	
三菱ロジスネクスト	22,300	1,086.00	24,217,800	
近畿車輛	1,800	1,051.00	1,891,800	
一家ホールディングス	2,800	578.00	1,618,400	
フルサト・マルカホールディングス	16,000	2,022.00	32,352,000	
ヤマエグループホールディングス	11,300	1,132.00	12,791,600	
F P G	55,500	619.00	34,354,500	
島根銀行	4,700	567.00	2,664,900	
じもとホールディングス	12,200	632.00	7,710,400	
全国保証	39,400	5,220.00	205,668,000	
めぶきフィナンシャルグループ	857,200	238.00	204,013,600	
ジャパンインベストメントアドバイザ	12,700	1,312.00	16,662,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	20,800	1,432.00	29,785,600	
九州フィナンシャルグループ	337,700	398.00	134,404,600	
かんぼ生命保険	166,500	1,838.00	306,027,000	
ゆうちょ銀行	391,600	864.00	338,342,400	
あんしん保証	5,100	327.00	1,667,700	
富山第一銀行	40,900	281.00	11,492,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	944,900	447.00	422,370,300	
ジェイリース	5,600	1,941.00	10,869,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	107,900	744.00	80,277,600	
イントラスト	7,000	799.00	5,593,000	
日本モーゲージサービス	9,300	1,080.00	10,044,000	
C A S A	5,900	909.00	5,363,100	
アルヒ	24,400	1,308.00	31,915,200	
プレミアグループ	8,300	3,890.00	32,287,000	
日産自動車	1,979,400	625.70	1,238,510,580	
いすゞ自動車	526,600	1,600.00	842,560,000	
トヨタ自動車	8,502,300	2,030.00	17,259,669,000	
日野自動車	209,500	1,076.00	225,422,000	
三菱自動車工業	620,700	381.00	236,486,700	
エフテック	11,800	532.00	6,277,600	
レシップホールディングス	7,300	575.00	4,197,500	
G M B	3,100	767.00	2,377,700	
ファルテック	2,600	707.00	1,838,200	
武蔵精密工業	37,400	1,888.00	70,611,200	
日産車体	24,800	735.00	18,228,000	
新明和工業	47,600	912.00	43,411,200	
極東開発工業	31,200	1,473.00	45,957,600	
トピー工業	13,900	1,115.00	15,498,500	

ティラド	4,800	2,948.00	14,150,400
曙ブレーキ工業	92,000	236.00	21,712,000
タチエス	29,400	1,393.00	40,954,200
NOK	81,200	1,309.00	106,290,800
フタバ産業	42,100	415.00	17,471,500
KYB	17,400	3,055.00	53,157,000
市光工業	20,200	562.00	11,352,400
大同メタル工業	32,600	602.00	19,625,200
プレス工業	82,500	399.00	32,917,500
ミクニ	22,700	314.00	7,127,800
太平洋工業	35,100	1,166.00	40,926,600
河西工業	20,800	330.00	6,864,000
アイシン	122,900	4,090.00	502,661,000
マツダ	526,600	1,040.00	547,664,000
今仙電機製作所	11,300	608.00	6,870,400
本田技研工業	1,321,500	3,238.00	4,279,017,000
スズキ	383,900	5,208.00	1,999,351,200
SUBARU	481,000	2,149.00	1,033,669,000
安永	8,200	1,072.00	8,790,400
ヤマハ発動機	219,000	3,100.00	678,900,000
小糸製作所	92,100	6,440.00	593,124,000
TBK	19,800	420.00	8,316,000
エクセディ	25,300	1,694.00	42,858,200
ミツバ	30,800	554.00	17,063,200
豊田合成	54,100	2,314.00	125,187,400
愛三工業	26,300	795.00	20,908,500
盟和産業	1,800	1,007.00	1,812,600
日本プラスト	13,400	612.00	8,200,800
ヨロズ	15,800	1,173.00	18,533,400
エフ・シー・シー	27,400	1,554.00	42,579,600
新家工業	4,300	1,652.00	7,103,600
シマノ	67,700	31,000.00	2,098,700,000
テイ・エス テック	70,800	1,430.00	101,244,000
三十三フィナンシャルグループ	15,700	1,382.00	21,697,400
第四北越フィナンシャルグループ	26,900	2,568.00	69,079,200
ひろぎんホールディングス	244,300	651.00	159,039,300
マーキュリアホールディングス	6,100	726.00	4,428,600
おきなわフィナンシャルグループ	15,000	2,368.00	35,520,000
ダイレクトマーケティングミックス	8,600	4,305.00	37,023,000
ポピンズホールディングス	3,700	3,580.00	13,246,000
LITALICO	13,000	3,635.00	47,255,000
十六フィナンシャルグループ	22,200	2,040.00	45,288,000
北國フィナンシャルホールディングス	15,300	2,007.00	30,707,100
ジャムコ	9,800	1,008.00	9,878,400
小野建	16,000	1,635.00	26,160,000
はるやまホールディングス	7,200	581.00	4,183,200
南陽	2,300	1,986.00	4,567,800
ノジマ	26,700	2,368.00	63,225,600
佐鳥電機	10,700	1,075.00	11,502,500
カップ・クリエイト	23,300	1,413.00	32,922,900

エコートレーディング	2,900	630.00	1,827,000
伯東	10,000	2,222.00	22,220,000
コンドーテック	13,200	994.00	13,120,800
中山福	8,000	387.00	3,096,000
ライトオン	12,600	690.00	8,694,000
ナガイレーベン	21,900	2,360.00	51,684,000
三菱食品	16,000	2,828.00	45,248,000
良品計画	190,100	2,102.00	399,590,200
三城ホールディングス	16,600	260.00	4,316,000
松田産業	12,000	3,115.00	37,380,000
第一興商	31,400	4,225.00	132,665,000
メディカルホールディングス	178,400	2,047.00	365,184,800
アドヴァングループ	17,000	961.00	16,337,000
S P K	6,900	1,361.00	9,390,900
萩原電気ホールディングス	6,200	2,137.00	13,249,400
アルビス	5,400	2,307.00	12,457,800
アズワン	11,900	15,210.00	180,999,000
スズデン	6,200	1,686.00	10,453,200
尾家産業	3,300	1,052.00	3,471,600
シモジマ	10,400	1,129.00	11,741,600
ドウシシャ	15,700	1,629.00	25,575,300
小津産業	2,600	1,908.00	4,960,800
コナカ	19,400	325.00	6,305,000
高速	10,000	1,520.00	15,200,000
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,660.00	2,158,000
G - 7ホールディングス	18,400	1,805.00	33,212,000
たけびし	6,400	1,453.00	9,299,200
イオン北海道	29,200	1,380.00	40,296,000
コジマ	28,300	589.00	16,668,700
ヒマラヤ	5,800	1,000.00	5,800,000
コーナン商事	23,500	3,535.00	83,072,500
ネットワンシステムズ	62,700	3,790.00	237,633,000
エコス	6,200	1,858.00	11,519,600
ワタミ	20,000	989.00	19,780,000
マルシェ	5,000	471.00	2,355,000
リックス	2,500	1,515.00	3,787,500
システムソフト	34,800	131.00	4,558,800
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	330,500	2,169.00	716,854,500
丸文	14,800	827.00	12,239,600
西松屋チェーン	36,200	1,515.00	54,843,000
ゼンショーホールディングス	80,700	2,663.00	214,904,100
ハビネット	13,900	1,530.00	21,267,000
幸楽苑ホールディングス	10,600	1,491.00	15,804,600
ハークスレイ	8,000	464.00	3,712,000
橋本総業ホールディングス	3,400	2,084.00	7,085,600
日本ライフライン	48,900	1,166.00	57,017,400
サイゼリヤ	24,500	3,025.00	74,112,500
タカヨー	12,600	817.00	10,294,200
V Tホールディングス	62,100	507.00	31,484,700

アルゴグラフィックス	12,900	3,015.00	38,893,500
魚力	4,800	1,996.00	9,580,800
I D O M	50,100	763.00	38,226,300
日本エム・ディ・エム	9,700	2,191.00	21,252,700
ポブラ	3,700	198.00	732,600
フジ・コーポレーション	8,900	1,204.00	10,715,600
ユナイテッドアローズ	17,300	2,031.00	35,136,300
進和	9,900	2,063.00	20,423,700
エスケイジャパン	4,000	479.00	1,916,000
ダイトロン	7,000	2,079.00	14,553,000
ハイデイ日高	23,900	1,642.00	39,243,800
シークス	23,700	1,295.00	30,691,500
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	9,100	220.00	2,002,000
コロワイド	67,800	1,649.00	111,802,200
ピーシーデポコーポレーション	19,300	463.00	8,935,900
田中商事	3,400	661.00	2,247,400
オーハシテクニカ	9,400	1,548.00	14,551,200
壱番屋	11,700	4,640.00	54,288,000
白銅	5,300	2,598.00	13,769,400
トップカルチャー	7,200	310.00	2,232,000
P L A N T	4,600	722.00	3,321,200
スギホールディングス	33,000	7,940.00	262,020,000
ダイコー通産	2,100	1,175.00	2,467,500
薬王堂ホールディングス	8,300	2,413.00	20,027,900
島津製作所	216,000	4,780.00	1,032,480,000
J M S	14,300	657.00	9,395,100
クボテック	3,400	299.00	1,016,600
長野計器	12,100	1,401.00	16,952,100
ブイ・テクノロジー	7,300	3,735.00	27,265,500
スター精密	25,900	1,478.00	38,280,200
東京計器	10,900	994.00	10,834,600
愛知時計電機	1,300	4,530.00	5,889,000
インターアクション	8,400	2,445.00	20,538,000
オーバル	15,400	252.00	3,880,800
東京精密	28,300	5,190.00	146,877,000
マニー	66,800	1,892.00	126,385,600
ニコン	256,300	1,155.00	296,026,500
トプコン	78,900	2,002.00	157,957,800
オリンパス	880,200	2,619.00	2,305,243,800
理研計器	13,600	3,095.00	42,092,000
S C R E E Nホールディングス	29,100	11,250.00	327,375,000
キヤノン電子	15,600	1,601.00	24,975,600
タムロン	13,100	2,557.00	33,496,700
H O Y A	327,500	17,465.00	5,719,787,500
シード	8,100	611.00	4,949,100
ノーリツ鋼機	15,100	2,478.00	37,417,800
エー・アンド・デイ	15,200	1,395.00	21,204,000
朝日インテック	184,000	2,835.00	521,640,000
キヤノン	834,100	2,583.00	2,154,480,300

リコー	465,900	1,107.00	515,751,300	
シチズン時計	196,400	465.00	91,326,000	
リズム	5,300	1,327.00	7,033,100	
大研医器	14,000	555.00	7,770,000	
メニコン	55,600	4,220.00	234,632,000	
シンシア	1,900	597.00	1,134,300	
中本パックス	4,800	1,694.00	8,131,200	
スノーピーク	10,900	6,150.00	67,035,000	
パラマウントベッドホールディングス	32,200	2,002.00	64,464,400	
トランザクション	9,200	1,140.00	10,488,000	
粧美堂	5,300	392.00	2,077,600	
ニホンフラッシュ	14,400	1,088.00	15,667,200	
前田工織	18,500	3,530.00	65,305,000	
永大産業	23,600	289.00	6,820,400	
アートネイチャー	14,700	676.00	9,937,200	
バンダイナムコホールディングス	150,400	9,148.00	1,375,859,200	
アイフィスジャパン	3,600	665.00	2,394,000	
共立印刷	29,400	155.00	4,557,000	
S H O E I	15,700	5,070.00	79,599,000	
フランスベッドホールディングス	22,300	898.00	20,025,400	
マーベラス	25,900	755.00	19,554,500	
パイロットコーポレーション	28,400	4,220.00	119,848,000	
萩原工業	11,000	1,451.00	15,961,000	
エイベックス	28,400	1,779.00	50,523,600	
トッパン・フォームズ	24,100	1,322.00	31,860,200	
フジシールインターナショナル	40,700	2,305.00	93,813,500	
タカラトミー	70,200	1,072.00	75,254,400	
広済堂ホールディングス	10,300	946.00	9,743,800	
エステールホールディングス	4,200	644.00	2,704,800	
レック	21,900	978.00	21,418,200	
タカノ	6,300	701.00	4,416,300	
三光合成	17,600	412.00	7,251,200	
プロネクサス	13,300	1,037.00	13,792,100	
ホクシン	11,700	173.00	2,024,100	
ウッドワン	5,200	1,004.00	5,220,800	
大建工業	9,900	2,427.00	24,027,300	
きもと	26,000	224.00	5,824,000	
凸版印刷	255,100	1,932.00	492,853,200	
大日本印刷	198,300	2,873.00	569,715,900	
共同印刷	5,300	2,746.00	14,553,800	
N I S S H A	34,400	1,724.00	59,305,600	
光村印刷	800	1,492.00	1,193,600	
藤森工業	15,100	4,310.00	65,081,000	
ヴィア・ホールディングス	21,500	178.00	3,827,000	
T A K A R A & C O M P A N Y	8,300	1,811.00	15,031,300	
前澤化成工業	10,900	1,300.00	14,170,000	
未来工業	6,300	1,643.00	10,350,900	
アシックス	148,400	2,907.00	431,398,800	
ツツミ	4,300	2,252.00	9,683,600	
ウェーブロックホールディングス	6,500	711.00	4,621,500	

JSP	10,000	1,560.00	15,600,000
ニチハ	23,300	3,055.00	71,181,500
ローランド	11,700	4,850.00	56,745,000
エフピコ	30,900	3,865.00	119,428,500
小松ウオール工業	5,400	1,957.00	10,567,800
ヤマハ	99,800	6,490.00	647,702,000
河合楽器製作所	4,700	3,475.00	16,332,500
クリナップ	16,000	516.00	8,256,000
ビジョン	101,400	2,477.00	251,167,800
天馬	14,100	2,592.00	36,547,200
兼松サステック	700	1,797.00	1,257,900
キングジム	14,300	889.00	12,712,700
象印マホービン	45,400	1,610.00	73,094,000
リンテック	36,100	2,536.00	91,549,600
信越ポリマー	30,200	1,014.00	30,622,800
東リ	45,000	232.00	10,440,000
イトーキ	30,900	363.00	11,216,700
任天堂	94,700	49,950.00	4,730,265,000
三菱鉛筆	27,700	1,265.00	35,040,500
松風	7,100	2,260.00	16,046,000
タカラスタANDARD	34,700	1,423.00	49,378,100
コクヨ	80,600	1,746.00	140,727,600
ナカバヤシ	16,400	541.00	8,872,400
ニフコ	56,100	3,635.00	203,923,500
立川ブラインド工業	7,700	1,166.00	8,978,200
グロープライド	15,000	3,560.00	53,400,000
オカムラ	57,700	1,394.00	80,433,800
バルカー	13,700	2,392.00	32,770,400
MUTOHホールディングス	1,300	1,613.00	2,096,900
伊藤忠商事	1,156,300	3,352.00	3,875,917,600
丸紅	1,630,500	1,010.00	1,646,805,000
スクロール	25,300	886.00	22,415,800
高島	1,800	2,097.00	3,774,600
ヨンドシーホールディングス	15,200	1,702.00	25,870,400
三陽商会	7,900	900.00	7,110,000
長瀬産業	90,800	1,736.00	157,628,800
ナイガイ	4,300	317.00	1,363,100
蝶理	9,300	1,806.00	16,795,800
豊田通商	166,000	5,340.00	886,440,000
オンワードホールディングス	98,300	363.00	35,682,900
三共生興	22,500	546.00	12,285,000
兼松	61,500	1,286.00	79,089,000
美津濃	16,600	2,387.00	39,624,200
ツカモトコーポレーション	1,900	1,350.00	2,565,000
ルックホールディングス	5,300	1,406.00	7,451,800
三井物産	1,283,700	2,495.50	3,203,473,350
日本紙パルプ商事	8,800	3,790.00	33,352,000
東京エレクトロン	106,500	56,520.00	6,019,380,000
カメイ	19,700	1,101.00	21,689,700
東都水産	900	4,545.00	4,090,500

OUGホールディングス	2,800	2,660.00	7,448,000	
スターゼン	12,400	2,035.00	25,234,000	
セイコーホールディングス	23,700	2,314.00	54,841,800	
山善	69,300	1,045.00	72,418,500	
椿本興業	2,200	3,785.00	8,327,000	
住友商事	1,043,400	1,631.00	1,701,785,400	
日本ユニシス	51,400	3,415.00	175,531,000	
内田洋行	7,100	4,830.00	34,293,000	
三菱商事	1,238,800	3,406.00	4,219,352,800	
第一実業	7,600	5,060.00	38,456,000	
キヤノンマーケティングジャパン	41,100	2,313.00	95,064,300	
西華産業	8,900	1,626.00	14,471,400	
佐藤商事	14,000	1,165.00	16,310,000	
菱洋エレクトロ	9,800	2,330.00	22,834,000	
東京産業	15,000	751.00	11,265,000	
ユアサ商事	15,600	2,920.00	45,552,000	
神鋼商事	3,700	3,345.00	12,376,500	
トルク	6,300	219.00	1,379,700	
阪和興業	33,100	3,335.00	110,388,500	
正栄食品工業	10,700	4,005.00	42,853,500	
カナデン	13,800	1,042.00	14,379,600	
菱電商事	13,300	1,732.00	23,035,600	
ニプロ	125,200	1,141.00	142,853,200	
岩谷産業	39,600	6,420.00	254,232,000	
ナイス	5,800	1,703.00	9,877,400	
ニチモウ	2,100	2,061.00	4,328,100	
極東貿易	4,800	2,417.00	11,601,600	
アステナホールディングス	23,200	562.00	13,038,400	
兼松エレクトロニクス	9,100	3,725.00	33,897,500	
三愛石油	40,700	1,307.00	53,194,900	
稲畑産業	36,300	1,589.00	57,680,700	
G S Iクレオス	8,000	867.00	6,936,000	
明和産業	15,100	825.00	12,457,500	
クワザワホールディングス	4,800	612.00	2,937,600	
キムラタン	100,900	21.00	2,118,900	
ゴールドウイン	29,700	7,120.00	211,464,000	
ユニ・チャーム	323,600	4,666.00	1,509,917,600	
デサント	32,100	4,560.00	146,376,000	
キング	8,300	540.00	4,482,000	
ワキタ	35,300	1,015.00	35,829,500	
ヤマトインターナショナル	15,300	312.00	4,773,600	
東邦ホールディングス	53,000	1,771.00	93,863,000	
サンゲツ	44,100	1,671.00	73,691,100	
ミツウロコグループホールディングス	24,400	1,275.00	31,110,000	
シナネンホールディングス	6,200	3,420.00	21,204,000	
伊藤忠エネクス	36,800	995.00	36,616,000	
サンリオ	51,100	2,663.00	136,079,300	
サンワテクノス	10,200	1,523.00	15,534,600	
リョーサン	18,200	2,233.00	40,640,600	
新光商事	25,000	865.00	21,625,000	

トーヨー	7,700	1,510.00	11,627,000
三信電気	7,800	1,526.00	11,902,800
東陽テクニカ	16,200	1,110.00	17,982,000
モスフードサービス	21,700	3,120.00	67,704,000
加賀電子	15,000	2,920.00	43,800,000
三益半導体工業	12,900	2,500.00	32,250,000
都築電気	8,500	1,835.00	15,597,500
ソーダニッカ	17,500	617.00	10,797,500
立花エレテック	13,400	1,580.00	21,172,000
木曽路	21,700	2,196.00	47,653,200
S R Sホールディングス	22,700	781.00	17,728,700
千趣会	29,800	400.00	11,920,000
タカキュー	15,100	130.00	1,963,000
リテールパートナーズ	20,000	1,237.00	24,740,000
ケーヨー	30,500	824.00	25,132,000
上新電機	18,900	2,206.00	41,693,400
日本瓦斯	80,300	1,443.00	115,872,900
ロイヤルホールディングス	28,300	2,058.00	58,241,400
東天紅	700	1,090.00	763,000
いなげや	20,500	1,396.00	28,618,000
チヨダ	16,100	763.00	12,284,300
ライフコーポレーション	15,400	3,570.00	54,978,000
リンガーハット	20,500	2,237.00	45,858,500
MrMaxHD	20,700	589.00	12,192,300
テナアライド	17,300	315.00	5,449,500
AOKIホールディングス	31,600	662.00	20,919,200
オークワ	26,000	1,083.00	28,158,000
コメリ	25,500	2,622.00	66,861,000
青山商事	33,800	741.00	25,045,800
しまむら	19,200	9,700.00	186,240,000
はせがわ	10,400	257.00	2,672,800
高島屋	120,200	1,143.00	137,388,600
松屋	33,300	979.00	32,600,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	78,200	886.00	69,285,200
近鉄百貨店	6,400	2,613.00	16,723,200
丸井グループ	139,800	2,234.00	312,313,200
クレディセゾン	106,100	1,271.00	134,853,100
アクシアル リテイリング	12,800	3,405.00	43,584,000
井筒屋	7,900	324.00	2,559,600
イオン	636,100	2,731.50	1,737,507,150
イズミ	29,800	3,465.00	103,257,000
フォーバル	7,400	1,151.00	8,517,400
平和堂	30,400	1,956.00	59,462,400
フジ	20,000	1,991.00	39,820,000
ヤオコー	18,800	6,740.00	126,712,000
ゼビオホールディングス	22,400	1,025.00	22,960,000
ケーズホールディングス	152,200	1,197.00	182,183,400
PALTAC	23,200	4,790.00	111,128,000
三谷産業	19,800	341.00	6,751,800
Olympicグループ	8,900	713.00	6,345,700

日産東京販売ホールディングス	26,700	234.00	6,247,800	
新生銀行	108,000	1,821.00	196,668,000	
あおぞら銀行	92,400	2,648.00	244,675,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,616,900	634.80	6,739,608,120	
りそなホールディングス	1,894,100	448.10	848,746,210	
三井住友トラスト・ホールディングス	313,000	3,877.00	1,213,501,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,145,900	3,828.00	4,386,505,200	
千葉銀行	552,400	707.00	390,546,800	
群馬銀行	317,200	348.00	110,385,600	
武蔵野銀行	24,700	1,706.00	42,138,200	
千葉興業銀行	39,400	262.00	10,322,800	
筑波銀行	65,200	165.00	10,758,000	
七十七銀行	51,700	1,180.00	61,006,000	
青森銀行	12,900	1,925.00	24,832,500	
秋田銀行	10,900	1,449.00	15,794,100	
山形銀行	18,600	821.00	15,270,600	
岩手銀行	10,800	1,632.00	17,625,600	
東邦銀行	137,900	200.00	27,580,000	
東北銀行	8,500	997.00	8,474,500	
みちのく銀行	11,000	875.00	9,625,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	139,400	2,076.00	289,394,400	
静岡銀行	403,100	893.00	359,968,300	
スルガ銀行	144,600	468.00	67,672,800	
八十二銀行	372,500	369.00	137,452,500	
山梨中央銀行	18,300	803.00	14,694,900	
大垣共立銀行	32,700	1,887.00	61,704,900	
福井銀行	14,300	1,491.00	21,321,300	
清水銀行	7,200	1,515.00	10,908,000	
富山銀行	2,100	1,883.00	3,954,300	
滋賀銀行	31,000	1,859.00	57,629,000	
南都銀行	25,900	1,941.00	50,271,900	
百五銀行	159,600	333.00	53,146,800	
京都銀行	59,200	5,060.00	299,552,000	
紀陽銀行	58,600	1,462.00	85,673,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	102,900	818.00	84,172,200	
山陰合同銀行	98,200	572.00	56,170,400	
中国銀行	132,200	847.00	111,973,400	
鳥取銀行	4,400	1,104.00	4,857,600	
伊予銀行	219,100	562.00	123,134,200	
百十四銀行	17,700	1,429.00	25,293,300	
四国銀行	25,700	732.00	18,812,400	
阿波銀行	25,400	2,053.00	52,146,200	
大分銀行	9,600	1,804.00	17,318,400	
宮崎銀行	10,500	1,995.00	20,947,500	
佐賀銀行	9,800	1,397.00	13,690,600	
琉球銀行	36,200	741.00	26,824,200	
セブン銀行	491,400	233.00	114,496,200	
みずほフィナンシャルグループ	2,117,200	1,535.50	3,250,960,600	
高知銀行	4,600	748.00	3,440,800	
山口フィナンシャルグループ	192,600	637.00	122,686,200	

芙蓉総合リース	17,400	7,450.00	129,630,000
みずほリース	25,600	3,150.00	80,640,000
東京センチュリー	32,100	6,210.00	199,341,000
SBIホールディングス	204,100	2,799.00	571,275,900
日本証券金融	65,000	827.00	53,755,000
アイフル	277,300	390.00	108,147,000
日本アジア投資	13,100	221.00	2,895,100
長野銀行	5,700	1,067.00	6,081,900
名古屋銀行	12,400	2,331.00	28,904,400
北洋銀行	249,300	233.00	58,086,900
愛知銀行	6,100	3,460.00	21,106,000
中京銀行	6,300	1,298.00	8,177,400
大光銀行	3,900	1,320.00	5,148,000
愛媛銀行	23,500	763.00	17,930,500
トマト銀行	6,800	1,034.00	7,031,200
京葉銀行	70,500	436.00	30,738,000
栃木銀行	80,800	177.00	14,301,600
北日本銀行	5,400	1,504.00	8,121,600
東和銀行	29,600	500.00	14,800,000
福島銀行	18,600	222.00	4,129,200
大東銀行	8,500	682.00	5,797,000
リコーリース	14,700	3,630.00	53,361,000
イオンフィナンシャルサービス	90,000	1,377.00	123,930,000
アコム	326,900	367.00	119,972,300
ジャックス	18,300	2,993.00	54,771,900
オリエントコーポレーション	447,100	144.00	64,382,400
オリックス	1,005,000	2,317.50	2,329,087,500
三菱HCキャピタル	611,500	574.00	351,001,000
ジャフコグループ	21,100	7,300.00	154,030,000
九州リースサービス	9,300	596.00	5,542,800
トモニホールディングス	128,000	301.00	38,528,000
大和証券グループ本社	1,239,900	641.30	795,147,870
野村ホールディングス	2,527,600	501.00	1,266,327,600
岡三証券グループ	130,000	375.00	48,750,000
丸三証券	49,200	560.00	27,552,000
東洋証券	53,300	153.00	8,154,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	189,500	385.00	72,957,500
光世証券	3,600	542.00	1,951,200
水戸証券	44,500	286.00	12,727,000
いちよし証券	31,000	636.00	19,716,000
松井証券	81,100	818.00	66,339,800
SOMPOホールディングス	291,800	4,858.00	1,417,564,400
日本取引所グループ	419,200	2,535.50	1,062,881,600
マネックスグループ	134,700	890.00	119,883,000
極東証券	22,300	752.00	16,769,600
岩井コスモホールディングス	15,700	1,316.00	20,661,200
アイザワ証券グループ	27,300	1,041.00	28,419,300
フィデアホールディングス	15,200	1,149.00	17,464,800
池田泉州ホールディングス	188,900	158.00	29,846,200

