【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年8月9日提出
【計算期間】	第7期(自 2021年5月11日至 2022年5月9日)
【ファンド名】	コア資産形成ファンド
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① 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、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および外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券（以下、各々を「主要投資対象マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜ファンドの特色＞

国内外の公社債・株式へ分散投資を行い、安定した収益の獲得を目指します。

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

■ 資産配分比率は、リスク均等配分を基本としつつ、投資環境分析による各資産の魅力度判定に応じた機動的な変更を行うことで、安定した収益の獲得を目指します。

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

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

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

◆ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

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

＜商品分類＞

・商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

＜属性区分＞

・属性区分表

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

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

その他資産 （投資信託証券）	目論見書又は投資信託約款において、主として「株式」、「債券」及び「不動産投信」以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載はその該当資産を表す。
資産複合 （株式・債券） 資産配分変更型	目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、括弧内の記載はその該当複数資産を表す。 ※当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券に投資を行います。
年１回	目論見書又は投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本を含む）	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が、日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

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

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

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

（２）【ファンドの沿革】

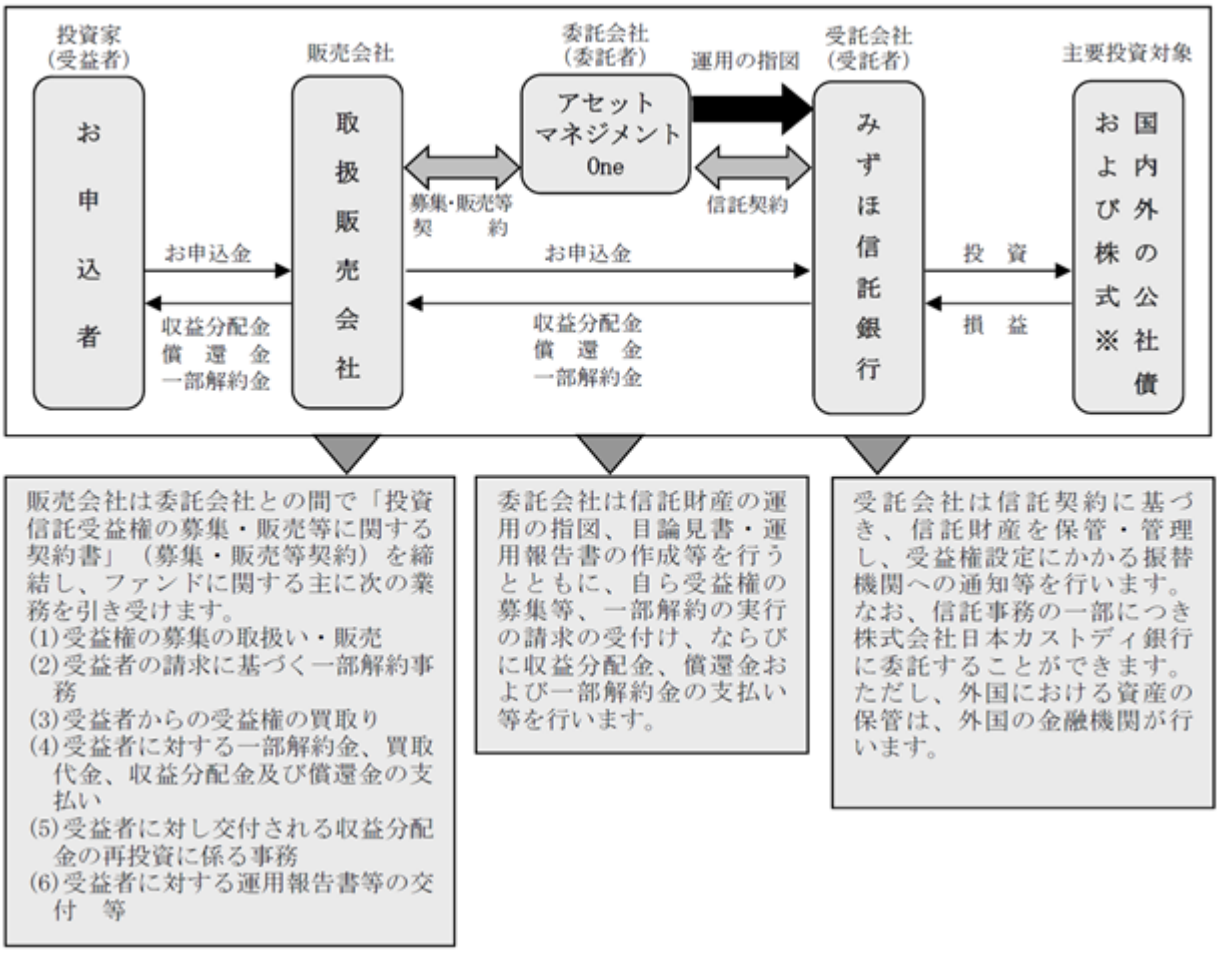
2015年４月20日	信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始
2016年10月１日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2021年7月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を追加し、「ＭＨＡＭ日本債券インデックスマザーファンド」を「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更
2021年12月17日	ファンドの主要投資対象から「ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸマザーファンド」を削除

2022年3月1日　　ファンドの主要投資対象に「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」を追加し、「ＭＨＡＭ外国債券インデックスマザーファンド」を「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更

2022年6月29日　　ファンドの主要投資対象から「ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド」を削除

（３）【ファンドの仕組み】

①　当ファンドの運営の仕組み

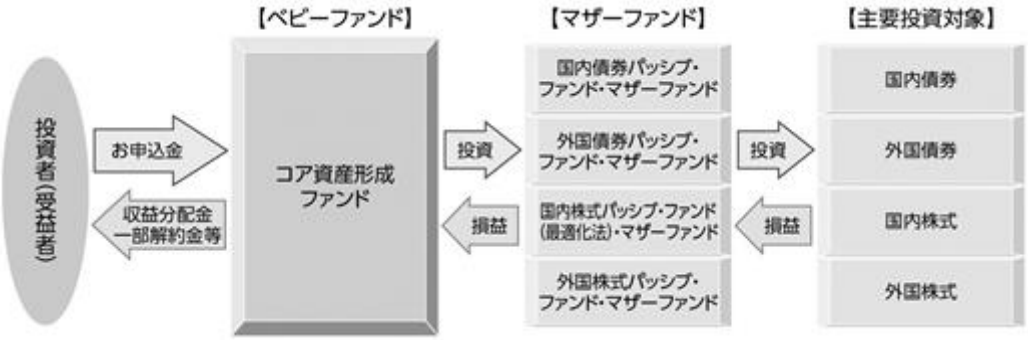


※ 主要投資対象である国内外の公社債および株式には、主として、各マザーファンドを通じて投資を行います。

② ファミリーファンド方式の仕組み

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

≪ファミリーファンド方式≫



※ ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資することにより、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。

※ 資産配分の決定の際、一部のマザーファンド受益証券への投資を行わない場合があります。また、ファンド全体のリスクの状況によっては、上記のマザーファンドを通じた投資のほか、ＭＨＡＭ国内短期債券マザーファンドを通じて国内短期債券に投資する場合や、信託財産の純資産総額の50%を上限に短期金融商品等へ直接投資する場合があります。

※ マザーファンドのほかに、株式、公社債等に直接投資する場合があります。

③ 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社
本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額
20億円（2022年5月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2022年5月31日現在）

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

① 基本方針

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

② 運用方法

1．主要投資対象

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、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および外国株式パッシブ・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。

2．投資態度

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

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

c．実質組入※外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

d．マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

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

③ ファンドの投資プロセス

1．当ファンドの投資プロセス

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

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

STEP1　各資産のリスクを計測

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

☞ 下記「リスク均等配分とは」をご参照ください。

STEP2　投資環境分析を実施

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

STEP3　リスクの管理

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

STEP4　ポートフォリオの構築

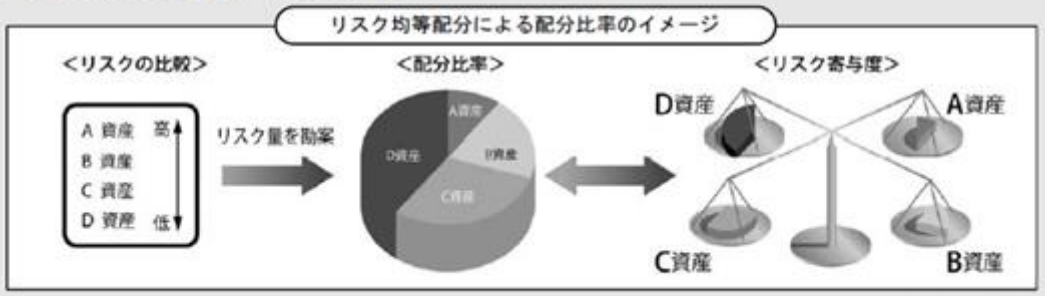
STEP1～3で決定した配分比率に従って、各資産への投資を行います。

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

※　上記のプロセスは、今後変更される場合があります。

リスク均等配分とは

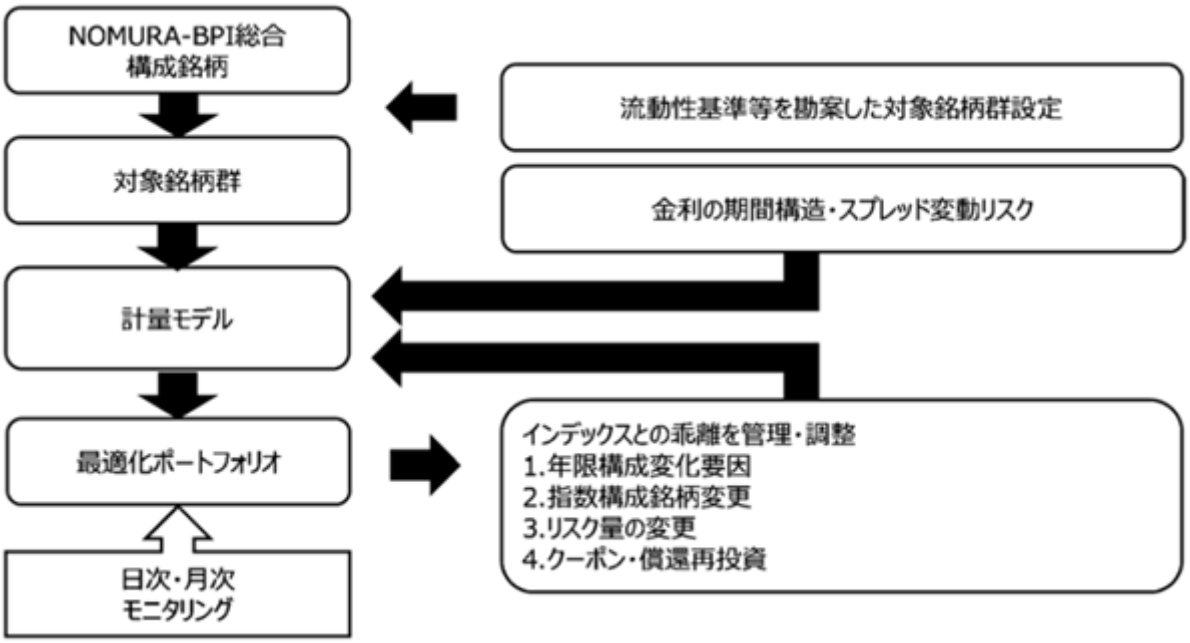
「リスク均等配分」とは、各資産のリスク（価格変動性）の大きさに着目した分散投資の方法で、リスクが相対的に高い資産の配分比率を低くし、リスクが相対的に低い資産の配分比率を高くすることにより、ファンドに対する各資産のリスク寄与度を均等にすることを目指す投資手法です。これにより、リスクが高い資産の値動きがファンド全体の値動きに与える影響を抑える効果が期待されます。



※上記はイメージ図です。

２．各マザーファンドの投資プロセス

＜国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス＞



1.流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因

2）金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因

1）、2）が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

3.インデックスとの乖離を管理

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

組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

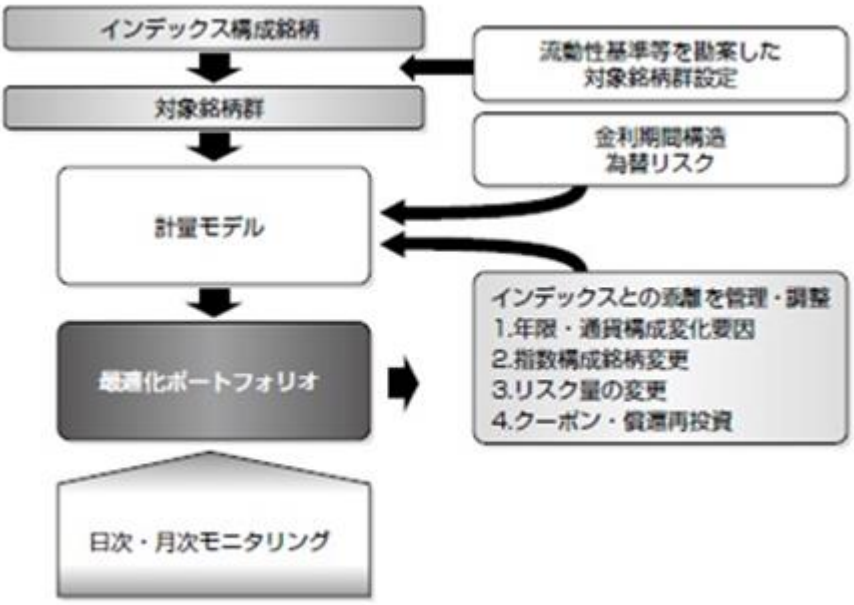
・年限構成変化要因

・指数構成銘柄変更

・リスク量の変更

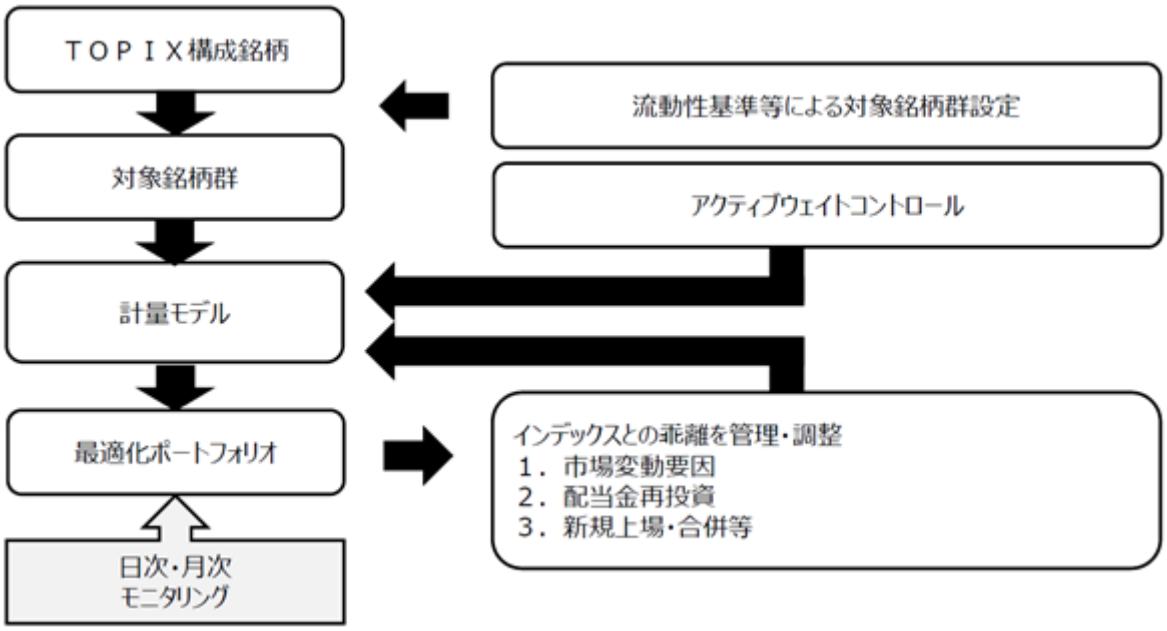
・クーポン、償還再投資

＜外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス＞



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

＜国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資プロセス＞



1.流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

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

3.インデックスとの乖離を管理

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

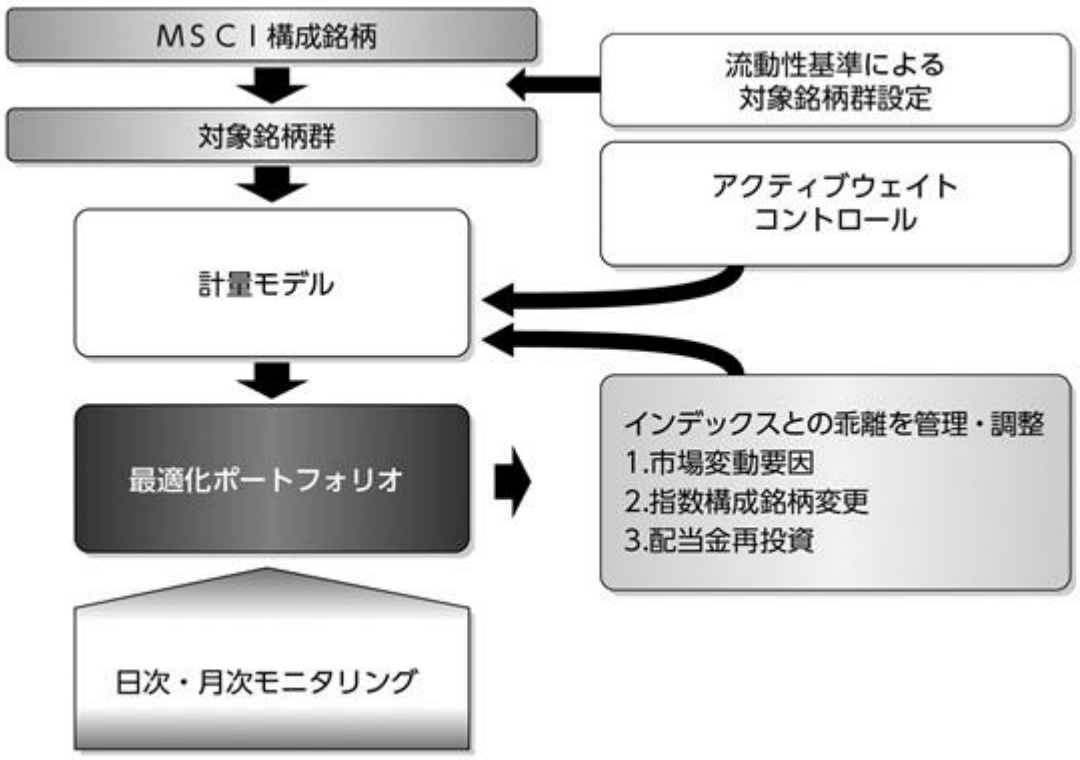
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施