アニコム ホールディングス	50,700	868.00	44,007,600	
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	371,300	3,659.00	1,358,586,700	
マネーパートナーズグループ	17,600	249.00	4,382,400	
スパークス・グループ	76,100	310.00	23,591,000	
小林洋行	3,300	252.00	831,600	
第一生命ホールディングス	814,800	2,419.00	1,971,001,200	
東京海上ホールディングス	545,300	5,948.00	3,243,444,400	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,200	837.00	6,863,400	
イー・ギャランティ	24,300	2,594.00	63,034,200	
アサックス	7,900	703.00	5,553,700	
NECキャピタルソリューション	7,000	1,986.00	13,902,000	
T & Dホールディングス	429,400	1,411.00	605,883,400	
アドバンスクリエイト	7,900	1,035.00	8,176,500	
三井不動産	754,700	2,542.00	1,918,447,400	
三菱地所	1,087,700	1,667.00	1,813,195,900	
平和不動産	28,400	3,375.00	95,850,000	
東京建物	163,300	1,634.00	266,832,200	
ダイビル	42,000	1,488.00	62,496,000	
京阪神ビルディング	26,500	1,399.00	37,073,500	
住友不動産	347,300	3,929.00	1,364,541,700	
太平洋興発	6,800	639.00	4,345,200	
テーオーシー	29,900	614.00	18,358,600	
東京楽天地	2,200	4,080.00	8,976,000	
レオパレス21	171,400	233.00	39,936,200	
スターツコーポレーション	22,500	2,585.00	58,162,500	
フジ住宅	19,800	679.00	13,444,200	
空港施設	17,600	559.00	9,838,400	
明和地所	8,200	623.00	5,108,600	
ゴールドクレスト	13,100	1,498.00	19,623,800	
リログループ	87,600	2,195.00	192,282,000	
エスリード	6,600	1,660.00	10,956,000	
日神グループホールディングス	27,500	490.00	13,475,000	
日本エスコン	30,900	823.00	25,430,700	
タカラレーベン	70,100	292.00	20,469,200	
AVANTIA	8,800	856.00	7,532,800	
イオンモール	82,900	1,708.00	141,593,200	
毎日コムネット	3,900	776.00	3,026,400	
ファースト住建	6,400	1,206.00	7,718,400	
ランド	892,200	12.00	10,706,400	
カチタス	41,000	4,210.00	172,610,000	
東祥	11,900	2,172.00	25,846,800	
トーセイ	22,800	1,084.00	24,715,200	
穴吹興産	3,100	2,012.00	6,237,200	
サンフロンティア不動産	22,700	997.00	22,631,900	
FJネクストホールディングス	16,500	1,061.00	17,506,500	
インテリックス	3,900	716.00	2,792,400	
ランドビジネス	7,500	268.00	2,010,000	
サンネクスタグループ	6,000	985.00	5,910,000	
グランディハウス	11,700	488.00	5,709,600	

東武鉄道	163,900	2,807.00	460,067,300
相鉄ホールディングス	53,700	2,145.00	115,186,500
東急	423,300	1,714.00	725,536,200
京浜急行電鉄	215,400	1,280.00	275,712,000
小田急電鉄	249,600	2,336.00	583,065,600
京王電鉄	87,000	5,450.00	474,150,000
京成電鉄	116,800	3,600.00	420,480,000
富士急行	20,000	4,880.00	97,600,000
新京成電鉄	4,100	2,048.00	8,396,800
東日本旅客鉄道	295,400	7,118.00	2,102,657,200
西日本旅客鉄道	203,400	5,378.00	1,093,885,200
東海旅客鉄道	139,600	16,885.00	2,357,146,000
西武ホールディングス	219,000	1,284.00	281,196,000
鴻池運輸	27,000	1,220.00	32,940,000
西日本鉄道	46,600	2,745.00	127,917,000
ハマキョウレックス	11,900	3,040.00	36,176,000
サカイ引越センター	7,800	4,475.00	34,905,000
近鉄グループホールディングス	158,900	3,560.00	565,684,000
阪急阪神ホールディングス	198,700	3,565.00	708,365,500
南海電気鉄道	70,900	2,221.00	157,468,900
京阪ホールディングス	70,700	3,040.00	214,928,000
神戸電鉄	4,000	3,420.00	13,680,000
名古屋鉄道	130,600	1,945.00	254,017,000
山陽電気鉄道	12,500	2,006.00	25,075,000
アルプス物流	11,400	1,047.00	11,935,800
トランコム	4,500	8,720.00	39,240,000
日本通運	55,000	7,110.00	391,050,000
ヤマトホールディングス	222,800	2,753.00	613,368,400
山九	44,200	4,820.00	213,044,000
日新	12,800	1,696.00	21,708,800
丸運	10,700	263.00	2,814,100
丸全昭和運輸	13,000	3,445.00	44,785,000
センコーグループホールディングス	79,900	980.00	78,302,000
トナミホールディングス	2,900	4,175.00	12,107,500
ニッコンホールディングス	53,400	2,100.00	112,140,000
日本石油輸送	1,000	2,710.00	2,710,000
福山通運	26,200	4,215.00	110,433,000
セイノーホールディングス	108,200	1,350.00	146,070,000
エスライン	3,300	905.00	2,986,500
神奈川中央交通	4,100	3,430.00	14,063,000
日立物流	30,800	4,475.00	137,830,000
丸和運輸機関	33,600	1,482.00	49,795,200
C & F ロジホールディングス	16,100	1,610.00	25,921,000
日本郵船	132,900	7,650.00	1,016,685,000
商船三井	88,000	6,720.00	591,360,000
川崎汽船	48,900	5,200.00	254,280,000
NSユニテッド海運	8,700	3,325.00	28,927,500
明治海運	18,800	728.00	13,686,400
飯野海運	73,700	515.00	37,955,500
共栄タンカー	2,900	878.00	2,546,200

九州旅客鉄道	122,800	2,665.00	327,262,000
S Gホールディングス	300,500	2,618.00	786,709,000
日本航空	364,300	2,516.00	916,578,800
A N Aホールディングス	403,700	2,769.50	1,118,047,150
パスコ	3,100	1,421.00	4,405,100
T R Eホールディングス	21,900	1,701.00	37,251,900
人・夢・技術グループ	6,400	1,936.00	12,390,400
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,800	3,965.00	15,067,000
シルバーライフ	3,400	1,394.00	4,739,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,500	1,958.00	2,937,000
G e n k y D r u g S t o r e s	7,300	5,140.00	37,522,000
コア商事ホールディングス	12,400	658.00	8,159,200
国際紙パルプ商事	35,400	397.00	14,053,800
ナルミヤ・インターナショナル	3,800	1,206.00	4,582,800
ブックオフグループホールディングス	10,100	987.00	9,968,700
ギフト	2,600	3,030.00	7,878,000
三菱倉庫	50,400	3,020.00	152,208,000
三井倉庫ホールディングス	16,900	2,390.00	40,391,000
住友倉庫	56,200	1,902.00	106,892,400
澁澤倉庫	9,700	2,196.00	21,301,200
ヤマタネ	8,200	1,583.00	12,980,600
東陽倉庫	28,300	326.00	9,225,800
乾汽船	10,800	2,002.00	21,621,600
日本トランスシティ	35,200	582.00	20,486,400
ケイヒン	1,900	1,402.00	2,663,800
中央倉庫	10,300	952.00	9,805,600
川西倉庫	3,600	1,197.00	4,309,200
安田倉庫	13,900	951.00	13,218,900
ファイズホールディングス	3,500	695.00	2,432,500
東洋埠頭	3,300	1,415.00	4,669,500
宇徳	12,600	522.00	6,577,200
上組	87,500	2,253.00	197,137,500
サンリツ	5,300	831.00	4,404,300
キムラユニティー	4,900	1,272.00	6,232,800
キューソー流通システム	4,200	1,983.00	8,328,600
近鉄エクスプレス	30,100	2,909.00	87,560,900
東海運	10,100	312.00	3,151,200
エーアイテイナー	10,200	1,127.00	11,495,400
内外トランスライン	6,200	1,952.00	12,102,400
ショーエイコーポレーション	4,600	781.00	3,592,600
日本コンセプト	5,200	1,715.00	8,918,000
T B Sホールディングス	99,900	1,893.00	189,110,700
日本テレビホールディングス	137,300	1,296.00	177,940,800
朝日放送グループホールディングス	17,400	711.00	12,371,400
テレビ朝日ホールディングス	39,400	1,784.00	70,289,600
スカパーJ S A Tホールディングス	139,400	433.00	60,360,200
テレビ東京ホールディングス	11,900	2,201.00	26,191,900
日本B S放送	6,200	1,106.00	6,857,200
ビジョン	28,100	1,504.00	42,262,400

スマートバリュー	4,300	562.00	2,416,600	
USEN-NEXT HOLDINGS	15,700	3,565.00	55,970,500	
ワイヤレスゲート	6,700	356.00	2,385,200	
コネクシオ	11,700	1,461.00	17,093,700	
日本通信	136,300	238.00	32,439,400	
クロップス	2,600	995.00	2,587,000	
日本電信電話	1,926,600	3,212.00	6,188,239,200	
KDDI	1,200,800	3,392.00	4,073,113,600	
ソフトバンク	2,494,900	1,519.00	3,789,753,100	
光通信	19,400	18,230.00	353,662,000	
エムティーアイ	16,000	666.00	10,656,000	
GMOインターネット	58,300	3,175.00	185,102,500	
ファイバーゲート	5,300	1,323.00	7,011,900	
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	370.00	1,184,000	
KADOKAWA	48,000	6,550.00	314,400,000	
学研ホールディングス	23,100	1,114.00	25,733,400	
ゼンリン	26,800	1,035.00	27,738,000	
昭文社ホールディングス	4,800	496.00	2,380,800	
インプレスホールディングス	13,700	231.00	3,164,700	
東京電力ホールディングス	1,255,500	302.00	379,161,000	
中部電力	513,700	1,134.00	582,535,800	
関西電力	636,200	1,047.00	666,101,400	
中国電力	262,300	878.00	230,299,400	
北陸電力	153,100	540.00	82,674,000	
東北電力	392,500	744.00	292,020,000	
四国電力	151,200	705.00	106,596,000	
九州電力	345,800	816.00	282,172,800	
北海道電力	145,700	453.00	66,002,100	
沖縄電力	35,800	1,387.00	49,654,600	
電源開発	143,000	1,431.00	204,633,000	
エフオン	10,100	781.00	7,888,100	
イーレックス	24,700	2,496.00	61,651,200	
レノバ	32,700	5,420.00	177,234,000	
東京瓦斯	321,600	1,974.00	634,838,400	
大阪瓦斯	304,000	1,823.00	554,192,000	
東邦瓦斯	77,000	3,235.00	249,095,000	
北海道瓦斯	8,700	1,506.00	13,102,200	
広島ガス	33,700	363.00	12,233,100	
西部ガスホールディングス	18,900	2,176.00	41,126,400	
静岡ガス	43,700	1,115.00	48,725,500	
メタウォーター	18,900	2,027.00	38,310,300	
アイネット	8,800	1,376.00	12,108,800	
松竹	10,900	12,270.00	133,743,000	
東宝	97,200	5,580.00	542,376,000	
エイチ・アイ・エス	35,500	2,639.00	93,684,500	
東映	5,400	23,050.00	124,470,000	
ラックランド	4,800	2,954.00	14,179,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	438,700	2,451.00	1,075,253,700	

共立メンテナンス	28,600	4,505.00	128,843,000	
イチネンホールディングス	16,600	1,425.00	23,655,000	
建設技術研究所	9,700	2,664.00	25,840,800	
スペース	12,100	960.00	11,616,000	
アインホールディングス	24,000	6,230.00	149,520,000	
燦ホールディングス	7,100	1,480.00	10,508,000	
ピー・シー・エー	9,700	1,595.00	15,471,500	
スバル興業	800	8,290.00	6,632,000	
東京テアトル	6,900	1,230.00	8,487,000	
タナベ経営	5,000	736.00	3,680,000	
ビジネスブレイン太田昭和	5,800	1,891.00	10,967,800	
ナガワ	5,100	10,800.00	55,080,000	
東京都競馬	12,000	4,570.00	54,840,000	
常磐興産	6,800	1,425.00	9,690,000	
カナモト	28,200	2,429.00	68,497,800	
D T S	31,500	2,406.00	75,789,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	76,600	6,530.00	500,198,000	
シーイーシー	17,600	1,358.00	23,900,800	
カブコン	155,300	3,130.00	486,089,000	
西尾レントオール	14,800	2,886.00	42,712,800	
アイ・エス・ピー	7,700	1,126.00	8,670,200	
アゴーラ ホスピタリティグループ	79,300	24.00	1,903,200	
日本空港ビルデング	63,100	6,030.00	380,493,000	
トランス・コスモス	20,400	3,190.00	65,076,000	
乃村工藝社	68,600	1,094.00	75,048,400	
ジャステック	9,700	1,296.00	12,571,200	
S C S K	114,100	2,134.00	243,489,400	
藤田観光	7,000	2,516.00	17,612,000	
K N T - C Tホールディングス	10,000	1,786.00	17,860,000	
日本管財	17,300	2,774.00	47,990,200	
トーカイ	14,200	2,138.00	30,359,600	
白洋舎	1,100	1,875.00	2,062,500	
セコム	158,100	7,911.00	1,250,729,100	
日本システムウエア	6,300	2,333.00	14,697,900	
セントラル警備保障	7,700	2,637.00	20,304,900	
アイネス	14,900	1,451.00	21,619,900	
丹青社	32,700	906.00	29,626,200	
メイテック	19,400	7,040.00	136,576,000	
T K C	27,900	3,325.00	92,767,500	
富士ソフト	17,600	5,850.00	102,960,000	
応用地質	18,100	1,878.00	33,991,800	
船井総研ホールディングス	32,800	2,656.00	87,116,800	
N S D	53,000	2,166.00	114,798,000	
進学会ホールディングス	6,300	390.00	2,457,000	
丸紅建材リース	1,000	1,838.00	1,838,000	
オオバ	11,600	811.00	9,407,600	
コナミホールディングス	59,800	6,280.00	375,544,000	
いであ	4,400	1,893.00	8,329,200	

学究社	5,600	1,382.00	7,739,200
ベネッセホールディングス	53,400	2,402.00	128,266,800
イオンディライト	19,800	3,530.00	69,894,000
ナック	8,600	951.00	8,178,600
福井コンピュータホールディングス	7,600	3,990.00	30,324,000
ダイセキ	29,600	5,370.00	158,952,000
ステップ	6,100	1,800.00	10,980,000
日鉄物産	11,800	4,785.00	56,463,000
泉州電業	4,600	4,655.00	21,413,000
元気寿司	4,700	2,680.00	12,596,000
トラスコ中山	34,400	2,654.00	91,297,600
ヤマダホールディングス	603,500	438.00	264,333,000
オートバックスセブン	55,500	1,401.00	77,755,500
モリト	12,300	676.00	8,314,800
アークランドサカモト	25,800	1,701.00	43,885,800
ニトリホールディングス	65,600	21,225.00	1,392,360,000
グルメ杵屋	13,700	989.00	13,549,300
愛眼	8,500	202.00	1,717,000
ケーユーホールディングス	8,900	1,034.00	9,202,600
吉野家ホールディングス	57,700	2,348.00	135,479,600
加藤産業	24,000	3,165.00	75,960,000
北恵	4,500	979.00	4,405,500
イノテック	10,100	1,394.00	14,079,400
イエローハット	28,600	1,710.00	48,906,000
松屋フーズホールディングス	8,100	3,610.00	29,241,000
J B C Cホールディングス	11,300	1,714.00	19,368,200
J Kホールディングス	13,500	978.00	13,203,000
サガミホールディングス	25,300	1,038.00	26,261,400
日伝	13,800	2,249.00	31,036,200
関西スーパーマーケット	12,500	1,474.00	18,425,000
ミロク情報サービス	14,500	1,792.00	25,984,000
北沢産業	8,100	244.00	1,976,400
杉本商事	7,900	2,222.00	17,553,800
因幡電機産業	44,100	2,607.00	114,968,700
王将フードサービス	11,000	6,060.00	66,660,000
プレナス	18,700	1,956.00	36,577,200
ミニストップ	12,600	1,403.00	17,677,800
アークス	31,500	2,205.00	69,457,500
パローホールディングス	36,500	2,414.00	88,111,000
東テク	5,600	2,632.00	14,739,200
ミスミグループ本社	207,400	4,940.00	1,024,556,000
藤久	4,000	770.00	3,080,000
アルテック	11,600	309.00	3,584,400
ベルク	7,300	5,370.00	39,201,000
大 庄	9,100	1,010.00	9,191,000
タキヒヨー	5,100	1,746.00	8,904,600
ファーストリテイリング	22,100	76,230.00	1,684,683,000
ソフトバンクグループ	987,600	6,675.00	6,592,230,000
蔵王産業	2,100	1,867.00	3,920,700
スズケン	64,600	3,140.00	202,844,000

サンドラッグ	62,200	3,285.00	204,327,000	
サックスパー ホールディングス	16,000	584.00	9,344,000	
ジェコス	12,200	807.00	9,845,400	
ヤマザワ	2,900	1,714.00	4,970,600	
やまや	3,700	2,411.00	8,920,700	
グローセル	19,800	405.00	8,019,000	
ベルーナ	35,300	752.00	26,545,600	
合計	184,666,200		463,236,644,110	

(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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	11,418,472,218
コール・ローン	1,348,451,363
株式	656,072,262,273
投資信託受益証券	1,203,181,591
投資証券	14,026,369,540
派生商品評価勘定	592,470,663
未収入金	44,484,063
未収配当金	544,292,464
差入委託証拠金	4,265,016,268
流動資産合計	689,515,000,443
資産合計	
689,515,000,443	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,935,441
未払解約金	877,181,000
流動負債合計	887,116,441
負債合計	
887,116,441	
純資産の部	
元本等	
元本	115,916,372,811
剰余金	
剰余金又は欠損金()	572,711,511,191
元本等合計	688,627,884,002
純資産合計	688,627,884,002
負債純資産合計	689,515,000,443

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5月12日 至 2021年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	99,287,308,113円
同期中追加設定元本額	50,110,220,212円
同期中一部解約元本額	33,481,155,514円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	2,929,473,342円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,385,874円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	10,326,418円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	23,979,653円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,937,004円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,271,934円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,654,011円
たわらノーロード 先進国株式	26,589,926,542円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	348,631,332円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,628,711,132円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	525,147,861円
たわらノーロード バランス(堅実型)	59,511,040円
たわらノーロード バランス(標準型)	482,161,672円
たわらノーロード バランス(積極型)	590,715,567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)	915,567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)	135,703,270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)	386,485,184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)	286,878,311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)	439,343,515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)	818,790円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	12,612,070円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,688,254円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	9,305,678円
たわらノーロード 全世界株式	160,068,367円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	49,542,174,415円
One DC 先進国株式インデックスファンド	1,528,355,627円
Oneグローバルバランス	1,144,740円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	153,892,342円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	784,728,362円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,010,301,431円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	92,572,284円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	280,863,801円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	252,116,485円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,636,202円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	680,759,907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)	172,416,517円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	171,588,509円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	296,794,402円
投資のソムリエ	10,183,163,589円
クルーズコントロール	192,055,371円
投資のソムリエ<DC年金>	520,262,158円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	178,047,599円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	132,787,421円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,412,929円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,429,742円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	269,591,442円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,495,436,416円
ワールドアセットバランス(基本コース)	222,879,469円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	680,566,243円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	24,459,429円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,738,517円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,665,962円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	54,085,843円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	89,396,409円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,302,047,770円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	151,273,665円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	18,911,291円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,431,671円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,540,444円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	21,023,418円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	354,396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)	827,245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)	784,505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)	10,539,464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)	574,504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)	812,556円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04(適格機関投資家限定)	3,781,657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)	147,828,312円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	776,833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)	969,769,109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)	63,448,069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)	1,193,508,696円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,190,876,862円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,072,405,837円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	273,295,514円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	8,178,901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)	1,328,437円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4,323,412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)	32,388,112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)	56,124,322円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,297,529円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	22,959,143円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,068,717円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	485,151円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	4,534,571円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	28,415,614円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	211,967,482円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	316,238,293円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,032,332,581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)	90,560,304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)	54,681,191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)	340,211,628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)	14,285,340円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,923,222円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	132,274,372円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	11,958,156円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	40,705,098円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	64,238,633円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	143,147,794円
計	115,916,372,811円
2. 受益権の総数	115,916,372,811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 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	70,826,568,495	
投資信託受益証券	135,595,882	
投資証券	2,031,289,019	
合計	72,993,453,396	

(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(2021年2月16日から2021年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	194,523,207	-	195,796,525	1,273,318
イギリス・ポンド	121,652,300	-	122,847,909	1,195,609
オーストラリア・ドル	6,730,592	-	6,721,853	8,739
カナダ・ドル	35,573,480	-	35,628,880	55,400
ユーロ	4,534,650	-	4,562,455	27,805
買建	26,032,185	-	26,035,428	3,243
アメリカ・ドル	1,300,937,111	-	1,303,276,390	2,339,279
イギリス・ポンド	943,470,940	-	946,075,517	2,604,577
オーストラリア・ドル	63,223,670	-	63,093,302	130,368
カナダ・ドル	18,441,566	-	18,440,240	1,326
ユーロ	49,379,701	-	49,456,118	76,417
合計	226,421,234	-	226,211,213	210,021
合計	1,495,460,318	-	1,499,072,915	1,065,961

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

れている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2021年11月11日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	17,259,527,350	-	17,840,996,611	581,469,261
合計	17,259,527,350	-	17,840,996,611	581,469,261

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.9407円 (59,407円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年11月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	46,395	3,482.050	161,549,709.750	
	ABBOTT LABORATORIES	181,415	127.820	23,188,465.300	
	AES CORP	65,452	24.100	1,577,393.200	
	ABIOMED INC	4,985	355.570	1,772,516.450	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	91,076	120.220	10,949,156.720	
	ADVANCED MICRO DEVICES	124,360	139.870	17,394,233.200	
	ADOBE INC	48,790	647.500	31,591,525.000	
	CHUBB LTD	45,824	193.050	8,846,323.200	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22,710	314.270	7,137,071.700	
	ALLEGHANY CORP	1,454	690.880	1,004,539.520	
	ALLSTATE CORP	30,996	114.110	3,536,953.560	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	70,611	225.410	15,916,425.510	
AMGEN INC	58,717	213.210	12,519,051.570	
HESS CORP	27,192	81.800	2,224,305.600	
AMERICAN EXPRESS CO	69,709	181.390	12,644,515.510	
AMERICAN ELECTRIC POWER	51,773	84.180	4,358,251.140	
AFLAC INC	66,003	56.020	3,697,488.060	
AMERICAN INTL GROUP	88,351	58.860	5,200,339.860	
AMERCO	929	735.430	683,214.470	
ANALOG DEVICES	55,065	180.860	9,959,055.900	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	73,646	76.150	5,608,142.900	
VALERO ENERGY CORP	42,871	76.860	3,295,065.060	
ANSYS INC	9,108	392.660	3,576,347.280	
APPLE INC	1,705,503	147.920	252,278,003.760	
APPLIED MATERIALS INC	93,713	150.400	14,094,435.200	
ALBEMARLE CORP	11,129	265.750	2,957,531.750	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	58,037	65.390	3,795,039.430	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,236	64.530	725,059.080	
AMEREN CORP	25,054	84.420	2,115,058.680	
ARROW ELECTRONICS INC	8,279	121.360	1,004,739.440	
AUTOLIV INC	7,570	101.190	766,008.300	
AUTODESK INC	22,640	320.530	7,256,799.200	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	43,471	229.640	9,982,680.440	
AUTOZONE INC	2,250	1,881.420	4,233,195.000	
AVERY DENNISON CORP	7,898	222.590	1,758,015.820	
BALL CORP	34,396	91.250	3,138,635.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	134,892	285.320	38,487,385.440	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	86,023	59.160	5,089,120.680	
BAXTER INTERNATIONAL INC	52,203	79.020	4,125,081.060	
BECTON DICKINSON & CO	29,879	245.880	7,346,648.520	
AMETEK INC	24,164	139.420	3,368,944.880	
VERIZON COMM INC	421,837	52.600	22,188,626.200	
WR BERKLEY CORP	16,304	81.340	1,326,167.360	
BEST BUY CO INC	23,706	131.250	3,111,412.500	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,401	733.960	1,762,237.960	
YUM! BRANDS INC	30,538	125.800	3,841,680.400	
FIRSTENERGY CORP	53,250	38.960	2,074,620.000	
BOEING CO	56,949	218.500	12,443,356.500	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	116.220	1,306,080.360	
BORGWARNER INC	21,938	47.010	1,031,305.380	
BOSTON BEER COMPANY INC-CL A	860	470.460	404,595.600	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	146,350	42.450	6,212,557.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	15,040	92.860	1,396,614.400	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,180	182.750	2,225,895.000	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,435	1,544.730	3,761,417.550	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	229,499	59.390	13,629,945.610	
ONEOK INC	43,019	62.860	2,704,174.340	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	145.680	1,084,441.920	
UNITED RENTALS INC	7,145	379.980	2,714,957.100	
SEMPRA ENERGY	32,836	124.610	4,091,693.960	
FEDEX CORP	25,951	248.520	6,449,342.520	
VERISIGN INC	10,001	231.690	2,317,131.690	
AMPHENOL CORP	61,252	82.290	5,040,427.080	
BROWN-FORMAN CORP	33,368	72.610	2,422,850.480	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.440	625,555.840	
CSX CORP	232,763	35.470	8,256,103.610	
COTERRA ENERGY INC	71,747	20.270	1,454,311.690	
CAMPBELL SOUP CO	20,334	41.410	842,030.940	
CONSTELLATION BRANDS INC	17,548	222.340	3,901,622.320	
CARDINAL HEALTH INC	29,005	50.300	1,458,951.500	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	88,301	23.490	2,074,190.490	
CATERPILLAR INC	56,033	206.670	11,580,340.110	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,347	117.300	1,448,303.100	
CITRIX SYSTEMS INC	11,589	89.040	1,031,884.560	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	92,188	13.950	1,286,022.600	
CERNER CORP	29,663	74.360	2,205,740.680	
JPMORGAN CHASE & CO	308,951	167.620	51,786,366.620	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,345	90.400	2,200,788.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,567	123.550	1,799,752.850	
CINTAS CORP	9,763	433.910	4,236,263.330	
CISCO SYSTEMS INC	430,080	57.770	24,845,721.600	
CLOROX COMPANY	13,010	165.440	2,152,374.400	
COCA-COLA CO/THE	416,944	56.720	23,649,063.680	
COPART INC	22,238	151.960	3,379,286.480	
COGNEX CORP	16,685	80.560	1,344,143.600	
COLGATE-PALMOLIVE CO	82,579	78.480	6,480,799.920	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	28,762	160.990	4,630,394.380	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,363	302.680	1,925,952.840	
NRG ENERGY, INC.	27,425	34.970	959,052.250	
COMCAST CORP-CL A	468,764	54.170	25,392,945.880	
CONAGRA BRANDS INC	48,557	32.480	1,577,131.360	
CONSOLIDATED EDISON INC	36,290	77.960	2,829,168.400	