・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定

＜外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス＞



1.流動性基準による対象銘柄群設定

取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

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

3.インデックスとの乖離を管理

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

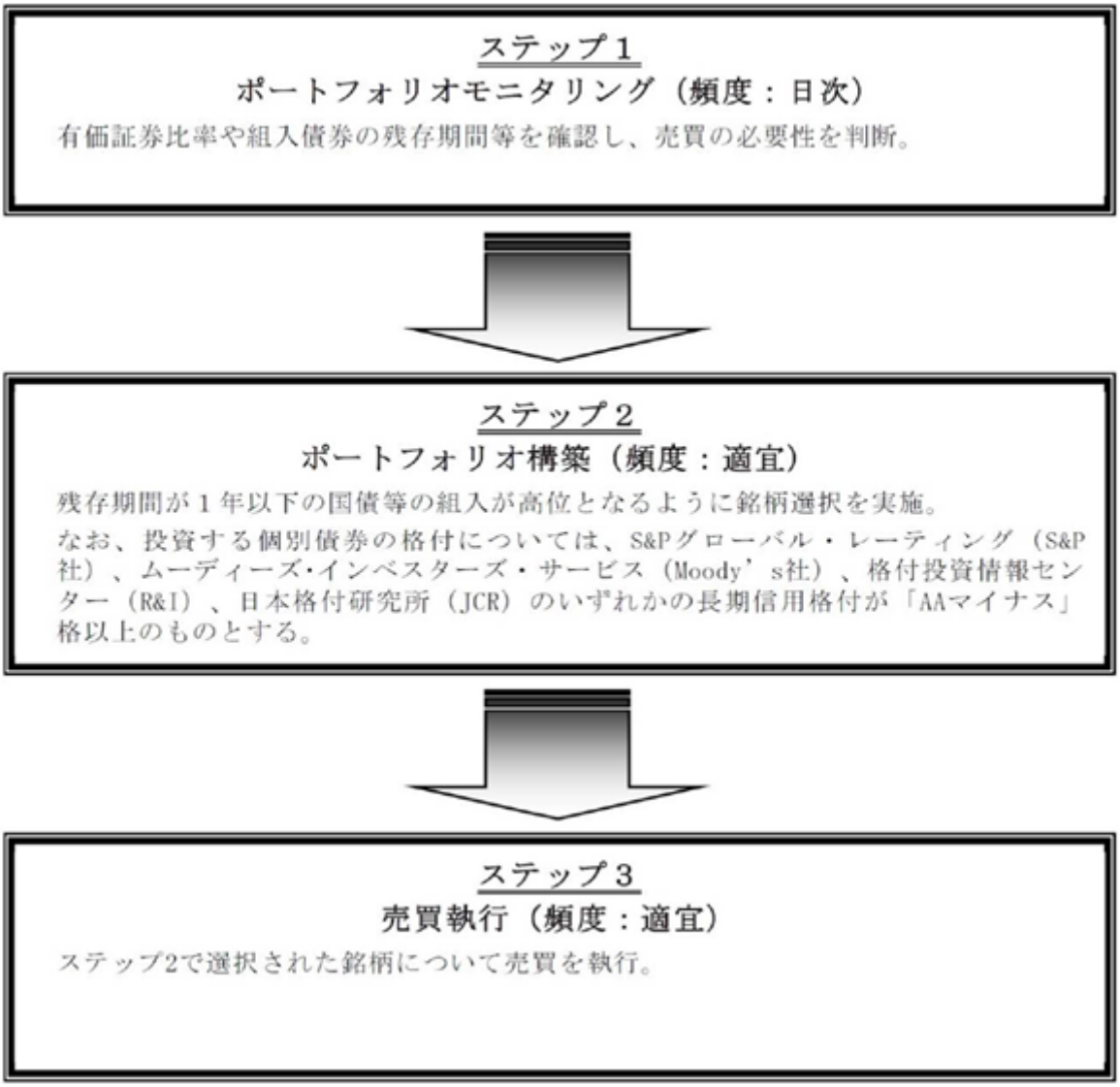
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施

・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施

・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

＜ＭＨＡＭ国内短期債券マザーファンドの投資プロセス＞



市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

（２）【投資対象】

①　投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

ａ．有価証券

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

ｃ．金銭債権

ｄ．約束手形（ａ.に掲げるものに該当するものを除きます。）

２．次に掲げる特定資産以外の資産

ａ．為替手形

②　有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として下記１．から下記５．までのアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の各受益証券を含む下記６．から下記27.までの有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券

２．外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券

３．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

４．外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券

５．ＭＨＡＭ国内短期債券マザーファンド受益証券

６．株券または新株引受権証書

７．国債証券

８．地方債証券

９．特別の法律により法人が発行する債券

10．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

11．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）

12．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）

13．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）

14．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）

15．コマーシャル・ペーパー

16. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記１．から前記16.の証券または証書の性質を有するもの（外国の者の発行する証券または証書で、前記６．から前記11.の証券または証書の性質を有するプリファードセキュリティーズ（ハイブリッド型のプリファードセキュリティーズを含みます。）およびこれらに類するものを含みます。）
18. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
19. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいい、プリファードセキュリティーズ（投資証券および投資法人債券のハイブリッド型のものを含みます。）に該当するものを含みます。）
20. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
21. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
22. 預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
24. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
25. 抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）
26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
27. 外国の者に対する権利で前記26.の有価証券の性質を有するもの

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

③　金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。また、②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、下記１．から下記４．までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

１．預金
２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３．コール・ローン
４．手形割引市場において売買される手形
５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前記５．の権利の性質を有するもの

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

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

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

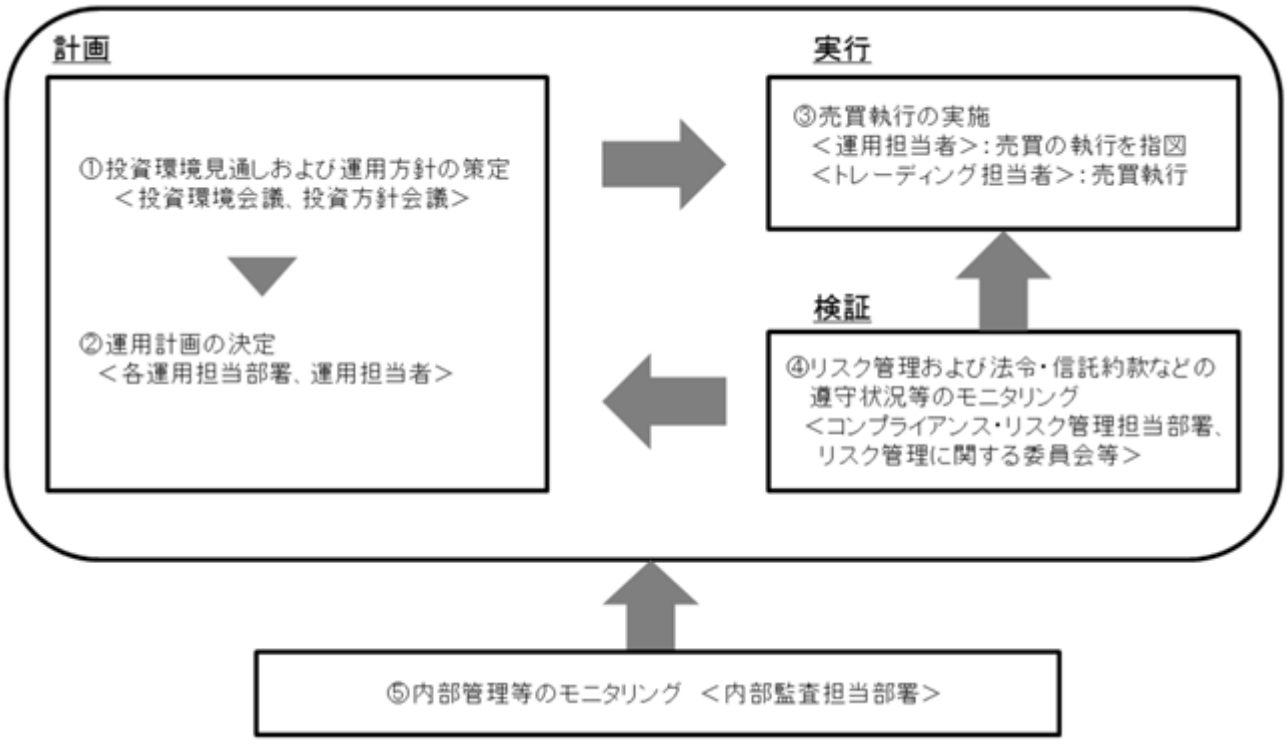
10．合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第２条第２項第３号で定めるものをいいます。）

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

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

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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2022年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。
※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①　収益分配方針

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

１．分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいま

す。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

２．分配金額は、委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。

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

※　将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

②　収益分配金の支払い

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

２．収益分配金の再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資することにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

※　収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し、お支払いします。

（５）【投資制限】

ａ．約款で定める投資制限

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

１．株式への実質投資割合※には制限を設けません。

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

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

３．同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。

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

５．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所（金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。なお、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

②　みなし有価証券（約款第17条）

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

③　投資信託証券（約款第17条）

委託会社は、投資信託証券（マザーファンド受益証券および取引所金融商品市場（金融商品取引法第２条第17項に規定する金融商品市場をいいます。）または外国金融商品市場に上場等（不動産投資信託証券については、予定を含みます。以下同じ。）され、かつこれらの市場において常時売却可能（市場の急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

④　転換社債等（約款第21条）

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

⑥　外国為替予約（約款第32条）

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

⑦　信用リスク集中回避のための投資制限（約款第22条）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

⑨　信用取引（約款第24条）

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

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

ａ．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ｂ．株式分割により取得する株券

ｃ．有償増資により取得する株券

ｄ．売り出しにより取得する株券

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

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

⑩　有価証券先物取引等（約款第25条）

１．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

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

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

⑪　スワップ取引（約款第26条）

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

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

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

４．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

⑫　金利先渡取引および為替先渡取引（約款第27条）

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

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

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

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

⑬　有価証券の貸付（約款第28条）

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

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

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

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

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

⑭　公社債の空売り（約款第29条）

１．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

２．前記１．の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

３．信託財産の一部解約等の事由により、前記２．の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑮　公社債の借入れ（約款第30条）

１．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

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

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

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑯　資金の借入れ（約款第38条）

１．委託会社は、信託財産の効率的な運用および運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

２．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金等および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を上回らない範囲内とします。

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

４．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

ｂ．法令で定める投資制限

○　同一の法人の発行する株式の取得割合（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

＜各マザーファンドの投資方針および主な投資制限＞

Ⅰ「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」

１．基本方針

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

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

れています。NOMURA－BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

２．運用方法

（1）投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

① 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA－BPI総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。

② 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

③ 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

（3）投資制限

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

② 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

④ 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤ 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥ 有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。

⑦ スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。

⑧ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。

⑨ 外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行ないます。

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

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

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

II「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」

１．基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

２．運用方法

（1）投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

① 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果を目指して運用を行います。

※ 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）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
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）は、FTSE世界国債インデックス・データに基づき当社が計算したものです。

② 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

③ 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

(3) 投資制限

① 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③ 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

⑤ 有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。

⑥ スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。

⑦ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

⑧ 外国為替予約取引は約款24条の範囲で行ないます。

⑨ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑩ 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

⑪ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

Ⅲ「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX、配当込み）※に連動する投資成果を目標として運用を行います。

※　東証株価指数(TOPIX＝Tokyo Stock Price Index)とは、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、基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

＊1 東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。

＊2 ＪＰＸは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（TOPIX）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

＊3 ＪＰＸ は、東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

＊4 ＪＰＸは、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

＊5 本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。

＊6 ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

＊7 ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

＊8 以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

2.運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

② 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。

③ 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

④ 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

⑤ 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

(3) 投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。

③ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。

④ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑤ 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

Ⅳ「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」

１.基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

２.運用方法

(1) 投資対象

海外の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み）※に連動する投資成果を目指して運用を行います。

※ ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。

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

方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

② 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

③ 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

(3) 投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。

③ 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

⑤ 有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。

⑥ スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。

⑦ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。

⑧ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑨ 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

V「MHAM国内短期債券マザーファンド」

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

この投資信託は、わが国の短期の国債等を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

③　投資する個別債券の残存期間については、原則として１年以下とします。

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

⑤　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

(3) 投資制限

①　株式（新株引受権証券を含みます。）への投資は行いません。

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

③　同一銘柄の転換社債等への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　外貨建資産への投資は行いません。

⑤　有価証券先物取引等は、約款第19条の範囲で行います。

⑥　スワップ取引は、約款第20条の範囲で行います。

⑦　金利先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

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

・当ファンドは、主として各マザーファンド受益証券への投資を通じて値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。したがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。
・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
・登録金融機関およびアセットマネジメントOne株式会社が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
・投資信託は預貯金とは異なります。
・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

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

① 資産配分リスク

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

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

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

② 金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスクとは、金利変動により公社債の価格が下落するリスクをいいます。

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

③ 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

④　為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

⑤　信用リスク

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

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

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

⑥　流動性リスク

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

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

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

⑦　カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

＜その他＞

- **当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が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。**
- **投資対象国において、税制、決済ルールの変更などにより税金や費用が新たに発生した場合や、外国為替取引規制や外国からの投資規制の実施などがあった場合は、当ファンドの基準価額に影響を与える場合があります。**
- **当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。**
- **当ファンドは、一部解約の実行の請求金額が多額な場合や取引所等における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことがあります。**

＜収益分配金に関する留意点＞

- **投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。**
- **分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。**
- **投資家（受益者）のファンドの取得価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド取得後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。**

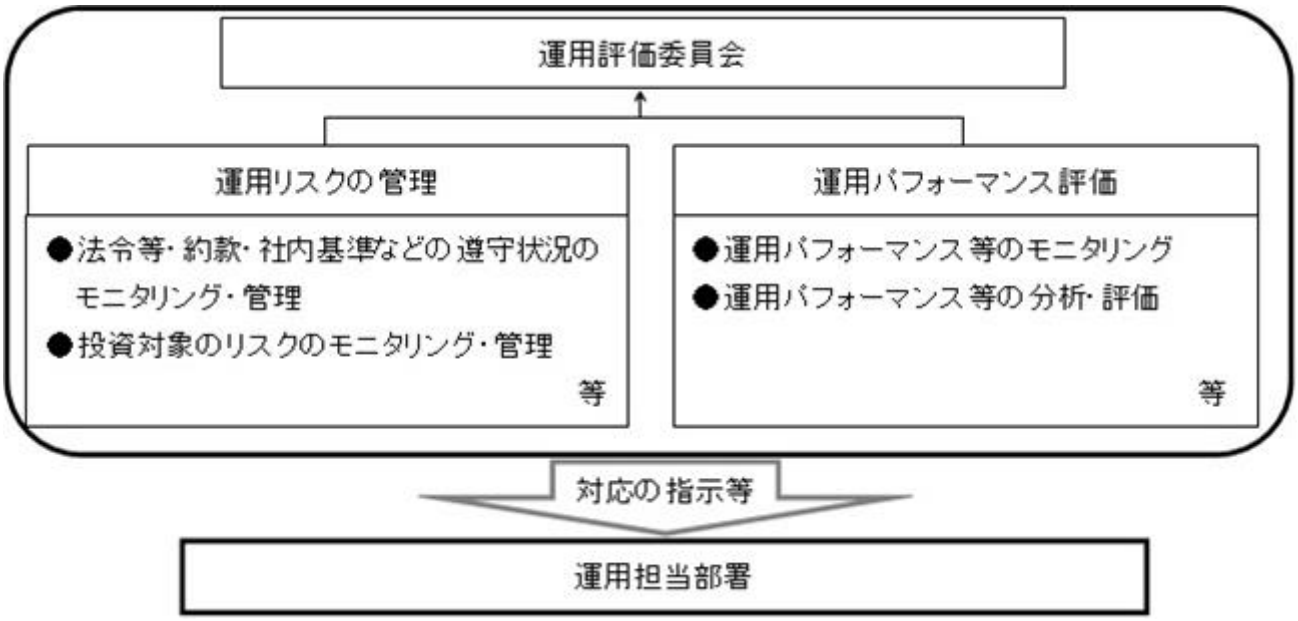
(2) リスク管理体制

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

- **運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。**

・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。

・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。

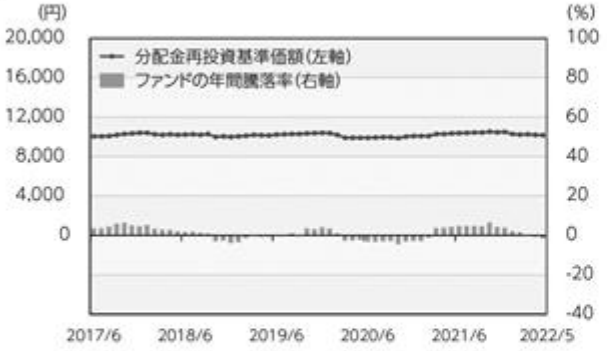


・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※リスク管理体制は2022年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

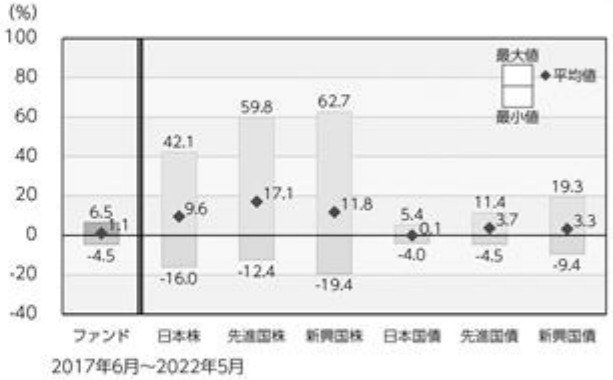
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2017年6月～2022年5月

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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

① 申込手数料(受益権１口当たり)は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜２%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。なお、申込手数料には消費税等相当額が課せられます。

② 申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

＜申込手数料を対価とする役務の内容＞

商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

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

信託報酬の配分（税抜）については、以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
0.53%	0.33%	0.04%

② 信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税等相当額を信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

＜信託報酬等を対価とする役務の内容＞

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

（４）【その他の手数料等】

①　信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、当該費用に係る消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支弁します。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場

株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限ります。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

○法人の受益者に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。
買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。
なお、益金不算入制度の適用はありません。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は、2022年5月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
※課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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

＜個別元本について＞
①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。
③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となりま

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

＜収益分配金の課税について＞

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2022年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		460,948,045	97.74
	内　日本	460,948,045	97.74
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,660,897	2.26
純資産総額		471,608,942	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）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		493,549,955,450	72.77
	内　日本	493,549,955,450	72.77
地方債証券		33,985,935,400	5.01
	内　日本	33,985,935,400	5.01
特殊債券		32,333,375,939	4.77
	内　日本	32,333,375,939	4.77
社債券		27,067,972,430	3.99
	内　日本	26,270,293,430	3.87
	内　フランス	797,679,000	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		91,252,273,016	13.46
純資産総額		678,189,512,235	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

2022年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		166,964,341,685	98.69
	内　アメリカ	82,987,408,790	49.05
	内　フランス	15,355,941,750	9.08
	内　イタリア	13,834,447,447	8.18
	内　ドイツ	11,346,986,166	6.71
	内　スペイン	9,095,963,776	5.38
	内　イギリス	8,792,554,996	5.20
	内　カナダ	3,464,862,305	2.05
	内　ベルギー	3,445,154,505	2.04
	内　中国	3,009,136,143	1.78
	内　オランダ	2,946,459,020	1.74
	内　オーストラリア	2,613,225,109	1.54
	内　オーストリア	2,116,140,252	1.25
	内　メキシコ	1,287,976,192	0.76
	内　アイルランド	1,179,570,389	0.70
	内　フィンランド	911,916,209	0.54
	内　マレーシア	892,139,680	0.53
	内　シンガポール	726,636,244	0.43

	内　ポーランド	719,171,280	0.43
	内　イスラエル	659,772,660	0.39
	内　デンマーク	659,310,862	0.39
	内　スウェーデン	463,665,004	0.27
	内　ノルウェー	455,902,906	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,210,039,612	1.31
純資産総額		169,174,381,297	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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		350,562,476,450	96.71
	内　日本	350,562,476,450	96.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,936,647,089	3.29
純資産総額		362,499,123,539	100.00

その他資産の投資状況

2022年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		12,293,960,000	3.39
	内　日本	12,293,960,000	3.39

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

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

2022年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	973,408,723	100.00
純資産総額	973,408,723	100.00

その他資産の投資状況

2022年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		973,207,102	99.98
	内　アメリカ	745,932,190	76.63
	内　ドイツ	148,119,552	15.22
	内　イギリス	36,840,031	3.78
	内　カナダ	25,545,948	2.62
	内　オーストラリア	16,769,381	1.72

（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

2022年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		670,183,170,104	94.48
	内　アメリカ	467,914,573,771	65.96
	内　イギリス	30,332,690,484	4.28
	内　カナダ	27,335,690,891	3.85
	内　スイス	22,945,706,791	3.23
	内　フランス	21,476,870,514	3.03
	内　ドイツ	16,691,294,838	2.35
	内　オーストラリア	15,384,624,307	2.17
	内　オランダ	12,501,327,434	1.76
	内　アイルランド	12,327,700,441	1.74
	内　スウェーデン	6,716,469,918	0.95
	内　デンマーク	5,492,405,056	0.77
	内　スペイン	5,214,479,966	0.74
	内　香港	4,475,953,711	0.63
	内　イタリア	3,715,282,715	0.52
	内　ジャージィー	2,732,203,529	0.39
	内　フィンランド	2,442,885,102	0.34
	内　シンガポール	2,124,467,422	0.30
	内　ベルギー	1,672,923,688	0.24
	内　ノルウェー	1,540,647,066	0.22
	内　ケイマン諸島	1,451,515,619	0.20
	内　イスラエル	1,357,626,654	0.19
	内　バミューダ	988,872,054	0.14
	内　オランダ領キュラソー	929,159,441	0.13
	内　ルクセンブルグ	674,827,698	0.10
	内　ニュージーランド	504,080,023	0.07
	内　オーストリア	404,641,204	0.06
	内　ポルトガル	375,983,953	0.05
	内　リベリア	167,228,001	0.02
	内　マン島	146,206,395	0.02
	内　パナマ	144,831,418	0.02
投資信託受益証券		1,213,455,510	0.17
	内　オーストラリア	905,374,634	0.13
	内　シンガポール	308,080,876	0.04
投資証券		15,610,536,223	2.20
	内　アメリカ	14,593,399,102	2.06
	内　イギリス	393,521,693	0.06
	内　フランス	300,848,189	0.04
	内　香港	246,274,212	0.03
	内　カナダ	76,493,027	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		22,345,960,474	3.15
純資産総額		709,353,122,311	100.00

その他資産の投資状況

2022年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		22,263,960,451	3.14
	内　アメリカ	16,144,103,837	2.28
	内　ドイツ	3,300,950,016	0.47

	内　カナダ	1,226,205,504	0.17
	内　イギリス	1,056,080,894	0.15
	内　オーストラリア	536,620,200	0.08

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2022年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	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	302,642,525	1.2786 386,985,116	1.2812 387,745,603	－ －	82.22
2	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	26,199,954	2.0572 53,898,546	2.0634 54,060,985	－ －	11.46
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	3,187,891	3.1479 10,035,480	3.2079 10,226,435	－ －	2.17
4	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	1,455,801	5.9409 8,648,913	5.9498 8,661,724	－ －	1.84
5	ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	81,675	3.0845 251,934	3.1013 253,298	－ －	0.05

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年5月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.74
合計	97.74

（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）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	３３９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	6,780,000,000	101.35 6,871,712,400	101.37 6,873,225,000	0.4 2025/6/20	1.01

2	３３３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,630,000,000	101.27 6,714,765,000	101.21 6,710,620,800	0.6 2024/3/20	0.99
3	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,540,000,000	101.45 6,634,959,900	101.47 6,636,268,800	0.4 2025/9/20	0.98
4	３３５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,510,000,000	101.31 6,595,632,900	101.30 6,594,825,300	0.5 2024/9/20	0.97
5	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,460,000,000	100.17 6,471,544,000	100.28 6,478,669,400	0.1 2028/3/20	0.96
6	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,970,000,000	100.36 5,991,514,100	100.48 5,998,656,000	0.1 2027/3/20	0.88
7	１４４回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,900,000,000	100.39 5,923,551,000	100.45 5,927,022,000	0.1 2025/6/20	0.87
8	１３７回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,700,000,000	100.25 5,714,250,000	100.24 5,713,737,000	0.1 2023/9/20	0.84
9	３４９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,530,000,000	100.30 5,546,938,000	100.36 5,549,908,000	0.1 2027/12/20	0.82
10	１５０回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,540,000,000	100.01 5,540,923,800	100.06 5,543,767,200	0.005 2026/12/20	0.82
11	３５９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,300,000,000	99.43 5,269,866,000	99.40 5,268,412,000	0.1 2030/6/20	0.78
12	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,190,000,000	100.40 5,211,107,000	100.50 5,216,001,900	0.1 2026/12/20	0.77
13	３６０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,240,000,000	99.23 5,199,957,000	99.30 5,203,529,600	0.1 2030/9/20	0.77
14	３６５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,240,000,000	98.80 5,177,131,100	98.83 5,178,692,000	0.1 2031/12/20	0.76
15	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,010,000,000	100.33 5,026,928,800	100.42 5,031,492,900	0.1 2027/6/20	0.74
16	１３８回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,000,000,000	100.27 5,013,800,000	100.27 5,013,950,000	0.1 2023/12/20	0.74
17	３５７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,910,000,000	99.75 4,898,123,200	99.58 4,889,819,900	0.1 2029/12/20	0.72
18	３４１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,820,000,000	101.18 4,877,290,000	101.20 4,878,273,800	0.3 2025/12/20	0.72

19	１４５回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,850,000,000	100.43 4,871,060,000	100.47 4,873,231,500	0.1 2025/9/20	0.72
20	３６１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,900,000,000	99.10 4,856,013,000	99.20 4,860,800,000	0.1 2030/12/20	0.72
21	３５６回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,840,000,000	99.60 4,820,772,000	99.71 4,825,964,000	0.1 2029/9/20	0.71
22	３４４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,730,000,000	100.39 4,748,788,200	100.51 4,754,406,800	0.1 2026/9/20	0.70
23	３６４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,800,000,000	98.77 4,741,293,000	98.90 4,747,440,000	0.1 2031/9/20	0.70
24	３４２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,680,000,000	100.47 4,702,160,000	100.49 4,703,119,200	0.1 2026/3/20	0.69
25	３３４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,620,000,000	101.40 4,685,038,400	101.37 4,683,571,200	0.6 2024/6/20	0.69
26	３５４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,660,000,000	99.88 4,654,580,000	99.93 4,656,831,200	0.1 2029/3/20	0.69
27	３５２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,640,000,000	99.99 4,639,718,000	100.12 4,645,800,000	0.1 2028/9/20	0.69
28	４３４回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	4,600,000,000	100.11 4,605,442,000	100.14 4,606,808,000	0.005 2024/3/1	0.68
29	３６２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,640,000,000	99.01 4,594,369,300	99.09 4,597,868,800	0.1 2031/3/20	0.68
30	３６３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,600,000,000	98.93 4,551,055,000	98.97 4,552,988,000	0.1 2031/6/20	0.67

（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

2022年5月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	72.77
地方債証券	5.01
特殊債券	4.77
社債券	3.99
合計	86.54

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

2022年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	979,524,400	97.80 958,027,275	91.20 893,356,862	1.625 2031/5/15	0.53
2	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	994,909,600	93.65 931,771,800	87.64 871,983,849	1.125 2031/2/15	0.52
3	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	978,242,300	94.51 924,590,304	87.93 860,241,822	1.25 2031/8/15	0.51
4	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	815,415,600	102.26 833,914,447	100.70 821,148,990	2.75 2023/11/15	0.49
5	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	896,187,900	95.97 860,093,738	88.64 794,456,563	1.375 2031/11/15	0.47
6	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証券	802,594,600	97.56 783,013,453	96.53 774,754,599	0.125 2024/1/15	0.46
7	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	897,470,000	90.80 814,919,885	86.15 773,226,496	0.875 2030/11/15	0.46
8	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	805,158,800	93.13 749,883,226	92.61 745,715,428	1.875 2032/2/15	0.44
9	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	761,567,400	98.82 752,602,272	94.60 720,454,654	1.5 2027/1/31	0.43
10	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	835,929,200	87.12 728,331,783	84.58 707,078,543	0.625 2030/8/15	0.42
11	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	691,051,900	101.72 702,991,612	99.18 685,437,103	2.25 2024/11/15	0.41
12	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証券	706,437,100	97.47 688,631,992	96.28 680,221,656	0.25 2024/3/15	0.40
13	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	671,820,400	105.95 711,802,300	100.40 674,549,669	2.875 2028/5/15	0.40
14	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	653,871,000	102.14 667,875,146	100.13 654,739,417	2.5 2024/5/15	0.39
15	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証券	620,536,400	101.29 628,550,850	99.53 617,627,635	2.125 2024/3/31	0.37
16	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	619,254,300	104.90 649,656,356	99.07 613,497,164	2.625 2029/2/15	0.36
17	US T N/B 2.25 03/31/24 アメリカ	国債証券	608,997,500	99.49 605,907,867	99.69 607,165,744	2.25 2024/3/31	0.36
18	US T N/B 1.125 01/15/25 アメリカ	国債証券	629,511,100	95.75 602,769,468	96.28 606,101,155	1.125 2025/1/15	0.36
19	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証券	615,408,000	97.41 599,492,168	96.31 592,714,830	0.125 2024/2/15	0.35
20	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	541,396,800	117.25 634,823,856	109.35 592,030,394	2.5 2030/5/25	0.35
21	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	591,048,100	101.93 602,479,953	99.70 589,293,425	2.375 2024/8/15	0.35
22	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	587,201,800	102.86 604,006,669	99.90 586,628,353	2.75 2028/2/15	0.35
23	US T N/B 2.5 01/31/24 アメリカ	国債証券	583,355,500	101.99 594,973,173	100.25 584,859,458	2.5 2024/1/31	0.35

24	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	580,791,300	106.13 616,418,943	100.39 583,105,386	2.875 2028/8/15	0.34
25	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	678,230,900	90.58 614,380,913	84.98 576,363,798	0.625 2030/5/15	0.34
26	US T N/B 1.25 05/31/28 アメリカ	国債証券	628,229,000	96.40 605,635,009	91.55 575,173,092	1.25 2028/5/31	0.34
27	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	561,559,800	107.87 605,803,602	101.90 572,264,532	3.125 2028/11/15	0.34
28	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証券	648,742,600	102.89 667,509,263	87.73 569,170,264	2.375 2051/5/15	0.34
29	US T N/B 1.0 12/15/24 アメリカ	国債証券	591,048,100	98.31 581,096,765	96.10 568,006,455	1 2024/12/15	0.34
30	US T N/B 1.5 02/15/25 アメリカ	国債証券	583,355,500	99.66 581,418,002	97.06 566,219,432	1.5 2025/2/15	0.33

（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

2022年5月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.69
合計	98.69

（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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	6,598,400	2,228.69 14,705,830,186	2,122.50 14,005,104,000	－ －	3.86
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	874,300	12,544.04 10,967,255,438	12,115.00 10,592,144,500	－ －	2.92
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	126,500	57,365.62 7,256,751,539	51,590.00 6,526,135,000	－ －	1.80
4	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,249,300	752.95 6,211,341,875	729.70 6,019,514,210	－ －	1.66
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,500,900	3,482.99 5,227,621,427	3,911.00 5,870,019,900	－ －	1.62
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	88,600	56,871.47 5,038,812,574	58,980.00 5,225,628,000	－ －	1.44
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	979,800	5,534.03 5,422,247,603	4,734.00 4,638,373,200	－ －	1.28

8	任天堂 日本	株式 その他製品	78,800	59,196.49 4,664,684,107	57,420.00 4,524,696,000	－ －	1.25
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	671,200	6,013.16 4,036,036,522	6,725.00 4,513,820,000	－ －	1.25
10	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	998,400	3,907.88 3,901,627,916	4,486.00 4,478,822,400	－ －	1.24
11	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	821,200	5,337.60 4,383,239,558	5,379.00 4,417,234,800	－ －	1.22
12	三菱商事 日本	株式 卸売業	944,300	4,126.91 3,897,050,260	4,433.00 4,186,081,900	－ －	1.15
13	信越化学工業 日本	株式 化学	222,700	18,835.06 4,194,568,690	18,335.00 4,083,204,500	－ －	1.13
14	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,096,900	3,516.36 3,857,102,350	3,703.00 4,061,820,700	－ －	1.12
15	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	269,400	15,023.25 4,047,265,833	13,810.00 3,720,414,000	－ －	1.03
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	913,100	4,281.42 3,909,367,919	3,922.00 3,581,178,200	－ －	0.99
17	第一三共 日本	株式 医薬品	1,040,600	2,484.92 2,585,808,958	3,419.00 3,557,811,400	－ －	0.98
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,046,500	3,400.77 3,558,908,467	3,187.00 3,335,195,500	－ －	0.92
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	160,900	22,279.84 3,584,827,836	20,685.00 3,328,216,500	－ －	0.92
20	三井物産 日本	株式 卸売業	1,020,100	3,057.46 3,118,924,540	3,232.00 3,296,963,200	－ －	0.91
21	村田製作所 日本	株式 電気機器	390,400	8,220.63 3,209,335,342	8,300.00 3,240,320,000	－ －	0.89
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	870,000	3,802.64 3,308,301,268	3,695.00 3,214,650,000	－ －	0.89
23	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,074,300	1,464.18 3,037,152,719	1,480.00 3,069,964,000	－ －	0.85
24	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	402,700	7,181.34 2,891,927,794	7,466.00 3,006,558,200	－ －	0.83
25	日本電産 日本	株式 電気機器	327,300	9,814.98 3,212,445,562	8,679.00 2,840,636,700	－ －	0.78
26	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	147,100	21,442.46 3,154,187,043	19,200.00 2,824,320,000	－ －	0.78
27	ＳＭＣ 日本	株式 機械	40,900	65,092.38 2,662,278,421	66,610.00 2,724,349,000	－ －	0.75
28	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	486,600	5,696.06 2,771,705,819	5,410.00 2,632,506,000	－ －	0.73

29	ファナック 日本	株式 電気機器	122,500	22,012.22 2,696,498,089	21,105.00 2,585,362,500	－ －	0.71
30	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,687,200	1,616.73 2,727,759,533	1,519.00 2,562,856,800	－ －	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

2022年5月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.71
合計	96.71

（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

2022年5月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	17.72
情報・通信業		8.66
輸送用機器		7.70
化学		6.18
卸売業		5.53
機械		5.23
サービス業		5.23
医薬品		5.01
銀行業		4.99
小売業		3.96
食料品		3.12
陸運業		2.85
精密機器		2.65
その他製品		2.34
保険業		2.19
建設業		2.06
不動産業		1.92
電気・ガス業		1.20
その他金融業		1.12
鉄鋼		0.82
非鉄金属		0.74
証券、商品先物取引業		0.71
ガラス・土石製品		0.70
ゴム製品		0.68
海運業		0.67
金属製品		0.58
石油・石炭製品		0.51
繊維製品		0.43
空運業		0.41
鉱業		0.35
倉庫・運輸関連業		0.19
パルプ・紙		0.18
水産・農林業		0.09

合計	96.71

（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。

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

投資株式の業種別投資比率

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

2022年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	1,728,123	21,446.43 37,062,078,969	19,185.34 33,154,634,920	－ －	4.67
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	751,470	37,666.01 28,304,877,823	35,032.10 26,325,572,487	－ －	3.71
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	48,101	392,970.31 18,902,265,342	295,258.65 14,202,236,578	－ －	2.00
4	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	31,724	344,169.28 10,918,426,551	288,001.96 9,136,574,474	－ －	1.29
5	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	89,985	111,570.64 10,039,684,919	97,392.16 8,763,833,724	－ －	1.24
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	30,108	343,982.54 10,356,626,550	289,239.19 8,708,413,707	－ －	1.23

7	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	99,284	61,275.55 6,083,681,992	65,016.57 6,455,105,443	－ －	0.91
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	277,260	21,401.36 5,933,743,503	23,217.54 6,437,297,608	－ －	0.91
9	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	263,742	30,776.36 8,117,020,263	24,117.58 6,360,819,601	－ －	0.90
10	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	249,564	27,556.63 6,877,144,215	25,017.61 6,243,496,643	－ －	0.88
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	137,479	40,626.42 5,585,280,801	40,913.09 5,624,691,126	－ －	0.79
12	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	446,686	10,256.87 4,581,602,659	12,512.01 5,588,941,440	－ －	0.79
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	311,735	19,175.63 5,977,717,101	16,830.12 5,246,539,546	－ －	0.74
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	255,418	19,963.73 5,099,096,253	19,067.39 4,870,154,925	－ －	0.69
15	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	176,069	28,567.98 5,029,937,322	27,293.34 4,805,511,925	－ －	0.68
16	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	203,305	18,093.44 3,678,487,566	22,857.27 4,646,999,066	－ －	0.66
17	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	297,038	15,684.58 4,658,918,405	15,608.31 4,636,261,779	－ －	0.65
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	110,194	44,227.28 4,873,581,750	39,547.65 4,357,914,471	－ －	0.61
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	92,488	47,299.18 4,374,607,441	45,870.97 4,242,514,624	－ －	0.60
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	591,734	6,417.87 3,797,673,806	6,911.80 4,089,947,712	－ －	0.58

21	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	777,773	5,933.97 4,615,282,442	4,746.33 3,691,570,589	－ －	0.52
22	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	433,244	7,805.00 3,381,469,451	8,292.62 3,592,729,072	－ －	0.51
23	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	186,536	18,562.08 3,462,497,408	19,231.50 3,587,367,084	－ －	0.51
24	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	85,706	31,129.90 2,668,019,669	41,473.37 3,554,516,717	－ －	0.50
25	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	43,673	77,502.72 3,384,776,495	76,608.33 3,345,715,858	－ －	0.47
26	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	74,401	45,901.60 3,415,125,075	44,131.91 3,283,458,607	－ －	0.46
27	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	43,454	74,026.55 3,216,749,940	74,782.32 3,249,591,315	－ －	0.46
28	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	146,000	21,315.67 3,112,088,492	22,022.63 3,215,304,228	－ －	0.45
29	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	266,144	9,939.68 2,645,388,509	11,933.78 3,176,105,754	－ －	0.45
30	SHELL PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	814,641	3,277.63 2,670,098,523	3,840.18 3,128,370,030	－ －	0.44

（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

2022年5月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	94.48
投資信託受益証券	0.17
投資証券	2.20
合計	96.85

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2022年5月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	6.86
銀行		5.94
医薬品		5.37
石油・ガス・消耗燃料		5.10
コンピュータ・周辺機器		4.95
半導体・半導体製造装置		4.60
情報技術サービス		3.67
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.63

保険	3.09
資本市場	3.07
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	2.33
インターネット販売・通信販売	2.32
ヘルスケア機器・用品	2.29
化学	2.16
電力	1.91
自動車	1.85
バイオテクノロジー	1.82
飲料	1.74
ホテル・レストラン・レジャー	1.71
金属・鉱業	1.67
食品	1.62
機械	1.59
専門小売り	1.55
航空宇宙・防衛	1.48
食品・生活必需品小売り	1.43
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.43
各種電気通信サービス	1.28
繊維・アパレル・贅沢品	1.25
家庭用品	1.13
娯楽	1.05
各種金融サービス	1.04
陸運・鉄道	1.03
コングロマリット	0.92
メディア	0.88
総合公益事業	0.87
電気設備	0.76
タバコ	0.76
専門サービス	0.66
通信機器	0.62
航空貨物・物流サービス	0.56
電子装置・機器・部品	0.52
パーソナル用品	0.52
建設関連製品	0.52
複合小売り	0.47
商業サービス・用品	0.46
消費者金融	0.45
不動産管理・開発	0.37
商社・流通業	0.33
無線通信サービス	0.29
家庭用耐久財	0.29
容器・包装	0.28
エネルギー設備・サービス	0.28
建設資材	0.23
建設・土木	0.21
自動車部品	0.20
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
ガス	0.15
運送インフラ	0.14

紙製品・林産品	0.12
ヘルスケア・テクノロジー	0.11
水道	0.10
販売	0.10
海運業	0.09
旅客航空輸送業	0.06
レジャー用品	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	94.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

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。

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。

ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

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。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０４０６月	買建	644	12,154,632,520	12,293,960,000	3.39

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド

2022年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Jun22	買建	28	739,425,533	745,932,190	76.63
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun22	買建	28	139,351,128	148,119,552	15.22
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun22	買建	3	35,694,770	36,840,031	3.78
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun22	買建	1	25,206,252	25,545,948	2.62
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Jun22	買建	1	16,454,452	16,769,381	1.72

（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

2022年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Jun22	買建	606	15,654,598,057	16,144,103,837	2.28
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun22	買建	624	3,157,796,712	3,300,950,016	0.47
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun22	買建	48	1,194,124,452	1,226,205,504	0.17
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun22	買建	86	1,034,231,971	1,056,080,894	0.15
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Jun22	買建	32	524,567,853	536,620,200	0.08

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

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2022年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末（2016年 5月 9日）	93	93	0.9889	0.9889
第2計算期間末（2017年 5月 8日）	219	219	1.0052	1.0052
第3計算期間末（2018年 5月 8日）	276	276	1.0243	1.0243

第4計算期間末 (2019年 5月 8日)	382	382	1.0152	1.0152
第5計算期間末 (2020年5月8日)	433	433	0.9884	0.9884
第6計算期間末 (2021年5月10日)	485	485	1.0343	1.0343
第7計算期間末 (2022年5月9日)	465	465	1.0171	1.0171
2021年5月末日	487	－	1.0348	－
6月末日	489	－	1.0380	－
7月末日	498	－	1.0406	－
8月末日	496	－	1.0453	－
9月末日	494	－	1.0433	－
10月末日	495	－	1.0520	－
11月末日	491	－	1.0468	－
12月末日	481	－	1.0489	－
2022年1月末日	475	－	1.0287	－
2月末日	473	－	1.0227	－
3月末日	484	－	1.0267	－
4月末日	467	－	1.0219	－
5月末日	471	－	1.0189	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	△1.11
第2計算期間	1.65
第3計算期間	1.90
第4計算期間	△0.89
第5計算期間	△2.6
第6計算期間	4.6
第7計算期間	△1.7

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	97,026,713	2,647,305
第2計算期間	146,988,315	23,166,841

第3計算期間	135,796,963	84,429,344
第4計算期間	180,925,539	73,460,775
第5計算期間	184,043,588	122,719,064
第6計算期間	159,040,672	128,083,716
第7計算期間	125,302,215	137,244,618