CMS ENERGY CORP	28,837	60.890	1,755,884.930	
COOPER COS INC	5,116	434.120	2,220,957.920	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	22,156	46.040	1,020,062.240	
CORNING INC	83,765	37.870	3,172,180.550	
SEALED AIR CORP	13,870	63.930	886,709.100	
HEICO CORP-CL A	7,477	138.270	1,033,844.790	
CUMMINS INC	15,275	237.710	3,631,020.250	
DR HORTON INC	36,409	95.020	3,459,583.180	
DANAHER CORP	65,493	302.030	19,780,850.790	
MOODY'S CORP	17,294	387.690	6,704,710.860	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	54,191	80.650	4,370,504.150	
TARGET CORP	50,629	254.050	12,862,297.450	
DEERE & CO	30,437	352.610	10,732,390.570	
MORGAN STANLEY	142,331	97.770	13,915,701.870	
REPUBLIC SERVICES INC	23,343	134.440	3,138,232.920	
COSTAR GROUP INC	40,900	82.210	3,362,389.000	
THE WALT DISNEY CO	185,703	174.450	32,395,888.350	
DOLLAR TREE INC	24,471	111.620	2,731,453.020	
DOVER CORP	15,418	174.750	2,694,295.500	
OMNICOM GROUP	21,323	69.190	1,475,338.370	
DTE ENERGY CO	18,647	113.170	2,110,280.990	
DUKE ENERGY CORP	78,546	101.620	7,981,844.520	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,936	151.690	1,962,261.840	
EBAY INC	70,089	73.230	5,132,617.470	
BANK OF AMERICA CORP	787,107	47.230	37,175,063.610	
CITIGROUP INC	210,643	68.210	14,367,959.030	
EASTMAN CHEMICAL CO	15,281	112.040	1,712,083.240	
EATON CORP PLC	40,644	171.870	6,985,484.280	
CADENCE DESIGN SYS INC	28,843	177.480	5,119,055.640	
DISH NETWORK CORP	21,420	36.480	781,401.600	
ECOLAB INC	26,431	233.380	6,168,466.780	
PERKINELMER INC	11,099	175.880	1,952,092.120	
ELECTRONIC ARTS INC	29,669	139.280	4,132,298.320	
SALESFORCE.COM INC	99,310	299.670	29,760,227.700	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	229.850	515,553.550	
EMERSON ELECTRIC CO	61,692	97.030	5,985,974.760	
ATMOS ENERGY CORP	14,992	94.070	1,410,297.440	
ENERGY CORP	19,079	103.440	1,973,531.760	
EOG RESOURCES INC	60,890	94.290	5,741,318.100	
EQUIFAX INC	12,663	277.290	3,511,323.270	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	23,693	345.110	8,176,691.230	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	18,139	125.520	2,276,807.280	
EXXON MOBIL CORP	432,803	64.190	27,781,624.570	
FMC CORP	14,467	105.810	1,530,753.270	
NEXTERA ENERGY INC	199,632	85.200	17,008,646.400	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,844	448.580	1,724,341.520	
FAIR ISAAC CORP	2,810	388.610	1,091,994.100	

ASSURANT INC	5,523	159.670	881,857.410	
FASTENAL CO	58,642	58.860	3,451,668.120	
FIFTH THIRD BANCORP	73,511	44.030	3,236,689.330	
M&T BANK CORP	14,107	156.390	2,206,193.730	
FISERV INC	61,667	100.250	6,182,116.750	
FORD MOTOR CO	404,029	19.360	7,822,001.440	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	35.010	935,257.140	
FREEPORT-MCMORAN INC	150,659	37.520	5,652,725.680	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	20,793	161.190	3,351,623.670	
DENTSPLY SIRONA INC	24,507	55.730	1,365,775.110	
GENERAL DYNAMICS CORP	24,588	201.330	4,950,302.040	
GENERAL MILLS INC	64,018	63.530	4,067,063.540	
GENUINE PARTS CO	14,520	134.190	1,948,438.800	
GILEAD SCIENCES INC	128,451	67.320	8,647,321.320	
GARTNER INC	9,029	329.530	2,975,326.370	
MCKESSON CORP	16,362	219.640	3,593,749.680	
NVIDIA CORP	254,793	294.590	75,059,469.870	
GENERAL ELECTRIC CO	112,388	108.960	12,245,796.480	
VW GRAINGER INC	4,765	481.010	2,292,012.650	
HALLIBURTON CO	84,523	23.830	2,014,183.090	
MONSTER BEVERAGE CORP	40,797	91.980	3,752,508.060	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	34,667	399.120	13,836,293.040	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,212	223.460	4,740,033.520	
HASBRO INC	14,615	97.650	1,427,154.750	
HENRY SCHEIN INC	14,358	78.180	1,122,508.440	
HEICO CORP	3,623	148.580	538,305.340	
HERSHEY FOODS CORP	14,916	179.560	2,678,316.960	
HP INC	130,740	31.520	4,120,924.800	
F5 NETWORKS INC	5,548	225.460	1,250,852.080	
CROWN HOLDINGS INC NPR	13,523	106.830	1,444,662.090	
JUNIPER NETWORKS INC	34,151	31.750	1,084,294.250	
HOLOGIC INC	24,690	71.440	1,763,853.600	
HOME DEPOT INC	108,641	368.580	40,042,899.780	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18,271	81.540	1,489,817.340	
HORMEL FOODS CORP	33,580	43.500	1,460,730.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	60,210	26.580	1,600,381.800	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,421	309.280	1,058,046.880	
HUMANA INC	13,279	448.510	5,955,764.290	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,576	193.480	1,659,284.480	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	153,872	15.890	2,445,026.080	
BIOGEN INC	15,570	266.930	4,156,100.100	
IDEX CORP	7,369	235.540	1,735,694.260	
ILLINOIS TOOL WORKS	32,246	234.710	7,568,458.660	
INTUIT INC	27,866	603.980	16,830,506.680	
IDEXX LABORATORIES INC	8,812	622.430	5,484,853.160	

TRANE TECHNOLOGIES PLC	24,706	189.450	4,680,551.700	
INTEL CORP	412,731	50.760	20,950,225.560	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	25,843	151.130	3,905,652.590	
INTERNATIONAL PAPER CO	35,544	49.700	1,766,536.800	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	43,532	36.090	1,571,069.880	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,946	145.520	1,883,901.920	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,620	161.760	1,070,851.200	
INCYTE CORP	18,028	65.390	1,178,850.920	
JOHNSON & JOHNSON	269,091	164.270	44,203,578.570	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34,801	72.490	2,522,724.490	
KLA CORPORATION	15,846	404.350	6,407,330.100	
DEVON ENERGY CORP	62,146	42.330	2,630,640.180	
KELLOGG CO	25,753	63.520	1,635,830.560	
KEYCORP	101,297	23.900	2,420,998.300	
KIMBERLY-CLARK CORP	34,975	134.710	4,711,482.250	
BLACKROCK INC/NEW YORK	15,515	959.210	14,882,143.150	
KROGER CO	74,030	42.470	3,144,054.100	
LAM RESEARCH CORP	14,601	605.780	8,844,993.780	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,949	442.980	2,192,308.020	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,881	135.450	1,202,931.450	
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,625	109.790	1,715,468.750	
PLUG POWER INC	54,206	40.180	2,177,997.080	
LENNAR CORP	29,258	105.070	3,074,138.060	
ELI LILLY & CO	83,458	264.650	22,087,159.700	
BATH & BODY WORKS INC	24,546	74.320	1,824,258.720	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	72.030	1,303,022.700	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	73,976	211.640	15,656,280.640	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	31,577	159.280	5,029,584.560	
LOCKHEED MARTIN CORP	25,515	337.630	8,614,629.450	
LOEWS CORP	22,394	57.220	1,281,384.680	
LOWE'S COS INC	72,322	232.550	16,818,481.100	
DOMINION ENERGY INC	83,114	75.680	6,290,067.520	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,345	46.060	1,904,350.700	
MCCORMICK & CO INC	24,703	82.310	2,033,303.930	
MCDONALD'S CORPORATION	76,008	253.130	19,239,905.040	
S&P GLOBAL INC	24,577	454.210	11,163,119.170	
EVEREST RE GROUP LTD	4,101	270.320	1,108,582.320	
MARKEL CORPORATION	1,367	1,301.540	1,779,205.180	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	64,009	118.770	7,602,348.930	

MARSH & MCLENNAN COS	52,000	165.150	8,587,800.000	
MASCO CORP	27,771	64.440	1,789,563.240	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	6,698	413.240	2,767,881.520	
METLIFE INC	76,162	63.350	4,824,862.700	
MEDTRONIC PLC	137,087	122.410	16,780,819.670	
ACTIVISION BLIZZARD INC	79,706	66.660	5,313,201.960	
CVS HEALTH CORP	134,663	92.960	12,518,272.480	
MERCK & CO. INC.	259,184	84.010	21,774,047.840	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	40,848	56.820	2,320,983.360	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,426	283.840	2,675,475.840	
MICROSOFT CORP	731,048	330.800	241,830,678.400	
MICRON TECH INC	115,671	73.410	8,491,408.110	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	56,999	80.960	4,614,639.040	
3M CO	59,159	182.420	10,791,784.780	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,963	175.000	1,043,525.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,187	387.600	2,010,481.200	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	17,571	247.050	4,340,915.550	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,697	310.560	2,700,940.320	
ILLUMINA INC	15,033	385.650	5,797,476.450	
XCEL ENERGY INC	56,415	64.390	3,632,561.850	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,713	91.870	892,333.310	
NETAPP INC	21,903	91.420	2,002,372.260	
NEWELL BRANDS INC	33,317	24.110	803,272.870	
NEWMONT CORP	82,658	58.170	4,808,215.860	
NOVAVAX INC	7,606	164.190	1,248,829.140	
NVR INC	352	5,114.950	1,800,462.400	
NIKE INC-CL B	130,536	168.260	21,963,987.360	
NORDSON CORP	5,870	263.770	1,548,329.900	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,677	281.710	7,233,467.670	
EVERSOURCE ENERGY	36,150	83.740	3,027,201.000	
NISOURCE INC	40,775	25.310	1,032,015.250	
NORTHERN TRUST CORP	21,006	123.450	2,593,190.700	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,673	362.100	5,675,193.300	
WELLS FARGO & CO	422,514	50.360	21,277,805.040	
NUCOR CORP	31,328	110.360	3,457,358.080	
CHENIERE ENERGY INC	24,614	104.590	2,574,378.260	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,350	156.280	7,243,578.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	97,764	31.820	3,110,850.480	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10,195	345.010	3,517,376.950	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,247	647.970	4,695,838.590	
ORACLE CORP	191,458	93.830	17,964,504.140	

PACCAR INC	36,232	89.460	3,241,314.720	
PTC INC	11,092	120.180	1,333,036.560	
EXELON CORP	100,657	54.450	5,480,773.650	
PARKER HANNIFIN CORP	13,435	326.790	4,390,423.650	
PAYCHEX INC	33,684	123.110	4,146,837.240	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,746	689.610	5,341,719.060	
PPL CORPORATION	75,032	28.780	2,159,420.960	
PEPSICO INC	140,456	164.040	23,040,402.240	
PENTAIR PLC	16,339	73.920	1,207,778.880	
PFIZER INC	572,642	49.020	28,070,910.840	
ESSENTIAL UTILITIES INC	24,458	47.350	1,158,086.300	
CONOCOPHILLIPS	139,139	73.000	10,157,147.000	
PG&E CORP	140,021	12.400	1,736,260.400	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	24,120	182.280	4,396,593.600	
ALTRIA GROUP INC	189,548	44.750	8,482,273.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	43,242	205.410	8,882,339.220	
BROWN & BROWN INC	24,295	63.190	1,535,201.050	
GARMIN LTD	14,761	143.030	2,111,265.830	
PPG INDUSTRIES INC	24,677	160.730	3,966,334.210	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	166.690	558,911.570	
COSTCO WHOLESALE CORP	45,099	505.510	22,797,995.490	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,567	213.060	5,021,185.020	
QUEST DIAGNOSTICS	12,499	144.780	1,809,605.220	
PROCTER & GAMBLE CO	249,556	146.820	36,639,811.920	
PROGRESSIVE CORP	60,150	95.710	5,756,956.500	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,270	62.720	3,090,214.400	
PULTE GROUP INC	25,385	50.620	1,284,988.700	
GLOBAL PAYMENTS INC	30,520	132.480	4,043,289.600	
QUALCOMM INC	115,175	159.800	18,404,965.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	18,189	99.540	1,810,533.060	
EXACT SCIENCES CORP	17,983	93.550	1,682,309.650	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,638	154.850	718,194.300	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,767	622.200	6,699,227.400	
RESMED INC	15,070	259.470	3,910,212.900	
US BANCORP	144,551	60.490	8,743,889.990	
SEAGEN INC	14,285	180.500	2,578,442.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,809	41.760	1,620,663.840	
ROSS STORES INC	37,180	118.670	4,412,150.600	
ROLLINS INC	25,899	35.760	926,148.240	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,780	485.910	5,238,109.800	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,070	333.480	4,025,103.600	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,882	88.750	2,030,777.500	

RPM INTERNATIONAL INC	12,897	91.290	1,177,367.130	
ACCENTURE PLC-CL A	64,583	364.740	23,556,003.420	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	143,078	62.730	8,975,282.940	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,411	231.350	2,871,284.850	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	26,020	158.220	4,116,884.400	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	63,656	118.390	7,536,233.840	
BOOKING HOLDINGS INC	4,206	2,569.780	10,808,494.680	
SCHLUMBERGER LTD	147,649	32.730	4,832,551.770	
SCHWAB (CHARLES) CORP	148,108	80.750	11,959,721.000	
POOL CORP	3,925	526.520	2,066,591.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	21,902	133.870	2,932,020.740	
BUNGE LTD	13,581	92.300	1,253,526.300	
SEI INVESTMENTS CO	14,469	64.390	931,658.910	
ANTHEM INC	25,083	424.940	10,658,770.020	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,485	125.680	2,071,834.800	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	29,675	68.460	2,031,550.500	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26,104	324.610	8,473,619.440	
CENTENE CORP	60,611	75.060	4,549,461.660	
SVB FINANCIAL GROUP	5,789	741.920	4,294,974.880	
SMITH (A.O.) CORP	14,015	78.440	1,099,336.600	
SNAP-ON INC	5,408	218.090	1,179,430.720	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	41,167	109.580	4,511,079.860	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	234.770	1,461,678.020	
EDISON INTERNATIONAL	40,904	65.460	2,677,575.840	
SOUTHERN CO	108,090	63.860	6,902,627.400	
TRUIST FINANCIAL CORP	137,775	63.890	8,802,444.750	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	49.690	656,901.800	
AT&T INC	729,484	24.950	18,200,625.800	
CHEVRON CORP	197,320	114.150	22,524,078.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	16,877	187.400	3,162,749.800	
STATE STREET CORP	36,094	97.550	3,520,969.700	
STARBUCKS CORP	120,203	113.250	13,612,989.750	
STEEL DYNAMICS INC	20,423	64.690	1,321,163.870	
STRYKER CORP	34,633	271.060	9,387,620.980	
NETFLIX INC	45,351	646.910	29,338,015.410	
NORTONLIFELOCK INC	55,388	24.980	1,383,592.240	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	59.000	937,333.000	
SYNOPSIS INC	15,794	337.660	5,333,002.040	
SYSCO CORP	52,800	78.550	4,147,440.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	36,345	359.490	13,065,664.050	
TELEFLEX INC	4,634	341.940	1,584,549.960	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	9.400	994,115.800	
TERADYNE INC	17,775	142.010	2,524,227.750	
TEXAS INSTRUMENTS INC	94,026	187.020	17,584,742.520	
TEXTRON INC	22,278	75.320	1,677,978.960	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	40,184	626.860	25,189,742.240	
GLOBE LIFE INC	10,611	92.770	984,382.470	
DAVITA INC	6,497	106.400	691,280.800	
TRACTOR SUPPLY CO	11,488	217.260	2,495,882.880	
BIO-TECHNE CORP	4,161	503.660	2,095,729.260	
TRIMBLE INC	24,682	85.460	2,109,323.720	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,014	534.130	2,143,997.820	
TYSON FOODS INC	28,083	82.540	2,317,970.820	
UGI CORP	19,377	44.760	867,314.520	
UNION PACIFIC CORP	67,714	241.540	16,355,639.560	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	154,858	90.180	13,965,094.440	
UNITEDHEALTH GROUP INC	96,311	459.900	44,293,428.900	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	129.370	1,000,935.690	
VF CORP	35,294	75.530	2,665,755.820	
VIACOMCBS INC	62,590	35.390	2,215,060.100	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,857	187.910	5,046,698.870	
VULCAN MATERIALS CO	12,739	200.280	2,551,366.920	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	76,167	48.970	3,729,897.990	
WALMART INC	157,692	148.440	23,407,800.480	
WASTE MANAGEMENT INC	43,162	162.080	6,995,696.960	
WATERS CORP	5,920	351.490	2,080,820.800	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,736	409.480	3,167,737.280	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,261	127.610	1,564,626.210	
VAIL RESORTS INC	4,318	355.930	1,536,905.740	
WESTERN DIGITAL CORP	29,830	55.260	1,648,405.800	
WABTEC CORP	18,377	96.360	1,770,807.720	
WHIRLPOOL CORP	7,030	221.110	1,554,403.300	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,892	160.310	2,547,646.520	
WYNN RESORTS LTD	9,809	92.020	902,624.180	
NASDAQ INC	11,126	207.380	2,307,309.880	
CME GROUP INC	36,809	221.080	8,137,733.720	
WILLIAMS COS INC	126,594	28.150	3,563,621.100	
LKQ CORP	28,725	56.830	1,632,441.750	
ALLIANT ENERGY CORP	28,464	56.080	1,596,261.120	
WEC ENERGY GROUP INC	33,440	90.640	3,031,001.600	
CARMAX INC	16,043	151.950	2,437,733.850	
XILINX INC	25,528	197.890	5,051,735.920	
TJX COMPANIES INC	124,021	68.960	8,552,488.160	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,598	581.800	3,256,916.400	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	5.660	615,242.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	60.000	1,236,000.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,581	176.250	2,041,151.250	
CBRE GROUP INC	34,563	104.940	3,627,041.220	
LIBERTY GLOBAL PLC	14,597	27.750	405,066.750	
REGIONS FINANCIAL CORP	97,214	24.170	2,349,662.380	
DOMINO'S PIZZA INC	3,715	495.150	1,839,482.250	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,275	537.600	2,298,240.000	
T-MOBILE US INC	63,747	119.550	7,620,953.850	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,060	40.040	1,323,722.400	
MOSAIC CO/THE	32,592	36.080	1,175,919.360	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,162	388.740	1,617,935.880	
CELANESE CORP	11,626	168.960	1,964,328.960	
DEXCOM INC	9,986	620.420	6,195,514.120	
DISCOVERY INC-A	20,231	27.360	553,520.160	
EXPEDIA GROUP INC	14,884	185.670	2,763,512.280	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,094	62.970	1,391,259.180	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,840	304.830	3,609,187.200	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	27.640	940,395.720	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	57,507	134.210	7,718,014.470	
LIVE NATION	15,697	115.010	1,805,311.970	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,900	1,812.010	5,254,829.000	
TRANSDIGM GROUP INC	5,382	677.250	3,644,959.500	
MASTERCARD INC	90,347	357.940	32,338,805.180	
WESTERN UNION CO	48,040	18.550	891,142.000	
OWENS CORNING	9,740	94.010	915,657.400	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	94.020	1,209,661.320	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	11.130	193,105.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	12,305	178.830	2,200,503.150	
DELTA AIR LINES INC	14,723	43.710	643,542.330	
INSULET CORP	6,387	307.680	1,965,152.160	
DISCOVER FINANCIAL	31,637	117.440	3,715,449.280	
TE CONNECTIVITY LTD	34,069	160.590	5,471,140.710	
MASIMO CORP	5,365	286.200	1,535,463.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,807	457.360	5,857,409.520	
VMWARE INC	19,705	124.950	2,462,139.750	
MERCADOLIBRE INC	4,618	1,592.220	7,352,871.960	
ULTA BEAUTY INC	5,259	391.340	2,058,057.060	

INVESCO LTD	39,794	25.530	1,015,940.820	
MSCI INC	8,493	642.000	5,452,506.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	158,971	94.380	15,003,682.980	
VISA INC	172,598	215.560	37,205,224.880	
KEURIG DR PEPPER INC	74,577	35.870	2,675,076.990	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	18,228	172.000	3,135,216.000	
DISCOVERY INC-C	30,388	26.390	801,939.320	
MARATHON PETROLEUM CORP	67,785	65.520	4,441,273.200	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,486	103.110	1,390,541.460	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	213,026	16.700	3,557,534.200	
XYLEM INC	19,136	132.270	2,531,118.720	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	28,312	92.830	2,628,202.960	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,818	193.820	933,824.760	
SPLUNK INC	17,202	164.410	2,828,180.820	
EPAM SYSTEMS INC	5,860	674.650	3,953,449.000	
ZILLOW GROUP INC	7,658	64.180	491,490.440	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	17,728	74.000	1,311,872.000	
HCA HEALTHCARE INC	27,673	245.270	6,787,356.710	
VERISK ANALYTICS INC	15,704	213.820	3,357,829.280	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,152	136.320	838,640.640	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,466	243.760	2,063,672.160	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	18,148	219.630	3,985,845.240	
NXP SEMICONDUCTOR NV	28,494	214.220	6,103,984.680	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	13,687	88.260	1,208,014.620	
LEAR CORP	5,733	177.520	1,017,722.160	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	127.860	1,345,982.220	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	23,036	79.150	1,823,299.400	
DOLLAR GENERAL CORP	24,467	220.770	5,401,579.590	
FORTINET INC	14,323	333.160	4,771,850.680	
HORIZON PHARMA PLC	20,678	108.190	2,237,152.820	
TESLA INC	83,707	1,067.950	89,394,890.650	
GENERAC HOLDINGS INC	6,138	440.390	2,703,113.820	
ENPHASE ENERGY INC	13,117	231.480	3,036,323.160	
GENERAL MOTORS CO	134,179	59.270	7,952,789.330	
ALLY FINANCIAL INC	39,108	49.460	1,934,281.680	
VOYA FINANCIAL INC	13,891	66.300	920,973.300	
APTIV PLC	28,088	171.420	4,814,844.960	
PHILLIPS 66	46,118	77.530	3,575,528.540	

GUIDEWIRE SOFTWARE INC	8,998	124.960	1,124,390.080	
META PLATFORMS INC	244,886	327.640	80,234,449.040	
IQVIA HOLDINGS INC	19,843	252.120	5,002,817.160	
SERVICENOW INC	20,220	670.910	13,565,800.200	
PALO ALTO NETWORKS INC	10,067	499.190	5,025,345.730	
WORKDAY INC	19,460	291.010	5,663,054.600	
ABBVIE INC	180,569	116.750	21,081,430.750	
ZOETIS INC	48,725	216.580	10,552,860.500	
NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	23.500	901,742.000	
CDW CORP	14,803	188.800	2,794,806.400	
HOWMET AEROSPACE INC	43,243	32.290	1,396,316.470	
TWILIO INC	16,764	297.280	4,983,601.920	
COUPA SOFTWARE INC	6,855	221.910	1,521,193.050	
SNAP INC	97,592	52.880	5,160,664.960	
TRADE DESK INC A	44,693	88.660	3,962,481.380	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,557	58.500	1,085,584.500	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	54.860	456,654.640	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	15,995	54.410	870,287.950	
OKTA INC	13,069	258.040	3,372,324.760	
BLACK KNIGHT INC	16,004	79.090	1,265,756.360	
BAKER HUGHES CO	69,453	24.080	1,672,428.240	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	58.580	772,142.980	
ALTICE USA INC-A	21,506	17.250	370,978.500	
BROADCOM INC	41,654	548.770	22,858,465.580	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	8,277	281.640	2,331,134.280	
MONGODB INC	5,843	554.960	3,242,631.280	
BURLINGTON STORES INC	6,573	292.630	1,923,456.990	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	32.980	1,334,008.020	
VEEVA SYSTEMS INC	14,280	313.780	4,480,778.400	
TWITTER INC	82,164	52.330	4,299,642.120	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	58.140	929,367.900	
EVERGY INC	22,104	64.690	1,429,907.760	
ALLEGION PLC	8,924	132.630	1,183,590.120	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	13,360	119.020	1,590,107.200	
STERIS PLC	10,537	231.960	2,444,162.520	
DOCUSIGN INC	20,091	255.660	5,136,465.060	
WIX.COM LTD	5,567	198.220	1,103,490.740	
DROPBOX INC	28,170	27.200	766,224.000	
KKR & CO INC	54,482	76.070	4,144,445.740	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	55.960	266,257.680	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	21,893	251.260	5,500,835.180	
MODERNA INC	34,960	228.960	8,004,441.600	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	29,081	146.530	4,261,238.930	
ARAMARK	20,857	38.490	802,785.930	

AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	53,186	38.290	2,036,491.940	
CIGNA CORP	35,431	217.840	7,718,289.040	
DELL TECHNOLOGIES INC	27,783	56.620	1,573,073.460	
DOW INC	77,436	58.760	4,550,139.360	
AMCOR PLC	153,824	12.340	1,898,188.160	
PINTEREST INC	52,639	45.860	2,414,024.540	
PELTON INTERACTIVE INC	24,387	48.950	1,193,743.650	
FOX CORP-A	35,798	40.690	1,456,620.620	
FOX CORP-B	15,080	37.810	570,174.800	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	31,617	22.150	700,316.550	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	19,488	281.560	5,487,041.280	
CHEWY INC	9,068	72.150	654,256.200	
AVANTOR INC	49,938	38.320	1,913,624.160	
LYFT INC	23,625	54.600	1,289,925.000	
DYNATRACE INC	20,409	72.390	1,477,407.510	
CLOUDFLARE INC	23,797	195.360	4,648,981.920	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	94.470	933,930.420	
CARRIER GLOBAL CORP	85,138	54.630	4,651,088.940	
OTIS WORLDWIDE CORP	41,822	83.360	3,486,281.920	
UBER TECHNOLOGIES INC	125,055	43.380	5,424,885.900	
CORTEVA INC	76,890	47.680	3,666,115.200	
MATCH GROUP INC	26,396	154.050	4,066,303.800	
BLACKSTONE INC	70,111	139.460	9,777,680.060	
CARLYLE GROUP INC	16,487	57.980	955,916.260	
10X GENOMICS INC	7,667	167.020	1,280,542.340	
DATADOG INC	19,036	188.800	3,593,996.800	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	19,472	99.020	1,928,117.440	
INGERSOLL RAND INC	41,830	58.390	2,442,453.700	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,898	491.600	2,407,856.800	
PPD INC	10,828	47.240	511,514.720	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	176.450	947,007.150	
AON PLC	23,124	297.720	6,884,477.280	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	57.180	914,994.360	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	139.580	985,993.120	
AIRBNB INC	12,671	192.220	2,435,619.620	
ZENDESK INC	11,915	100.640	1,199,125.600	
ROYALTY PHARMA PLC	16,861	41.580	701,080.380	
VIATRIS INC	114,640	14.540	1,666,865.600	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,765	99.980	2,176,064.700	
DRAFTKINGS INC	33,459	41.080	1,374,495.720	
SNOWFLAKE INC	19,742	361.080	7,128,441.360	
DOORDASH INC	7,641	214.240	1,637,007.840	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	36.130	330,372.720	
ARISTA NETWORKS INC	5,602	522.160	2,925,140.320	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	158,066	22.520	3,559,646.320	

IHS MARKIT LTD	38,954	124.460	4,848,214.840	
FNF GROUP	30,955	51.080	1,581,181.400	
MARVELL TECHNOLOGY INC	84,475	70.970	5,995,190.750	
CATALENT INC	18,081	123.660	2,235,896.460	
SYNCHRONY FINANCIAL	60,907	49.490	3,014,287.430	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	42,845	48.020	2,057,416.900	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	191.430	661,773.510	
WAYFAIR INC	7,829	240.930	1,886,240.970	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	19,558	183.610	3,591,044.380	
HUBSPOT INC	4,605	806.960	3,716,050.800	
QORVO INC	11,107	154.280	1,713,587.960	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	167.500	406,187.500	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	16,288	170.280	2,773,520.640	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	5,031	343.300	1,727,142.300	
GODADDY INC	16,574	71.110	1,178,577.140	
ETSY INC	13,199	248.580	3,281,007.420	
TRANSUNION	18,741	112.640	2,110,986.240	
SQUARE INC	40,167	227.210	9,126,344.070	
DUPONT DE NEMOURS INC	55,239	79.970	4,417,462.830	
CARVANA CO	7,521	287.260	2,160,482.460	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,941	57.030	1,308,325.230	
TELADOC HEALTH INC	14,744	137.040	2,020,517.760	
WESTROCK CO	26,297	49.030	1,289,341.910	
KRAFT HEINZ CO	64,743	37.490	2,427,215.070	
NOVOCURE LTD	9,772	102.930	1,005,831.960	
FORTIVE CORP	33,891	78.590	2,663,493.690	
WASTE CONNECTIONS INC	27,354	135.430	3,704,552.220	
ALPHABET INC-CL A	30,705	2,917.870	89,593,198.350	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	139,296	15.720	2,189,733.120	
PAYPAL HOLDINGS INC	113,989	204.640	23,326,708.960	
SEA LTD ADR	7,078	335.300	2,373,253.400	
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,417	34.510	1,394,790.670	
SUNRUN INC	16,213	53.960	874,853.480	
ZILLOW GROUP INC-C	15,665	64.270	1,006,789.550	
ALPHABET INC-CL C	29,781	2,932.520	87,333,378.120	
ZSCALER INC	8,506	337.110	2,867,457.660	
CABLE ONE INC	542	1,804.000	977,768.000	
LINDE PLC	53,048	336.620	17,857,017.760	
ATHENE HOLDING LTD	13,416	84.050	1,127,614.800	
ROKU INC	11,730	274.600	3,221,058.000	
AVALARA INC	8,515	157.860	1,344,177.900	