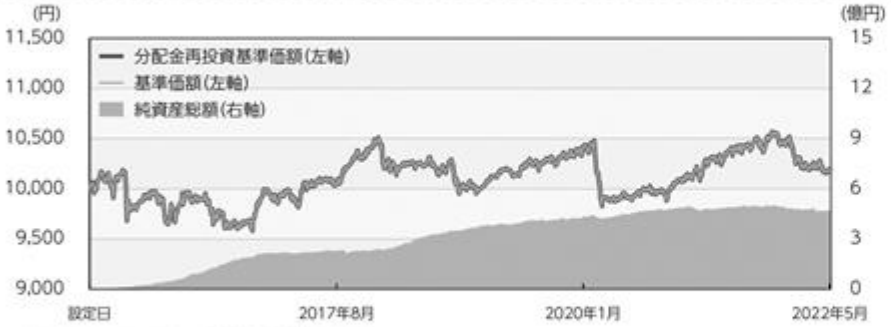
（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

≪参考情報≫

データの基準日:2022年5月31日

基準価額・純資産の推移 (2015年4月20日～2022年5月31日)



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

分配の推移(税引前)

2018年 5月	0円
2019年 5月	0円
2020年 5月	0円
2021年 5月	0円
2022年 5月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

マザーファンドの入替えのため、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」を2022年3月1日に投資対象に追加し、「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」を2022年6月29日に投資対象から削除する約款変更を行いました。
以下は2022年5月31日基準日のデータのため、約款変更前の主要な資産の状況です。

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	82.22
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.46
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	2.17
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.84
5	MHAM外国株式インデックスマザーファンド	0.05

■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	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	1.01
2	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/3/20	0.99
3	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	0.98
4	335回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2024/9/20	0.97
5	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	0.96

○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:2022年5月31日

■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	0.53
2	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.52
3	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.51
4	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	0.49
5	US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	アメリカ	1.375	2031/11/15	0.47

■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	3.86
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.92
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.80
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.66
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.62

■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	4.67
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.71
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.00
4	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	1.29
5	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.24

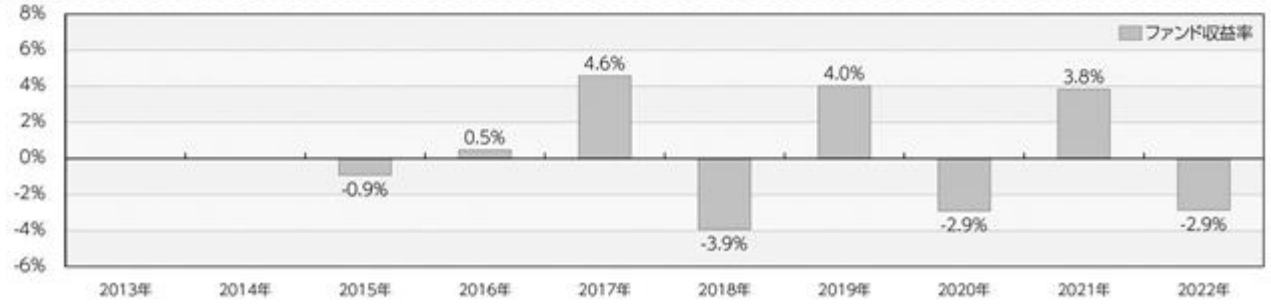
■MHAM外国株式インデックスマザーファンド

組入銘柄

該当事項はありません。

※基準日現在、株価指数先物取引(買建)およびコール・ローンによる運用を行っております。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2015年は設定日から年末までの収益率、および2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

(1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後３時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付けにかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。ただし、取得申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、お申込みの受付けはいたしません。

(2) 取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。

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

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

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

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

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

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

(9) 信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、販売会社は、受益権の取得申込みの受付けを中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

２【換金（解約）手続等】

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

※　解約単位は、販売会社にお問い合わせください。

(2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

(3) 解約請求の受付けについては、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後３時までに解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付けにかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。ただし、解約請求受付日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、解約請求の受付けはいたしません。

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

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

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

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

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

(7) 委託会社は、信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合（一部解約の実行の請求金額が多額な場合を含みます。）、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この日が前記(3)に規定する一部解約の実行の請求を受付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、前記(4)の規定に準じて算出した価額とします。

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

① 基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※ 外国で取引されているものについては、計算日の直近の日とします。

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

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2015年４月20日から2028年５月８日までとします。

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

（４）【計算期間】

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

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

（５）【その他】

① 信託契約の解約

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

を得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合にも書面決議は行いません。

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

ｂ．やむを得ない事情が発生したとき。

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

２．前記１．により信託契約を解約する場合には、委託会社はあらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

ａ．委託会社が監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき。

ｂ．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき、または業務を廃止したとき。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「②信託約款の変更等」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

ｃ．受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないとき。

②　信託約款の変更等

１．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は「②信託約款の変更等」および「③書面決議」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

２．委託会社は、前記１.の事項（前記１.の変更事項にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前記１.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。ただし、当該重大な約款の変更等についての委託会社による提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。

３．この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

４．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

③　書面決議

１．委託会社は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に係る書面決議を行う場合には、あらかじめ、書面決議の日および当該決議の内容に応じて次の事項をそれぞれ定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託契約または信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

ａ．信託契約の解約の場合　信託契約の解約の理由など

ｂ．重大な約款の変更等の場合　重大な約款の変更等の内容およびその理由など

２．書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下この２．において同じ。）は受益権の口数に応じて議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

３．書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

４．書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

④　償還金の支払い

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

※　償還金は、償還日に振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し、お支払いします。

⑤　委託会社の事業の譲渡および承継に伴なう取扱い

１．委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

２．委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

⑥　関係法人との契約の更改ならびに受託会社の辞任または解任に伴なう取扱い

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

２．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「② 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

⑦　信託事務処理の再信託

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

⑧　公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

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

⑨ 運用報告書

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

・交付運用報告書は、販売会社を通じて交付いたします。

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（2021年5月11日から2022年5月9日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【コア資産形成ファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 2021年5月10日現在	第7期 2022年5月9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,786,916	10,908,584
親投資信託受益証券	474,909,843	435,320,186
未収入金	－	22,000,000
流動資産合計	488,696,759	468,228,770
資産合計	488,696,759	468,228,770
負債の部		
流動負債		
未払解約金	892,283	689,968
未払受託者報酬	106,172	104,134
未払委託者報酬	2,283,503	2,239,877
その他未払費用	9,370	9,184
流動負債合計	3,291,328	3,043,163
負債合計	3,291,328	3,043,163
純資産の部		
元本等		
元本	469,314,745	457,372,342
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,090,686	7,813,265
（分配準備積立金）	11,013,736	8,216,869
元本等合計	485,405,431	465,185,607
純資産合計	485,405,431	465,185,607
負債純資産合計	488,696,759	468,228,770

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自　2020年5月9日 至　2021年5月10日	第7期 自　2021年5月11日 至　2022年5月9日
営業収益		
受取利息	10	40
有価証券売買等損益	26,329,014	△2,956,316
その他収益	－	5
営業収益合計	26,329,024	△2,956,271
営業費用		
支払利息	4,160	2,780
受託者報酬	208,333	213,386
委託者報酬	4,480,702	4,589,764
その他費用	18,476	18,823
営業費用合計	4,711,671	4,824,753
営業利益又は営業損失（△）	21,617,353	△7,781,024
経常利益又は経常損失（△）	21,617,353	△7,781,024
当期純利益又は当期純損失（△）	21,617,353	△7,781,024
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（△）	2,399,589	494,784
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△5,090,477	16,090,686
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,963,399	4,820,232
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,249,163	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	714,236	4,820,232
剰余金減少額又は欠損金増加額	－	4,821,845
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	4,821,845
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,090,686	7,813,265

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第7期 自　2021年5月11日 至　2022年5月9日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年5月8日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2021年5月10日、当計算期間末日を2022年5月9日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第6期 2021年5月10日現在	第7期 2022年5月9日現在
１．　期首元本額	438,357,789円	469,314,745円
期中追加設定元本額	159,040,672円	125,302,215円
期中一部解約元本額	128,083,716円	137,244,618円
２．　受益権の総数	469,314,745口	457,372,342口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第6期 自　2020年5月9日 至　2021年5月10日	第7期 自　2021年5月11日 至　2022年5月9日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,309,416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（2,633,617円）、信託約款に規定される収益調整金（15,525,794円）及び分配準備積立金（4,070,703円）より分配対象収益は26,539,530円（1万口当たり565.49円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（17,713,898円）及び分配準備積立金（8,216,869円）より分配対象収益は25,930,767円（1万口当たり566.95円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自　2020年5月9日 至　2021年5月10日	第7期 自　2021年5月11日 至　2022年5月9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。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 2021年5月10日現在	第7期 2022年5月9日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第6期 2021年5月10日現在	第7期 2022年5月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	23,834,144	△5,309,188
合計	23,834,144	△5,309,188

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第6期 2021年5月10日現在	第7期 2022年5月9日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0343円 (10,343円)	1.0171円 (10,171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

2022年5月9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	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	231,918,896	296,485,116	
	MHAM外国株式インデックスマザーファンド	81,675	251,934	
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	3,187,891	10,035,480	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,990,560	29,648,916	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	48,074,441	98,898,740	
親投資信託受益証券　合計		288,253,463	435,320,186	
合計			435,320,186	

（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、「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、「ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券及び「外国株式パッシブ・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）

	2022年5月9日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,556,261,200
国債証券	570,995,339,750
地方債証券	30,649,524,735
特殊債券	28,139,594,607
社債券	27,870,883,800
未収入金	808,616,000
未収利息	685,010,286
前払費用	306,916,204
流動資産合計	661,012,146,582
資産合計	661,012,146,582
負債の部	
流動負債	
未払解約金	457,917,000
流動負債合計	457,917,000
負債合計	457,917,000
純資産の部	
元本等	
元本	516,686,311,075
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	143,867,918,507
元本等合計	660,554,229,582
純資産合計	660,554,229,582
負債純資産合計	661,012,146,582

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11日 至　2022年5月9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	2022年5月9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	236,713,695,224円
同期中追加設定元本額	849,892,400,638円
同期中一部解約元本額	569,919,784,787円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	24,974,400,269円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	147,584,576円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	176,881,974円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	181,234,759円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	694,440,939円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	123,940,023円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	23,171,779円
たわらノーロード　国内債券	16,161,446,337円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,781,171,060円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	951,631,799円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,654,409,468円
たわらノーロード　バランス（積極型）	210,127,584円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	78,089,855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）	1,341,753,899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）	1,284,654,513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）	345,845,380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）	24,078,119円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	17,957,809円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	14,055,418円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	103,471,359円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,421,468円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	414,272円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,206,484,072円
Ｏｎｅグローバルバランス	12,283,551円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	9,151,090,974円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	12,736,994,476円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	5,278,074,227円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,237,491,074円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,354,139,092円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	386,286,265円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	99,738,983円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	3,420,628,335円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	13,441,521円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	4,357,977,595円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,612,714,977円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	335,927,774円
投資のソムリエ	144,350,322,186円
クルーズコントロール	587,423,106円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	8,893,125,540円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	4,767,248,907円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	848,159,225円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	9,292,871,095円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	50,852,728,340円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	24,277,283円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	12,135,127円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	64,146,247円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	207,839,119円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	2,433,767,907円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,800,456,506円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,373,891,586円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	28,464,042円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	10,718,568円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	8,102,254円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	392,255,369円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,124,567円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	1,925,572,990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）	1,972,924,761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）	1,522,987,910円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	1,204,874,172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）	1,903,971,380円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	4,909,368,609円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	1,920,169,465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）	1,717,672,121円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	9,131,127,190円
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,745,194,385円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	3,700,170,524円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	274,644,643円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	4,870,266,482円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	4,881,603,781円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	4,838,160,658円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	3,272,119,464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）	133,431,186円
ＡＭＯｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	221,474,815円

しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	736,424,128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）	155,855,784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）	98,388,250円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,056,778円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	98,141,551円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,415,314円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,104,031円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,040,465円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	110,595,094円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,493,916,724円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,293,810,477円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,388,143,977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）	101,800,772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）	167,389,328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）	2,098,674,842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）	170,838,196円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,687,682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）	2,188,281,494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）	49,774,799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）	349,066,971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）	541,677,605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）	920,168,474円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	284,861,209円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	97,952,645円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	935,002,540円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	352,384,052円
コア資産形成ファンド	231,918,896円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	40,743,549,033円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	48,509,137,174円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	13,700,139,256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］	2,162,416,439円
計	516,686,311,075円
２．　受益権の総数	516,686,311,075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11日 至　2022年5月9日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年5月9日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2022年5月9日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△3,707,956,900
地方債証券	△164,421,109
特殊債券	△175,956,668
社債券	△160,830,240
合計	△4,209,164,917

（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（2022年2月15日から2022年5月9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）

	2022年5月9日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2784円 (12,784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

2022年5月9日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	４２６回　利付国庫債券（２年）	2,100,000,000	2,101,911,000	
	４２７回　利付国庫債券（２年）	2,400,000,000	2,402,208,000	
	４２８回　利付国庫債券（２年）	2,800,000,000	2,802,744,000	
	４２９回　利付国庫債券（２年）	2,830,000,000	2,832,943,200	
	４３０回　利付国庫債券（２年）	3,340,000,000	3,343,707,400	
	４３１回　利付国庫債券（２年）	4,300,000,000	4,305,031,000	
	４３２回　利付国庫債券（２年）	3,400,000,000	3,403,910,000	
	４３３回　利付国庫債券（２年）	2,800,000,000	2,803,136,000	
	４３４回　利付国庫債券（２年）	4,600,000,000	4,605,382,000	
	４３５回　利付国庫債券（２年）	3,720,000,000	3,724,575,600	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	5,700,000,000	5,713,224,000	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	5,000,000,000	5,013,300,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	4,050,000,000	4,061,664,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	3,490,000,000	3,500,679,400	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	6,610,000,000	6,631,879,100	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	3,530,000,000	3,542,919,800	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	4,500,000,000	4,518,000,000	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	5,200,000,000	5,221,840,000	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	7,050,000,000	7,080,808,500	

１４６回　利付国庫債券（５年）	3,800,000,000	3,817,176,000	
１４７回　利付国庫債券（５年）	6,980,000,000	6,985,374,600	
１４８回　利付国庫債券（５年）	6,690,000,000	6,694,080,900	
１４９回　利付国庫債券（５年）	5,950,000,000	5,951,249,500	
１５０回　利付国庫債券（５年）	5,340,000,000	5,340,000,000	
１５１回　利付国庫債券（５年）	2,040,000,000	2,039,000,400	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	146,456,200	
２回　利付国庫債券（４０年）	630,000,000	812,429,100	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	699,483,600	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	934,430,400	
５回　利付国庫債券（４０年）	1,010,000,000	1,262,560,600	
６回　利付国庫債券（４０年）	1,420,000,000	1,746,088,800	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,390,000,000	1,640,950,600	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,650,000,000	1,817,722,500	
９回　利付国庫債券（４０年）	2,430,000,000	1,988,250,300	
１０回　利付国庫債券（４０年）	2,180,000,000	2,088,549,000	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,680,000,000	1,556,385,600	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,660,000,000	1,382,464,600	
１３回　利付国庫債券（４０年）	2,130,000,000	1,764,811,500	
１４回　利付国庫債券（４０年）	2,400,000,000	2,124,192,000	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	2,050,000,000	2,069,967,000	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	3,860,000,000	3,905,856,800	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	1,950,000,000	1,967,842,500	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	8,110,000,000	8,197,101,400	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	6,630,000,000	6,710,819,700	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	8,120,000,000	8,230,675,600	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	5,510,000,000	5,580,362,700	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	2,100,000,000	2,129,652,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	6,900,000,000	6,961,341,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	4,330,000,000	4,384,514,700	

３３９回　利付国庫債券（１０年）	6,780,000,000	6,871,869,000	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	6,540,000,000	6,634,699,200	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	7,120,000,000	7,203,660,000	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	4,480,000,000	4,499,891,200	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	6,350,000,000	6,378,702,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	6,430,000,000	6,458,034,800	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	6,690,000,000	6,719,302,200	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	5,670,000,000	5,693,360,400	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	5,910,000,000	5,929,562,100	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	5,690,000,000	5,703,656,000	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	5,530,000,000	5,539,235,100	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	7,260,000,000	7,266,316,200	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	6,100,000,000	6,098,109,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	5,340,000,000	5,331,562,800	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	4,740,000,000	4,727,533,800	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	4,660,000,000	4,642,571,600	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	4,410,000,000	4,386,759,300	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	4,240,000,000	4,212,270,400	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	4,610,000,000	4,573,673,200	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	4,250,000,000	4,212,217,500	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	5,500,000,000	5,445,220,000	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	6,040,000,000	5,973,076,800	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	5,500,000,000	5,434,990,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	5,140,000,000	5,075,338,800	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	5,300,000,000	5,231,471,000	

３６４回　利付国庫債券（１０年）	6,000,000,000	5,920,320,000	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	6,940,000,000	6,845,477,200	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	130,993,500	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	116,906,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	244,988,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	240,590,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	230,996,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	287,020,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	274,590,100	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	177,720,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	419,369,600	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	324,576,200	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	300,441,600	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	335,445,300	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	493,256,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	346,063,200	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	417,120,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	384,799,900	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	368,279,700	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	445,504,500	
２４回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	344,214,900	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	412,295,400	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	784,572,800	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	796,352,800	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	991,197,900	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,097,205,200	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,110,753,600	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	899,035,200	

３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,229,067,600	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,437,806,400	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,506,156,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,785,171,200	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	2,163,648,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	2,660,000,000	3,206,071,400	
３８回　利付国庫債券（３０年）	1,750,000,000	2,077,687,500	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,680,000,000	2,026,584,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,420,000,000	1,686,775,400	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,580,000,000	1,847,130,600	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,660,000,000	1,941,585,800	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,720,000,000	2,012,726,800	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,750,000,000	2,048,777,500	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,940,000,000	2,191,637,400	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,990,000,000	2,248,341,800	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,860,000,000	2,139,799,800	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,940,000,000	2,150,082,600	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,760,000,000	1,950,361,600	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,860,000,000	1,821,665,400	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,450,000,000	1,261,384,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,510,000,000	1,375,549,600	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,560,000,000	1,452,516,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,750,000,000	1,702,330,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,185,291,000	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,330,000,000	1,290,538,900	

５７回　利付国庫債券（３０年）	1,670,000,000	1,616,727,000	
５８回　利付国庫債券（３０年）	2,170,000,000	2,095,894,500	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,930,000,000	1,815,744,000	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,470,000,000	1,448,391,000	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,440,000,000	1,349,193,600	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,470,000,000	1,306,080,300	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,710,000,000	1,475,422,200	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,670,000,000	1,436,200,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	1,610,000,000	1,383,006,100	
６６回　利付国庫債券（３０年）	1,530,000,000	1,312,801,200	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,950,000,000	1,763,346,000	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,890,000,000	1,705,970,700	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,870,000,000	1,731,694,800	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,810,000,000	1,671,535,000	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,940,000,000	1,790,600,600	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,800,000,000	1,658,592,000	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,710,000,000	1,573,011,900	
７４回　利付国庫債券（３０年）	710,000,000	705,129,400	
６４回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	30,807,000	
６５回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	61,904,400	
６７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,820,000	
７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,584,500	
７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,898,400	
７２回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	483,294,400	
７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	400,280,600	

７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,239,600	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	191,028,600	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	73,888,500	
７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,336,400	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	265,070,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	53,170,000	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	95,986,800	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	427,344,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	150,042,200	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	75,380,200	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	182,450,800	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	638,197,100	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	130,729,200	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	130,266,000	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	646,067,700	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,909,100	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	515,124,700	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	121,041,800	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,272,090,800	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	405,668,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	737,844,200	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	613,569,000	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	132,645,600	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	735,715,200	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	177,499,200	

９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	835,132,500	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	932,629,500	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	261,123,600	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	569,860,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	181,384,000	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	123,365,000	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	720,032,000	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	565,685,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	677,280,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	769,826,100	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	391,723,500	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	498,427,600	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	525,803,000	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	840,654,800	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,170,000,000	1,333,261,800	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	820,000,000	937,186,200	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	414,151,200	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	612,028,100	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,227,322,100	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	634,237,350	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	529,605,400	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	744,282,900	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	899,004,200	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	643,963,200	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,216,351,500	

１２４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	689,988,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	702,636,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	588,381,900	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	618,305,400	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,574,198,500	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	866,491,200	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,040,967,200	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	896,452,500	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	944,307,600	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,181,543,900	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,035,234,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	844,066,200	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	1,460,000,000	1,651,245,400	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	1,480,000,000	1,689,982,400	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	1,420,000,000	1,593,495,600	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,811,248,000	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	2,590,000,000	2,960,421,800	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,880,000,000	2,151,829,200	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	1,610,000,000	1,859,356,800	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	2,320,000,000	2,634,429,600	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	1,550,000,000	1,743,781,000	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,850,000,000	3,272,028,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	3,080,000,000	3,540,244,400	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	3,190,000,000	3,635,005,000	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	3,100,000,000	3,499,962,000	

１４９回　利付国庫債券（２０年）	3,160,000,000	3,571,874,400	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	3,450,000,000	3,860,998,500	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	3,160,000,000	3,461,464,000	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	3,040,000,000	3,331,323,200	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	3,220,000,000	3,569,917,400	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	3,090,000,000	3,386,392,800	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,860,000,000	3,059,799,600	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	2,700,000,000	2,670,192,000	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	2,630,000,000	2,524,326,600	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,990,000,000	2,985,993,400	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	2,680,000,000	2,709,104,800	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	2,300,000,000	2,353,843,000	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	2,790,000,000	2,809,446,300	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	2,430,000,000	2,442,004,200	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,170,000,000	2,176,206,200	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,930,000,000	2,887,544,300	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	2,490,000,000	2,448,018,600	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	2,440,000,000	2,468,987,200	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	2,470,000,000	2,416,252,800	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	2,370,000,000	2,274,773,400	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	2,500,000,000	2,352,550,000	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	2,520,000,000	2,363,936,400	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	2,440,000,000	2,281,570,800	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	2,110,000,000	2,003,128,500	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,720,000,000	2,576,384,000	

	１７４回　利付国庫債券（２０年）	3,010,000,000	2,842,222,600	
	１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,630,000,000	2,522,590,800	
	１７６回　利付国庫債券（２０年）	2,520,000,000	2,409,926,400	
	１７７回　利付国庫債券（２０年）	2,580,000,000	2,416,918,200	
	１７８回　利付国庫債券（２０年）	2,400,000,000	2,286,936,000	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	2,660,000,000	2,528,995,000	
	１８０回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	802,056,000	
国債証券　合計		557,145,000,000	570,995,339,750	
地方債証券	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	302,877,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	404,620,000	
	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,869,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	110,165,000	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	196,460,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	394,468,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	296,073,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	238,912,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	122,143,000	
	１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	101,707,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	105,911,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	107,087,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	219,480,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	329,409,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	113,328,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	114,162,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,978,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	398,560,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	98,279,000	
	２９回１号　宮城県公募公債　１０年	100,000,000	100,981,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	245,977,500	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	303,270,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	101,408,000	
	２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	198,694,000	
	２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	197,570,000	
	３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	128,459,000	

１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	112,782,000	
１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	344,928,000	
１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	114,272,000	
３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	303,396,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,759,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	100,424,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	195,408,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	196,884,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	196,242,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	195,720,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	227,102,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	108,550,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	99,333,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	298,905,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	353,976,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	109,487,435	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	394,584,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	197,912,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	202,346,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	196,492,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	98,624,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	126,489,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	213,386,000	
１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	306,771,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	319,992,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	105,245,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	102,903,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	196,606,000	

令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	98,410,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	196,556,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	106,553,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	106,883,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	208,180,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	107,136,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	339,690,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	344,367,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	123,320,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	169,314,000	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	101,472,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	198,170,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	100,213,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	197,828,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	94,597,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	94,613,000	
２５年度８回　埼玉県公募公債	100,000,000	101,121,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	405,064,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	197,430,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	198,698,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	114,491,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	112,787,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	337,797,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	108,184,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	202,410,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	100,716,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	199,542,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	196,630,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	98,393,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	106,471,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	111,864,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,742,000	

２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	338,727,000	
２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	202,154,000	
２５年度６回　千葉県公募公債	100,000,000	101,092,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	100,115,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	195,904,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	107,834,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	107,869,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	97,853,000	
２５年度２回　新潟県公募公債	100,000,000	101,165,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	197,506,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	112,451,000	
１２７回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,973,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,991,000	
１３２回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,181,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,050,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,928,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	609,240,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,060,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,477,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,070,800	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,000,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,230,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,973,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,339,000	
１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,865,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,836,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,781,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,398,000	

３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	99,641,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	101,227,000	
２５年度２回　島根県公募公債	106,000,000	107,086,500	
令和元年度１回　島根県公募公債	200,000,000	190,828,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	196,752,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	101,207,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	100,796,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	199,998,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	295,683,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	225,814,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	455,926,500	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	196,380,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	112,328,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	108,744,000	
５回　京都市公募公債　３０年定時償還	200,000,000	187,892,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	110,586,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	230,554,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	227,370,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	101,238,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	300,732,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	182,122,000	
２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	404,152,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	393,004,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	124,493,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	111,994,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	112,445,000	
２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	122,809,000	
２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	201,764,000	
２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	101,067,000	
２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	298,593,000	
第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	199,558,000	
６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	227,062,000	
５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	122,786,000	

	６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	111,661,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	112,333,000	
	２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	125,442,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	200,418,000	
	２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	92,847,000	
	２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	101,085,000	
	２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	199,746,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	300,945,000	
	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	100,624,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	197,162,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	196,670,000	
	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	101,154,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	101,091,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	198,644,000	
地方債証券　合計		29,745,330,000	30,649,524,735	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	212,564,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	210,754,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	301,617,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,949,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	90,532,000	
	３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,826,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	205,042,500	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	258,256,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,702,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	100,953,000	
	１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,991,000	
	１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,061,000	
	１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,375,000	
	１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,016,000	
	１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	118,113,000	
	１６９回　高速道路機構債	100,000,000	103,599,000	
	１７２回　高速道路機構債	200,000,000	191,622,000	
	２１０回　高速道路機構債	100,000,000	99,362,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,784,000	

１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,497,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	562,500,000	
１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,200,000	
１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,801,000	
１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	505,155,000	
１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	434,914,900	
２０２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	106,117,200	
２１１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,211,000	
２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,349,000	
２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,708,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	324,978,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	506,275,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,864,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,388,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	218,146,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,692,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,766,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,235,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	802,376,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	200,562,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,307,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	173,686,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	178,754,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	181,090,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	632,090,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	223,698,000	

１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	341,460,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	342,165,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	115,158,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	319,104,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	228,400,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	113,122,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	226,428,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,520,000	
５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	505,500,000	
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	549,056,840	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	112,478,000	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,717,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,111,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	219,000,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	331,746,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	400,316,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,137,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	100,514,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,302,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,139,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,184,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	225,886,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,940,260	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	107,316,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	105,588,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	209,064,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	181,448,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	109,652,000	

２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	101,253,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	226,594,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,378,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	403,284,000	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,558,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,139,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,999,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	298,625,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,179,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,552,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,078,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,738,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,113,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,323,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	498,475,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	498,475,000	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	20,172,000	20,312,800	
９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	30,960,000	31,178,577	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	32,652,000	33,140,473	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,336,000	50,570,386	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,035,000	11,208,911	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,925,000	53,778,150	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,518,000	31,928,994	
１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,815,000	52,196,876	
４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,780,000	10,926,823	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,258,000	19,222,935	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,520,000	117,187,671	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,200,000	179,012,956	

３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,729,000	24,901,212	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,570,000	21,561,679	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,380,000	25,464,178	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,444,000	26,574,476	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,873,000	35,312,263	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,054,000	80,963,853	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,288,000	35,614,602	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,415,000	41,627,450	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,023,000	42,281,995	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,867,000	46,226,470	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,934,000	48,044,927	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,104,000	52,544,799	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,579,000	59,541,452	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,688,000	62,134,195	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	225,771,000	223,553,928	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,557,000	76,325,032	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,181,000	76,043,112	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,260,000	76,063,249	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	238,413,000	237,123,185	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	238,635,000	237,174,553	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,258,000	160,250,137	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	242,649,000	240,676,263	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	242,619,000	240,724,145	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	420,360,000	418,808,870	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,637,000	83,257,288	

	１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,191,000	84,948,125	
	１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,555,000	268,767,787	
	１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	366,076,000	360,848,434	
	１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	280,626,000	276,904,899	
	１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,744,000	285,821,910	
	１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	874,845,000	862,780,887	
	２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,775,000	
	い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,092,000	
	い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,967,000	
	い第８５１号　利付商工債	300,000,000	299,172,000	
	い第８５４号　利付商工債	300,000,000	298,932,000	
	い第８５５号　利付商工債	200,000,000	199,230,000	
	３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	399,472,000	
	３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	299,052,000	
	７回　広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	100,981,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	113,284,000	
	１８回　国際協力機構債券	100,000,000	100,941,000	
	７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	199,542,000	
	７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	298,416,000	
	８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	299,943,000	
	８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	399,612,000	
	７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,209,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,578,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	197,172,000	
特殊債券　合計		27,157,496,000	28,139,594,607	
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	297,111,000	
	２６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,185,000	
	２回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,656,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	201,108,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	98,548,000	
	２５回　首都高速道路社債	100,000,000	99,914,000	

２７回　首都高速道路社債	400,000,000	399,696,000	
１６回　成田国際空港社債	100,000,000	101,243,000	
３７回　成田国際空港社債	100,000,000	92,930,000	
５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	100,020,000	
６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,114,000	
７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	299,322,000	
８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	199,548,000	
５６回　中日本高速道路社債	100,000,000	101,169,000	
９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	199,538,000	
９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	498,480,000	
２５回　西日本高速道路社債	200,000,000	202,394,000	
２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	101,630,000	
３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	302,127,000	
３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	201,992,000	
６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	498,480,000	
２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	199,056,000	
１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	101,171,000	
９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	98,837,000	
１２回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,830,000	
１４回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,812,000	
３０回　東レ社債	300,000,000	300,054,000	
４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	198,948,000	
４９回　住友化学社債	100,000,000	101,454,000	
２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	200,760,000	
４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,488,000	
１７回　ダイセル社債	300,000,000	298,587,000	
１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	489,190,000	
４回　住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,784,000	
６回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	101,186,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	298,260,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	298,221,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	100,790,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	98,234,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	196,030,000	
２９回　三菱重工業社債	100,000,000	101,065,000	
５回　三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	99,337,000	
１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	202,080,000	
２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	199,384,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	99,259,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	394,996,000	

４７回　住友商事社債	100,000,000	101,021,000	
４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	101,305,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	399,060,000	
１３回　新生銀行社債	200,000,000	199,436,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	110,322,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,397,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	298,350,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	201,832,000	
１１回　セブン銀行社債	200,000,000	201,944,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,753,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	299,169,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	397,200,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,386,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,731,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,686,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	195,696,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	294,660,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	98,891,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,066,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,754,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	196,358,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	300,498,000	
３回　野村ホールディングス社債	300,000,000	298,131,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	104,921,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	100,412,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	200,236,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	104,958,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	96,342,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	317,721,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	213,086,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	112,977,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,260,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	228,390,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	107,567,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,952,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,813,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,884,000	

１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	88,828,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,416,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	189,392,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	182,256,000	
１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	308,055,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,721,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	197,518,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	91,754,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	89,110,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,375,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	188,780,000	
１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	206,114,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,831,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,807,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	130,776,000	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	87,246,000	
６回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	197,422,000	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	394,284,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	197,724,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	99,736,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	196,086,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	102,403,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	301,167,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	396,020,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	189,984,000	
５４１回　関西電力社債	300,000,000	293,361,000	
３７７回　中国電力社債	400,000,000	405,104,000	
３９６回　中国電力社債	200,000,000	200,036,000	
４２５回　中国電力社債	100,000,000	98,681,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	103,247,000	
３１１回　北陸電力社債	100,000,000	102,488,000	
４７１回　東北電力社債	400,000,000	406,684,000	
４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,977,000	
５２１回　東北電力社債	400,000,000	396,168,000	
５２５回　東北電力社債	200,000,000	198,020,000	
５３６回　東北電力社債	300,000,000	291,738,000	
２５３回　四国電力社債	200,000,000	201,952,000	
４２４回　九州電力社債	200,000,000	203,354,000	
４２６回　九州電力社債	400,000,000	406,468,000	
４２８回　九州電力社債	100,000,000	101,652,000	
４６３回　九州電力社債	100,000,000	97,998,000	
４６６回　九州電力社債	100,000,000	96,758,000	
４９１回　九州電力社債	300,000,000	293,037,000	
４９２回　九州電力社債	100,000,000	93,080,000	
４９３回　九州電力社債	200,000,000	198,798,000	
３２１回　北海道電力社債	261,000,000	265,645,800	
３４０回　北海道電力社債	300,000,000	301,530,000	
３５０回　北海道電力社債	200,000,000	195,406,000	
１３回　電源開発社債	200,000,000	211,264,000	
３８回　電源開発社債	300,000,000	304,119,000	

	５４回　電源開発社債	100,000,000	100,052,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	195,300,000	
	２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	303,009,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	196,818,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	94,578,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	90,892,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	200,000,000	201,784,000	
	５回　ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,017,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	200,000,000	
	８回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	197,880,000	
社債券　合計		27,881,000,000	27,870,883,800	
合計			657,655,342,892	

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）

	2022年5月9日現在
資産の部	
流動資産	
預金	991,296,039
コール・ローン	556,491,152
国債証券	166,726,050,005
派生商品評価勘定	73,326
未収入金	9,528,736,504
未収利息	1,022,282,843
前払費用	181,246,556
流動資産合計	179,006,176,425
資産合計	179,006,176,425
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	964,122
未払金	412,297,364
未払解約金	691,886,000
流動負債合計	1,105,147,486
負債合計	1,105,147,486
純資産の部	
元本等	
元本	86,476,270,642
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	91,424,758,297
元本等合計	177,901,028,939
純資産合計	177,901,028,939
負債純資産合計	179,006,176,425

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11日 至　2022年5月9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	2022年5月9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	68,771,195,521円
同期中追加設定元本額	41,309,903,871円
同期中一部解約元本額	23,604,828,750円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	7,744,250,235円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	11,836,308円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	42,032,157円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	169,213,607円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	55,432,582円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	29,561,485円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	21,731,021円
たわらノーロード　先進国債券	13,840,817,596円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	235,987,252円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,777,150,221円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	49,739,028円
たわらノーロード　バランス（標準型）	247,426,289円
たわらノーロード　バランス（積極型）	51,977,210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）	6,563,546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）	320,120,948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）	385,172,199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）	75,491,758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）	370,014円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	3,062,120円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	28,700,669円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,214,418円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	2,174,323円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,318,457,658円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	616,223,785円

Ｏｎｅグローバルバランス	7,941,634円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	709,553,372円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,226,508,317円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,403,942,419円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	401,486,864円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	838,867,705円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	702,200,052円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	14,352,119円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	492,321,877円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	36,330,259円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	142,143,683円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	125,371,251円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	214,713,670円
クルーズコントロール	548,598,312円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	154,405,852円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	376,324,375円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	433,751,972円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	181,479,592円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	98,353,227円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,171,483,309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）	5,605,141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）	5,452,267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）	95,948,247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）	3,656,100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）	5,634,661円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	3,468,868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）	191,664,142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）	4,919,954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）	5,297,278,450円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	2,634,949,168円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,560,480,740円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,289,990,122円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,670,660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）	9,433,692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）	385,718,822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）	243,559,852円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,350,521円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	40,455,732円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,510,837円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	634,300円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,103,867円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	45,589,024円

ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,890,487,493円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,536,753,216円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,713,684,321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）	104,954,677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）	144,939,174円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,732,835,675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）	389,227,485円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,994,896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）	338,195,238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）	334,978,616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）	455,180,972円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,569,289円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	72,356,017円
コア資産形成ファンド	48,074,441円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	2,646,781,889円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	244,033,284円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	9,970,710,721円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,559,958,585円
計	86,476,270,642円
２．　受益権の総数	86,476,270,642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11日 至　2022年5月9日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年5月9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	2022年5月9日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△13,028,220,998
合計	△13,028,220,998

（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（2022年2月22日から2022年5月9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	2022年5月9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	8,899,999,000	－	8,900,889,796	△890,796
アメリカ・ドル	4,529,169,000	－	4,529,750,494	△581,494
イギリス・ポンド	521,351,000	－	521,406,080	△55,080
イスラエル・シュケル	36,526,000	－	36,479,974	46,026
オーストラリア・ドル	139,853,000	－	139,834,853	18,147
オフショア・人民元	39,562,000	－	39,576,473	△14,473
カナダ・ドル	161,348,000	－	161,359,015	△11,015
スウェーデン・クローナ	33,252,000	－	33,263,172	△11,172
デンマーク・クローネ	36,142,000	－	36,141,218	782
ポーランド・ズロチ	37,695,000	－	37,759,657	△64,657
メキシコ・ペソ	84,094,000	－	84,101,799	△7,799
ユーロ	3,281,007,000	－	3,281,217,061	△210,061
合計	8,899,999,000	－	8,900,889,796	△890,796

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年5月9日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0572円 (20,572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

2022年5月9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	6,260,000.000	6,004,220.280	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,800,000.000	4,592,437.480	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,550,000.000	3,478,204.160	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,558,874.990	
		US T N/B 0.125 07/31/23	2,640,000.000	2,568,328.110	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,900,000.000	2,817,078.120	
		US T N/B 0.125 08/31/23	530,000.000	514,307.020	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,938,281.240	
		US T N/B 0.125 10/15/23	230,000.000	222,255.460	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,160,000.000	2,077,143.730	
		US T N/B 0.25 03/15/24	5,510,000.000	5,270,444.090	
		US T N/B 0.25 05/15/24	2,500,000.000	2,379,394.520	
		US T N/B 0.25 05/31/25	890,000.000	819,982.020	
		US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,739,406.230	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,587,603.880	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,216,718.750	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	916,015.620	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,590,000.000	1,453,856.250	
		US T N/B 0.25 09/30/23	2,500,000.000	2,424,707.020	

		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,394,790.600	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,819,531.240	
		US T N/B 0.25 11/15/23	800,000.000	772,937.490	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,357,894.520	
		US T N/B 0.375 04/15/24	2,110,000.000	2,018,017.180	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,374,800.000	
		US T N/B 0.375 07/15/24	500,000.000	475,078.120	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,289,781.250	
		US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,883,468.750	
		US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,889,218.740	
		US T N/B 0.375 09/30/27	1,870,000.000	1,619,449.200	
		US T N/B 0.375 10/31/23	890,000.000	862,396.080	
		US T N/B 0.375 11/30/25	3,190,000.000	2,908,382.810	
		US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,729,765.610	
		US T N/B 0.5 02/28/26	3,370,000.000	3,066,173.430	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,669,407.820	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,092,728.500	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,742,554.670	
		US T N/B 0.5 06/30/27	1,050,000.000	922,154.280	
		US T N/B 0.5 08/31/27	4,370,000.000	3,819,994.500	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,181,912.500	
		US T N/B 0.5 11/30/23	3,000,000.000	2,904,843.750	
		US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,958,945.310	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,290,000.000	4,362,596.870	
		US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,529,347.620	
		US T N/B 0.625 08/15/30	4,960,000.000	4,067,200.000	
		US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,793,750.000	
		US T N/B 0.625 11/30/27	2,700,000.000	2,360,390.620	
		US T N/B 0.625 12/31/27	3,320,000.000	2,896,051.560	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,837,632.780	
		US T N/B 0.75 03/31/26	3,220,000.000	2,953,343.740	
		US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,387,234.370	
		US T N/B 0.75 05/31/26	3,230,000.000	2,950,403.120	
		US T N/B 0.75 08/31/26	4,750,000.000	4,312,665.980	
		US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,477,460.930	
		US T N/B 0.75 12/31/23	1,990,000.000	1,930,066.790	
		US T N/B 0.875 01/31/24	200,000.000	194,007.810	
		US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	3,034,339.050	
		US T N/B 0.875 09/30/26	3,110,000.000	2,833,865.980	
		US T N/B 0.875 11/15/30	7,000,000.000	5,839,804.660	
		US T N/B 1.0 07/31/28	3,770,000.000	3,315,832.810	
		US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,397,147.620	
		US T N/B 1.125 01/15/25	4,910,000.000	4,687,899.190	
		US T N/B 1.125 02/15/31	7,760,000.000	6,589,937.480	
		US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,837,984.370	
		US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,005,941.400	
		US T N/B 1.125 02/29/28	3,860,000.000	3,454,096.870	
		US T N/B 1.125 05/15/40	2,600,000.000	1,796,437.500	
		US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	2,168,303.100	