	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,491	701.250	9,460,563.750	
	VISTRA CORP	38,032	19.440	739,342.080	
アメリカ・ドル	小計	32,101,682		4,212,042,560.110 (480,004,370,150)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	14.210	501,058.810	
	ASHTAD GROUP	46,709	63.020	2,943,601.180	
	SEVERN TRENT PLC	29,888	27.810	831,185.280	
	BHP GROUP PLC	217,345	19.010	4,131,728.450	
	BARCLAYS PLC	1,766,992	1.927	3,404,993.580	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	97,947	6.624	648,800.920	
	BT GROUP PLC	864,218	1.651	1,426,823.910	
	BUNZL PLC	34,184	27.460	938,692.640	
	AVIVA PLC	422,785	4.056	1,714,815.960	
	CRODA INTERNATIONAL	15,033	96.580	1,451,887.140	
	DIAGEO PLC	238,449	37.660	8,979,989.340	
	SCHRODERS PLC	11,354	37.200	422,368.800	
	DCC PLC	7,898	61.420	485,095.160	
	NATIONAL GRID PLC	366,500	9.647	3,535,625.500	
	KINGFISHER PLC	211,460	3.403	719,598.380	
	BAE SYSTEMS PLC	307,253	5.700	1,751,342.100	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	223,164	25.805	5,758,747.020	
	HALMA PLC	38,776	30.270	1,173,749.520	
	NEXT PLC	13,140	82.620	1,085,626.800	
	IMPERIAL BRANDS PLC	91,865	15.485	1,422,529.520	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	27.630	527,926.410	
	ANGLO AMERICAN PLC	133,485	27.365	3,652,817.020	
	COMPASS GROUP PLC	187,013	15.940	2,980,987.220	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,090,621	4.313	9,016,848.370	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	637,652	2.935	1,871,508.620	
	UNILEVER PLC	267,570	39.180	10,483,392.600	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	10.670	722,508.380	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	41,685	20.580	857,877.300	
	PEARSON PLC	87,535	6.346	555,497.110	
	PERSIMMON PLC	29,453	27.030	796,114.590	
	PRUDENTIAL PLC	270,026	14.985	4,046,339.610	
	RIO TINTO PLC	114,677	44.450	5,097,392.650	
	VODAFONE GROUP PLC	2,917,408	1.122	3,273,331.770	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	73,669	62.070	4,572,634.830	
	RELX PLC	198,997	23.600	4,696,329.200	
	RENTOKIL INITIAL PLC	199,293	6.158	1,227,246.290	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	781,282	1.472	1,150,047.100	
	NATWEST GROUP PLC	572,346	2.153	1,232,260.930	

ST JAMES'S PLACE PLC	57,843	15.845	916,522.330	
SSE PLC	99,950	16.590	1,658,170.500	
BP PLC	2,074,034	3.478	7,213,490.250	
SAGE GROUP PLC(THE)	110,105	7.424	817,419.520	
SMITHS GROUP PLC	35,235	14.520	511,612.200	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,856	162.750	1,278,564.000	
STANDARD CHARTERED PLC	267,266	4.517	1,207,240.520	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,371,160	0.492	3,626,610.720	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.580	547,934.520	
TESCO PLC	794,842	2.849	2,264,504.850	
3I GROUP PLC	106,343	13.655	1,452,113.660	
SMITH & NEPHEW PLC	84,627	13.305	1,125,962.230	
GLAXOSMITHKLINE PLC	518,967	15.902	8,252,613.230	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	33,898	71.080	2,409,469.840	
WPP PLC	124,119	11.070	1,373,997.330	
ASTRAZENECA PLC	158,705	93.840	14,892,877.200	
WHITBREAD PLC	18,594	33.380	620,667.720	
INTERTEK GROUP PLC	16,139	51.820	836,322.980	
BURBERRY GROUP PLC	38,764	19.670	762,487.880	
INTERCONTINENTAL HOTELS	19,802	51.540	1,020,595.080	
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.936	536,882.830	
ADMIRAL GROUP PLC	20,087	29.200	586,540.400	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,559	43.240	456,571.160	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	417,887	16.812	7,025,516.240	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	379,302	16.846	6,389,721.490	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	23.780	428,848.520	
AVEVA GROUP PLC	10,408	33.840	352,206.720	
ABRDN PLC	206,313	2.625	541,571.620	
EXPERIAN PLC	95,792	34.750	3,328,772.000	
MONDI PLC	47,464	18.370	871,913.680	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	15.360	542,392.320	
OCADO GROUP PLC	54,445	17.635	960,137.570	
INFORMA PLC	151,566	5.406	819,365.790	
GLENORE PLC	1,027,227	3.553	3,649,737.530	
ENTAIN PLC	58,126	19.640	1,141,594.640	
EVRAZ PLC	48,765	6.102	297,564.030	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.820	317,797.080	
COCA-COLA HBC AG	20,233	25.800	522,011.400	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	85,046	6.584	559,942.860	
FERGUSON PLC	22,957	115.350	2,648,089.950	
M&G PLC	259,117	1.973	511,237.840	

	JD SPORTS FASHION PLC	47,098	11.505	541,862.490	
	AUTO TRADER GROUP PLC	115,111	6.202	713,918.420	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	498,786	1.681	838,459.260	
イギリス・ポンド 小計		29,939,988		187,461,152.410 (28,638,440,254)	
イスラエル・ シケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	30.550	3,127,067.450	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	143,645	30.230	4,342,388.350	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	477.400	840,224.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	18.800	1,920,119.200	
	ICL GROUP LTD	68,048	27.480	1,869,959.040	
	NICE LTD	6,862	904.600	6,207,365.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	112.000	1,169,728.000	
	AZRIELI GROUP	4,414	301.900	1,332,586.600	
イスラエル・シケル 小計		439,666		20,809,437.840 (759,935,699)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	72.260	1,217,870.040	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	291,600	28.120	8,199,792.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	375,772	22.710	8,533,782.120	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	179,715	14.280	2,566,330.200	
	TELSTRA CORP LTD	479,279	3.930	1,883,566.470	
	ASX LTD	19,940	93.890	1,872,166.600	
	BHP GROUP LTD	302,104	35.740	10,797,196.960	
	AMPOL LTD	20,946	30.900	647,231.400	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	19.200	990,796.800	
	CSL LIMITED	46,680	314.220	14,667,789.600	
	REA GROUP LTD	5,828	165.180	962,669.040	
	TRANSURBAN GROUP	319,654	13.750	4,395,242.500	
	COCHLEAR LTD	6,917	225.040	1,556,601.680	
	ORIGIN ENERGY LTD	196,680	5.000	983,400.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	180,958	108.910	19,708,135.780	
	RIO TINTO LIMITED	38,299	87.510	3,351,545.490	
	APA GROUP	118,205	8.820	1,042,568.100	
	ARISTOCRAT LEISU	61,444	47.490	2,917,975.560	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	216,220	4.490	970,827.800	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	41,434	54.770	2,269,340.180	
	ORICA LTD	41,311	15.350	634,123.850	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	10.910	677,685.560	
	BLUESCOPE STEEL LTD	46,777	20.000	935,540.000	
	SYDNEY AIRPORT	116,130	8.420	977,814.600	
MACQUARIE GROUP LTD	35,501	199.970	7,099,134.970		
SUNCORP GROUP LTD	144,345	11.110	1,603,672.950		

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	338,406	30.150	10,202,940.900	
	NEWCREST MINING LTD	88,485	25.120	2,222,743.200	
	OIL SEARCH LTD	211,926	4.240	898,566.240	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	107,483	5.710	613,727.930	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	143,822	11.490	1,652,514.780	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	130,073	10.140	1,318,940.220	
	REECE LTD	30,319	21.630	655,799.970	
	SANTOS LTD	194,614	6.920	1,346,728.880	
	SONIC HEALTHCARE	46,547	39.370	1,832,555.390	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	24,711	31.840	786,798.240	
	TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	5.200	1,115,904.400	
	WESFARMERS LTD	117,643	59.840	7,039,757.120	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	106,024	22.630	2,399,323.120	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	132,184	39.000	5,155,176.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	34.270	533,001.310	
	SEEK LTD	36,770	34.100	1,253,857.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	121.080	736,892.880	
	AUSNET SERVICES	165,066	2.590	427,520.940	
	AGL ENERGY LTD	49,076	5.460	267,954.960	
	BRAMBLES LTD	150,237	10.400	1,562,464.800	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	9.730	319,737.530	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	3.950	556,807.800	
	AURIZON HOLDINGS LTD	153,654	3.450	530,106.300	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	75,903	11.430	867,571.290	
	XERO LTD	12,462	147.280	1,835,403.360	
	AFTERPAY LTD	22,748	116.950	2,660,378.600	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	119,574	7.100	848,975.400	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.440	974,049.760	
	SOUTH32 LTD(AUD)	497,070	3.460	1,719,862.200	
	COLES GROUP LTD	127,363	17.630	2,245,409.690	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	55.390	753,525.560	
	オーストラリア・ドル 小計	7,205,292		156,797,796.020 (13,083,208,100)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	24,568	71.450	1,755,383.600	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	86,394	50.080	4,326,611.520	
	BARRICK GOLD CORP	187,998	25.570	4,807,108.860	
	ATCO LTD	7,193	41.430	298,005.990	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	21.230	451,604.560	
	BANK OF MONTREAL	66,133	138.990	9,191,825.670	

BANK OF NOVA SCOTIA	123,377	82.710	10,204,511.670	
NATIONAL BANK OF CANADA	35,196	104.880	3,691,356.480	
BCE INC	7,275	64.070	466,109.250	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	131,856	75.490	9,953,809.440	
BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	33.780	952,325.760	
SAPUTO INC	25,395	31.030	788,006.850	
BLACKBERRY LTD	46,671	13.110	611,856.810	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	66,161	17.920	1,185,605.120	
CGI INC	23,623	109.790	2,593,569.170	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	69.560	1,068,302.480	
CAE INC	30,443	41.700	1,269,473.100	
CAMECO CORP	41,733	32.960	1,375,519.680	
ROGERS COMM-CL B	35,510	61.320	2,177,473.200	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	45,777	149.090	6,824,892.930	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	122,790	53.010	6,509,097.900	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,889	185.950	1,095,059.550	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,291	35.150	572,628.650	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	72,842	163.520	11,911,123.840	
YAMANA GOLD INC	84,317	5.450	459,527.650	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,815	52.590	1,094,660.850	
OPEN TEXT CORP	31,650	63.620	2,013,573.000	
EMPIRE CO LTD	15,093	38.920	587,419.560	
KINROSS GOLD CORP	118,575	8.060	955,714.500	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	88.170	878,437.710	
FORTIS INC	47,849	56.960	2,725,479.040	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,914	27.100	1,542,369.400	
TELUS CORP	31,890	29.240	932,463.600	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	38.280	966,570.000	
IMPERIAL OIL LTD	28,897	42.810	1,237,080.570	
ENBRIDGE INC	207,456	52.740	10,941,229.440	
IGM FINANCIAL INC	6,069	50.710	307,758.990	
MANULIFE FINANCIAL CORP	203,178	24.950	5,069,291.100	
LOBLAW CO LTD	19,729	97.660	1,926,734.140	
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,630	104.240	3,192,871.200	
SUN LIFE FINANCIAL INC	61,272	70.390	4,312,936.080	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,743	530.180	1,454,283.740	
METRO INC	25,305	65.300	1,652,416.500	
EMERA INC	26,674	58.960	1,572,699.040	
ONEX CORP	6,646	94.300	626,717.800	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	33.560	629,786.960	
POWER CORP OF CANADA	55,860	42.730	2,386,897.800	
QUEBECOR INC-B	16,042	30.300	486,072.600	

ROYAL BANK OF CANADA	143,910	132.390	19,052,244.900	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	69,182	96.800	6,696,817.600	
SHAW COMM INC-B	47,913	36.590	1,753,136.670	
SUNCOR ENERGY INC	157,646	32.320	5,095,118.720	
LUNDIN MINING CORP	64,310	10.580	680,399.800	
TECK RESOURCES LTD-CL B	52,980	33.520	1,775,889.600	
THOMSON REUTERS CORP	16,826	150.400	2,530,630.400	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,070	112.500	1,020,375.000	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	184,768	92.220	17,039,304.960	
TC ENERGY CORP	100,989	62.510	6,312,822.390	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,298	103.190	959,460.620	
WESTON (GEORGE) LTD	7,886	139.650	1,101,279.900	
INTACT FINANCIAL CORP	17,922	169.870	3,044,410.140	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	47,399	53.740	2,547,222.260	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,131	2,169.400	4,622,991.400	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	20,302	180.710	3,668,774.420	
B2GOLD CORP	101,675	5.620	571,413.500	
KEYERA CORP	23,772	30.430	723,381.960	
PARKLAND CORP	14,497	35.660	516,963.020	
ALTAGAS LTD	24,236	25.090	608,081.240	
PEMBINA PIPELINE CORP	51,071	41.770	2,133,235.670	
DOLLARAMA INC	32,298	58.530	1,890,401.940	
CENOVUS ENERGY INC W/I	139,645	15.870	2,216,166.150	
NORTHLAND POWER INC	23,490	38.390	901,781.100	
TMX GROUP LTD	5,058	133.260	674,029.080	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,971	56.220	1,516,309.620	
IVANHOE MINES LTD	61,930	9.620	595,766.600	
NUTRIEN LTD	59,774	84.570	5,055,087.180	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	11,346	84.890	963,161.940	
WSP GLOBAL INC	12,587	178.650	2,248,667.550	
IA FINANCIAL CORP INC	11,660	74.340	866,804.400	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	49.190	810,897.150	
NUVEI CORP	4,960	135.750	673,320.000	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	50.430	546,913.350	
AIR CANADA	17,940	25.860	463,928.400	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	29,456	72.060	2,122,599.360	
SHOPIFY INC	11,559	1,842.830	21,301,271.970	
FIRSTSERVICE CORP	3,503	239.240	838,057.720	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	16.350	304,665.900	
HYDRO ONE LTD	38,647	30.370	1,173,709.390	
カナダ・ドル 小計	4,124,091		259,651,746.320 (23,693,221,852)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	204,600	3.840	785,664.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	186,700	32.100	5,993,070.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.260	264,264.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.530	656,617.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.815	590,223.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.310	716,319.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	321,553	11.840	3,807,187.520	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.550	2,061,476.100	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	5.420	856,631.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	114,200	27.690	3,162,198.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.110	287,955.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	18.420	386,820.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.330	785,462.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	313,215	3.440	1,077,459.600	
シンガポール・ドル 小計	3,314,040		21,431,346.220 (1,805,162,292)		
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	268,908	9.362	2,517,516.690	
	LOGITECH INTL-REG	18,464	72.420	1,337,162.880	
	NESTLE SA-REGISTERED	293,570	123.460	36,244,152.200	
	CIE FINANC RICHEMONT	54,061	121.750	6,581,926.750	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	71,500	370.100	26,462,150.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	251.400	1,036,270.800	
	SIKA INHABER	14,436	322.500	4,655,610.000	
	SGS SA-REG	646	2,809.000	1,814,614.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	226,819	76.600	17,374,335.400	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	144.900	617,129.100	
	BARRY CALLEBAUT AG	401	2,214.000	887,814.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	19.275	385,095.220	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	507.400	1,262,918.600	
	ABB LTD	177,117	31.970	5,662,430.490	
	ADECCO GROUP AG-REG	18,586	45.970	854,398.420	
	GEBERIT AG	3,963	726.200	2,877,930.600	
	LONZA GROUP AG-REG	7,695	729.800	5,615,811.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	11,550.000	1,351,350.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	116,400.000	1,280,400.000	
	GIVAUDAN-REG	945	4,432.000	4,188,240.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	15,267	409.400	6,250,309.800	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,604	407.400	1,468,269.600	
	HOLCIM LTD	56,774	47.530	2,698,468.220	
TEMENOS GROUP	6,753	139.800	944,069.400		
SONOVA HOLDING AG	5,191	387.000	2,008,917.000		
KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,894	290.600	1,422,196.400		

	STRAUMANN HOLDING AG	1,032	2,021.000	2,085,672.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	263.500	788,128.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	50.950	233,962.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,671	247.200	413,071.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,090	513.400	1,586,406.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	71.700	179,250.000	
	VIFOR PHARMA AG	5,256	118.950	625,201.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING	563	915.500	515,426.500	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	93.850	754,554.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,378	1,611.500	3,832,147.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,176	65.960	1,528,688.960	
	SWISS RE LTD	31,694	90.200	2,858,798.800	
	ALCON INC	51,835	77.500	4,017,212.500	
	UBS GROUP AG	377,008	16.685	6,290,378.480	
スイス・フラン	小計	1,796,397		163,508,384.110 (20,297,930,803)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	65,891	556.400	36,661,752.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	43,456	473.700	20,585,107.200	
	ERICSSON LM-B SHS	303,709	96.260	29,235,028.340	
	LUNDBERGS B	7,382	512.800	3,785,489.600	
	SKF AB-B SHS	35,049	214.900	7,532,030.100	
	SANDVIK AB	117,110	221.700	25,963,287.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	162,441	140.200	22,774,228.200	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	221.000	6,995,313.000	
	SWEDBANK AB	89,378	191.060	17,076,560.680	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	69,687	134.300	9,358,964.100	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	100.600	14,006,538.000	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	209.400	4,960,895.400	
	VOLVO AB-B SHS	145,195	206.050	29,917,429.750	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	66.380	10,509,879.020	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	125.050	5,884,227.750	
	INDUSTRIVARDEN A	14,273	286.000	4,082,078.000	
	INDUSTRIVARDEN C	18,886	282.100	5,327,740.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	30,439	199.700	6,078,668.300	
	SECURITAS AB-B SHS	35,948	140.300	5,043,504.400	
	INVESTOR AB-B SHS	185,463	207.200	38,427,933.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	168.820	11,968,662.720	
	ASSA ABLOY AB-B	105,338	266.800	28,104,178.400	
	TELIA CO AB	269,954	34.870	9,413,295.980	
	LUNDIN ENERGY AB	20,762	354.900	7,368,433.800	
	BOLIDEN AB	28,603	296.200	8,472,208.600	
	ALFA LAVAL AB	29,835	374.500	11,173,207.500	
	KINNEVIK AB-B	21,722	343.800	7,468,023.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	645.000	5,783,715.000	

	ICA GRUPPEN AB	9,009	534.200	4,812,607.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,442	125.450	4,195,298.900	
	NIBE INDUSTRIER AB	137,747	131.200	18,072,406.400	
	HEXAGON AB-B SHS	207,524	136.500	28,327,026.000	
	EPIROC AB-A	70,906	219.800	15,585,138.800	
	EPIROC AB-B	38,943	185.500	7,223,926.500	
	ESSITY AB-B	66,034	288.800	19,070,619.200	
	EQT AB	31,042	499.600	15,508,583.200	
	EMBRACER GROUP AB	49,142	89.150	4,381,009.300	
	EVOLUTION AB	17,548	1,378.600	24,191,672.800	
	NORDEA BANK ABP	332,254	109.440	36,361,877.760	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	328.400	4,907,938.000	
	SINCH AB	56,299	117.500	6,615,132.500	
スウェーデン・クローナ 小計		3,345,177		583,211,618.200 (7,634,240,082)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,585	1,094.000	11,579,990.000	
	A P MOLLER A/S	568	19,505.000	11,078,840.000	
	AP MOLLER MAERSK A	341	18,730.000	6,386,930.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	112.000	7,697,200.000	
	GENMAB A/S	6,936	2,779.000	19,275,144.000	
	NOVOZYMES-B SHS	20,271	499.700	10,129,418.700	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	3,042.000	2,473,146.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	172,681	730.900	126,212,542.900	
	GN STORE NORD A/S	13,407	398.000	5,335,986.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	105,017	230.500	24,206,418.500	
	COLOPLAST-B	12,804	1,119.000	14,327,676.000	
	DSV A/S	20,878	1,524.000	31,818,072.000	
	DEMANT A/S	10,739	323.200	3,470,844.800	
	TRYG A/S	35,784	157.850	5,648,504.400	
	PANDORA A/S	9,639	895.000	8,626,905.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,263	532.000	6,523,916.000	
	AMBU A/S B	14,156	181.250	2,565,775.000	
ORSTED A/S	18,161	875.400	15,898,139.400		
デンマーク・クローネ 小計		533,768		313,255,448.700 (5,510,163,343)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	8.250	909,364.500	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	14.380	711,076.620	
	A2 MILK CO LTD	62,165	6.430	399,720.950	
	FISHER & PAYKEL	57,388	31.800	1,824,938.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.590	732,669.570	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	5.990	369,786.660	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.865	604,048.130	
ニュージーランド・ドル 小計		624,747		5,551,604.830 (446,959,705)	

ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	239.400	10,342,558.800	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	61.100	7,884,099.600	
	TELENOR ASA	67,591	138.300	9,347,835.300	
	SCHIBSTED ASA	7,537	452.000	3,406,724.000	
	ORKLA ASA	97,223	85.160	8,279,510.680	
	EQUINOR ASA	104,676	225.350	23,588,736.600	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	472.200	7,174,134.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	213.400	3,560,152.200	
	ADEVINTA ASA	22,265	152.000	3,384,280.000	
	DNB BANK ASA	91,214	213.300	19,455,946.200	
	SCHIBSTED ASA	7,445	392.400	2,921,418.000	
	ノルウェー・クローネ 小計	602,065		99,345,395.980 (1,310,365,773)	
ユーロ	CRH PLC	80,795	44.060	3,559,827.700	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17,350	147.350	2,556,522.500	
	KERRY GROUP PLC-A	15,455	116.500	1,800,507.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	16,773	97.080	1,628,322.840	
	UMICORE	21,964	49.820	1,094,246.480	
	AIR LIQUIDE	48,640	152.060	7,396,198.400	
	AIRBUS SE	60,621	116.200	7,044,160.200	
	AXA SA	199,304	25.670	5,116,133.680	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	70,558	29.680	2,094,161.440	
	ADIDAS AG	19,713	284.500	5,608,348.500	
	ASSICURAZIONI GENERALI	115,980	19.020	2,205,939.600	
	DASSAULT AVIATION SA	2,950	95.850	282,757.500	
	DANONE	68,030	57.940	3,941,658.200	
	SAFRAN SA	35,436	123.000	4,358,628.000	
	INTESA SANPAOLO	1,681,980	2.477	4,166,264.460	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	35,037	91.760	3,214,995.120	
	ACCOR SA	17,380	32.780	569,716.400	
	BOUYGUES	21,417	33.020	707,189.340	
	BNP PARIBAS	115,565	59.200	6,841,448.000	
	THALES SA	10,448	83.380	871,154.240	
	CAPGEMINI SA	16,687	208.500	3,479,239.500	
	UNICREDIT SPA	217,091	11.534	2,503,927.590	
	KONINKLIJKE DSM NV	18,409	191.250	3,520,721.250	
	COMMERZBANK AG	106,215	6.950	738,194.250	
	EIFFAGE	8,477	91.820	778,358.140	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	39,680	38.080	1,511,014.400	
	UNITED INTERNET	9,882	34.260	338,557.320	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	41.880	232,266.480	
	PUBLICIS GROUPE	24,498	58.600	1,435,582.800	
	FAURECIA	10,774	46.510	501,098.740	
	IBERDROLA SA	606,243	10.160	6,159,428.880	
ENI SPA	260,598	12.664	3,300,213.070		

JERONIMO MARTINS	34,337	20.920	718,330.040	
KESKO OYJ-B	30,812	28.440	876,293.280	
KBC GROUPE	23,789	85.740	2,039,668.860	
HANNOVER RUECK SE	5,923	162.250	961,006.750	
WARTSILA OYJ	48,612	12.675	616,157.100	
L'OREAL	25,723	414.350	10,658,325.050	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	28,448	698.600	19,873,772.800	
GEA GROUP AG	13,061	44.650	583,173.650	
BOLLORE	110,900	5.190	575,571.000	
MEDIOBANCA SPA	57,442	10.720	615,778.240	
MICHELIN(CGDE) -B	18,313	134.200	2,457,604.600	
CONTINENTAL AG	12,666	107.400	1,360,328.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	102,202	55.440	5,666,078.880	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	22.130	469,288.780	
OMV AG	12,817	54.100	693,399.700	
VERBUND AG	6,916	87.400	604,458.400	
PERNOD-RICARD	21,590	205.000	4,425,950.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	15,524	85.860	1,332,890.640	
RENAULT SA	19,019	34.300	652,351.700	
REPSOL SA	152,723	11.060	1,689,116.380	
REMY COINTREAU	1,860	178.100	331,266.000	
MERCK KGAA	12,629	206.500	2,607,888.500	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	52,747	59.820	3,155,325.540	
RWE AG	63,738	32.600	2,077,858.800	
SEB SA	2,439	137.300	334,874.700	
SOCIETE GENERALE-A	86,502	29.400	2,543,158.800	
VINCI S.A.	55,086	95.200	5,244,187.200	
SODEXO	9,325	83.860	781,994.500	
SOFINA	1,382	395.400	546,442.800	
SOLVAY SA	7,183	104.700	752,060.100	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	54,956	153.980	8,462,124.880	
VIVENDI SE	73,788	11.210	827,163.480	
SAP SE	106,617	127.680	13,612,858.560	
TELEFONICA S.A	527,117	3.930	2,071,569.810	
TOTALENERGIES SE	255,391	43.915	11,215,495.760	
VALEO	19,653	27.600	542,422.800	
E.ON SE	226,220	11.164	2,525,520.080	
VOEST-ALPINE AG	9,875	31.880	314,815.000	
HENKEL AG & CO KGAA	10,366	72.100	747,388.600	
SIEMENS AG-REG	78,149	146.960	11,484,777.040	
UPM-KYMMENE OYJ	54,222	31.200	1,691,726.400	
ING GROEP NV-CVA	404,824	13.262	5,368,775.880	
PUMA AG	10,448	110.500	1,154,504.000	
BAYER AG	102,445	51.250	5,250,306.250	
STORA ENSO OYJ-R SHS	65,747	14.550	956,618.850	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,941	77.460	1,312,249.860	
DAIMLER AG	88,035	88.090	7,755,003.150	
BASF SE	95,250	61.950	5,900,737.500	
BEIERSDORF AG	10,342	93.560	967,597.520	
HEIDELBERGCEMENT AG	15,297	65.440	1,001,035.680	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	19,754	58.980	1,165,090.920	
ASM INTERNATIONAL NV	4,578	408.800	1,871,486.400	
ORANGE	219,631	9.828	2,158,533.460	
SAMPO OYJ-A SHS	51,942	44.680	2,320,768.560	
RANDSTAD NV	11,017	62.020	683,274.340	
ALLIANZ SE	42,207	205.250	8,662,986.750	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.769	1,281,125.080	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	110,259	29.660	3,270,281.940	
HERMES INTL	3,283	1,430.000	4,694,690.000	
ENDESA S.A.	27,736	19.605	543,764.280	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	103,741	7.007	726,913.180	
ERSTE GROUP BANK AG	31,158	40.570	1,264,080.060	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	14,546	256.350	3,728,867.100	
ARCELOR MITTAL (NL)	76,261	27.360	2,086,500.960	
DASSAULT SYSTEMES SA	68,574	53.950	3,699,567.300	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,877	23.360	534,406.720	
HEINEKEN NV	24,889	96.560	2,403,281.840	
AKZO NOBEL	18,548	101.550	1,883,549.400	
ASML HOLDING NV	42,901	719.700	30,875,849.700	
AEGON NV	189,323	4.313	816,550.090	
VOLKSWAGEN AG	3,644	284.600	1,037,082.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	18,625	185.600	3,456,800.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	689,790	6.032	4,160,813.280	
KERING	7,749	664.800	5,151,535.200	
CNP ASSURANCES	13,987	21.650	302,818.550	
FORTUM OYJ	47,130	25.950	1,223,023.500	
AGEAS	17,055	41.830	713,410.650	
UCB SA	12,778	106.100	1,355,745.800	
NEMETSCHEK SE	5,095	109.700	558,921.500	
CARREFOUR SA	61,189	16.350	1,000,440.150	
NATURGY ENERGY GROUP SA	34,156	23.010	785,929.560	
ATOS SE	8,972	43.610	391,268.920	
NOKIA OYJ	561,989	5.026	2,824,556.710	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	95,812	41.800	4,004,941.600	
WOLTERS KLUWER-CVA	28,910	94.880	2,742,980.800	
SANOFI	116,480	89.820	10,462,233.600	
STMICROELECTRONICS NV	71,332	43.405	3,096,165.460	
ELISA OYJ	13,642	53.720	732,848.240	