		US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,303,672.630	
		US T N/B 1.125 10/31/26	2,390,000.000	2,198,893.350	
		US T N/B 1.25 03/31/28	3,610,000.000	3,251,820.300	
		US T N/B 1.25 04/30/28	4,010,000.000	3,606,493.750	
		US T N/B 1.25 05/15/50	4,370,000.000	2,749,685.930	
		US T N/B 1.25 05/31/28	4,900,000.000	4,393,539.030	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,321,899.200	
		US T N/B 1.25 07/31/23	350,000.000	345,132.810	
		US T N/B 1.25 08/15/31	8,630,000.000	7,341,905.000	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,770,446.870	
		US T N/B 1.25 09/30/28	3,980,000.000	3,545,309.370	
		US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,419,464.810	
		US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,587,917.180	
		US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	720,175.770	
		US T N/B 1.375 06/30/23	3,830,000.000	3,792,298.430	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	3,170,636.280	
		US T N/B 1.375 08/31/23	370,000.000	365,071.480	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,026,351.550	
		US T N/B 1.375 09/30/23	1,830,000.000	1,802,978.890	
		US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,222,809.370	
		US T N/B 1.375 11/15/31	6,990,000.000	5,991,740.620	
		US T N/B 1.375 11/15/40	3,190,000.000	2,285,086.690	
		US T N/B 1.375 12/31/28	1,500,000.000	1,342,382.800	
		US T N/B 1.5 01/31/27	5,940,000.000	5,536,033.530	
		US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,378,308.570	
		US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,321,448.430	
		US T N/B 1.5 02/29/24	4,000,000.000	3,918,125.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,499,934.740	
		US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,672,887.500	
		US T N/B 1.5 11/30/24	2,300,000.000	2,225,070.300	
		US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,610,000.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	2,890,000.000	2,747,757.800	
		US T N/B 1.625 04/30/23	3,320,000.000	3,303,918.750	
		US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,479,045.300	
		US T N/B 1.625 05/15/31	7,640,000.000	6,754,535.900	
		US T N/B 1.625 05/31/23	3,100,000.000	3,081,835.910	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,581,943.740	
		US T N/B 1.625 09/30/26	2,150,000.000	2,025,703.120	
		US T N/B 1.625 10/31/23	2,800,000.000	2,764,234.360	
		US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,610,071.870	
		US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	3,328,075.000	
		US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,701,965.620	
		US T N/B 1.75 01/31/29	3,000,000.000	2,748,984.360	
		US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,872,812.480	
		US T N/B 1.75 05/15/23	3,510,000.000	3,495,877.710	
		US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,312,048.430	
		US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,946,002.330	
		US T N/B 1.75 08/15/41	4,430,000.000	3,361,262.500	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,866,781.250	

		US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,933,253.890	
		US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,991,312.500	
		US T N/B 1.875 02/15/32	4,350,000.000	3,895,628.870	
		US T N/B 1.875 02/15/41	4,650,000.000	3,639,714.800	
		US T N/B 1.875 02/15/51	4,720,000.000	3,504,968.710	
		US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,422,308.180	
		US T N/B 1.875 02/28/29	2,000,000.000	1,846,718.740	
		US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,795,840.600	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,780,000.000	2,655,334.370	
		US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	803,151.550	
		US T N/B 1.875 11/15/51	5,070,000.000	3,770,812.500	
		US T N/B 2.0 02/15/25	1,010,000.000	985,460.140	
		US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,845,218.720	
		US T N/B 2.0 04/30/24	360,000.000	355,218.750	
		US T N/B 2.0 05/31/24	3,970,000.000	3,912,621.070	
		US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	285,514.060	
		US T N/B 2.0 08/15/25	3,380,000.000	3,277,543.750	
		US T N/B 2.0 08/15/51	5,890,000.000	4,514,592.910	
		US T N/B 2.0 11/15/26	2,830,000.000	2,704,087.090	
		US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,369,453.120	
		US T N/B 2.125 02/29/24	1,650,000.000	1,634,789.050	
		US T N/B 2.125 03/31/24	4,840,000.000	4,792,356.250	
		US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,858,656.250	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,350,000.000	2,269,585.930	
		US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	374,775.000	
		US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	2,886,050.000	
		US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	1,986,875.000	
		US T N/B 2.125 11/30/24	280,000.000	275,012.500	
		US T N/B 2.25 01/31/24	710,000.000	705,396.080	
		US T N/B 2.25 02/15/27	1,490,000.000	1,436,394.900	
		US T N/B 2.25 02/15/52	2,500,000.000	2,037,304.670	
		US T N/B 2.25 03/31/26	2,690,000.000	2,613,292.940	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,271,769.520	
		US T N/B 2.25 05/15/41	2,760,000.000	2,294,896.850	
		US T N/B 2.25 08/15/27	2,190,000.000	2,101,287.870	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,070,000.000	1,658,910.930	
		US T N/B 2.25 08/15/49	3,040,000.000	2,463,349.990	
		US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,318,238.260	
		US T N/B 2.25 11/15/24	5,390,000.000	5,310,834.370	
		US T N/B 2.25 11/15/25	2,920,000.000	2,848,368.750	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,131,535.930	
		US T N/B 2.25 12/31/23	280,000.000	278,425.000	
		US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,951,953.110	
		US T N/B 2.375 02/15/42	2,000,000.000	1,693,281.240	
		US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	2,009,948.420	
		US T N/B 2.375 05/15/27	4,700,000.000	4,550,554.660	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,470,000.000	3,306,259.370	
		US T N/B 2.375 05/15/51	5,060,000.000	4,227,471.870	
		US T N/B 2.375 08/15/24	4,610,000.000	4,568,221.870	

		US T N/B 2.375 11/15/49	2,180,000.000	1,820,470.280	
		US T N/B 2.5 01/31/24	4,550,000.000	4,538,980.430	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,948,340.620	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,493,437.500	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,920,000.000	2,865,706.240	
		US T N/B 2.5 05/15/24	5,100,000.000	5,078,683.570	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,130,000.000	1,795,606.620	
		US T N/B 2.5 08/15/23	4,080,000.000	4,084,781.220	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,426,559.370	
		US T N/B 2.625 02/15/29	4,830,000.000	4,683,213.230	
		US T N/B 2.625 03/31/25	2,390,000.000	2,370,021.070	
		US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,975,917.950	
		US T N/B 2.625 06/30/23	2,350,000.000	2,361,015.620	
		US T N/B 2.625 12/31/23	3,530,000.000	3,532,895.680	
		US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,261,643.340	
		US T N/B 2.75 02/15/24	6,030,000.000	6,039,421.870	
		US T N/B 2.75 02/15/28	4,580,000.000	4,491,978.110	
		US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,951,731.240	
		US T N/B 2.75 04/30/23	2,720,000.000	2,735,831.240	
		US T N/B 2.75 05/31/23	3,800,000.000	3,821,523.420	
		US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,033,093.740	
		US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,286,860.930	
		US T N/B 2.75 08/15/42	240,000.000	214,612.500	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,240,000.000	1,987,474.970	
		US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,181,019.520	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,815,846.070	
		US T N/B 2.75 11/15/23	6,360,000.000	6,379,378.090	
		US T N/B 2.75 11/15/42	2,476,000.000	2,210,797.150	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,360,000.000	2,095,421.840	
		US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,997,031.240	
		US T N/B 2.875 05/15/28	5,240,000.000	5,170,815.590	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	2,081,395.300	
		US T N/B 2.875 05/15/49	2,890,000.000	2,663,315.620	
		US T N/B 2.875 05/31/25	570,000.000	568,975.770	
		US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,193,296.860	
		US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,462,403.870	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,050,000.000	949,511.700	
		US T N/B 2.875 09/30/23	1,220,000.000	1,226,957.800	
		US T N/B 2.875 10/31/23	3,990,000.000	4,009,638.260	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	977,990.600	
		US T N/B 2.875 11/30/25	360,000.000	358,565.620	
		US T N/B 3.0 02/15/47	1,960,000.000	1,817,287.490	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,476,921.860	
		US T N/B 3.0 02/15/49	3,460,000.000	3,261,590.610	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	1,009,884.360	
		US T N/B 3.0 05/15/45	720,000.000	664,312.490	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,502,803.120	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,250,000.000	3,040,781.250	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,751,503.880	

	US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,270,975.360	
	US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,439,343.740	
	US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	794,828.110	
	US T N/B 3.125 02/15/42	860,000.000	820,896.870	
	US T N/B 3.125 02/15/43	1,690,000.000	1,601,803.120	
	US T N/B 3.125 05/15/48	1,830,000.000	1,755,370.310	
	US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,971,784.370	
	US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,377,604.650	
	US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	972,825.000	
	US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,405,980.450	
	US T N/B 3.375 11/15/48	3,200,000.000	3,220,249.960	
	US T N/B 3.5 02/15/39	100,000.000	102,945.310	
	US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,666,038.260	
	US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,503,764.050	
	US T N/B 3.75 08/15/41	820,000.000	855,618.740	
	US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,416,843.740	
	US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,376,671.870	
	US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	1,070,753.890	
	US T N/B 4.25 11/15/40	700,000.000	781,648.420	
	US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	687,468.740	
	US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	1,039,106.250	
	US T N/B 4.375 05/15/41	1,150,000.000	1,302,914.060	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,190,000.000	1,359,296.080	
	US T N/B 4.5 02/15/36	1,140,000.000	1,324,359.370	
	US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	696,609.360	
	US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,137,642.180	
	US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	1,048,044.510	
	US T N/B 4.75 02/15/41	30,000.000	35,702.340	
	US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	676,492.960	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	956,250.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	860,000.000	1,009,122.640	
	US T N/B 6.0 02/15/26	1,100,000.000	1,218,164.050	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,037,250.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	927,581.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,048,437.500	
アメリカ・ドル　小計		686,500,000.000 (89,780,470,000)	634,989,789.030 (83,043,964,610)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	950,000.000	899,460.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,756,872.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	500,000.000	455,975.000	
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	800,000.000	770,632.000	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	540,000.000	461,138.400	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,150,000.000	1,084,921.500	

		UK TREASURY 0.375 10/22/30	790,000.000	696,914.300	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	680,000.000	622,418.220	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,130,000.000	662,326.900	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	860,000.000	836,236.480	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,050,000.000	860,955.900	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	450,000.000	303,561.000	
		UK TREASURY 0.75 07/22/23	960,000.000	952,522.920	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	870,000.000	653,805.000	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	850,000.000	747,872.500	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,140,000.000	1,064,133.000	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	660,000.000	599,790.910	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,750,000.000	1,732,965.500	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	390,000.000	329,121.000	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	350,000.000	259,949.200	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,000,000.000	979,160.000	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	430,000.000	343,385.100	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,500,000.000	1,264,725.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	800,000.000	796,184.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,180,000.000	1,015,460.800	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	350,000.000	299,365.500	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	923,648.100	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	680,000.000	598,359.200	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	630,000.000	563,850.000	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	572,525.100	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,310,000.000	1,195,678.390	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	1,302,291.000	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	890,000.000	901,913.540	
		UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,380,000.000	1,393,738.720	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,210,000.000	1,376,096.700	

		UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	492,960.000	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,250,000.000	1,463,187.500	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,250,000.000	1,526,037.500	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	840,000.000	1,212,949.920	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,000,000.000	1,347,300.000	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	1,353,357.000	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,100,000.000	1,369,225.000	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,170,000.000	1,408,172.220	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	800,000.000	1,032,404.800	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	884,091.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,395,558.200	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,200,000.000	1,652,748.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	917,000.000	1,300,929.560	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,826,484.000	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	300,000.000	376,638.000	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,195,000.000	1,637,819.200	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,095,000.000	1,343,444.550	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,080,000.000	1,460,732.400	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	965,000.000	1,054,487.530	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	857,613.540	
イギリス・ポンド　小計			51,264,000.000 (8,250,428,160)	54,274,092.800 (8,734,872,495)	
イスラエル・シュケル		ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	200,000.000	193,425.400	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	260,000.000	246,351.820	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	320,000.000	307,881.280	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,599,465.440	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	800,000.000	671,730.400	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	160,000.000	160,317.440	
		ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,300,000.000	2,291,048.400	

	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,500,000.000	2,498,270.000	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,460,000.000	1,466,942.300	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,701,816.000	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,700,000.000	1,891,845.000	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,530,000.000	2,122,939.260	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	220,000.000	259,909.100	
イスラエル・シュケル　小計		16,910,000.000 (649,956,142)	17,411,941.840 (669,248,879)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,390,000.000	1,300,228.170	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,311,955.210	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,310,000.000	1,167,473.710	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,700,000.000	1,362,998.290	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,368,679.390	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,732,842.640	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,610,000.000	1,366,218.590	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	920,000.000	577,300.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,140,000.000	966,855.820	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	800,000.000	751,600.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,695,936.330	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,160,000.000	1,159,974.570	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	900,000.000	773,890.320	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	593,846.620	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,650,000.000	1,605,202.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	270,000.000	260,884.260	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,550,000.000	1,478,545.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,380,000.000	1,198,543.640	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	490,000.000	493,234.630	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,200,000.000	1,192,542.390	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	582,914.100	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	930,000.000	941,001.980	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,160,000.000	2,248,082.850	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,030,000.000	1,124,558.120	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	530,000.000	567,046.620	
オーストラリア・ドル　小計		30,450,000.000 (2,792,265,000)	27,822,355.750 (2,551,310,022)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	17,500,000.000	17,422,868.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	12,000,000.000	11,990,460.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,340,445.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	17,000,000.000	17,075,395.000	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,498,246.480	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,707,354.940	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	11,000,000.000	10,936,628.670	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	9,000,000.000	8,976,771.090	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,112,139.280	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	15,600,000.000	15,685,722.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	1,000,000.000	1,010,680.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,604,579.650	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	14,150,000.000	14,634,425.250	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,232,112.260	
オフショア・人民元　小計			155,450,000.000 (3,018,543,645)	156,227,828.920 (3,033,647,605)	
カナダ・ドル		CANADA 0.25 03/01/26	1,010,000.000	915,727.610	
		CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,433,262.000	
		CANADA 0.25 05/01/23	1,000,000.000	978,655.000	
		CANADA 0.25 08/01/23	700,000.000	680,624.700	
		CANADA 0.5 09/01/25	1,910,000.000	1,769,424.000	
		CANADA 0.5 11/01/23	620,000.000	601,302.660	
		CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,449,090.000	
		CANADA 0.75 02/01/24	1,200,000.000	1,161,340.800	
		CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	638,910.300	
		CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,174,220.410	
		CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	671,682.900	
		CANADA 1.25 03/01/27	1,180,000.000	1,093,582.700	
		CANADA 1.25 06/01/30	2,250,000.000	1,957,821.750	
		CANADA 1.5 06/01/23	1,410,000.000	1,395,186.540	
		CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	664,374.900	
		CANADA 1.5 06/01/31	2,480,000.000	2,166,391.600	
		CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	428,145.960	
		CANADA 1.5 12/01/31	1,110,000.000	963,286.860	
		CANADA 1.75 12/01/53	1,440,000.000	1,064,507.040	
		CANADA 2.0 06/01/28	100,000.000	94,929.800	
		CANADA 2.0 06/01/32	500,000.000	451,488.000	
		CANADA 2.0 09/01/23	880,000.000	873,525.840	
		CANADA 2.0 12/01/51	2,500,000.000	1,993,477.500	
		CANADA 2.25 03/01/24	900,000.000	893,602.800	
		CANADA 2.25 06/01/25	1,130,000.000	1,113,187.860	
		CANADA 2.25 06/01/29	730,000.000	695,162.210	
		CANADA 2.5 06/01/24	1,270,000.000	1,264,973.340	

	CANADA 2.75 12/01/48	680,000.000	640,777.600	
	CANADA 2.75 12/01/64	490,000.000	450,532.950	
	CANADA 3.5 12/01/45	720,000.000	765,455.040	
	CANADA 4.0 06/01/41	630,000.000	704,580.030	
	CANADA 5.0 06/01/37	450,000.000	547,328.250	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,090,000.000	1,278,868.660	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	756,352.420	
カナダ・ドル　小計		36,100,000.000 (3,648,988,000)	33,731,780.030 (3,409,608,325)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	350,000.000	327,775.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	350,000.000	318,076.930	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	401,800.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	290,000.000	237,786.950	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	279,368.600	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	370,000.000	364,413.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	547,006.700	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	440,000.000	440,000.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	180,000.000	166,320.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	420,000.000	419,160.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	500,000.000	487,000.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	460,000.000	450,498.700	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	706,086.010	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	550,000.000	555,225.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	490,000.000	493,675.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	260,000.000	264,030.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	380,000.000	399,190.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	832,352.000	
シンガポール・ドル　小計		7,900,000.000 (743,469,000)	7,689,763.890 (723,683,680)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	3,040,000.000	2,584,703.010	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	2,890,000.000	2,700,112.550	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,170,000.000	2,904,604.430	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	3,920,000.000	3,776,449.600	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	5,780,000.000	5,790,635.200	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,200,000.000	3,281,232.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	8,540,000.000	8,729,837.360	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,900,000.000	4,703,947.950	
スウェーデン・クローナ　小計		34,440,000.000 (451,164,000)	34,471,522.100 (451,576,940)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	1,010,000.000	992,112.900	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,080,000.000	3,550,901.520	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,370,000.000	1,641,284.250	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,030,000.000	6,774,377.590	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,750,000.000	5,402,700.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,540,000.000	5,696,637.960	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,950,000.000	11,515,334.090	

デンマーク・クローネ　小計		33,730,000.000 (624,005,000)	35,573,348.310 (658,106,944)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,650,000.000	1,419,049.500	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,816,936.000	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,400,000.000	4,198,722.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,284,788.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	6,790,000.000	6,616,379.700	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,420,000.000	3,155,107.320	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,980,265.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,800,000.000	1,802,874.600	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,700,000.000	1,574,710.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,290,000.000	6,357,182.230	
ノルウェー・クローネ　小計		34,830,000.000 (477,519,300)	33,206,014.850 (455,254,464)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,398,720.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	1,970,000.000	1,650,860.000	
	POLAND 07/25/24	810,000.000	702,033.240	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,980,000.000	1,959,946.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	1,400,000.000	919,380.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,620,000.000	2,348,502.500	
	POLAND 2.5 04/25/24	690,000.000	638,933.100	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,329,231.500	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	1,899,328.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,390,000.000	2,707,254.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	710,000.000	544,179.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,780,000.000	2,479,134.500	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,740,000.000	2,646,018.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,358,856.000	
ポーランド・ズロチ　小計		28,560,000.000 (834,226,176)	23,582,376.340 (688,831,780)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	857,162.960	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	996,335.080	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,927,179.000	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,300,000.000	1,113,606.830	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,000,000.000	1,808,701.610	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,539,426.260	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	300,000.000	300,083.100	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	400,000.000	382,955.660	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	600,000.000	588,927.430	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,430,000.000	1,398,080.950	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	740,000.000	731,918.130	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,700,000.000	2,691,483.250	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	904,646.610	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,730,000.000	1,744,804.120	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	300,000.000	291,168.240	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,104,390.750	

	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,000,000.000	1,983,584.570	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	495,257.760	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	285,350.490	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,682,395.910	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	120,000.000	119,401.190	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	3,150,000.000	3,047,402.210	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,576,063.630	
マレーシア・リンギット　小計		30,500,000.000 (911,684,650)	29,570,325.740 (883,895,478)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,085,000.000	5,397,666.980	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	21,822,000.000	22,313,931.150	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	26,132,000.000	23,413,258.850	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	21,546,000.000	20,219,779.910	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	18,748,000.000	17,139,796.560	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	16,487,000.000	14,071,159.890	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,315,000.000	6,513,861.200	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	20,670,000.000	20,239,650.600	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	15,371,000.000	13,354,659.090	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	15,151,000.000	14,950,889.060	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	19,545,474.130	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,638,773.730	
メキシコ・ペソ　小計		204,128,000.000 (1,321,259,306)	191,798,901.150 (1,241,456,747)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	850,000.000	759,904.250	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	610,000.000	533,746.380	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	330,000.000	322,957.140	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	250,000.000	229,466.250	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	420,000.000	300,930.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	170,000.000	137,292.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	570,000.000	539,379.600	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	690,000.000	671,464.530	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	250,000.000	154,934.250	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	815,618.170	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	530,000.000	408,379.840	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	850,000.000	839,499.100	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	300,000.000	156,110.360	
	AUSTRIA 07/15/23	750,000.000	749,745.000	
	AUSTRIA 07/15/24	850,000.000	842,413.750	