BANCO SANTANDER SA	1,786,945	3.212	5,739,667.340	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47,453	18.035	855,814.850	
QIAGEN N.V.	21,144	46.300	978,967.200	
DEUTSCHE BANK AG-REG	197,931	11.096	2,196,242.370	
BMW VORZUG	4,471	77.250	345,384.750	
ENEL SPA	832,203	7.160	5,958,573.480	
COLRUYT NV	4,673	43.460	203,088.580	
VOPAK (KON.)	5,364	34.130	183,073.320	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	346,030	16.718	5,784,929.540	
SARTORIUS AG	2,391	540.800	1,293,052.800	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	47.090	361,933.740	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	135,379	41.230	5,581,676.170	
RATIONAL AG	479	879.000	421,041.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	175.800	662,941.800	
BECHTLE AG	7,533	68.620	516,914.460	
KONINKLIJKE KPN NV	341,447	2.633	899,029.950	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,226	101.140	1,337,677.640	
TELEPERFORMANCE	6,257	357.400	2,236,251.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	19,846	149.450	2,965,984.700	
EURAZEO	3,008	77.250	232,368.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,395	103.500	1,282,882.500	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,883	80.550	876,625.650	
INDITEX	112,267	32.280	3,623,978.760	
ESSILORLUXOTTICA	29,703	182.380	5,417,233.140	
SNAM SPA	198,963	5.086	1,011,925.810	
CREDIT AGRICOLE SA	127,883	12.858	1,644,319.610	
ORPEA	4,932	90.920	448,417.440	
ENAGAS	23,477	20.150	473,061.550	
WENDEL	2,220	114.300	253,746.000	
TENARIS SA	52,985	10.490	555,812.650	
TELECOM ITALIA SPA	1,123,551	0.334	375,266.030	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.348	173,163.400	
ATLANTIA SPA	45,299	16.945	767,591.550	
PROXIMUS	13,739	16.900	232,189.100	
TERNA SPA	162,227	6.734	1,092,436.610	
BIOMERIEUX	3,248	105.900	343,963.200	
GRIFOLS SA	30,687	18.525	568,476.670	
FERROVIAL SA	46,794	26.800	1,254,079.200	
LANXESS AG	7,194	54.740	393,799.560	
NESTE OYJ	39,808	47.800	1,902,822.400	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	28.660	513,329.260	
RECORDATI SPA	10,303	56.220	579,234.660	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	12.815	708,720.760	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,809	205.100	986,325.900	
KONE OYJ	35,976	59.100	2,126,181.600	

ELIA GROUP	2,862	101.900	291,637.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,771	461.000	1,277,431.000	
ENGIE	178,037	12.860	2,289,555.820	
ALSTOM	30,600	35.010	1,071,306.000	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	12.905	706,910.090	
IPSEN SA	3,646	86.360	314,868.560	
ARKEMA SA	6,393	122.600	783,781.800	
LEGRAND SA	28,463	94.900	2,701,138.700	
AMPLIFON SPA	11,372	46.070	523,908.040	
ADP	2,313	122.050	282,301.650	
ORION OYJ	8,051	38.280	308,192.280	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	9.010	361,192.880	
SYMRISE AG	12,698	124.650	1,582,805.700	
SCOR SE	15,667	28.000	438,676.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	45.180	1,094,621.040	
PRYSMIAN SPA	28,236	33.310	940,541.160	
DIASORIN SPA	2,223	183.400	407,698.200	
CAIXABANK	496,448	2.524	1,253,034.750	
BUREAU VERITAS SA	29,810	28.900	861,509.000	
GETLINK	50,458	13.695	691,022.310	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	22.680	634,404.960	
SUEZ SA	34,245	19.680	673,941.600	
AMADEUS IT GROUP SA	46,873	63.840	2,992,372.320	
BRENTAG SE	17,199	80.800	1,389,679.200	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,340	27.950	652,353.000	
EDENRED	24,865	44.290	1,101,270.850	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.454	241,436.790	
LEG IMMOBILIEN SE	8,287	126.250	1,046,233.750	
KION GROUP AG	7,508	98.040	736,084.320	
VONOVIA SE	56,729	52.700	2,989,618.300	
KNORR-BREMSE AG	6,860	96.220	660,069.200	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	26,679	59.380	1,584,199.020	
FERRARI NV	12,037	222.100	2,673,417.700	
CNH INDUSTRIAL NV	101,681	15.315	1,557,244.510	
AROUNDTOWN SA	106,018	6.114	648,194.050	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	44.790	362,440.680	
MONCLER SPA	21,870	65.300	1,428,111.000	
NEXI SPA	43,586	14.680	639,842.480	
TEAMVIEWER AG	13,668	13.500	184,518.000	
PROSUS NV	96,197	72.720	6,995,445.840	
JDE PEET'S BV	7,308	26.230	191,688.840	
SIEMENS ENERGY AG	46,176	25.450	1,175,179.200	
INPOST SA	20,395	14.070	286,957.650	
WORLDLINE SA	23,570	49.450	1,165,536.500	
NN GROUP NV	28,556	46.980	1,341,560.880	
FINECOBANK SPA	66,478	17.070	1,134,779.460	

	ARGENX SE	4,403	268.400	1,181,765.200	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	73,788	27.490	2,028,432.120	
	ZALANDO SE	23,726	75.180	1,783,720.680	
	STELLANTIS NV	209,418	17.882	3,744,812.670	
	AENA SME SA	7,240	149.050	1,079,122.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	53,509	53.620	2,869,152.580	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,807	61.000	1,025,227.000	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	13.000	445,263.000	
	EXOR NV	9,966	83.760	834,752.160	
	SCOUT24 SE	9,670	62.980	609,016.600	
	COVESTRO AG	19,158	55.020	1,054,073.160	
	HELLOFRESH SE	15,029	85.300	1,281,973.700	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	78,937	52.470	4,141,824.390	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	12.510	697,419.990	
	AMUNDI SA	5,924	78.500	465,034.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	39,494	9.890	390,595.660	
	ADYEN NV	2,034	2,572.000	5,231,448.000	
	UNIPER SE	10,427	38.880	405,401.760	
	DELIVERY HERO SE	16,642	111.900	1,862,239.800	
ユーロ 小計		19,567,568		516,797,342.660 (67,612,596,340)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	17.820	2,922,480.000	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	75.800	12,279,600.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	45,000	46.150	2,076,750.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	124,140	464.000	57,600,960.000	
	MTR CORP	179,500	43.000	7,718,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	75,800	145.400	11,021,320.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	123,450	33.500	4,135,575.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	47.100	6,876,600.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,260,456	11.880	14,974,217.280	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	224,000	43.900	9,833,600.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	431,500	24.400	10,528,600.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	34.300	5,593,163.800	
	SINO LAND CO	273,400	10.060	2,750,404.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	142,000	99.800	14,171,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	49.200	2,435,400.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	142,000	168.000	23,856,000.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	20.300	3,369,800.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	5.790	903,240.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	6.950	864,580.000	

CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	16.360	3,553,392.000	
AIA GROUP LTD	1,241,627	82.550	102,496,308.850	
HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.680	4,752,600.000	
SANDS CHINA LTD	252,000	17.920	4,515,840.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	133,000	26.250	3,491,250.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	20.900	2,177,780.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	44.000	6,589,000.000	
ESR CAYMAN LTD	203,800	25.850	5,268,230.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.760	1,784,800.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	20.800	3,132,480.000	
WH GROUP LTD	897,000	5.320	4,772,040.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	254,332	52.650	13,390,579.800	
CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	47.900	10,769,452.800	
香港・ドル 小計	8,655,553		360,606,143.530 (5,275,667,880)	
合計	112,250,034		656,072,262,273 (656,072,262,273)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	118,215.000	1,324,008.000	
		GOODMAN GROUP	173,711.000	4,130,847.580	
		GPT GROUP	207,292.000	1,071,699.640	
		MIRVAC GROUP	414,125.000	1,192,680.000	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,499,422.500	
		STOCKLAND	243,481.000	1,100,534.120	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	643,060.030	
	オーストラリア・ドル 小計		2,013,785.000	10,962,251.870 (914,690,296)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	417,906.000	1,291,329.540	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	556,577.000	1,196,640.550	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	407,676.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	529,396.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,436,883.000	3,425,042.090 (288,491,295)	
投資信託受益証券 合計		3,450,668	1,203,181,591 (1,203,181,591)		

投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,214.000	708,308.280	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,037.000	2,883,480.540	
		AMERICAN TOWER CORP	46,404.000	12,801,935.520	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	129,689.000	1,112,731.620	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,523.000	3,490,748.280	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,549.000	1,708,343.580	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,661.000	1,754,800.600	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	44,197.000	7,970,486.980	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	29,011.000	4,470,885.210	
		DUKE REALTY TRUST	35,962.000	2,056,666.780	
		EQUINIX INC	9,182.000	7,174,906.620	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,134.000	1,618,927.740	
		EQUITY RESIDENTIAL	37,333.000	3,191,598.170	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,408.000	2,196,598.320	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,714.000	2,506,565.100	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	53,001.000	1,801,503.990	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	64,637.000	1,165,405.110	
		INVITATION HOMES INC	60,097.000	2,438,135.290	
		IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,348,340.400	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	65,435.000	1,389,185.050	
		MID AMERICA	11,430.000	2,318,004.000	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	19,995.000	575,056.200	
		PROLOGIS INC	75,400.000	11,217,258.000	
		PUBLIC STORAGE	16,139.000	5,279,873.850	
		REALTY INCOME CORP	57,389.000	4,082,653.460	
		REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	1,078,145.640	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	11,302.000	3,871,161.040	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	33,940.000	5,565,141.800	
		SUN COMMUNITIES INC	10,801.000	2,090,533.550	
		UDR INC	32,372.000	1,795,027.400	
		VENTAS INC	40,460.000	2,215,185.000	
		VICI PROPERTIES INC	59,521.000	1,721,347.320	
		VORNADO REALTY TRUST	17,313.000	776,661.180	
WELLTOWER INC	43,158.000	3,755,177.580			
WEYERHAEUSER CO	71,903.000	2,652,501.670			
WP CAREY INC	20,038.000	1,539,920.300			
アメリカ・ドル	小計	1,275,288.000	114,323,201.170 (13,028,272,004)		
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	111,148.000	567,743.980		

	LAND SECURITIES GROUP PLC	74,028.000	522,785.730	
	SEGRO PLC	116,375.000	1,549,533.120	
イギリス・債券 小計		301,551.000	2,640,062.830 (403,322,399)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,220.000	496,652.400	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	307,586.280	
カナダ・ドル 小計		21,687.000	804,238.680 (73,386,780)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	350,937.380	
	GECINA SA	4,763.000	579,180.800	
	KLEPIERRE	17,099.000	376,519.980	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	886,828.800	
ユーロ 小計		39,445.000	2,193,466.960 (286,971,282)	
香港・ドル	LINK REIT	227,600.000	16,023,040.000	
香港・ドル 小計		227,600.000	16,023,040.000 (234,417,075)	
投資証券 合計		1,865,571	14,026,369,540 (14,026,369,540)	
合計			15,229,551,131 (15,229,551,131)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 598銘柄	69.70	-	-	73.44
	投資証券 36銘柄	-	-	1.89	
イギリス・債券	株式 82銘柄	4.16	-	-	4.33
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.11	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄	1.90	-	-	2.09
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.44	-	-	3.54
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.26	-	-	0.31
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 40銘柄	2.95	-	-	3.02
スウェーデン・クローナ	株式 41銘柄	1.11	-	-	1.14
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.80	-	-	0.82
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.06	-	-	0.07
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.19	-	-	0.20

ユーロ	株式	230銘柄	9.82	-	-	10.11
	投資証券	4銘柄	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	32銘柄	0.77	-	-	0.82
	投資証券	1銘柄	-	-	0.03	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,755,944,103
国債証券	426,102,029,200
地方債証券	27,510,897,694
特殊債証券	28,677,181,629
社債証券	20,906,705,570
未収利息	726,058,154
前払費用	114,765,299
流動資産合計	505,793,581,649
資産合計	
505,793,581,649	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	551,355,000
流動負債合計	551,355,000
負債合計	
551,355,000	
純資産の部	
元本等	
元本	386,492,682,761
剰余金	
剰余金又は欠損金()	118,749,543,888
元本等合計	505,242,226,649
純資産合計	
505,242,226,649	
負債純資産合計	
505,793,581,649	

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5月12日 至 2021年11月11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11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	236,574,874,490円
同期中追加設定元本額	301,274,974,223円
同期中一部解約元本額	151,357,165,952円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,439,479,206円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	73,166,119円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	106,552,353円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	44,948,218円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	662,913,290円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	135,581,824円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	21,999,973円
たわらノーロード 国内債券	15,265,464,185円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,250,914,687円
たわらノーロード バランス(堅実型)	807,544,575円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,351,107,054円
たわらノーロード バランス(積極型)	169,518,264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)	63,827,914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)	1,157,840,050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)	1,156,243,726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)	306,801,553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)	21,493,224円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	15,789,279円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	12,436,444円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	78,158,975円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,148,998円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	776,072円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,346,304,863円
Oneグローバルバランス	3,533,624円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,841,694,737円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	12,262,315,349円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,091,448,131円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,188,123,587円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,316,736,998円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	387,215,930円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	88,189,996円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,009,608,655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)	4,243,731,056円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	1,546,755,229円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	323,979,263円
投資のソムリエ	45,892,158,392円
クルーズコントロール	1,633,296,275円
投資のソムリエ<DC年金>	2,344,608,359円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,434,624,694円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	683,236,305円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	6,051,750円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	14,593,663円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	5,040,812,208円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	46,659,264,768円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	28,251,009円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	14,570,326円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	50,995,782円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	84,026,700円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,124,582,996円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,383,684,831円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,160,689,807円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	22,156,493円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	10,897,693円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,708,454円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	236,665,285円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	413,483円
D I A M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)	1,137,549,215円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,165,131,769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)	1,298,284,921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)	709,469,603円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,120,229,541円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	324,231,468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)	530,260,326円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,115,524,266円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,844,613,490円
O n eコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	510,704,750円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,246,093,307円
O n eコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(債券動的アロケーション型)(適格機関投資家限定)	266,317,607円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	282,890,018円
O n e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)	5,234,218,423円
O n e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)	5,245,490,399円
O n e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)	5,178,498,774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)	1,908,748,472円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	19,492,401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)	175,135,766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)	101,089,849円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	34,684,112円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	103,445,782円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	46,647,043円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,369,715円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	30,631,293円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	128,040,314円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,823,328,767円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,443,355,418円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,651,662,932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)	123,472,377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)	205,210,662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)	2,300,495,420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)	191,817,814円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	11,778,215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)	2,384,960,328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)	53,889,533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)	366,885,465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)	579,091,466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)	1,075,179,025円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	319,221,589円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	105,351,341円
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,254,866,754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>	305,268,925円
コア資産形成ファンド	231,311,641円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	46,364,311,142円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	43,424,701,423円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	14,608,671,912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]	1,870,990,102円
計	386,492,682,761円
2. 受益権の総数	386,492,682,761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 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	837,008,750
地方債証券	79,438,378
特殊債券	72,864,560
社債券	76,119,050
合計	1,065,430,738

(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(2021年2月16日から2021年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

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11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3072円 (13,072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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	419回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,403,164,000	
	420回 利付国庫債券(2年)	3,200,000,000	3,208,000,000	
	421回 利付国庫債券(2年)	1,040,000,000	1,042,797,600	
	422回 利付国庫債券(2年)	1,600,000,000	1,604,576,000	
	423回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,005,190,000	
	424回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	500,915,000	
	425回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,880,000	
	426回 利付国庫債券(2年)	2,100,000,000	2,104,284,000	
	427回 利付国庫債券(2年)	2,400,000,000	2,405,160,000	
	428回 利付国庫債券(2年)	2,700,000,000	2,706,075,000	
	429回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,004,720,000	
	134回 利付国庫債券(5年)	2,930,000,000	2,936,797,600	
	135回 利付国庫債券(5年)	3,040,000,000	3,048,816,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	3,250,000,000	3,261,212,500	
	137回 利付国庫債券(5年)	3,610,000,000	3,624,728,800	
	138回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,515,855,000	
	139回 利付国庫債券(5年)	3,750,000,000	3,768,975,000	
	140回 利付国庫債券(5年)	3,190,000,000	3,207,481,200	
141回 利付国庫債券(5年)	3,210,000,000	3,229,741,500		

142回 利付国庫債券(5年)	3,130,000,000	3,150,939,700	
143回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,223,136,000	
144回 利付国庫債券(5年)	4,100,000,000	4,131,119,000	
145回 利付国庫債券(5年)	4,350,000,000	4,385,322,000	
146回 利付国庫債券(5年)	3,900,000,000	3,932,916,000	
147回 利付国庫債券(5年)	4,600,000,000	4,621,068,000	
148回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,516,170,000	
149回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,105,093,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	157,560,700	
2回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	874,011,600	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	753,904,800	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	1,012,543,200	
5回 利付国庫債券(40年)	840,000,000	1,141,938,000	
6回 利付国庫債券(40年)	1,060,000,000	1,421,735,600	
7回 利付国庫債券(40年)	1,010,000,000	1,305,677,500	
8回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	1,464,753,400	
9回 利付国庫債券(40年)	1,730,000,000	1,575,355,300	
10回 利付国庫債券(40年)	1,720,000,000	1,830,441,200	
11回 利付国庫債券(40年)	1,280,000,000	1,320,908,800	
12回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,214,018,000	
13回 利付国庫債券(40年)	1,630,000,000	1,517,660,400	
14回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	995,390,000	
326回 利付国庫債券(10年)	1,120,000,000	1,130,024,000	
327回 利付国庫債券(10年)	1,970,000,000	1,989,798,500	
328回 利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,120,160,000	
329回 利付国庫債券(10年)	3,850,000,000	3,906,248,500	
330回 利付国庫債券(10年)	3,460,000,000	3,518,820,000	
331回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,469,270,500	
332回 利付国庫債券(10年)	3,680,000,000	3,735,494,400	
333回 利付国庫債券(10年)	4,230,000,000	4,300,767,900	

334回 利付国庫債券(10年)	4,640,000,000	4,725,979,200	
335回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,172,201,000	
336回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,936,081,000	
337回 利付国庫債券(10年)	2,810,000,000	2,846,305,200	
338回 利付国庫債券(10年)	4,730,000,000	4,811,119,500	
339回 利付国庫債券(10年)	4,410,000,000	4,491,320,400	
340回 利付国庫債券(10年)	4,610,000,000	4,701,923,400	
341回 利付国庫債券(10年)	4,020,000,000	4,087,938,000	
342回 利付国庫債券(10年)	3,780,000,000	3,813,831,000	
343回 利付国庫債券(10年)	4,350,000,000	4,390,194,000	
344回 利付国庫債券(10年)	4,390,000,000	4,432,802,500	
345回 利付国庫債券(10年)	4,590,000,000	4,635,900,000	
346回 利付国庫債券(10年)	4,390,000,000	4,436,007,200	
347回 利付国庫債券(10年)	3,730,000,000	3,770,955,400	
348回 利付国庫債券(10年)	3,790,000,000	3,833,509,200	
349回 利付国庫債券(10年)	4,330,000,000	4,380,487,800	
350回 利付国庫債券(10年)	5,310,000,000	5,372,711,100	
351回 利付国庫債券(10年)	4,400,000,000	4,452,536,000	
352回 利付国庫債券(10年)	4,340,000,000	4,392,297,000	
353回 利付国庫債券(10年)	4,210,000,000	4,261,067,300	
354回 利付国庫債券(10年)	3,510,000,000	3,552,751,800	
355回 利付国庫債券(10年)	3,510,000,000	3,551,523,300	
356回 利付国庫債券(10年)	4,040,000,000	4,086,136,800	
357回 利付国庫債券(10年)	3,790,000,000	3,831,576,300	
358回 利付国庫債券(10年)	3,250,000,000	3,283,995,000	

359回 利付国庫債券(10年)	4,610,000,000	4,653,656,700	
360回 利付国庫債券(10年)	3,940,000,000	3,973,096,000	
361回 利付国庫債券(10年)	3,700,000,000	3,726,899,000	
362回 利付国庫債券(10年)	3,950,000,000	3,973,897,500	
363回 利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,617,172,000	
364回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,204,104,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	134,561,900	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	120,155,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,098,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,498,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	236,954,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	294,862,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	282,732,100	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	183,097,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	432,500,400	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	334,950,200	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	310,346,400	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	346,734,000	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	509,892,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	357,865,200	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	432,029,400	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	398,477,100	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	381,982,200	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	462,248,500	
24回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	357,523,200	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	428,458,800	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	816,453,200	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	830,204,800	

28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	1,035,642,300	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,147,902,200	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,165,454,400	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	944,625,600	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,293,921,800	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,514,990,200	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,589,364,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,886,203,200	
36回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	2,423,931,400	
37回 利付国庫債券(30年)	1,860,000,000	2,383,273,800	
38回 利付国庫債券(30年)	1,050,000,000	1,327,399,500	
39回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,441,160,000	
40回 利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,318,054,400	
41回 利付国庫債券(30年)	1,280,000,000	1,598,451,200	
42回 利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	1,337,542,800	
43回 利付国庫債券(30年)	1,270,000,000	1,589,163,700	
44回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	1,352,754,000	
45回 利付国庫債券(30年)	1,170,000,000	1,416,717,900	
46回 利付国庫債券(30年)	1,570,000,000	1,902,243,400	
47回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,555,885,800	
48回 利付国庫債券(30年)	1,340,000,000	1,597,025,400	
49回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,740,787,200	
50回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,330,497,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,080,666,500	
52回 利付国庫債券(30年)	1,310,000,000	1,288,620,800	

53回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,106,028,000	
54回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,208,581,000	
55回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,176,235,200	
56回 利付国庫債券(30年)	1,230,000,000	1,289,384,400	
57回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,255,572,000	
58回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,566,465,000	
59回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,140,451,200	
60回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,097,650,400	
61回 利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,054,404,000	
62回 利付国庫債券(30年)	1,010,000,000	972,559,300	
63回 利付国庫債券(30年)	1,160,000,000	1,084,507,200	
64回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,101,329,400	
65回 利付国庫債券(30年)	1,010,000,000	941,047,300	
66回 利付国庫債券(30年)	990,000,000	921,917,700	
67回 利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,226,050,000	
68回 利付国庫債券(30年)	1,280,000,000	1,255,296,000	
69回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,380,001,000	
70回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	1,227,466,400	
71回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,308,008,000	
72回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	602,976,000	
59回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,200,000	
64回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,123,500	
65回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	62,543,400	
67回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,362,000	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,275,500	

71回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,411,600	
72回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	489,108,800	
73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	404,973,600	
74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,753,200	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	193,377,600	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	74,731,300	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,838,400	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	268,125,000	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,806,000	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	97,176,600	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	432,588,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	151,947,600	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	76,361,600	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	184,749,200	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	646,858,300	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	132,613,200	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	132,088,800	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	655,472,300	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,063,500	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	522,607,100	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	122,849,100	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,290,592,800	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	411,684,200	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	749,086,800	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	624,195,000	

96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	134,835,600	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	748,954,800	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	180,622,400	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	850,552,500	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	950,789,900	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	266,409,000	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	582,115,000	
103回 利付国債(20年)	160,000,000	185,214,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	125,875,200	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	735,654,400	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	578,175,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	692,706,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	786,765,600	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	400,648,500	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	510,166,800	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	538,986,600	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	861,419,200	
113回 利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,367,823,600	
114回 利付国庫債券(20年)	820,000,000	962,278,200	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	425,390,400	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	628,680,700	
117回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,260,267,400	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	651,048,300	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	543,244,800	
120回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	762,875,400	
121回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	922,498,800	

122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	660,555,900	
123回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,248,471,000	
124回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	707,958,000	
125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	721,404,000	
126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	603,681,900	
127回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	634,154,400	
128回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,612,983,200	
129回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	887,528,000	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,065,118,600	
131回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	916,921,400	
132回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	965,738,200	
133回 利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,326,134,100	
134回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,294,216,000	
135回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	746,432,000	
136回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	762,979,800	
137回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	935,272,000	
138回 利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,308,811,200	
139回 利付国庫債券(20年)	920,000,000	1,065,893,600	
140回 利付国庫債券(20年)	2,090,000,000	2,449,082,900	
141回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,702,909,000	
142回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,066,851,000	
143回 利付国庫債券(20年)	1,380,000,000	1,608,707,400	
144回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,050,622,300	
145回 利付国庫債券(20年)	2,450,000,000	2,889,652,500	
146回 利付国庫債券(20年)	1,880,000,000	2,221,990,800	

147回 利付国庫債券(20年)	2,180,000,000	2,555,766,600	
148回 利付国庫債券(20年)	2,490,000,000	2,894,102,100	
149回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,561,020,000	
150回 利付国庫債券(20年)	2,610,000,000	3,010,060,800	
151回 利付国庫債券(20年)	2,440,000,000	2,755,077,200	
152回 利付国庫債券(20年)	2,150,000,000	2,429,564,500	
153回 利付国庫債券(20年)	2,220,000,000	2,540,013,000	
154回 利付国庫債券(20年)	2,090,000,000	2,365,378,400	
155回 利付国庫債券(20年)	2,160,000,000	2,387,188,800	
156回 利付国庫債券(20年)	1,850,000,000	1,889,738,000	
157回 利付国庫債券(20年)	2,030,000,000	2,012,846,500	
158回 利付国庫債券(20年)	2,090,000,000	2,160,182,200	
159回 利付国庫債券(20年)	1,980,000,000	2,073,317,400	
160回 利付国庫債券(20年)	1,710,000,000	1,815,695,100	
161回 利付国庫債券(20年)	1,790,000,000	1,872,823,300	
162回 利付国庫債券(20年)	1,720,000,000	1,798,088,000	
163回 利付国庫債券(20年)	1,720,000,000	1,796,505,600	
164回 利付国庫債券(20年)	1,880,000,000	1,931,060,800	
165回 利付国庫債券(20年)	1,610,000,000	1,651,779,500	
166回 利付国庫債券(20年)	1,830,000,000	1,935,005,400	
167回 利付国庫債券(20年)	2,040,000,000	2,087,695,200	
168回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,587,726,200	
169回 利付国庫債券(20年)	1,650,000,000	1,626,867,000	
170回 利付国庫債券(20年)	1,490,000,000	1,466,383,500	
171回 利付国庫債券(20年)	1,340,000,000	1,316,255,200	

	172回 利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,457,503,400	
	173回 利付国庫債券(20年)	1,920,000,000	1,913,356,800	
	174回 利付国庫債券(20年)	1,850,000,000	1,840,306,000	
	175回 利付国庫債券(20年)	1,760,000,000	1,780,169,600	
	176回 利付国庫債券(20年)	1,880,000,000	1,898,405,200	
	177回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,782,180,000	
	178回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	604,914,000	
	国債証券 合計	402,095,000,000	426,102,029,200	
地方債証券	719回 東京都公募公債	200,000,000	202,314,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	304,167,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	406,068,000	
	760回 東京都公募公債	100,000,000	100,169,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	111,267,200	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	401,824,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	245,440,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	130,087,000	
	1回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,466,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,035,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,285,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	222,362,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	333,759,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	115,855,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	117,048,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	100,263,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	403,560,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	100,137,000	
	29回1号 宮城県公募公債 10年	100,000,000	101,315,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	250,677,500	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	302,610,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	304,227,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,755,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	201,554,000		
3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	133,663,000		

11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	115,507,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	354,459,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	116,787,000	
368回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	101,000,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	304,758,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,029,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,904,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	199,032,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	200,446,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	232,468,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	112,097,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	102,759,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	355,061,000	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	110,401,434	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	201,826,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	202,962,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,466,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	133,290,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	215,546,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	308,571,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	324,741,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	107,371,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	103,707,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	100,359,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	200,460,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	107,720,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	108,528,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	212,736,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	108,363,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	346,689,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	131,223,000	

25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	303,954,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	181,843,500	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	101,863,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	200,880,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	101,430,000	
27年度2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	101,920,000	
令和2年2回 広島県公募公債	100,000,000	99,910,000	
25年度8回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,469,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	406,516,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	214,402,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	117,597,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	115,682,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	347,724,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	111,618,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	203,136,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	101,162,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	201,982,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	100,271,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	107,755,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	114,089,000	
21年度2回 福岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,744,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	346,272,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	302,454,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	202,982,000	
25年度6回 千葉県公募公債	100,000,000	101,487,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	100,391,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	110,398,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	111,245,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	101,191,000	
25年度2回 新潟県公募公債	100,000,000	101,517,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	201,304,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	115,761,000	
118回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,007,000	

119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,120,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,105,000	
127回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,315,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,978,000	
132回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,538,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,360,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	406,192,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	611,490,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,045,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,892,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,390,000	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,552,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,160,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,672,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,145,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,115,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,065,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,164,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	100,884,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	101,569,000	
25年度2回 島根県公募公債	106,000,000	107,432,060	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	200,630,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	101,534,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	101,039,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,402,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	230,444,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	457,560,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	115,699,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	112,121,000	

4回	京都市公募公債 20年	100,000,000	112,125,000	
9回	京都市公募公債 20年	200,000,000	236,856,000	
24年度12回	神戸市公募公債	200,000,000	233,072,000	
26年度4回	神戸市公募公債	100,000,000	101,598,000	
30年度7回	神戸市公募公債 30年	300,000,000	304,287,000	
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	405,904,000	
2回	横浜市公募公債 30年	100,000,000	128,794,000	
17回	横浜市公募公債 20年	100,000,000	114,231,000	
29回	横浜市公募公債 20年	100,000,000	115,750,000	
23年度7回	札幌市公募公債 30年	100,000,000	130,031,000	
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	202,552,000	
26年度4回	札幌市公募公債 10年	100,000,000	101,380,000	
29年度5回	札幌市公募公債 20年	300,000,000	310,425,000	
第91回	川崎市公募公債	200,000,000	201,914,000	
5回	川崎市公募公債 30年	100,000,000	130,233,000	
6回	北九州市公募公債 20年	100,000,000	113,867,000	
17回	北九州市公募公債 20年	100,000,000	115,633,000	
22年度8回	福岡市公募公債	100,000,000	132,300,000	
30年度7回	福岡市公募公債	200,000,000	209,392,000	
2019年度5回	福岡市公募公債 20年	100,000,000	97,305,000	
26年度3回	広島市公募公債	100,000,000	101,378,000	
29年度2回	広島市公募公債	200,000,000	207,636,000	
29年度6回	広島市公募公債	300,000,000	303,480,000	
30年度2回	仙台市公募公債 20年	100,000,000	105,139,000	
26年度1回	相模原市公募公債	100,000,000	101,482,000	
26年度1回	三重県公募公債	100,000,000	101,391,000	
地方債証券 合計		26,145,330,000	27,510,897,694	
特殊債券				
9回	新関西国際空港社債	200,000,000	215,892,000	
12回	新関西国際空港社債	200,000,000	214,664,000	
78回	日本政策投資銀行債券	300,000,000	302,592,000	
127回	日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,057,000	
131回	日本政策投資銀行債券	100,000,000	98,245,000	
19回	政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,915,000	
19回	高速道路機構債	150,000,000	220,507,500	
26回	高速道路機構債	200,000,000	269,302,000	

75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,299,000	
101回 日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	201,706,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	101,322,000	
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,295,000	
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,356,000	
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,782,000	
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	120,430,000	
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	127,972,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	111,577,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	197,860,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	103,797,000	
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,649,000	
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	123,747,000	
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	576,390,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,568,000	
177回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,862,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,502,000	
189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	504,055,000	
193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	507,320,000	
195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	436,837,000	
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	106,471,050	
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,494,000	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,657,000	
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,330,000	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	334,281,000	
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	507,355,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,256,000	

254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,613,000	
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	234,342,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,745,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,495,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	805,240,000	
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,186,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,301,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	195,000,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	195,562,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	651,625,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	227,896,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	349,467,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	350,544,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	118,288,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	322,305,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	233,120,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	115,521,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	231,868,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,188,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	404,044,000	
44回 地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,945,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,735,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	550,742,460	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	115,696,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,545,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,297,000	

44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	225,696,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	349,314,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	401,388,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,330,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	104,219,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,793,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,792,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,332,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	231,792,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,042,230	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	108,467,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	107,606,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	213,780,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	196,912,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	111,092,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	101,454,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	232,066,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,401,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	413,203,000	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,580,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,911,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,194,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	318,295,000	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,432,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,913,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,302,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,367,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,273,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,504,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	499,635,000	

6 回貸付債権担保 S 種住宅金融 公庫債券	30,498,000	30,720,025	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融 公庫債券	21,304,000	21,616,316	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融 公庫債券	32,412,000	32,889,428	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融 支援機構債券	34,452,000	35,227,514	
4 0 回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	51,608,000	53,285,776	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	11,420,000	11,693,851	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	55,040,000	55,977,881	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	33,399,000	34,136,115	
1 回貸付債権担保住宅金融支援 機構債券	54,775,000	55,620,178	
4 回貸付債権担保住宅金融支援 機構債券	11,302,000	11,533,464	
2 7 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	19,154,000	20,315,690	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	116,120,000	124,179,889	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	179,664,000	189,710,810	
3 8 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	24,971,000	26,317,686	
4 9 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	21,919,000	23,058,130	
5 2 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	26,493,000	27,817,385	
5 3 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	28,183,000	29,620,896	
6 0 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	36,993,000	38,922,554	
6 4 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	82,192,000	86,090,366	
7 6 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	35,718,000	37,425,320	
8 2 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	42,139,000	43,837,201	
8 4 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	42,670,000	44,428,430	
8 6 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	46,579,000	48,500,849	
9 0 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	48,643,000	50,342,586	
9 3 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	54,215,000	55,349,177	

9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,635,000	62,400,691	
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,731,000	65,060,829	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	231,828,000	233,098,417	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,734,000	79,749,668	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,347,000	79,439,157	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,436,000	79,477,630	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	244,425,000	247,270,107	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	244,860,000	247,543,665	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,760,000	167,598,278	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	249,117,000	251,496,067	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	248,811,000	251,274,228	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	430,815,000	437,130,747	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,589,000	86,782,110	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,306,000	88,706,026	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	279,897,000	280,666,716	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	373,320,000	375,690,582	
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	286,374,000	288,644,945	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,850,000	297,029,457	
1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	889,749,000	896,297,552	
2 1 回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,147,000	
い第8 2 8号 利付商工債	100,000,000	100,240,000	
い第8 4 3号 利付商工債	100,000,000	100,208,000	
い第8 5 1号 利付商工債	300,000,000	300,105,000	
い第8 5 4号 利付商工債	300,000,000	299,928,000	
3 4 2回 利附信金中金債(5年)	100,000,000	100,130,000	
3 6 9回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	400,300,000	
7回 広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	101,339,000	
1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	116,001,000	

	18回 国際協力機構債券	100,000,000	101,377,000	
	72回 東日本高速道路社債	200,000,000	200,334,000	
	77回 東日本高速道路社債	300,000,000	300,270,000	
	85回 中日本高速道路債券	300,000,000	300,294,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	505,630,000	
	71回 鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,520,000	
	78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	105,894,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	200,750,000	
特殊債券 合計		27,143,447,000	28,677,181,629	
社債券	25回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2017)	300,000,000	302,379,000	
	26回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2018)	100,000,000	100,346,000	
	2回 BPCE SA円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	100,124,000	
	6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	203,300,000	
	11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	99,844,000	
	25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,957,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	400,244,000	
	344回 東京交通債券	100,000,000	102,034,000	
	16回 成田国際空港社債	100,000,000	101,552,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	97,667,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	100,275,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	201,380,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	200,000,000	
	56回 中日本高速道路社債	100,000,000	101,524,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	199,998,000	
	25回 西日本高速道路社債	200,000,000	202,972,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	101,966,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	302,889,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,620,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	200,052,000	
	10回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,629,000	
	9回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	102,141,000	
	12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	102,363,000	
	14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	200,462,000	
	30回 東レ社債	300,000,000	302,352,000	
	42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	199,924,000	
	49回 住友化学社債	100,000,000	101,984,000	

19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,388,000	
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	207,956,000	
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,026,000	
6回 JXホールディングス社債	100,000,000	101,718,000	
14回 プリヂストン社債	300,000,000	303,204,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	101,420,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	100,865,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	201,448,000	
29回 三菱重工業社債	100,000,000	101,475,000	
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	101,190,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	202,510,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	202,888,000	
26回 トヨタ自動車	200,000,000	200,172,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	103,639,000	
47回 住友商事社債	100,000,000	101,440,000	
48回 クレディセゾン社債	100,000,000	101,792,000	
13回 新生銀行社債	200,000,000	199,780,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	111,544,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,590,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	202,732,000	
10回 セブン銀行社債	100,000,000	100,953,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	302,187,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	404,388,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	100,637,000	
96回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	100,059,000	
47回 日立キャピタル社債	200,000,000	202,126,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	302,166,000	
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,408,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	201,302,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	304,407,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	106,191,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	100,926,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	201,734,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	107,282,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	100,688,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	321,189,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	215,438,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	115,836,000	

71回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,935,000	
73回	東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	233,964,000	
107回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	114,034,000	
125回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,437,000	
127回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,853,000	
147回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,664,000	
160回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,985,000	
165回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	200,734,000	
171回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	198,692,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	311,079,000	
21回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,220,000	
70回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,596,000	
71回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,167,000	
74回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,230,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	303,648,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	208,140,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,925,000	
32回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,526,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	132,536,400	
47回	東京地下鉄社債	100,000,000	97,146,000	
30回	光通信社債	200,000,000	203,556,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,312,000	
527回	中部電力社債	100,000,000	103,827,000	
497回	関西電力社債	100,000,000	103,129,000	
508回	関西電力社債	300,000,000	304,284,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	200,212,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	407,500,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	100,714,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	101,476,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	104,223,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	103,932,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	409,168,000	
488回	東北電力社債	100,000,000	100,712,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	200,270,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	203,014,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	204,670,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	408,884,000	
428回	九州電力社債	100,000,000	102,252,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	101,895,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	99,743,000	
493回	九州電力社債	200,000,000	199,652,000	
321回	北海道電力社債	261,000,000	267,256,170	
340回	北海道電力社債	300,000,000	304,116,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	203,522,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	213,690,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	305,622,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	101,014,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	304,413,000	

41回	東京瓦斯社債	200,000,000	203,378,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	99,136,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	95,453,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	101,548,000	
30回	大阪瓦斯社債	100,000,000	100,750,000	
27回	NTTデータ社債	200,000,000	202,596,000	
5回	ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,043,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	202,536,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	207,024,000	
社債券 合計		20,481,000,000	20,906,705,570	
合計			503,196,814,093	

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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	674,344,838
コール・ローン	263,827,609
国債証券	150,947,946,038
派生商品評価勘定	41,223
未収入金	238,391,349
未収利息	866,220,410
前払費用	59,728,180
流動資産合計	153,050,499,647
資産合計	
153,050,499,647	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,663,783
未払金	111,122,396
未払解約金	539,351,000
流動負債合計	653,137,179
負債合計	
653,137,179	
純資産の部	
元本等	
元本	73,208,120,285
剰余金	
剰余金又は欠損金()	79,189,242,183
元本等合計	152,397,362,468
純資産合計	
152,397,362,468	
負債純資産合計	
153,050,499,647	

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5月12日 至 2021年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基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11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	68,771,080,570円
同期中追加設定元本額	15,806,603,378円
同期中一部解約元本額	11,369,563,663円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,853,741,573円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	6,345,695円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	27,702,668円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	43,851,180円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	58,553,867円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	35,139,311円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	21,223,814円
たわらノーロード 先進国債券	12,399,888,857円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	222,039,532円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,472,804,630円
たわらノーロード バランス（堅実型）	42,636,287円
たわらノーロード バランス（標準型）	204,811,412円
たわらノーロード バランス（積極型）	42,427,957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）	6,391,546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）	354,906,978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）	394,328,033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）	90,271,309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）	161,833円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,970,006円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	23,693,868円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,272,611円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,913,086円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,174,379,568円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	563,311,838円

Oneグローバルバランス	2,337,797円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	678,806,294円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,127,129,844円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,306,180,397円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	396,490,996円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	808,341,212円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	706,504,947円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	13,972,311円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	463,466,681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)	119,126,488円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	202,700,465円
クルーズコントロール	1,566,804,653円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	146,939,002円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	310,959,006円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	5,761,037円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	14,015,437円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	383,557,915円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	174,153,606円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	60,224,753円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,215,237,902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)	9,981,003円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	10,287,407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)	145,358,964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)	6,295,855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)	9,551,784円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	1,131,262,663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)	717,514,799円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	9,757,945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)	5,714,154,622円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	3,988,738,848円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,563,995,087円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,408,508,131円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	53,849,150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)	16,408,969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)	438,712,047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)	253,223,713円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	21,704,837円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	43,141,526円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,672,391円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	683,572円

D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	19,181,207円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	53,395,639円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,092,977,086円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,656,116,574円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,910,311,873円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	128,613,483円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	179,974,946円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,924,709,890円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	439,372,699円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,682,632円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	372,898,823円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	362,316,204円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	538,114,909円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	60,867,299円
計	73,208,120,285円
2. 受益権の総数	73,208,120,285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 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	1,755,220,056	
合計	1,755,220,056	

(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(2021年2月23日から2021年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	510,000,000	-	512,622,560	2,622,560
アメリカ・ドル	268,618,000	-	271,255,663	2,637,663
イギリス・ポンド	31,751,000	-	31,709,777	41,223
ユーロ	209,631,000	-	209,657,120	26,120
合計	510,000,000	-	512,622,560	2,622,560

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0817円 (20,817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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	5,000,000.000	4,949,414.050	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,000,000.000	3,957,031.240	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,000,000.000	2,989,394.520	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,592,437.480	
		US T N/B 0.125 07/31/23	2,640,000.000	2,626,696.850	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,000,000.000	1,989,375.000	
		US T N/B 0.125 08/31/23	530,000.000	526,935.930	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,987,968.740	
		US T N/B 0.125 11/30/22	5,340,000.000	5,337,079.660	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,000,000.000	1,981,640.620	
		US T N/B 0.25 03/15/24	4,810,000.000	4,765,282.000	
		US T N/B 0.25 04/15/23	2,000,000.000	1,998,085.940	
		US T N/B 0.25 05/15/24	2,000,000.000	1,977,421.860	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,470,000.000	4,357,551.560	
		US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,794,531.230	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,733,931.250	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,000,000.000	2,921,132.790	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	972,304.680	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,000,000.000	970,703.120	
		US T N/B 0.25 09/30/23	2,500,000.000	2,490,039.050	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,000,000.000	2,910,468.750	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,936,718.740	
		US T N/B 0.375 01/31/26	4,000,000.000	3,878,437.480	
		US T N/B 0.375 04/15/24	5,000,000.000	4,963,085.900	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,000,000.000	1,960,937.500	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,500,000.000	3,324,042.960	
US T N/B 0.375 08/15/24	3,500,000.000	3,463,632.790			
US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,977,500.000			
US T N/B 0.375 09/30/27	1,050,000.000	993,562.500			

US T N/B 0.375 11/30/25	2,590,000.000	2,518,066.790	
US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,912,812.500	
US T N/B 0.5 02/28/26	2,500,000.000	2,434,375.000	
US T N/B 0.5 03/15/23	2,000,000.000	2,005,273.400	
US T N/B 0.5 03/31/25	1,300,000.000	1,281,972.640	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,000,000.000	1,918,320.320	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,500,000.000	1,437,128.890	
US T N/B 0.5 06/30/27	5,540,000.000	5,303,467.920	
US T N/B 0.5 08/31/27	2,000,000.000	1,907,734.360	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,855,859.360	
US T N/B 0.625 03/31/27	1,800,000.000	1,741,042.960	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,220,000.000	4,862,042.570	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,200,000.000	3,116,749.970	
US T N/B 0.625 08/15/30	5,120,000.000	4,755,999.990	
US T N/B 0.625 10/15/24	3,500,000.000	3,482,226.540	
US T N/B 0.625 11/30/27	2,000,000.000	1,914,609.360	
US T N/B 0.625 12/31/27	2,430,000.000	2,324,589.240	
US T N/B 0.75 01/31/28	3,390,000.000	3,263,139.820	
US T N/B 0.75 03/31/26	2,570,000.000	2,527,032.810	
US T N/B 0.75 04/30/26	3,000,000.000	2,947,148.430	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,000,000.000	2,945,039.040	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,000,000.000	3,916,562.480	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	3,264,487.500	
US T N/B 0.875 11/15/30	7,000,000.000	6,638,789.000	
US T N/B 1.0 07/31/28	3,000,000.000	2,916,679.680	
US T N/B 1.125 02/15/31	6,860,000.000	6,640,801.510	
US T N/B 1.125 02/28/25	1,000,000.000	1,007,656.250	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,093,447.260	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,020,000.000	2,976,351.540	
US T N/B 1.125 05/15/40	2,100,000.000	1,831,101.540	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,500,000.000	3,043,769.490	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,000,000.000	2,939,062.500	
US T N/B 1.25 03/31/28	2,910,000.000	2,883,969.110	
US T N/B 1.25 04/30/28	3,170,000.000	3,140,033.570	
US T N/B 1.25 05/15/50	3,780,000.000	3,215,141.010	
US T N/B 1.25 05/31/28	1,500,000.000	1,484,648.430	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,000,000.000	2,966,835.930	
US T N/B 1.25 08/15/31	6,160,000.000	6,001,187.490	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,472,406.250	
US T N/B 1.25 09/30/28	3,000,000.000	2,959,804.680	
US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,333,043.730	
US T N/B 1.375 02/15/23	4,000,000.000	4,055,781.240	
US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,515,819.520	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,040,000.000	3,542,101.530	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,109,582.020	
US T N/B 1.375 09/30/23	1,500,000.000	1,525,078.120	
US T N/B 1.375 11/15/40	1,810,000.000	1,642,575.000	
US T N/B 1.5 01/31/27	2,490,000.000	2,524,237.500	
US T N/B 1.5 02/15/30	3,970,000.000	3,981,165.620	

US T N/B 1.5 02/28/23	1,000,000.000	1,016,289.060	
US T N/B 1.5 03/31/23	2,000,000.000	2,032,968.740	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,090,000.000	3,135,867.180	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,200,000.000	2,243,914.040	
US T N/B 1.5 11/30/24	2,000,000.000	2,040,468.740	
US T N/B 1.625 02/15/26	2,180,000.000	2,225,899.200	
US T N/B 1.625 04/30/23	3,000,000.000	3,056,835.930	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,090,000.000	3,156,145.310	
US T N/B 1.625 05/15/31	7,740,000.000	7,818,911.680	
US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	2,957,546.870	
US T N/B 1.625 08/15/29	1,380,000.000	1,399,567.950	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,900,000.000	1,939,410.140	
US T N/B 1.625 10/31/23	4,500,000.000	4,597,910.140	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,399,111.310	
US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,701,994.900	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,400,000.000	4,103,171.850	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,846,977.720	
US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,070,457.010	
US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,675,060.920	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,375,541.390	
US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,790,466.000	
US T N/B 1.75 08/15/41	2,570,000.000	2,481,756.620	
US T N/B 1.75 11/15/29	1,940,000.000	1,985,923.420	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,600,000.000	1,644,812.490	
US T N/B 1.75 12/31/26	1,740,000.000	1,786,490.620	
US T N/B 1.875 02/15/41	4,110,000.000	4,056,216.760	
US T N/B 1.875 02/15/51	4,770,000.000	4,715,592.180	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,450,000.000	2,528,955.070	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,445,821.460	
US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,215,793.730	
US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,466,788.630	
US T N/B 2.0 02/15/25	4,300,000.000	4,451,339.830	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,270,000.000	3,325,181.250	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,925,397.630	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,369,191.360	
US T N/B 2.0 08/15/51	3,690,000.000	3,759,475.750	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	4,299,616.370	
US T N/B 2.0 11/30/22	5,590,000.000	5,696,122.620	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,344,230.450	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,220,887.500	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,320,000.000	3,454,226.530	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,138,726.560	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	3,041,591.770	
US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	2,064,609.360	
US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,638,701.520	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	362,728.510	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,550,000.000	3,729,302.720	
US T N/B 2.25 03/31/26	2,260,000.000	2,367,791.400	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,427,230.440	

US T N/B 2.25 05/15/41	4,390,000.000	4,601,097.230	
US T N/B 2.25 08/15/27	5,830,000.000	6,137,441.370	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,710,000.000	1,813,067.560	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,500,000.000	2,677,050.770	
US T N/B 2.25 10/31/24	2,000,000.000	2,084,921.860	
US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	4,889,691.380	
US T N/B 2.25 11/15/25	4,690,000.000	4,910,210.130	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,442,058.170	
US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	3,130,546.860	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,854,393.740	
US T N/B 2.375 05/15/27	5,200,000.000	5,505,093.710	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,810,000.000	2,994,625.750	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,100,000.000	5,632,312.500	
US T N/B 2.375 08/15/24	3,920,000.000	4,092,878.110	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	3,047,216.370	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,053,045.690	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,080,000.000	2,290,437.480	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,183,006.250	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,697,720.680	
US T N/B 2.5 03/31/23	3,020,000.000	3,111,897.630	
US T N/B 2.5 05/15/24	4,240,000.000	4,431,296.840	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,810,000.000	2,007,190.990	
US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,485,440.200	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,316,079.670	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,110,000.000	4,445,221.870	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,800,000.000	1,855,335.920	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,272,533.180	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,886,117.170	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,192,321.070	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,434,466.770	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,576,440.590	
US T N/B 2.75 02/15/28	2,370,000.000	2,567,561.700	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,660,000.000	1,761,026.550	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,578,122.640	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,390,836.700	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	839,714.440	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,400,800.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	430,000.000	488,285.150	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,880,000.000	2,192,476.540	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,259,258.190	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,745,318.750	
US T N/B 2.75 11/15/23	5,520,000.000	5,764,734.330	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,220,000.000	1,385,939.040	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,140,000.000	2,498,032.000	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	4,840,986.280	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,400,000.000	2,782,781.230	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,090,000.000	3,724,657.000	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,699,292.570	
US T N/B 2.875 07/31/25	1,860,000.000	1,986,930.450	

US T N/B 2.875 08/15/28	2,730,000.000	2,987,003.890	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,890,000.000	2,225,032.020	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	877,832.810	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	3,860,230.060	
US T N/B 2.875 11/15/46	920,000.000	1,092,464.040	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,640,000.000	1,993,112.490	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,540,000.000	3,108,622.630	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	3,779,217.940	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,155,328.120	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,300,000.000	1,558,933.580	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,290,000.000	1,572,086.710	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,710,000.000	3,323,772.620	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,515,419.520	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,066,849.990	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,790,000.000	2,135,763.650	
US T N/B 3.0 11/15/45	650,000.000	781,955.070	
US T N/B 3.125 02/15/42	680,000.000	815,946.870	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,731,825.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,760,000.000	3,458,948.400	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,750,000.000	2,124,199.210	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,670,000.000	5,201,212.500	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	909,981.250	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,530,000.000	1,925,528.890	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,660,000.000	3,492,289.030	
US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,132,593.750	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	2,121,801.550	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,170,000.000	1,517,572.260	
US T N/B 3.75 08/15/41	710,000.000	924,109.370	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,797,537.500	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,461,471.070	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,112,421.080	
US T N/B 4.25 11/15/40	510,000.000	702,684.370	
US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	762,437.500	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,200,000.000	1,677,796.870	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,460,956.240	
US T N/B 4.375 11/15/39	910,000.000	1,269,023.430	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,030,000.000	1,425,906.250	
US T N/B 4.5 05/15/38	540,000.000	759,037.500	
US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,116,677.330	
US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,076,367.170	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,757,812.500	
US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	733,398.430	
US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,068,941.400	
US T N/B 5.375 02/15/31	700,000.000	937,398.430	
US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	821,843.750	
US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,012,593.750	
US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,151,085.930	
US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	982,961.710	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,101,835.930	

アメリカ・ドル	小計	597,510,000.000 (68,092,239,600)	619,470,846.660 (70,594,897,687)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	900,000.000	881,910.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,500,000.000	1,494,253.200	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,782,701.280	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,000,000.000	964,470.000	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,440,000.000	1,350,072.000	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,200,000.000	1,180,525.440	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	600,000.000	575,004.000	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	970,000.000	828,273.300	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	750,000.000	751,777.500	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,300,000.000	1,223,833.000	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	860,000.000	769,132.400	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,260,000.000	1,265,602.960	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	760,000.000	719,963.200	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	910,000.000	915,987.800	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,470,000.000	1,486,875.600	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	390,000.000	390,074.100	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	700,000.000	722,269.800	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	390,000.000	408,057.000	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,340,000.000	1,369,372.800	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	936,843.480	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,030,000.000	1,125,656.100	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	986,744.880	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	970,000.000	1,127,657.200	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	500,000.000	659,870.000		
UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	591,678.540		
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,210,000.000	1,481,185.200		