		AUSTRIA 1.2 10/20/25	820,000.000	830,457.460	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	490,000.000	468,427.260	
		AUSTRIA 1.5 11/02/86	180,000.000	145,980.000	
		AUSTRIA 1.65 10/21/24	740,000.000	760,694.100	
		AUSTRIA 1.75 10/20/23	900,000.000	922,086.000	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	440,000.000	443,278.440	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	720,000.000	779,868.130	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	490,000.000	624,409.450	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	280,000.000	433,183.160	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	840,000.000	1,115,100.000	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	710,000.000	819,156.110	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	755,000.000	952,908.150	
		BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	545,484.200	
		BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	806,115.800	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	1,000,000.000	896,500.000	
		BELGIUM 0.2 10/22/23	810,000.000	812,227.500	
		BELGIUM 0.4 06/22/40	480,000.000	360,913.920	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	1,090,000.000	1,088,689.820	
		BELGIUM 0.65 06/22/71	390,000.000	211,934.600	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	1,270,000.000	1,273,110.230	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,210,000.000	1,192,733.300	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	560,000.000	550,424.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	1,070,000.000	1,038,381.500	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,030,000.000	1,034,255.960	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,270,000.000	1,210,208.400	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	778,037.400	
		BELGIUM 1.4 06/22/53	320,000.000	264,769.280	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	530,000.000	493,960.530	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	800,000.000	721,688.000	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	800,000.000	729,837.600	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	760,000.000	752,544.400	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	500,000.000	505,400.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	851,841.450	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	400,886.850	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	1,020,000.000	1,067,121.130	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	730,000.000	824,225.480	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	740,000.000	963,313.500	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	730,000.000	886,768.230	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	820,000.000	1,096,055.460	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	610,000.000	696,600.480	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,120,000.000	1,518,476.960	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,050,000.000	1,313,603.550	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,800,000.000	1,748,628.000	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,563,677.550	
		BUNDESOBL 0.0 04/16/27	660,000.000	632,520.900	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,260,000.000	1,215,169.200	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,750,000.000	1,710,520.000	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	670,000.000	655,990.300	
		BUNDESOBL 04/05/24	1,860,000.000	1,848,717.240	

		BUNDESOBL 10/13/23	1,540,000.000	1,539,245.400	
		BUNDESOBL 10/18/24	1,920,000.000	1,897,699.200	
		BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,500,000.000	1,490,880.000	
		BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	60,000.000	59,850.060	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,020,000.000	1,866,015.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,940,000.000	1,766,370.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	910,000.000	814,083.270	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,560,000.000	1,324,908.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,310,000.000	1,934,694.300	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,130,000.000	1,954,573.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	590,000.000	542,109.700	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,290,000.000	1,164,057.300	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	500,000.000	452,334.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,120,000.000	1,505,361.120	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	480,000.000	343,377.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	990,000.000	679,268.700	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,320,000.000	1,255,834.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,000,000.000	940,284.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,330,000.000	2,267,090.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,780,000.000	1,696,389.840	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,810,000.000	1,732,803.500	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,897,416.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,010,000.000	1,993,920.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,640,000.000	1,600,935.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,210,000.000	1,186,870.850	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	1,980,000.000	1,916,671.680	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	1,890,000.000	1,758,263.220	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,540,000.000	1,559,453.280	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	640,000.000	647,296.000	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,450,000.000	1,466,856.250	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,220,000.000	1,240,229.550	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,230,000.000	2,280,806.090	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,150,000.000	2,206,244.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,290,000.000	3,375,418.270	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,900,000.000	2,383,892.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,190,000.000	2,806,320.750	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,650,000.000	2,248,521.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,830,000.000	2,513,947.860	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,130,000.000	1,654,647.700	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	160,000.000	196,380.800	

		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,330,000.000	1,869,793.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	2,213,150.100	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,520,000.000	2,076,760.800	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,650,128.400	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	910,000.000	1,001,491.400	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	1,080,268.800	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	1,089,385.500	
		FINLAND 0.0 09/15/24	220,000.000	217,348.120	
		FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	186,095.280	
		FINLAND 0.125 04/15/36	290,000.000	233,026.020	
		FINLAND 0.125 04/15/52	250,000.000	158,373.750	
		FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	262,944.900	
		FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	221,792.000	
		FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	452,305.120	
		FINLAND 0.5 04/15/43	150,000.000	116,823.300	
		FINLAND 0.5 09/15/27	580,000.000	562,141.800	
		FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	229,060.800	
		FINLAND 0.5 09/15/29	450,000.000	423,743.400	
		FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	187,925.600	
		FINLAND 0.875 09/15/25	330,000.000	330,678.150	
		FINLAND 09/15/23	300,000.000	299,751.900	
		FINLAND 1.125 04/15/34	490,000.000	461,067.460	
		FINLAND 1.375 04/15/47	310,000.000	293,606.270	
		FINLAND 2.0 04/15/24	430,000.000	443,607.350	
		FINLAND 2.625 07/04/42	320,000.000	367,973.760	
		FINLAND 2.75 07/04/28	490,000.000	536,369.680	
		FINLAND 4.0 07/04/25	480,000.000	529,514.400	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,620,000.000	1,610,586.180	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,000,000.000	979,486.000	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	1,750,000.000	1,690,468.500	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,450,000.000	2,324,827.050	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	800,000.000	677,040.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,090,000.000	2,783,135.190	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,680,000.000	3,236,560.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,806,287.840	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,620,000.000	2,527,962.020	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,990,000.000	2,967,353.740	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,260,000.000	3,200,694.080	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,392,463.840	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,550,000.000	1,206,709.100	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	660,000.000	338,576.040	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	900,000.000	664,185.600	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	850,000.000	827,534.500	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,160,000.000	1,536,222.240	

		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	800,000.000	557,561.600	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,370,000.000	3,262,780.080	
		FRANCE OAT 03/25/24	3,020,000.000	2,997,772.800	
		FRANCE OAT 03/25/25	3,320,000.000	3,251,604.680	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,870,000.000	2,855,707.400	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,753,689.040	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,760,000.000	2,597,438.760	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,310,000.000	2,132,823.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,680,000.000	3,674,641.920	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,130,000.000	1,896,679.800	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	2,430,000.000	2,476,527.210	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,070,000.000	978,072.020	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,270,000.000	2,236,063.500	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,850,000.000	2,929,785.750	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,050,000.000	2,050,916.350	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,590,795.000	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,930,000.000	4,258,736.640	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,900,000.000	4,233,551.400	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,860,000.000	2,293,406.040	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,080,000.000	3,386,922.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	900,000.000	1,317,330.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,440,000.000	2,175,484.320	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,523,616.020	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,695,000.000	3,916,958.650	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,691,506.720	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,980,000.000	2,659,282.560	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,253,173.580	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,499,580.050	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,553,797.050	
		IRISH 0.0 10/18/31	770,000.000	654,152.340	
		IRISH 0.2 05/15/27	500,000.000	478,439.000	
		IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	489,806.620	
		IRISH 0.4 05/15/35	390,000.000	322,633.350	
		IRISH 0.55 04/22/41	270,000.000	207,333.000	
		IRISH 0.9 05/15/28	510,000.000	498,356.190	
		IRISH 1.0 05/15/26	790,000.000	792,388.960	
		IRISH 1.1 05/15/29	530,000.000	519,018.930	
		IRISH 1.3 05/15/33	390,000.000	368,178.720	
		IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	353,376.000	
		IRISH 1.5 05/15/50	500,000.000	437,296.000	
		IRISH 1.7 05/15/37	560,000.000	542,366.160	
		IRISH 2.0 02/18/45	560,000.000	558,250.560	
		IRISH 2.4 05/15/30	740,000.000	791,437.400	
		IRISH 3.4 03/18/24	420,000.000	443,460.360	
		IRISH 5.4 03/13/25	860,000.000	972,890.650	
		ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	982,600.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	990,000.000	912,978.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,400,000.000	1,365,700.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,250,000.000	1,141,500.000	

		ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,302,132.000	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,284,070.000	
		ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,300,000.000	1,296,074.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,460,000.000	1,409,776.000	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,200,000.000	1,035,060.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,525,402.550	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	500,000.000	442,300.000	
		ITALY BTPS 0.6 06/15/23	500,000.000	502,085.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,810,000.000	1,455,264.920	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,380,000.000	1,378,167.360	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,510,000.000	1,419,400.000	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,400,000.000	1,170,037.400	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,080,000.000	795,312.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,380,000.000	1,123,872.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,158,840.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,564,080.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	1,071,915.000	
		ITALY BTPS 1.1 04/01/27	500,000.000	471,700.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,530,000.000	1,470,805.830	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,750,000.000	1,568,483.000	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	906,080.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,370,000.000	1,356,397.420	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,035,634.080	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	574,857.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,760,000.000	1,747,208.320	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,350,000.000	1,326,645.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,490,000.000	1,317,086.990	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,568,822.280	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,020,000.000	713,220.720	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,208,688.000	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,360,000.000	1,072,632.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	1,001,880.000	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,140,000.000	1,140,000.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,750,000.000	1,712,613.000	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,200,000.000	1,203,325.200	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,040,000.000	1,025,828.960	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	890,000.000	890,660.380	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	257,328.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	440,000.000	337,172.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	690,000.000	687,999.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	860,000.000	767,550.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,246,940.170	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	959,675.000	
		ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	952,721.760	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,350,000.000	1,376,568.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,675,765.790	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,330,000.000	1,199,128.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	605,640.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,240,000.000	1,258,538.000	

		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,100,000.000	1,067,660.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,641,422.370	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,000,000.000	975,156.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	1,174,810.360	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,230,000.000	1,252,078.500	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,217,661.550	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,870,000.000	1,971,368.960	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,705,817.220	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	100,000.000	108,873.400	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,980,000.000	2,166,912.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,710,000.000	1,814,241.600	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,910,000.000	2,090,495.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,990,000.000	2,072,588.980	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	2,290,000.000	2,409,057.100	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,897,912.800	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,364,145.600	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	60,000.000	65,546.460	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,984,530.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,600,000.000	1,963,840.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,550,000.000	1,915,955.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,440,000.000	2,874,076.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,530,000.000	1,901,790.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,780,000.000	2,218,414.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,210,000.000	1,473,538.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	427,280.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,270,000.000	1,422,527.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	920,000.000	879,631.320	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	220,000.000	203,164.060	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	450,000.000	353,704.500	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	740,000.000	489,979.160	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	900,000.000	811,620.000	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	700,000.000	620,596.900	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,360,000.000	1,340,565.600	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	910,000.000	850,786.300	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	760,000.000	641,534.240	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,360,000.000	1,339,532.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,144,514.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,140,000.000	1,115,969.940	
		NETHERLANDS 01/15/24	1,440,000.000	1,434,003.840	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	560,000.000	572,076.960	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,770,000.000	1,829,378.190	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,020,000.000	1,126,877.640	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,580,000.000	2,029,260.360	

		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,290,000.000	1,780,089.060	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,190,000.000	1,575,203.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,020,000.000	1,274,898.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	1,590,000.000	1,547,070.000	
		SPAIN 0.0 01/31/26	1,370,000.000	1,304,642.780	
		SPAIN 0.0 01/31/27	230,000.000	214,084.000	
		SPAIN 0.0 01/31/28	1,160,000.000	1,061,748.000	
		SPAIN 0.0 04/30/23	1,000,000.000	999,940.000	
		SPAIN 0.0 05/31/24	1,260,000.000	1,240,433.460	
		SPAIN 0.0 05/31/25	620,000.000	597,980.700	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,640,000.000	1,368,580.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	1,270,000.000	1,254,304.070	
		SPAIN 0.35 07/30/23	1,690,000.000	1,693,917.420	
		SPAIN 0.5 04/30/30	1,900,000.000	1,704,689.500	
		SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,408,141.720	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,399,269.150	
		SPAIN 0.7 04/30/32	1,240,000.000	1,070,988.000	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,550,000.000	1,497,687.500	
		SPAIN 0.85 07/30/37	730,000.000	574,052.290	
		SPAIN 1.0 07/30/42	130,000.000	98,189.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,380,000.000	920,919.540	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	1,001,841.120	
		SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,666,525.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,730,000.000	1,723,789.300	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,640,000.000	1,617,371.930	
		SPAIN 1.4 07/30/28	970,000.000	958,990.500	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,500,000.000	1,468,368.000	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,760,000.000	1,746,993.600	
		SPAIN 1.45 10/31/71	360,000.000	220,636.080	
		SPAIN 1.5 04/30/27	1,510,000.000	1,508,188.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,510,000.000	1,534,133.570	
		SPAIN 1.85 07/30/35	1,330,000.000	1,246,142.170	
		SPAIN 1.9 10/31/52	730,000.000	594,670.860	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,566,375.750	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,770,810.660	
		SPAIN 2.15 10/31/25	1,710,000.000	1,765,922.130	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,470,000.000	1,474,410.000	
		SPAIN 2.7 10/31/48	1,070,000.000	1,081,696.170	
		SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,611,281.980	
		SPAIN 2.9 10/31/46	1,290,000.000	1,357,586.970	
		SPAIN 3.45 07/30/66	1,070,000.000	1,186,980.960	
		SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,559,562.090	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,300,000.000	1,590,230.200	
		SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,176,926.340	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,635,000.000	1,815,217.870	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,480,000.000	1,973,426.080	
		SPAIN 4.8 01/31/24	1,300,000.000	1,396,006.300	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,290,000.000	1,741,500.000	

		SPAIN 5.15 10/31/28	380,000.000	462,536.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	660,000.000	952,379.340	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,515,000.000	2,014,878.790	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,934,876.830	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,680,000.000	2,140,635.840	
	ユーロ　小計		430,552,000.000 (59,256,871,760)	437,263,620.110 (60,180,592,036)	
国債証券　合計			172,760,850,138.600 (172,760,850,139)	166,726,050,005 (166,726,050,005)	
合計				166,726,050,005 (166,726,050,005)	

（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	250銘柄	46.68	49.81
イギリス・ポンド	国債証券	55銘柄	4.91	5.24
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	0.38	0.40
オーストラリア・ドル	国債証券	25銘柄	1.43	1.53
オフショア・人民元	国債証券	14銘柄	1.71	1.82
カナダ・ドル	国債証券	34銘柄	1.92	2.05
シンガポール・ドル	国債証券	18銘柄	0.41	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.25	0.27
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.37	0.39
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.26	0.27
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	0.39	0.41
マレーシア・リンギット	国債証券	23銘柄	0.50	0.53
メキシコ・ペソ	国債証券	12銘柄	0.70	0.74
ユーロ	国債証券	342銘柄	33.83	36.10

（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）

	2022年5月9日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,265,709,948
株式	342,399,039,710
派生商品評価勘定	2,899,720
未収配当金	4,684,405,626
差入委託証拠金	438,075,000
流動資産合計	356,790,130,004
資産合計	356,790,130,004
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	100,307,790
前受金	77,055,000
未払金	14,365,560
未払解約金	4,901,110,000
流動負債合計	5,092,838,350
負債合計	5,092,838,350
純資産の部	
元本等	
元本	111,720,693,843
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	239,976,597,811
元本等合計	351,697,291,654
純資産合計	351,697,291,654
負債純資産合計	356,790,130,004

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11日 至　2022年5月9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	2022年5月9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	111,902,695,114円
同期中追加設定元本額	184,383,628,678円
同期中一部解約元本額	184,565,629,949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	2,678,856,718円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	7,022,098,388円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	21,154,373,018円
ＤＩAM国内株式パッシブ・ファンド	4,727,719,452円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,402,887円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	24,945,102円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	108,615,403円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	25,302,412円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	17,567,875円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,951,068円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,403,669,929円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,169,373,970円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	44,033,153円
たわらノーロード　バランス（標準型）	286,277,156円
たわらノーロード　バランス（積極型）	439,936,062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）	3,662,761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）	172,786,709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）	438,867,354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）	294,875,175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）	426,568,906円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	740,574円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	3,019,423円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	43,276,099円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,377,732円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	19,962,324円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,949,755,720円
Ｏｎｅグローバルバランス	3,127,298円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,084,651,475円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,597,750,478円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,890,417,999円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	348,265,964円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,120,063,627円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,135,166,613円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	32,407,197円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,111,761,786円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	15,484,653円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	309,475,685円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	313,431,637円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	566,744,839円
投資のソムリエ	7,553,910,911円
クルーズコントロール	237,107,897円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	462,453,548円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	338,355,786円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	617,421,526円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	230,673,311円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,274,094,844円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	44,473,788円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	21,902,857円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,605,438円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	134,923,980円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	380,459,421円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	558,141,239円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	297,597,660円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	42,416,231円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	19,631,621円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	14,849,802円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	129,399,754円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	2,079,167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）	22,877,436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）	23,382,532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）	21,508,092円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	14,348,403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）	22,560,843円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	18,836,219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）	10,989,111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）	68,800,315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）	18,029,169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）	12,498,039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）	20,503,849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）	12,636,763円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－１２（適格機関投資家限定）	18,207,688円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	193,263,877円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,301,365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）	38,131,400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）	39,090,198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）	6,914,190円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	18,506,299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）	51,789,549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）	99,094,348円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,791,937円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,230,433円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,479,776円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,237,384円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,954,582円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,537,097円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	523,461,867円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	612,501,515円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,766,802,358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）	27,315,762円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	26,942,297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）	278,809,176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）	68,877,851円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,299,241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）	327,855,610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）	20,040,682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）	70,244,143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）	163,558,478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）	222,231,058円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,619,444円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,923,639円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１２１２）（適格機関投資家限定）	291,737,796円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	936,557,239円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,240,495,959円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	49,936,951円

動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	4,988,294円
コア資産形成ファンド	3,187,891円
ＭＨＡＭトピックスファンド	722,316,815円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	60,200,117円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	680,133,628円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,796,034,498円
計	111,720,693,843円
２．　受益権の総数	111,720,693,843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11日 至　2022年5月9日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年5月9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	2022年5月9日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△10,289,734,528
合計	△10,289,734,528

（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（2022年2月8日から2022年5月9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	2022年5月9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	9,109,635,000	－	9,012,385,000	△97,250,000
合計	9,109,635,000	－	9,012,385,000	△97,250,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年5月9日現在
1口当たり純資産額	3.1480円
（1万口当たり純資産額）	(31,480円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年5月9日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	

極洋	6,400	3,260.00	20,864,000	
日本水産	180,300	572.00	103,131,600	
マルハニチロ	27,400	2,363.00	64,746,200	
雪国まいたけ	13,500	1,000.00	13,500,000	
カネコ種苗	5,300	1,799.00	9,534,700	
サカタのタネ	21,400	4,380.00	93,732,000	
ホクト	15,100	2,027.00	30,607,700	
ホクリヨウ	2,700	667.00	1,800,900	
ショーボンドホールディングス	24,800	5,370.00	133,176,000	
ミライト・ホールディングス	59,500	1,834.00	109,123,000	
タマホーム	11,200	2,650.00	29,680,000	
サンヨーホームズ	2,300	740.00	1,702,000	
日本アクア	7,400	592.00	4,380,800	
ファーストコーポレーション	4,700	803.00	3,774,100	
ベステラ	3,700	1,173.00	4,340,100	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	30,800	198.00	6,098,400	
キャンディル	3,200	514.00	1,644,800	
住石ホールディングス	32,300	178.00	5,749,400	
日鉄鉱業	4,000	6,240.00	24,960,000	
三井松島ホールディングス	7,700	1,960.00	15,092,000	
ＩＮＰＥＸ	683,600	1,598.00	1,092,392,800	
石油資源開発	21,700	2,701.00	58,611,700	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8,000	1,660.00	13,280,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	980.00	3,528,000	
第一カッター興業	4,400	1,331.00	5,856,400	
明豊ファシリティワークス	6,000	679.00	4,074,000	
安藤・間	89,200	899.00	80,190,800	
東急建設	52,600	588.00	30,928,800	
コムシスホールディングス	59,500	2,696.00	160,412,000	
ビーアールホールディングス	24,500	300.00	7,350,000	
高松コンストラクショングループ	10,800	2,182.00	23,565,600	
東建コーポレーション	5,100	8,520.00	43,452,000	
ソネック	2,100	993.00	2,085,300	
ヤマウラ	8,800	929.00	8,175,200	
オリエンタル白石	62,200	234.00	14,554,800	
大成建設	113,100	3,505.00	396,415,500	
大林組	416,600	888.00	369,940,800	
清水建設	388,700	677.00	263,149,900	
飛島建設	11,400	1,017.00	11,593,800	
長谷工コーポレーション	122,800	1,395.00	171,306,000	
松井建設	16,000	636.00	10,176,000	
錢高組	1,500	3,690.00	5,535,000	
鹿島建設	305,300	1,433.00	437,494,900	
不動テトラ	9,100	1,551.00	14,114,100	
大末建設	4,500	1,322.00	5,949,000	
鉄建建設	9,100	1,855.00	16,880,500	
西松建設	25,800	3,815.00	98,427,000	
三井住友建設	96,100	420.00	40,362,000	
大豊建設	6,200	4,465.00	27,683,000	
佐田建設	9,500	445.00	4,227,500	