	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,440,000.000	1,576,857.600	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	832,186.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,216,764.550	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	980,000.000	1,535,424.800	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	509,331.840	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	910,000.000	1,292,617.500	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	1,906,828.800	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	1,907,485.800	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	870,000.000	1,486,325.400	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	770,000.000	1,516,746.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,140,000.000	1,625,890.800	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,010,000.000	1,344,542.300	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	720,000.000	1,089,871.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	943,659.440	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,480,863.360	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	1,789,254.560	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	850,000.000	1,508,714.980	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	1,963,273.560	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	860,000.000	1,217,854.600	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,180,000.000	1,934,041.240	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	870,000.000	1,166,043.600	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	880,000.000	1,386,968.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,410,000.000	1,614,802.500	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,035,309.690	
	イギリス・ボンド 小計	48,750,000.000 (7,447,537,500)	59,871,448.900 (9,146,561,248)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,350,000.000	1,324,185.300	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	1,000,000.000	1,012,016.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,000,000.000	942,989.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,112,215.000	

	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,766,720.060	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,160,000.000	1,253,483.240	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,807,820.600	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,390,000.000	1,764,008.690	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,320,000.000	2,450,395.600	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,500,000.000	2,353,087.500	
イスラエル・シュケル 小計		16,960,000.000 (619,358,848)	18,786,920.990 (686,075,810)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,440,000.000	1,412,664.410	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,398,146.950	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	310,000.000	298,334.720	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,600,000.000	1,492,785.360	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,560,000.000	1,469,812.520	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,390,000.000	1,322,047.410	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,640,000.000	1,610,130.260	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	930,000.000	775,434.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	900,000.000	896,285.850	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,180,000.000	1,230,799.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,050,000.000	2,191,352.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,082,246.800	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	740,000.000	785,010.050	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	579,787.980	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,630,000.000	1,744,507.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,160,000.000	1,255,577.850	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,684,488.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	960,654.430	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	190,000.000	204,158.490	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,000,000.000	1,119,646.200	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	709,507.970		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	924,754.850		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,272,882.470		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	880,000.000	1,127,548.840		
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,120,000.000	2,274,864.940		
オーストラリア・ドル 小計		30,500,000.000 (2,544,920,000)	31,823,428.850 (2,655,346,903)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	4,000,000.000	4,002,660.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	3,000,000.000	2,930,985.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	3,000,000.000	2,993,850.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	3,000,000.000	2,996,655.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,000,000.000	3,078,960.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	1,100,000.000	1,156,947.000	
オフショア・人民元 小計		17,100,000.000 (304,527,060)	17,160,057.000 (305,596,591)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	500,000.000	496,743.000	
	CANADA 0.25 03/01/26	1,300,000.000	1,237,585.700	
	CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,470,178.500	
	CANADA 0.25 05/01/23	1,000,000.000	991,130.000	
	CANADA 0.25 08/01/23	700,000.000	691,828.900	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,550,000.000	1,500,400.000	
	CANADA 0.5 11/01/23	620,000.000	613,982.280	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,300,000.000	1,175,189.600	
	CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	681,641.800	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,070,000.000	1,046,686.840	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	700,060.200	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,810,000.000	1,759,763.450	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,221,607.530	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	803,204.800	
	CANADA 1.5 06/01/31	1,970,000.000	1,938,870.060	
	CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	444,091.560	
	CANADA 1.75 03/01/23	2,460,000.000	2,489,660.220	
	CANADA 1.75 12/01/53	410,000.000	382,593.960	
	CANADA 2.0 06/01/28	420,000.000	432,332.040	
	CANADA 2.0 09/01/23	880,000.000	896,052.960	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,430,000.000	2,424,697.740	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	544,184.920	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,000,000.000	1,033,999.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	640,635.420	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,550,000.000	1,603,678.050	
	CANADA 2.75 12/01/48	800,000.000	924,946.400	
CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	414,829.800		
CANADA 3.5 12/01/45	780,000.000	1,004,653.260		
CANADA 4.0 06/01/41	540,000.000	719,515.980		
CANADA 5.0 06/01/37	390,000.000	554,265.270		
CANADA 5.75 06/01/29	1,000,000.000	1,297,546.000		
CANADA 5.75 06/01/33	520,000.000	734,422.000		
カナダ・ドル 小計		31,840,000.000 (2,905,400,000)	32,870,977.240 (2,999,476,673)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	200,000.000	195,100.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	200,000.000	198,493.750	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	200,000.000	202,900.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	440,000.000	423,720.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	50,000.000	48,931.250	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	287,449.400	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	420,000.000	436,212.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	480,000.000	499,912.800	

	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	355,470.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	180,000.000	190,980.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	380,000.000	404,700.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	473,340.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	427,522.800	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	723,450.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	470,000.000	510,420.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	404,040.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	581,185.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	556,080.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	805,117.000	
シンガポール・ドル 小計		7,270,000.000 (612,352,100)	7,725,024.000 (650,678,772)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	3,500,000.000	3,454,769.070	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	1,540,000.000	1,603,402.410	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,170,000.000	3,315,661.500	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,459,291.250	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	4,700,000.000	4,860,059.440	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,700,000.000	3,253,162.500	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,980,000.000	8,702,048.750	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	4,918,191.500	
スウェーデン・クローナ 小計		31,110,000.000 (407,229,900)	34,566,586.420 (452,476,616)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	3,300,000.000	3,303,872.550	
	DENMARK 0.25 11/15/22	3,510,000.000	3,541,957.490	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,320,000.000	2,319,605.600	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,472,097.400	
	DENMARK 0.5 11/15/29	4,370,000.000	4,605,149.700	
	DENMARK 1.5 11/15/23	3,500,000.000	3,653,300.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,797,150.800	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,680,000.000	13,817,915.120	
デンマーク・クローネ 小計		37,130,000.000 (653,116,700)	44,511,048.660 (782,949,346)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,800,000.000	1,742,850.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,664,128.200	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,768,938.360	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,900,000.000	1,920,311.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,837,544.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,750,000.000	2,781,831.250	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,129,305.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,800,000.000	1,823,173.920	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,436,034.000	
ノルウェー・クローネ 小計		27,820,000.000 (366,945,800)	28,104,116.230 (370,693,293)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,400,000.000	1,236,060.000	

	POLAND 0.75 04/25/25	180,000.000	167,256.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,050,000.000	3,545,510.580	
	POLAND 2.25 10/25/24	1,000,000.000	980,552.560	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,850,000.000	2,847,620.500	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,266,985.500	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,180,000.000	2,143,376.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,250,000.000	2,202,862.500	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,510,000.000	3,483,499.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	210,000.000	208,467.310	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,404,990.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,240,000.000	3,310,146.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,726,446.960	
	ポーランド・ズロチ 小計	26,980,000.000 (765,713,984)	26,523,773.410 (752,765,908)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	930,424.130	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	1,021,081.700	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,239,669.930	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,040,185.600	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,700,000.000	1,666,167.690	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,199,368.130	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	826,562.640	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	800,000.000	824,609.680	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	500,000.000	518,211.750	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,700,000.000	2,795,755.230	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,521,524.240	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,241,806.710	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,919,198.880	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	529,837.150	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,400,000.000	1,482,066.460	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,600,000.000	2,764,582.600		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,143,162.600		
	マレーシア・リンギット 小計	26,730,000.000 (732,281,715)	27,664,215.120 (757,875,005)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	8,000,000.000	8,028,080.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	9,985,029.160	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	22,596,000.000	24,430,957.890	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	19,143,000.000	18,165,679.010	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	18,353,317.810	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	15,000,000.000	15,495,750.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	13,643,000.000	13,801,853.630	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,254,030.000	

	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	20,000,000.000	20,478,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	11,654,000.000	12,056,212.170	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,293,116.600	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	17,109,000.000	18,391,572.760	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	12,125,000.000	13,173,218.370	
	メキシコ・ペソ 小計	186,426,000.000 (1,031,532,343)	193,906,817.400 (1,072,925,202)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	690,000.000	695,812.210	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	530,000.000	531,188.040	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	200,000.000	202,087.600	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	220,000.000	205,238.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	140,000.000	139,202.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	820,000.000	862,175.060	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	650,000.000	682,457.100	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	875,000.000	933,569.870	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	390,000.000	421,061.550	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	480,000.000	509,375.520	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	250,000.000	248,322.250	
	AUSTRIA 07/15/23	650,000.000	657,910.500	
	AUSTRIA 07/15/24	800,000.000	813,756.800	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	685,147.520	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	630,000.000	798,454.440	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	206,055.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	800,000.000	854,879.200	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	780,000.000	817,919.700	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	350,000.000	608,282.850	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	680,000.000	874,694.880	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	570,000.000	925,658.050	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	771,283.500	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	454,323.450	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,426,581.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	740,000.000	916,268.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	928,164.400	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	610,000.000	622,600.770	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	570,000.000	565,951.860	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	814,800.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	672,474.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	430,000.000	421,255.520	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	548,116.990	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	330,000.000	292,083.450	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,140,000.000	1,197,192.660	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	840,000.000	896,187.600	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	930,000.000	1,000,540.500	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,050,000.000	1,137,116.400	

BELGIUM 1.0 06/22/26	1,460,000.000	1,560,426.100	
BELGIUM 1.0 06/22/31	930,000.000	1,021,614.300	
BELGIUM 1.25 04/22/33	710,000.000	802,228.290	
BELGIUM 1.45 06/22/37	340,000.000	395,001.460	
BELGIUM 1.6 06/22/47	670,000.000	814,472.770	
BELGIUM 1.7 06/22/50	670,000.000	836,331.520	
BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	681,656.800	
BELGIUM 2.15 06/22/66	420,000.000	619,962.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	870,038.370	
BELGIUM 2.25 06/22/57	350,000.000	503,782.300	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,220,000.000	1,325,838.660	
BELGIUM 3.0 06/22/34	590,000.000	795,532.990	
BELGIUM 3.75 06/22/45	740,000.000	1,252,635.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	730,000.000	1,030,509.610	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,110,000.000	1,876,720.290	
BELGIUM 4.5 03/28/26	430,000.000	526,723.340	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,090,000.000	1,775,824.730	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,040,000.000	1,435,239.520	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,430,000.000	1,467,780.600	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,250,000.000	1,278,699.500	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	600,000.000	616,212.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,400,000.000	1,434,902.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	670,000.000	688,840.400	
BUNDESOBL 04/05/24	1,540,000.000	1,568,145.040	
BUNDESOBL 04/14/23	1,030,000.000	1,041,608.100	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,299,340.800	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,153,645.250	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,742,390.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,660,000.000	1,704,106.200	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,700,000.000	1,730,702.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,050,000.000	1,062,873.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,000,000.000	2,058,800.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	500,000.000	516,970.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	500,000.000	512,105.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	450,000.000	462,813.750	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,720,000.000	1,706,406.880	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	400,000.000	401,144.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	500,000.000	490,855.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,200,000.000	1,237,224.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	500,000.000	515,714.900	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,960,000.000	2,043,280.400	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,890,000.000	1,985,840.010	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,510,545.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,060,000.000	2,140,772.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,810,000.000	1,896,318.900	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,640,000.000	1,743,598.800	

DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,000,000.000	2,119,628.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,680,000.000	1,726,401.600	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,610,000.000	1,660,548.360	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,404,547.800	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,770,000.000	1,881,049.800	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,820,000.000	2,433,097.940	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,420,000.000	1,461,422.820	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,707,756.930	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,950,000.000	2,060,955.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,750,000.000	2,908,980.250	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,930,000.000	3,075,955.020	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,760,000.000	2,807,481.600	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,890,000.000	3,099,854.370	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,260,000.000	2,152,306.800	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,730,000.000	2,850,097.150	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,140,000.000	2,044,932.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,100,000.000	1,490,841.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,760,000.000	2,897,364.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,140,000.000	2,201,488.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	1,919,718.400	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,160,000.000	1,607,191.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	968,142.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,104,639.300	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	999,296.600	
FINLAND 0.0 09/15/24	180,000.000	183,432.960	
FINLAND 0.0 09/15/30	170,000.000	171,635.570	
FINLAND 0.125 04/15/36	240,000.000	237,775.920	
FINLAND 0.125 04/15/52	210,000.000	195,272.280	
FINLAND 0.125 09/15/31	240,000.000	243,474.000	
FINLAND 0.25 09/15/40	270,000.000	269,734.050	
FINLAND 0.5 04/15/26	580,000.000	606,187.580	
FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	525,773.500	
FINLAND 0.5 09/15/28	190,000.000	200,056.510	
FINLAND 0.5 09/15/29	370,000.000	390,626.020	
FINLAND 0.75 04/15/31	250,000.000	269,378.250	
FINLAND 0.875 09/15/25	390,000.000	411,853.650	
FINLAND 09/15/23	260,000.000	263,619.980	
FINLAND 1.125 04/15/34	290,000.000	327,860.660	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	355,410.440	

FINLAND 1.5 04/15/23	470,000.000	485,430.100	
FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	298,839.800	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	518,823.900	
FINLAND 2.75 07/04/28	420,000.000	506,988.720	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	503,508.070	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,168,891.380	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	1,100,000.000	1,110,736.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,150,000.000	1,167,569.700	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,660,000.000	2,712,314.220	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	900,000.000	916,110.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,550,000.000	2,569,280.550	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,000,000.000	3,002,501.700	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	1,930,000.000	1,910,308.210	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,550,000.000	2,633,328.900	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,290,000.000	2,375,201.740	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,770,000.000	2,888,356.560	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,620,000.000	2,748,839.020	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,270,000.000	1,271,468.620	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	600,000.000	499,083.000	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	740,000.000	725,799.360	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,170,000.000	3,379,854.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,930,000.000	1,926,993.060	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	450,000.000	445,591.800	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,240,000.000	3,460,548.740	
FRANCE OAT 03/25/23	2,200,000.000	2,222,860.200	
FRANCE OAT 03/25/24	2,520,000.000	2,560,173.840	
FRANCE OAT 03/25/25	2,970,000.000	3,025,661.350	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,460,000.000	2,646,101.460	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,220,000.000	2,355,209.100	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,540,000.000	2,853,010.020	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,470,000.000	2,793,817.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,090,000.000	3,523,287.520	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,000,000.000	2,408,884.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,130,000.000	3,250,498.740	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	820,000.000	1,088,591.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,690,000.000	2,077,804.300	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,980,000.000	3,194,503.380	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,690,000.000	2,247,698.310	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,127,381.300	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,240,000.000	3,961,049.040	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,050,000.000	3,619,105.600	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,600,000.000	2,546,729.600	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,820,000.000	3,325,626.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,260,000.000	2,466,954.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,090,000.000	2,242,919.160	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,760,000.000	2,808,671.360	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,130,000.000	3,437,231.410	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,310,000.000	4,046,231.090	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,550,000.000	2,478,388.000	

FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,628,405.240	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,100,000.000	3,399,921.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,270,961.000	
IRISH 0.0 10/18/31	660,000.000	648,795.840	
IRISH 0.2 05/15/27	640,000.000	656,405.120	
IRISH 0.2 10/18/30	450,000.000	455,882.400	
IRISH 0.4 05/15/35	390,000.000	392,416.050	
IRISH 0.55 04/22/41	280,000.000	279,145.720	
IRISH 0.9 05/15/28	180,000.000	192,486.060	
IRISH 1.0 05/15/26	640,000.000	681,568.640	
IRISH 1.1 05/15/29	520,000.000	565,987.320	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	379,976.780	
IRISH 1.35 03/18/31	270,000.000	302,465.090	
IRISH 1.5 05/15/50	420,000.000	499,889.880	
IRISH 1.7 05/15/37	390,000.000	464,107.020	
IRISH 2.0 02/18/45	600,000.000	783,531.600	
IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	760,163.670	
IRISH 3.4 03/18/24	340,000.000	372,877.660	
IRISH 3.9 03/20/23	570,000.000	605,430.060	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	960,105.600	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	1,007,100.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	990,000.000	985,248.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,000,000.000	1,006,400.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	400,000.000	397,240.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	580,000.000	574,258.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,000,000.000	1,013,700.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,080,000.000	1,097,268.120	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,400,000.000	1,427,109.600	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	500,000.000	501,150.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	500,000.000	509,285.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,210,000.000	1,180,009.180	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	1,000,547.660	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,300,000.000	1,342,380.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,200,000.000	2,214,460.600	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	937,682.400	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	900,000.000	859,770.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,091,132.500	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,170,000.000	1,189,422.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,430,000.000	1,482,481.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,180,000.000	1,183,754.520	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,424,036.700	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,510,000.000	1,591,826.900	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	1,052,538.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,340,000.000	1,413,235.020	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,090,773.840	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	590,000.000	580,973.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,460,000.000	1,542,863.760	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000.000	1,176,780.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,220,000.000	1,306,693.200	

ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,480,000.000	1,591,446.960	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	900,000.000	893,421.000	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,263,044.400	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	770,000.000	807,884.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	853,335.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	900,000.000	963,990.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	920,000.000	1,012,967.840	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,049,317.870	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,040,000.000	1,143,884.560	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,380,000.000	1,508,879.580	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	500,000.000	492,350.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,120,000.000	1,240,960.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,159,842.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,140,000.000	1,315,839.300	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	970,000.000	1,130,438.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	981,074.670	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,250,000.000	1,376,756.250	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,170,000.000	1,265,931.810	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,120,000.000	1,363,152.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	590,000.000	693,250.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.000	1,161,101.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,174,718.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,574,102.880	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,190,000.000	1,507,212.350	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,315,669.410	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,010,000.000	1,281,991.990	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,408,412.940	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,540,000.000	1,895,288.780	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,410,000.000	1,567,212.180	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	1,094,656.100	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,660,000.000	2,283,662.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,655,003.200	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,943,286.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,504,060.600	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,072,235.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,890,000.000	2,433,669.840	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,561,796.030	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,094,421.720	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,349,956.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	2,084,908.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,490,000.000	2,366,120.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,650,000.000	3,614,600.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,074,360.120	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,939,712.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,470,000.000	2,172,513.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,443,529.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,460,808.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,410,507.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	920,000.000	941,976.040	

NETHERLANDS 0.0 01/15/29	280,000.000	285,820.640	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	400,000.000	394,147.200	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	610,000.000	580,043.940	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	950,000.000	966,580.350	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	540,000.000	546,862.860	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,420,000.000	1,464,730.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	821,931.800	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	630,000.000	681,625.980	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,130,000.000	1,187,234.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	820,000.000	876,512.100	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	980,000.000	1,053,971.380	
NETHERLANDS 01/15/24	1,930,000.000	1,961,706.040	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	450,000.000	469,546.060	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	880,000.000	944,760.080	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	980,000.000	1,264,435.200	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,200,000.000	1,997,810.400	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	350,000.000	369,068.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,170,000.000	2,037,469.590	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,160,000.000	1,864,816.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,167,815.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,417,150.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	800,000.000	808,297.600	
SPAIN 0.0 01/31/28	270,000.000	270,040.500	
SPAIN 0.0 04/30/23	990,000.000	999,236.700	
SPAIN 0.0 05/31/24	860,000.000	869,154.700	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,190,000.000	1,158,084.200	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,240,000.000	1,263,199.160	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,620,000.000	1,647,052.380	
SPAIN 0.45 10/31/22	840,000.000	849,211.440	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,850,000.000	1,887,954.600	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,100,000.000	1,105,340.500	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,180,000.000	1,218,203.680	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,200,000.000	1,260,840.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	600,000.000	599,517.000	
SPAIN 1.0 07/30/42	130,000.000	129,961.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,170,000.000	1,107,215.460	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,080,000.000	1,121,977.440	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,370,000.000	1,491,108.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,850,000.000	1,988,777.750	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,440,000.000	1,566,918.720	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,651,185.000	

	SPAIN 1.45 04/30/29	1,170,000.000	1,284,261.720	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,500,000.000	1,633,653.000	
	SPAIN 1.45 10/31/71	300,000.000	276,332.400	
	SPAIN 1.5 04/30/27	1,240,000.000	1,350,422.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,550,087.700	
	SPAIN 1.85 07/30/35	1,490,000.000	1,713,036.610	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,270,000.000	1,394,509.530	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,670,642.960	
	SPAIN 2.15 10/31/25	1,380,000.000	1,516,234.980	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,240,000.000	1,487,380.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	930,000.000	1,264,674.450	
	SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,687,693.700	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,180,000.000	1,646,195.580	
	SPAIN 3.45 07/30/66	920,000.000	1,452,007.480	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,670,000.000	1,849,162.610	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,350,000.000	2,027,053.350	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,221,158.730	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,626,762.660	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,390,000.000	2,341,195.070	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,265,466.660	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,986,660.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,540,000.000	2,090,781.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	910,000.000	1,686,147.190	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,567,818.080	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,220,000.000	1,898,700.640	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,670,000.000	2,154,919.570	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,256,307.940	
	ユーロ 小計	391,165,000.000 (51,176,116,950)	456,467,377.390 (59,719,626,984)	
国債証券 合計		137,659,272,500.200 (137,659,272,500)	150,947,946,038 (150,947,946,038)	
合計			150,947,946,038 (150,947,946,038)	

(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 225銘柄	46.32	46.77
イギリス・ポンド	国債証券 50銘柄	6.00	6.06
イスラエル・シケル	国債証券 10銘柄	0.45	0.45
オーストラリア・ドル	国債証券 25銘柄	1.74	1.76
オフショア・人民元	国債証券 6銘柄	0.20	0.20
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	1.97	1.99
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.43	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.30	0.30
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.51	0.52

ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.24	0.25
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.49	0.50
マレーシア・リングgit	国債証券	17銘柄	0.50	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	0.70	0.71
ユーロ	国債証券	337銘柄	39.19	39.56

(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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,889,586,289
投資証券	211,714,890,900
未収入金	882,340,627
未収配当金	1,860,621,227
前払金	205,688,480
差入委託証拠金	226,870,000
流動資産合計	217,779,997,523
資産合計	217,779,997,523
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	187,423,130
未払解約金	502,568,000
流動負債合計	689,991,130
負債合計	689,991,130
純資産の部	
元本等	
元本	88,358,860,745
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	128,731,145,648
元本等合計	217,090,006,393
純資産合計	217,090,006,393
負債純資産合計	217,779,997,523

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5月12日 至 2021年11月11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11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	32,426,571,903円
同期中追加設定元本額	97,387,928,185円
同期中一部解約元本額	41,455,639,343円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	236,245円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,022,431円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	2,330,727円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	2,142,043円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	1,314,812円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,163,019円
たわらノーロード 国内リート	4,562,316,742円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	690,983,219円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,248,735,814円
たわらノーロード バランス(堅実型)	23,916,078円
たわらノーロード バランス(標準型)	434,807,385円
たわらノーロード バランス(積極型)	463,956,032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)	114,357,197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)	294,253,058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)	189,451,709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)	249,178,288円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,936,458円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	22,376,955円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,497,647円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,598,958円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	11,755,986円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	395,109,709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)	127,599,856円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	154,211,666円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	311,900,598円
投資のソムリエ	12,741,898,540円
投資のソムリエ<DC年金>	651,117,870円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	123,589,297円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	344,592,370円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,190,620,814円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	14,902,806円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,686,333円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,407,146円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	39,915,863円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,655,822,876円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	109,416,406円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	11,688,831円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,748,254円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,593,284円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	218,184円
Jリートインデックスファンド(DC)	43,902,709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)	81,191,622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)	733,820,233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)	230,397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)	374,697,962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)	560,599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)	153,581,431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)	224,795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)	206,670,830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)	79,763,675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)	182,770,387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)	382,865円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	10,245,029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)	354,512,513円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	581,906,057円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	403,761,927円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	81,017,581円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	444,109円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	402,720,448円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,976,288,425円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	342,465,411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)	637,317,659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)	467,242円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	5,387,834円
日米資産配分戦略ファンド(TIPS活用型)(為替ヘッジ比率調整型)(適格機関投資家限定)	100,753,468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)	2,207,274,356円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	7,592,406,126円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	38,785,872,776円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,683,413,450円
MHAM J-REITインデックスファンド(ファンドラップ)	107,186,345円
計	88,358,860,745円
2. 受益権の総数	88,358,860,745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 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	7,343,909,365
合計	7,343,909,365

(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(2021年6月8日から2021年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2021年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	4,961,855,980	-	4,774,687,500	187,168,480
合計	4,961,855,980	-	4,774,687,500	187,168,480

(注)時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年11月11日現在
1口当たり純資産額	2.4569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11月11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	7,247	1,584,194,200	
	GLP投資法人	60,607	11,212,295,000	
	NTT都市開発リート投資法人	17,937	2,746,154,700	
	Oneリート投資法人	3,247	970,528,300	
	SOSILA物流リート投資法人	7,850	1,326,650,000	
	いちごオフィスリート投資法人	15,333	1,335,504,300	
	いちごホテルリート投資法人	3,100	285,510,000	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	9,973	4,562,647,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	18,710	6,819,795,000	
	イオンリート投資法人	22,007	3,415,486,400	
	インヴィンシブル投資法人	82,364	3,632,252,400	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,768	531,288,000	
	オリックス不動産投資法人	37,286	6,730,123,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	12,994	1,555,381,800	
	ケネディクス・オフィス投資法人	5,789	4,104,401,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ ネクスト投資法人	12,781	2,778,589,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	7,472	2,163,144,000	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	8,426	2,730,024,000	
	サムティ・レジデンシャル投資 法人	4,239	503,593,200	
	サンケイリアルエステート投資 法人	5,927	721,315,900	
	ザイマックス・リート投資法人	2,716	317,228,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資 法人	57,329	3,886,906,200	
	ジャパンエクセレント投資法人	17,364	2,439,642,000	
ジャパンリアルエステイト投資 法人	18,713	12,668,701,000		
スターアジア不動産投資法人	19,339	1,195,150,200		
スターツプロシード投資法人	2,914	682,750,200		

タカラレーベン不動産投資法人	7,379	820,544,800	
トーセイ・リート投資法人	3,910	518,857,000	
ヒューリックリート投資法人	17,457	3,016,569,600	
フロンティア不動産投資法人	6,560	3,384,960,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	3,991	637,761,800	
マリモ地方創生リート投資法人	1,753	232,623,100	
ユナイテッド・アーバン投資法人	42,127	6,049,437,200	
ラサールロジポート投資法人	22,908	4,366,264,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	7,297	1,221,517,800	
阪急阪神リート投資法人	8,453	1,424,330,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6,956	4,104,040,000	
三菱地所物流リート投資法人	4,756	2,285,258,000	
産業ファンド投資法人	26,566	5,539,011,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	4,391	608,592,600	
森トラスト総合リート投資法人	13,374	1,957,953,600	
森ヒルズリート投資法人	22,005	3,439,381,500	
星野リゾート・リート投資法人	2,887	2,113,284,000	
積水ハウス・リート投資法人	56,805	4,851,147,000	
大江戸温泉リート投資法人	3,020	249,754,000	
大和ハウスリート投資法人	28,098	9,216,144,000	
大和証券オフィス投資法人	3,956	2,872,056,000	
大和証券リビング投資法人	25,286	2,885,132,600	
投資法人みらい	21,333	1,100,782,800	
東海道リート投資法人	1,433	156,483,600	
東急リアル・エステート投資法人	12,546	2,396,286,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	6,461	4,102,735,000	
日本ビルファンド投資法人	21,208	15,121,304,000	
日本プライムリアルティ投資法人	12,298	5,134,415,000	
日本プロロジスリート投資法人	29,647	11,058,331,000	
日本リート投資法人	5,774	2,468,385,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	12,227	4,071,591,000	
日本都市ファンド投資法人	94,418	9,668,403,200	
福岡リート投資法人	9,678	1,637,517,600	
平和不動産リート投資法人	12,123	1,914,221,700	
野村不動産マスターファンド投資法人	60,514	10,190,557,600	
投資証券 合計	1,085,027	211,714,890,900	
合計		211,714,890,900	

(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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	99,010,851
コール・ローン	158,837,204
投資信託受益証券	8,548,831,903
投資証券	74,450,964,309
派生商品評価勘定	523,755
未収入金	15,712,865
未収配当金	80,367,290
流動資産合計	83,354,248,177
資産合計	
83,354,248,177	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,397
未払金	129,157,006
未払解約金	16,980,000
流動負債合計	146,169,403
負債合計	
146,169,403	
純資産の部	
元本等	
元本	49,033,840,425
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	34,174,238,349
元本等合計	83,208,078,774
純資産合計	
83,208,078,774	
負債純資産合計	
83,354,248,177	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	48,371,251,129円
同期中追加設定元本額	52,912,108,601円
同期中一部解約元本額	52,249,519,305円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	86,580,486円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	54,066,818円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,826,902円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	16,608,685円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	38,659,708円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	35,198,821円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,329,368円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	18,704,401円
たわらノーロード 先進国リート	10,025,750,657円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,531,874,435円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	364,482,762円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,835,800,945円
たわらノーロード バランス(堅実型)	17,606,735円

たわらノーロード バランス(標準型)	316,113,939円
たわらノーロード バランス(積極型)	627,652,249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)	54,081,616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)	139,280,066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)	266,439,492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)	7,311,018円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,805,091円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,788,908円
One DC 先進国リートインデックスファンド	792,149,416円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,050,217円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	594,460,007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)	200,951,724円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	254,863,897円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	479,434,038円
投資のソムリエ	15,113,656,084円
投資のソムリエ<DC年金>	772,125,987円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	196,233,945円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	365,507,854円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,383,280,921円
ワールドアセットバランス(基本コース)	516,567,262円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,577,496,455円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	22,088,526円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,393,011円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,616,422円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	59,507,185円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,734,726,528円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	161,014,829円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	17,322,602円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	8,516,664円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,806,195円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	322,136円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	342,287,865円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	180,889,902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)	89,505,203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)	237,688,369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)	91,770,486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)	125,559,493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)	55,527,451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)	61,079,208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)	87,942,357円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	252,542,793円

インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	88,093,389円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	405,667,088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）	150,274,423円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	6,326,749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）	99,264,720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）	229,869,135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）	3,933,896,640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）	437,121,965円
計	49,033,840,425円
2. 受益権の総数	49,033,840,425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 2021年5月12日 至 2021年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	355,000,519	
投資証券	3,785,860,269	
合計	4,140,860,788	

(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(2021年6月23日から2021年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	5,864,040	-	5,896,037	31,997
シンガポール・ドル	5,864,040	-	5,896,037	31,997
買建	127,877,650	-	128,401,005	523,355
アメリカ・ドル	102,115,000	-	102,561,790	446,790
イギリス・ポンド	6,110,920	-	6,110,700	220
オーストラリア・ドル	2,503,380	-	2,503,200	180
シンガポール・ドル	4,211,300	-	4,211,315	15
韓国・ウォン	12,937,050	-	13,014,000	76,950
合計	133,741,690	-	134,297,042	491,358

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

おります。

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6970円 (16,970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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	338,100.000	267,099.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	623,900.000	446,088.500		
		PRIME US REIT	296,400.000	247,494.000		
		アメリカ・ドル	小計	1,331,100.000	960,681.500 (109,479,264)	
	オーストラリア・ドル		ABACUS PROPERTY GROUP	176,542.000	633,785.780	
			ARENA REIT	161,029.000	726,240.790	
			AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	192,472.000	654,404.800	
			BWP TRUST	210,447.000	875,459.520	
			CENTURIA CAPITAL GROUP	276,081.000	913,828.110	
			CENTURIA INDUSTRIAL REIT	248,813.000	920,608.100	
			CENTURIA OFFICE REIT	198,359.000	466,143.650	
			CHARTER HALL GROUP	207,491.000	3,969,302.830	
			CHARTER HALL LONG WALE REIT	249,640.000	1,213,250.400	
CHARTER HALL RETAIL REIT			226,016.000	949,267.200		
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	155,934.000	592,549.200		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	604,514.000	510,814.330		

	DEXUS	488,247.000	5,468,366.400	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	92,852.000	312,911.240	
	GDI PROPERTY GROUP	250,188.000	278,959.620	
	GOODMAN GROUP	758,309.000	18,032,588.020	
	GPT GROUP	863,065.000	4,462,046.050	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	125,873.000	527,407.870	
	HOME CONSORTIUM LTD	78,989.000	609,795.080	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	266,984.000	384,456.960	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,550.000	301,136.000	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	158,679.000	998,090.910	
	IRONGATE GROUP	251,857.000	408,008.340	
	MIRVAC GROUP	1,790,171.000	5,155,692.480	
	NATIONAL STORAGE REIT	472,894.000	1,134,945.600	
	RURAL FUNDS GROUP	162,766.000	463,883.100	
	SCENTRE GROUP	2,353,439.000	7,272,126.510	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	475,874.000	1,365,758.380	
	STOCKLAND	1,081,983.000	4,890,563.160	
	VICINITY CENTRES	1,721,534.000	2,978,253.820	
	WAYPOINT REIT LTD	322,256.000	876,536.320	
	オーストラリア・ドル 小計	14,708,848.000	68,347,180.570 (5,702,888,747)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	220,295.000	306,210.050	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	564,380.000	502,298.200	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,524,460.000	4,710,581.400	
	ASCOTT TRUST	854,716.000	923,093.280	
	CAPITALAND CHINA TRUST	443,380.000	527,622.200	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,265,509.000	4,870,844.350	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	375,200.000	472,752.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	127,400.000	103,831.000	
	ESR REIT	1,315,730.000	638,129.050	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	508,800.000	320,544.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	493,800.000	128,388.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	469,800.000	1,089,936.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,286,064.000	1,916,235.360	
	IREIT GLOBAL	186,300.000	120,163.500	
	KEPPEL DC REIT	553,800.000	1,295,892.000	
	KEPPEL REIT	853,600.000	981,640.000	

		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	426,800.000	384,120.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	971,600.000	2,059,792.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	861,720.000	2,300,792.400	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,310,820.000	2,569,207.200	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,003,500.000	1,003,500.000	
		QUE COMMERCIAL REIT	1,019,355.000	448,516.200	
		PARKWAY LIFE REIT	180,100.000	873,485.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	286,600.000	245,043.000	
		SPH REIT	407,200.000	415,344.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	607,600.000	388,864.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	954,290.000	1,469,606.600	
	シンガポール・ドル	小計	20,072,819.000	31,066,430.790 (2,616,725,465)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	132,040.000	343,304.000	
	ユーロ	小計	132,040.000	343,304.000 (44,914,462)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	626,000.000	5,114,420.000	
	香港・ドル	小計	626,000.000	5,114,420.000 (74,823,965)	
投資信託受益証券 合計			36,870,807	8,548,831,903 (8,548,831,903)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	38,816.000	879,570.560	
		AGREE REALTY CORP	30,651.000	2,141,278.860	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	33,995.000	852,254.650	
		ALEXANDER'S INC.	1,124.000	306,852.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	62,629.000	12,865,249.180	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,917.000	93,275.490	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	23,115.000	908,881.800	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	62,039.000	3,340,179.760	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	55,272.000	476,997.360	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	124,207.000	4,986,911.050	
		AMERICOLD REALTY TRUST	116,456.000	3,454,084.960	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	71,078.000	3,758,604.640	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	70,123.000	552,569.240	

APPLE HOSPITALITY REIT INC	94,063.000	1,525,701.860	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	28,837.000	443,513.060	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,224.000	208,264.320	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	63,053.000	15,155,419.080	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	14,304.000	200,256.000	
BOSTON PROPERTIES INC	64,379.000	7,559,382.180	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	24,777.000	132,309.180	
BRANDYWINE REALTY TRUST	75,271.000	1,059,815.680	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	134,698.000	3,318,958.720	
BROADSTONE NET LEASE INC	70,543.000	1,841,877.730	
BRT APARTMENTS CORP	6,580.000	132,192.200	
CAMDEN PROPERTY TRUST	45,560.000	7,499,176.000	
CARETRUST REIT INC	42,666.000	910,065.780	
CEDAR REALTY TRUST INC	5,828.000	132,179.040	
CENTERSPACE	6,518.000	667,443.200	
CHATHAM LODGING TRUST	25,469.000	339,501.770	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	4,068.000	33,154.200	
CITY OFFICE REIT INC	20,607.000	384,732.690	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	46,943.780	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	50,575.000	968,511.250	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10,853.000	510,091.000	
COREPOINT LODGING INC	20,777.000	324,121.200	
CORESITE REALTY CORP	20,053.000	3,231,139.890	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	49,711.000	1,405,827.080	
COUSINS PROPERTIES INC	66,214.000	2,641,938.600	
CTO REALTY GROUTH INC	2,436.000	136,123.680	
CUBESMART	91,506.000	4,950,474.600	
CYRUSONE INC	56,112.000	4,603,989.600	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	92,485.000	957,219.750	
DIGITAL REALTY TRUST INC	127,275.000	19,614,350.250	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	218,091.000	1,677,119.790	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	112,371.000	396,669.630	
DOUGLAS EMMETT INC	78,125.000	2,817,968.750	
DUKE REALTY TRUST	171,290.000	9,796,075.100	
EAST GROUP	18,300.000	3,669,882.000	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	39,629.000	846,475.440	

EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	65,446.000	682,601.780	
EPR PROPERTIES	33,190.000	1,719,573.900	
EQUINIX INC	40,437.000	31,597,876.170	
EQUITY COMMONWEALTH	53,986.000	1,399,856.980	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	77,443.000	6,552,452.230	
EQUITY RESIDENTIAL	153,918.000	13,158,449.820	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	52,427.000	1,526,149.970	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	29,442.000	10,092,423.180	
EXTRA SPACE STORAGE INC	60,279.000	11,884,004.850	
FARMLAND PARTNERS INC	11,176.000	136,458.960	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	31,684.000	4,048,581.520	
FIRST INDUSTRIAL RT	58,105.000	3,523,487.200	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	33,548.000	969,872.680	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	51,454.000	302,549.520	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	100,957.000	4,877,232.670	
GEO GROUP INC	57,457.000	526,306.120	
GETTY REALTY CORP	18,127.000	591,484.010	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	17,405.000	394,397.300	
GLADSTONE LAND CORP	14,902.000	380,895.120	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	28,359.000	475,864.020	
GLOBAL NET LEASE INC	44,087.000	689,961.550	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	64,715.000	2,092,883.100	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	97,587.000	3,316,982.130	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	244,063.000	8,295,701.370	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	18,489.000	205,597.680	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	46,327.000	2,180,611.890	
HOST HOTELS & RESORTS INC	323,710.000	5,836,491.300	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	67,665.000	1,795,152.450	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	46,371.000	1,144,436.280	
INDUS REALTY TRUST INC	1,685.000	124,993.300	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	28,647.000	730,212.030	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,660.000	2,895,895.600	
INVITATION HOMES INC	259,152.000	10,513,796.640	

IRON MOUNTAIN INC	131,200.000	6,220,192.000	
JBG SMITH PROPERTIES	51,442.000	1,556,120.500	
KILROY REALTY CORP	47,531.000	3,377,077.550	
KIMCO REALTY	278,040.000	6,508,916.400	
KITE REALTY GROUP TRUST	97,024.000	2,099,599.360	
LEXINGTON REALTY TRUST	123,277.000	1,829,430.680	
LIFE STORAGE INC	35,525.000	4,645,249.000	
LTC PROPERTIES INC	18,291.000	626,466.750	
MACK CALI	35,127.000	676,194.750	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	270,037.000	5,732,885.510	
MID AMERICA	52,155.000	10,577,034.000	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	43,121.000	907,265.840	
NATIONAL HEALTH INVS INC	20,333.000	1,182,973.940	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	79,529.000	3,647,995.230	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	36,280.000	2,262,783.600	
NETSTREIT CORP	18,571.000	441,989.800	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	9,951.000	750,205.890	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	22,449.000	607,694.430	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	106,512.000	3,063,285.120	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,521.000	286,135.180	
PARAMOUNT GROUP INC	71,985.000	665,141.400	
PARK HOTELS & RESORTS INC	105,059.000	2,166,316.580	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	58,080.000	1,443,868.800	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,075.000	46,229.250	
PHYSICIANS REALTY TRUST	96,536.000	1,789,777.440	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	54,660.000	1,031,980.800	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,125.000	426,222.500	
POSTAL REALTY TRUST INC	5,941.000	118,760.590	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	27,417.000	380,273.790	
PROLOGIS INC	333,577.000	49,626,250.290	
PS BUSINESS PARKS	8,915.000	1,578,757.350	
PUBLIC STORAGE	68,668.000	22,464,736.200	
REALTY INCOME CORP	248,364.000	17,668,614.960	
REGENCY CENTERS CORP	69,344.000	5,156,419.840	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	53,437.000	980,034.580	
RETAIL VALUE INC	7,197.000	45,269.130	

	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	62,336.000	4,332,975.360	
	RLJ LODGING TRUST	73,457.000	1,087,898.170	
	RPT REALTY	37,938.000	529,235.100	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24,475.000	2,203,484.250	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	97,798.000	1,457,190.200	
	SAFEHOLD INC	6,256.000	463,381.920	
	SAUL CENTERS INC	6,796.000	349,722.160	
	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	19,202.000	299,167.160	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	74,464.000	855,591.360	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	148,025.000	24,271,659.250	
	SITE CENTERS CORP	79,319.000	1,336,525.150	
	SL GREEN	29,855.000	2,294,058.200	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	53,041.000	2,585,218.340	
	STAG INDUSTRIAL INC	72,249.000	3,063,357.600	
	STORE CAPITAL CORP	110,719.000	3,791,018.560	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	49,792.000	506,882.560	
	SUN COMMUNITIES INC	52,343.000	10,130,987.650	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	96,745.000	1,219,954.450	
	TANGER FACTORY OUTLET	46,956.000	918,459.360	
	TERRENO REALTY CORP	31,376.000	2,370,456.800	
	THE MACERICH COMPANY	94,509.000	1,950,665.760	
	UDR INC	126,419.000	7,009,933.550	
	UMH PROPERTIES INC	20,659.000	491,684.200	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,659.000	400,738.620	
	URBAN EDGE PROPERTIES	48,342.000	897,710.940	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	15,758.000	331,548.320	
	VENTAS INC	178,146.000	9,753,493.500	
	VICI PROPERTIES INC	278,051.000	8,041,234.920	
	VORNADO REALTY TRUST	70,873.000	3,179,362.780	
	WASHINGTON REIT	37,230.000	961,278.600	
	WELLTOWER INC	190,819.000	16,603,161.190	
	WHITESTONE REIT	17,850.000	173,859.000	
	WP CAREY INC	83,505.000	6,417,359.250	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	50,196.000	953,222.040	
アメリカ・ドル	小計	10,041,110.000	553,239,432.250 (63,047,165,700)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	50,845.000	56,336.260	
	ASSURA PLC	1,182,410.000	863,159.300	
	BIG YELLOW GROUP PLC	76,592.000	1,148,114.080	

BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	361,573.000	358,680.410	
BRITISH LAND CO PLC	426,520.000	2,178,664.160	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	373,733.000	626,750.240	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	295,662.000	274,374.330	
CUSTODIAN REIT PLC	177,203.000	174,899.360	
DERWENT LONDON PLC	50,991.000	1,741,342.650	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	284,685.000	250,522.800	
GCP STUDENT LIVING PLC	197,804.000	416,377.420	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	112,066.000	831,529.720	
HAMMERSON PLC	1,843,975.000	604,823.800	
HOME REIT PLC	100,813.000	115,430.880	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	169,223.000	201,375.370	
INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
LAND SECURITIES GROUP PLC	341,428.000	2,411,164.530	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	403,184.000	1,083,758.590	
LXI REIT PLC	324,779.000	469,630.430	
NEWRIVER REIT PLC	139,604.000	104,982.200	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	232,786.000	231,622.070	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	587,905.000	893,615.600	
PRS REIT PLC/THE	222,591.000	224,816.910	
REGIONAL REIT LTD	228,222.000	201,976.470	
SAFESTORE HOLDINGS LTD	93,437.000	1,155,815.690	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	306,690.000	153,651.690	
SEGRO PLC	541,303.000	7,207,449.440	
SHAFTESBURY PLC	127,133.000	820,007.850	
STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	179,591.000	134,334.060	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	376,821.000	447,286.520	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	196,536.000	190,836.450	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	775,811.000	1,750,229.610	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	416,742.000	325,475.500	
UNITE GROUP PLC	181,509.000	1,996,599.000	
WORKSPACE GROUP PLC	56,083.000	465,488.900	
イギリス・ボンド 小計	11,667,290.000	30,111,122.290 (4,600,076,152)	

イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	80,431.000	1,660,095.840	
イスラエル・シュケル 小計		80,431.000	1,660,095.840 (60,624,708)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	27,442.000	1,215,406.180	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,816.000	331,288.560	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,902.000	134,766.220	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,735.000	579,904.700	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,606.000	89,664.900	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	38,595.000	2,331,909.900	
	CHOICE PROPERTIES REIT	70,335.000	1,063,465.200	
	COMINAR REAL ESTATE INVTR	42,525.000	494,991.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	22,937.000	429,839.380	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,513.000	409,061.210	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	52,015.000	885,815.450	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	13,216.000	318,902.080	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,576.000	94,238.080	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	46,951.000	884,556.840	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,207.000	1,418,000.670	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	62,044.000	1,042,959.640	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	44,712.090	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	32,062.000	571,986.080	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,163.000	528,348.030	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,025.000	180,402.000	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,583.000	165,737.730		
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,759.000	101,720.490		
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	49,692.000	670,345.080		
PLAZA RETAIL REIT	20,611.000	94,192.270		

	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	68,710.000	1,569,336.400	
	SLATE GROCERY REIT	10,657.000	142,270.950	
	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	60,147.780	
	SMARTCENTRES REIT	31,061.000	998,611.150	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	35,992.000	832,494.960	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	24,231.000	179,794.020	
カナダ・ドル 小計		840,238.000	17,864,869.040 (1,630,169,300)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	361,598.000	544,204.990	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	472,254.000	1,157,022.300	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	696,022.000	803,905.410	
	PRECINCT PROPERTIES	562,444.000	897,098.180	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	182,144.000	538,235.520	
ニュージーランド・ドル 小計		2,274,462.000	3,940,466.400 (317,246,950)	
ユーロ	AEDIFICA	16,317.000	1,869,928.200	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	78,999.000	1,536,530.550	
	ALTAREA	1,672.000	309,654.400	
	BEFIMMO	10,544.000	370,621.600	
	CARE PROPERTY INVEST NV	12,219.000	320,748.750	
	CARMILA SA	22,046.000	312,171.360	
	COFINIMMO SA	12,417.000	1,739,621.700	
	COIMA RES SPA	8,531.000	61,764.440	
	COVIVIO	21,000.000	1,580,460.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18,624.000	378,160.320	
	GECINA SA	24,514.000	2,980,902.400	
	HAMBORNER REIT AG	33,082.000	324,832.150	
	HIBERNIA REIT PLC	284,817.000	367,983.560	
	ICADE	14,402.000	968,534.500	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	26,547.000	107,382.610	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	120,668.000	1,025,678.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10,920.000	290,472.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	202,856.000	329,438.140	
	KLEPIERRE	87,775.000	1,932,805.500	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	27,656.000	147,129.920	
MERCIALYS	23,207.000	222,207.020		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	150,061.000	1,440,585.600		
MONTEA SCA	4,718.000	614,283.600		

	NSI NV	7,510.000	267,356.000	
	RETAIL ESTATES	4,830.000	341,481.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	52,861.000	3,628,379.040	
	VASTNED RETAIL	8,261.000	204,872.800	
	WAREHOUSES DE PAUW	63,589.000	2,538,472.880	
	WERELDHAVE NV	17,541.000	247,152.690	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,196.000	422,094.000	
	ユーロ 小計	1,376,380.000	26,881,704.730 (3,516,933,430)	
韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	43,051.000	278,539,970.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	48,028.000	325,149,560.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,958.000	58,453,460.000	
	JR REIT XXVII	56,170.000	306,126,500.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11,840.000	80,156,800.000	
	LOTTE REIT CO LTD	50,731.000	283,586,290.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	37,378.000	184,273,540.000	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21,740.000	173,920,000.000		
	韓国・ウォン 小計	278,896.000	1,690,206,120.000 (162,935,870)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	815,070.000	3,358,088.400	
	LINK REIT	944,920.000	66,522,368.000	
	PROSPERITY REIT	578,000.000	1,757,120.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	461,000.000	2,056,060.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	771,000.000	2,575,140.000	
	香港・ドル 小計	3,569,990.000	76,268,776.400 (1,115,812,199)	
投資証券 合計		30,128,797	74,450,964,309 (74,450,964,309)	
合計			82,999,796,212 (82,999,796,212)	

(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)

- 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。
- 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。
- 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	0.13	-	76.09

	投資証券	152銘柄	-	75.77	
イギリス・ポンド	投資証券	35銘柄	-	5.53	5.54
イスラエル・シケル	投資証券	1銘柄	-	0.07	0.07
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	31銘柄	6.85	-	6.87
カナダ・ドル	投資証券	30銘柄	-	1.96	1.96
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	27銘柄	3.14	-	3.15
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	-	0.38	0.38
ユーロ	投資信託受益証券	1銘柄	0.05	-	4.29
	投資証券	30銘柄	-	4.23	
韓国・ウォン	投資証券	8銘柄	-	0.20	0.20
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.09	-	1.43
	投資証券	5銘柄	-	1.34	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年11月30日現在

資産総額	426,582,702円
負債総額	207,098円
純資産総額(-)	426,375,604円
発行済数量	331,456,611口
1口当たり純資産額(/)	1.2864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11月30日現在

資産総額	453,787,790,064円
負債総額	870,859,270円
純資産総額(-)	452,916,930,794円
発行済数量	142,044,597,457口
1口当たり純資産額(/)	3.1886円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	686,599,586,016円
負債総額	405,943,435円
純資産総額(-)	686,193,642,581円
発行済数量	117,058,637,639口
1口当たり純資産額(/)	5.8620円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	520,999,008,332円
負債総額	10,193,620,694円
純資産総額(-)	510,805,387,638円
発行済数量	390,347,513,477口
1口当たり純資産額(/)	1.3086円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	149,701,448,887円
負債総額	562,759,148円
純資産総額(-)	149,138,689,739円
発行済数量	72,232,509,908口
1口当たり純資産額(/)	2.0647円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	211,231,092,486円
負債総額	523,795,260円
純資産総額(-)	210,707,297,226円
発行済数量	88,316,668,906口
1口当たり純資産額(/)	2.3858円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	84,976,232,019円
負債総額	505,954,892円
純資産総額(-)	84,470,277,127円
発行済数量	50,161,277,767口
1口当たり純資産額(/)	1.6840円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2021年11月30日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2021年11月30日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「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11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,423,958,821,203
追加型株式投資信託	826	15,691,923,686,048
単位型公社債投資信託	28	60,158,467,127
単位型株式投資信託	218	1,311,798,129,058
合計	1,098	18,487,839,103,436

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第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		
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		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
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	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 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</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 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。</p> <p>(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ェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、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。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 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あります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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あります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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おります。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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 其他有価証券	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 其他有価証券	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)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	5,299,196

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 其他有価証券」には含めておりません。

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 其他有価証券(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 其他有価証券(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、記載していません。

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			
株式	-	-	-
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			
株式	-	-	-
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			
株式	-	-	-
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			
株式	-	-	-
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的主要原因別の内訳

	第35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
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

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
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	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

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(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。

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,648
金銭の信託		25,866
未収委託者報酬		18,882
未収運用受託報酬		2,911
未収投資助言報酬		319
未収収益		15
前払費用		996
その他		2,470
	流動資産計	80,112
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	792
器具備品	1	184
無形固定資産		
ソフトウェア		4,193
ソフトウェア仮勘定		3,475
電話加入権		714
電話加入権		3
投資その他の資産		
投資有価証券		10,724
関係会社株式		261
長期差入保証金		5,299
繰延税金資産		1,273
繰延税金資産		3,311
その他		578
	固定資産計	15,895
資産合計		96,007

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,845
未払金	7,922
未払収益分配金	0
未払償還金	9
未払手数料	7,759
その他未払金	153
未払費用	7,337
未払法人税等	3,423
未払消費税等	1,234
契約負債	20
賞与引当金	836
役員賞与引当金	33
	流動負債計
	22,653
固定負債	
退職給付引当金	2,391
時効後支払損引当金	147
	固定負債計
	2,538
負債合計	25,192
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	49,261
利益準備金	123
その他利益剰余金	49,138
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	17,458
	株主資本計
	70,814
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
	評価・換算差額等計
	0
純資産合計	70,814
負債・純資産合計	96,007

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	54,995	
運用受託報酬	7,193	
投資助言報酬	569	
その他営業収益	6	
		営業収益計 62,765
営業費用		
支払手数料	22,800	
広告宣伝費	126	
公告費	0	
調査費	17,656	
調査費	4,722	
委託調査費	12,934	
委託計算費	281	
営業雑経費	437	
通信費	17	
印刷費	315	
協会費	33	
諸会費	17	
支払販売手数料	52	
		営業費用計 41,301
一般管理費		
給料	4,865	
役員報酬	82	
給料・手当	4,565	
賞与	217	
交際費	1	
寄付金	4	
旅費交通費	13	
租税公課	292	
不動産賃借料	892	
退職給付費用	248	
固定資産減価償却費	1 670	
福利厚生費	16	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	836	
役員賞与引当金繰入額	33	
機器リース料	0	
事務委託費	1,971	
事務用消耗品費	26	
器具備品費	0	
諸経費	99	
		一般管理費計 9,973
営業利益		11,490

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	7	
受取配当金	548	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	10	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	288	
雑収入	2	
営業外収益計		884
経常利益		12,374
特別損失		
固定資産除却損	5	
ゴルフ会員権売却損	3	
オフィス再編費用	5	
特別損失計		13
税引前中間純利益		12,360
法人税、住民税及び事業税		3,254
法人税等調整額		364
法人税等合計		3,619
中間純利益		8,741

(3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280
中間純利益							8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	2,538
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,458

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	51,800	73,353	0	0	73,353
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280	11,280			11,280
中間純利益	8,741	8,741			8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	2,538	2,538	0	0	2,538
当中間期末残高	49,261	70,814	0	0	70,814

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(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ェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計上の見積りの変更

第37期中間会計期間

(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

当社は、当中間会計期間において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当中間会計期間において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ124百万円減少しております。

(会計方針の変更)

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識基準に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計方針の変更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の適用

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	520百万円
	器具備品	1,004百万円

(中間損益計算書関係)

項目	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.減価償却実施額	有形固定資産	156百万円
	無形固定資産	514百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

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

（金融商品関係）

第37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	25,866	25,866	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,844	-	5,844
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	5,844	-	5,844

「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。以下、「時価算定適用指針」という）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託20,021百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	259
関係会社株式	
非上場株式	5,299

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末

(2021年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2021年4月1日から2021年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	80,759百万円
資産合計	80,759百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	5,228百万円
負債合計	5,228百万円
純資産	75,530百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額57,168百万円及び顧客関連資産の金額27,484百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,214百万円
経常利益	4,214百万円
税引前中間純利益	4,214百万円
中間純利益	3,507百万円
1株当たり中間純利益	87,690円34銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,309百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間
（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

委託者報酬	54,819百万円
運用受託報酬	7,193百万円
投資助言報酬	569百万円
成功報酬（注）	175百万円
その他営業収益	6百万円
合計	62,765百万円

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,770,364円46銭
1株当たり中間純利益金額	218,536円02銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益金額	8,741百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,741百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2021年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
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

(3) 投資顧問会社

名称	イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社
資本金の額	9,557.5万円（2021年3月末日現在）
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (6) 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
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年12月17日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の2021年5月12日から2021年11月11日までの特定期間の財務諸表、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<隔月分配型>の2021年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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11月25日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

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) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。