ナカノフドー建設	10,600	313.00	3,317,800	
奥村組	24,100	3,115.00	75,071,500	
東鉄工業	18,800	2,206.00	41,472,800	
イチケン	3,100	1,829.00	5,669,900	
富士ピー・エス	5,300	484.00	2,565,200	
淺沼組	4,800	5,060.00	24,288,000	
戸田建設	172,900	737.00	127,427,300	
熊谷組	21,100	2,702.00	57,012,200	
北野建設	2,600	2,112.00	5,491,200	
植木組	3,700	1,391.00	5,146,700	
矢作建設工業	18,300	780.00	14,274,000	
ピーエス三菱	14,200	571.00	8,108,200	
日本ハウスホールディングス	29,000	415.00	12,035,000	
大東建託	43,700	11,470.00	501,239,000	
新日本建設	18,200	692.00	12,594,400	
東亜道路工業	2,200	5,090.00	11,198,000	
日本道路	3,700	7,210.00	26,677,000	
東亜建設工業	10,200	2,826.00	28,825,200	
日本国土開発	38,900	540.00	21,006,000	
若築建設	7,000	1,944.00	13,608,000	
東洋建設	47,900	889.00	42,583,100	
五洋建設	165,200	620.00	102,424,000	
世紀東急工業	20,600	742.00	15,285,200	
福田組	4,600	4,570.00	21,022,000	
日本ドライケミカル	3,300	1,629.00	5,375,700	
住友林業	103,900	1,941.00	201,669,900	
日本基礎技術	11,400	758.00	8,641,200	
巴コーポレーション	18,000	458.00	8,244,000	
大和ハウス工業	375,300	3,106.00	1,165,681,800	
ライト工業	25,000	1,890.00	47,250,000	
積水ハウス	443,600	2,224.50	986,788,200	
日特建設	9,000	703.00	6,327,000	
北陸電気工事	8,600	739.00	6,355,400	
ユアテック	24,500	682.00	16,709,000	
日本リーテック	8,700	1,070.00	9,309,000	
四電工	4,500	1,741.00	7,834,500	
中電工	18,900	2,105.00	39,784,500	
関電工	69,400	826.00	57,324,400	
きんでん	92,400	1,503.00	138,877,200	
東京エネシス	13,800	953.00	13,151,400	
トーエネック	4,300	3,350.00	14,405,000	
住友電設	10,600	2,221.00	23,542,600	
日本電設工業	21,700	1,663.00	36,087,100	
エクシオグループ	62,500	2,178.00	136,125,000	
新日本空調	10,600	1,807.00	19,154,200	
日本工営	8,300	2,904.00	24,103,200	
九電工	30,900	2,839.00	87,725,100	
三機工業	27,800	1,490.00	41,422,000	
日揮ホールディングス	127,900	1,447.00	185,071,300	
中外炉工業	4,200	1,490.00	6,258,000	

ヤマト	11,900	728.00	8,663,200	
太平電業	8,900	2,757.00	24,537,300	
高砂熱学工業	36,600	1,686.00	61,707,600	
三晃金属工業	1,700	2,558.00	4,348,600	
ＮＥＣネッツエスアイ	44,200	1,831.00	80,930,200	
朝日工業社	5,600	1,566.00	8,769,600	
明星工業	24,800	675.00	16,740,000	
大氣社	19,800	3,200.00	63,360,000	
ダイダン	9,000	2,075.00	18,675,000	
日比谷総合設備	13,100	1,889.00	24,745,900	
ニップン	37,800	1,684.00	63,655,200	
日清製粉グループ本社	145,800	1,717.00	250,338,600	
日東富士製粉	1,500	4,040.00	6,060,000	
昭和産業	12,200	2,609.00	31,829,800	
鳥越製粉	11,600	640.00	7,424,000	
中部飼料	15,100	1,012.00	15,281,200	
フィード・ワン	17,400	652.00	11,344,800	
東洋精糖	1,700	983.00	1,671,100	
日本甜菜製糖	7,200	1,660.00	11,952,000	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	12,000	1,909.00	22,908,000	
塩水港精糖	17,100	208.00	3,556,800	
日新製糖	6,600	1,706.00	11,259,600	
ＬＩＦＵＬＬ	39,600	219.00	8,672,400	
ミクシィ	29,800	2,246.00	66,930,800	
ジェイエイシーリクルートメント	10,500	1,796.00	18,858,000	
日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	213,300	1,382.00	294,780,600	
メンバーズ	3,700	2,981.00	11,029,700	
中広	1,000	380.00	380,000	
ＵＴグループ	18,800	2,722.00	51,173,600	
アイティメディア	6,200	1,693.00	10,496,600	
Ｅ・Ｊホールディングス	7,500	1,150.00	8,625,000	
夢真ビーネックスグループ	42,400	1,403.00	59,487,200	
コシダカホールディングス	34,700	764.00	26,510,800	
アルトナー	3,200	832.00	2,662,400	
パソナグループ	14,100	1,969.00	27,762,900	
ＣＤＳ	2,200	1,746.00	3,841,200	
リンクアンドモチベーション	28,600	426.00	12,183,600	
エス・エム・エス	44,200	3,055.00	135,031,000	
サニーサイドアップグループ	4,600	792.00	3,643,200	
パーソルホールディングス	130,000	2,430.00	315,900,000	
リニカル	7,400	796.00	5,890,400	
クックパッド	40,900	254.00	10,388,600	
エスクリ	5,800	415.00	2,407,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,400	569.00	3,641,600	
森永製菓	30,500	4,030.00	122,915,000	
中村屋	3,200	3,085.00	9,872,000	
江崎グリコ	35,700	3,685.00	131,554,500	
名糖産業	5,800	1,618.00	9,384,400	
井村屋グループ	7,400	2,226.00	16,472,400	
不二家	7,600	2,375.00	18,050,000	

山崎製パン	96,100	1,656.00	159,141,600	
第一屋製パン	3,000	521.00	1,563,000	
モロゾフ	3,400	3,070.00	10,438,000	
亀田製菓	7,600	4,040.00	30,704,000	
寿スピリッツ	12,700	6,850.00	86,995,000	
カルビー	62,200	2,307.00	143,495,400	
森永乳業	24,600	5,010.00	123,246,000	
六甲バター	9,700	1,512.00	14,666,400	
ヤクルト本社	96,400	6,750.00	650,700,000	
明治ホールディングス	83,600	6,420.00	536,712,000	
雪印メグミルク	31,900	1,918.00	61,184,200	
プリマハム	17,100	2,186.00	37,380,600	
日本ハム	50,800	4,015.00	203,962,000	
林兼産業	3,500	503.00	1,760,500	
丸大食品	13,200	1,500.00	19,800,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	12,300	2,942.00	36,186,600	
柿安本店	4,700	2,416.00	11,355,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	88,000	650.00	57,200,000	
学情	5,300	935.00	4,955,500	
スタジオアリス	5,800	2,246.00	13,026,800	
クロスキャット	7,300	874.00	6,380,200	
シミックホールディングス	6,900	1,423.00	9,818,700	
エプコ	2,800	689.00	1,929,200	
システナ	190,600	407.00	77,574,200	
ＮＪＳ	2,600	2,031.00	5,280,600	
デジタルアーツ	7,200	6,740.00	48,528,000	
日鉄ソリューションズ	20,600	3,760.00	77,456,000	
綜合警備保障	50,300	3,645.00	183,343,500	
キューブシステム	6,800	888.00	6,038,400	
いちご	149,500	283.00	42,308,500	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	1,900	1,065.00	2,023,500	
日本駐車場開発	142,200	154.00	21,898,800	
コア	5,700	1,385.00	7,894,500	
カカクコム	95,400	2,651.00	252,905,400	
アイロムグループ	4,700	1,998.00	9,390,600	
セントケア・ホールディング	8,500	793.00	6,740,500	
サイネックス	2,200	594.00	1,306,800	
ルネサンス	9,000	878.00	7,902,000	
ディップ	22,900	4,180.00	95,722,000	
ＳＢＳホールディングス	10,100	2,957.00	29,865,700	
デジタルホールディングス	9,000	1,441.00	12,969,000	
新日本科学	15,800	1,345.00	21,251,000	
キャリアデザインセンター	3,100	1,042.00	3,230,200	
ベネフィット・ワン	47,300	1,880.00	88,924,000	
エムスリー	229,500	3,887.00	892,066,500	
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	310.00	2,573,000	
ブラス	1,700	689.00	1,171,300	
アウトソーシング	74,500	1,249.00	93,050,500	
ウェルネット	12,600	455.00	5,733,000	
ワールドホールディングス	5,200	2,281.00	11,861,200	

ディー・エヌ・エー	49,500	1,893.00	93,703,500	
博報堂ＤＹホールディングス	175,600	1,540.00	270,424,000	
ぐるなび	20,500	402.00	8,241,000	
タカミヤ	16,000	341.00	5,456,000	
ジャパンベストレスキューシステム	8,300	801.00	6,648,300	
ファンコミュニケーションズ	31,600	419.00	13,240,400	
ライク	4,300	2,135.00	9,180,500	
ビジネス・ブレークスルー	5,000	408.00	2,040,000	
エスプール	36,700	1,255.00	46,058,500	
ＷＤＢホールディングス	5,900	2,651.00	15,640,900	
手間いらず	1,900	5,020.00	9,538,000	
ティア	7,800	433.00	3,377,400	
ＣＤＧ	1,400	1,294.00	1,811,600	
アドウェイズ	19,400	833.00	16,160,200	
バリューコマース	10,200	3,105.00	31,671,000	
インフォマート	142,500	503.00	71,677,500	
サッポロホールディングス	44,400	2,744.00	121,833,600	
アサヒグループホールディングス	307,100	4,822.00	1,480,836,200	
キリンホールディングス	502,000	1,917.50	962,585,000	
宝ホールディングス	87,200	1,056.00	92,083,200	
オエノンホールディングス	38,400	311.00	11,942,400	
養命酒製造	4,100	1,727.00	7,080,700	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	93,000	1,482.00	137,826,000	
サントリー食品インターナショナル	91,400	5,140.00	469,796,000	
ダイドーグループホールディングス	7,000	5,080.00	35,560,000	
伊藤園	41,500	5,390.00	223,685,000	
キーコーヒー	13,100	2,030.00	26,593,000	
ユニカフェ	4,300	922.00	3,964,600	
ジャパンフーズ	1,500	1,149.00	1,723,500	
日清オイリオグループ	16,600	3,010.00	49,966,000	
不二製油グループ本社	29,600	1,838.00	54,404,800	
かどや製油	1,400	3,520.00	4,928,000	
Ｊ－オイルミルズ	12,800	1,596.00	20,428,800	
ローソン	29,700	4,735.00	140,629,500	
サンエー	9,800	4,165.00	40,817,000	
カワチ薬品	10,400	2,058.00	21,403,200	
エービーシー・マート	20,900	5,470.00	114,323,000	
ハードオフコーポレーション	6,000	816.00	4,896,000	
高千穂交易	5,100	1,531.00	7,808,100	
アスクル	30,300	1,493.00	45,237,900	
ゲオホールディングス	17,300	1,266.00	21,901,800	
アダストリア	14,400	2,176.00	31,334,400	
ジーフット	8,400	311.00	2,612,400	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	2,200	391.00	860,200	
オルバヘルスケアホールディングス	1,500	1,713.00	2,569,500	
伊藤忠食品	3,100	4,800.00	14,880,000	
くら寿司	14,000	3,060.00	42,840,000	
キャンドゥ	5,000	2,366.00	11,830,000	
エレマテック	10,800	1,190.00	12,852,000	

アイケイ	4,200	546.00	2,293,200	
パルグループホールディングス	11,700	1,476.00	17,269,200	
エディオン	61,500	1,204.00	74,046,000	
あらた	10,400	3,585.00	37,284,000	
サーラコーポレーション	27,300	630.00	17,199,000	
ワッツ	6,500	710.00	4,615,000	
トーメンデバイス	2,000	5,830.00	11,660,000	
ハローズ	6,100	3,100.00	18,910,000	
ＪＰホールディングス	33,400	209.00	6,980,600	
フジオフードグループ本社	10,900	1,332.00	14,518,800	
あみやき亭	3,200	2,901.00	9,283,200	
東京エレクトロン　デバイス	4,000	5,710.00	22,840,000	
ひらまつ	28,500	190.00	5,415,000	
フィールズ	11,700	872.00	10,202,400	
双日	144,500	2,032.00	293,624,000	
アルフレッサ　ホールディングス	145,600	1,810.00	263,536,000	
大黒天物産	4,300	4,760.00	20,468,000	
ハニーズホールディングス	11,400	1,084.00	12,357,600	
ファーマライズホールディングス	3,400	719.00	2,444,600	
キッコーマン	92,800	7,060.00	655,168,000	
味の素	287,500	3,098.00	890,675,000	
ブルドックソース	5,500	1,870.00	10,285,000	
キユーピー	67,800	2,197.00	148,956,600	
ハウス食品グループ本社	48,200	2,985.00	143,877,000	
カゴメ	51,800	3,175.00	164,465,000	
焼津水産化学工業	6,600	880.00	5,808,000	
アリアケジャパン	12,500	5,060.00	63,250,000	
ピエトロ	1,900	1,755.00	3,334,500	
エバラ食品工業	3,000	2,804.00	8,412,000	
やまみ	1,200	1,664.00	1,996,800	
ニチレイ	58,500	2,333.00	136,480,500	
横浜冷凍	36,000	864.00	31,104,000	
東洋水産	64,000	4,055.00	259,520,000	
イートアンドホールディングス	5,200	2,205.00	11,466,000	
大冷	1,700	1,882.00	3,199,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,100	524.00	3,720,400	
日清食品ホールディングス	49,900	8,940.00	446,106,000	
永谷園ホールディングス	6,200	1,970.00	12,214,000	
一正蒲鉾	5,800	812.00	4,709,600	
フジッコ	12,700	2,011.00	25,539,700	
ロック・フィールド	14,300	1,388.00	19,848,400	
日本たばこ産業	732,400	2,271.50	1,663,646,600	
ケンコーマヨネーズ	7,400	1,403.00	10,382,200	
わらべや日洋ホールディングス	8,700	1,672.00	14,546,400	
なとり	7,700	2,014.00	15,507,800	
イフジ産業	2,200	1,023.00	2,250,600	
ピックルスコーポレーション	6,500	1,280.00	8,320,000	
ファーマフーズ	17,200	1,573.00	27,055,600	
北の達人コーポレーション	47,500	168.00	7,980,000	
ユーグレナ	69,800	835.00	58,283,000	

紀文食品	10,600	1,022.00	10,833,200	
スター・マイカ・ホールディングス	7,300	1,477.00	10,782,100	
ＳＲＥホールディングス	3,400	2,426.00	8,248,400	
ＡＤワークスグループ	26,800	147.00	3,939,600	
片倉工業	13,900	2,459.00	34,180,100	
グンゼ	8,200	3,800.00	31,160,000	
ヒューリック	311,000	1,057.00	328,727,000	
神栄	1,900	885.00	1,681,500	
ラサ商事	6,700	986.00	6,606,200	
アルペン	10,000	1,947.00	19,470,000	
ハブ	4,400	508.00	2,235,200	
ラクーンホールディングス	11,300	1,451.00	16,396,300	
クオールホールディングス	16,400	1,069.00	17,531,600	
アルコニックス	16,800	1,402.00	23,553,600	
神戸物産	100,200	2,855.00	286,071,000	
ソリトンシステムズ	6,700	1,385.00	9,279,500	
ジンズホールディングス	8,400	4,150.00	34,860,000	
ビックカメラ	79,500	1,137.00	90,391,500	
ＤＣＭホールディングス	82,700	1,079.00	89,233,300	
ペッパーフードサービス	18,300	375.00	6,862,500	
ハイパー	2,200	471.00	1,036,200	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	169,500	1,947.00	330,016,500	
東京一番フーズ	3,500	592.00	2,072,000	
ＤＤホールディングス	7,000	518.00	3,626,000	
あい　ホールディングス	19,200	1,683.00	32,313,600	
ディーブイエックス	4,700	1,035.00	4,864,500	
きちりホールディングス	3,700	383.00	1,417,100	
アークランドサービスホールディングス	9,800	2,082.00	20,403,600	
Ｊ．フロント　リテイリング	156,200	1,000.00	156,200,000	
ドトール・日レスホールディングス	22,500	1,490.00	33,525,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	81,100	4,205.00	341,025,500	
ブロンコビリー	7,400	2,306.00	17,064,400	
ＺＯＺＯ	92,200	2,626.00	242,117,200	
トレジャー・ファクトリー	3,900	957.00	3,732,300	
物語コーポレーション	6,600	5,110.00	33,726,000	
三越伊勢丹ホールディングス	223,500	1,010.00	225,735,000	
東洋紡	52,600	1,104.00	58,070,400	
ユニチカ	36,500	279.00	10,183,500	
富士紡ホールディングス	5,800	3,150.00	18,270,000	
日清紡ホールディングス	78,600	954.00	74,984,400	
倉敷紡績	10,800	1,831.00	19,774,800	
ダイワボウホールディングス	62,400	1,650.00	102,960,000	
シキボウ	7,100	888.00	6,304,800	
日東紡績	19,100	2,420.00	46,222,000	
トヨタ紡織	52,900	2,074.00	109,714,600	
マクニカ・富士エレホールディングス	32,000	2,793.00	89,376,000	
Ｈａｍｅｅ	4,800	1,068.00	5,126,400	
マーケットエンタープライズ	1,400	738.00	1,033,200	
ラクト・ジャパン	4,600	2,025.00	9,315,000	

ウエルシアホールディングス	70,900	2,552.00	180,936,800	
クリエイトＳＤホールディングス	19,800	2,895.00	57,321,000	
グリムス	6,000	1,583.00	9,498,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,700	753.00	17,093,100	
八洲電機	9,800	940.00	9,212,000	
メディアスホールディングス	7,700	985.00	7,584,500	
レスターホールディングス	12,700	2,038.00	25,882,600	
ジューテックホールディングス	3,000	1,041.00	3,123,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	16,200	380.00	6,156,000	
大光	5,900	719.00	4,242,100	
ＯＣＨＩホールディングス	3,700	1,220.00	4,514,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	65,000	874.00	56,810,000	
黒谷	3,600	581.00	2,091,600	
ミサワ	2,700	611.00	1,649,700	
ティーライフ	1,800	1,434.00	2,581,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,600	734.00	1,908,400	
エー・ピーホールディングス	2,100	445.00	934,500	
三洋貿易	13,100	972.00	12,733,200	
チムニー	4,200	1,163.00	4,884,600	
シュッピン	11,100	1,132.00	12,565,200	
ビューティガレージ	2,200	2,699.00	5,937,800	
オイシックス・ラ・大地	19,300	2,482.00	47,902,600	
ウイン・パートナーズ	9,800	995.00	9,751,000	
ネクステージ	27,200	1,942.00	52,822,400	
ジョイフル本田	40,300	1,576.00	63,512,800	
鳥貴族ホールディングス	4,700	1,739.00	8,173,300	
ホットランド	10,100	1,371.00	13,847,100	
すかいらーくホールディングス	169,800	1,534.00	260,473,200	
ＳＦＰホールディングス	6,600	1,382.00	9,121,200	
綿半ホールディングス	9,900	1,325.00	13,117,500	
日本毛織	37,700	966.00	36,418,200	
ダイトウボウ	21,600	92.00	1,987,200	
トーア紡コーポレーション	3,800	385.00	1,463,000	
ダイドーリミテッド	18,700	138.00	2,580,600	
ヨシックスホールディングス	2,600	2,056.00	5,345,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,900	1,082.00	42,089,800	
三栄建築設計	5,400	1,656.00	8,942,400	
野村不動産ホールディングス	69,400	3,155.00	218,957,000	
三重交通グループホールディングス	27,400	468.00	12,823,200	
サムティ	20,900	2,067.00	43,200,300	
ディア・ライフ	17,100	515.00	8,806,500	
コーセーアールイー	4,000	639.00	2,556,000	
地主	8,500	1,961.00	16,668,500	
プレサンスコーポレーション	16,600	1,490.00	24,734,000	
フィル・カンパニー	2,300	1,097.00	2,523,100	
ＴＨＥグローバル社	7,200	156.00	1,123,200	
ハウスコム	1,000	1,156.00	1,156,000	
日本管理センター	6,500	991.00	6,441,500	

サンセイランディック	4,100	814.00	3,337,400	
エストラスト	1,400	556.00	778,400	
フージャースホールディングス	17,300	647.00	11,193,100	
オープンハウスグループ	42,700	4,870.00	207,949,000	
東急不動産ホールディングス	385,300	673.00	259,306,900	
飯田グループホールディングス	112,000	2,103.00	235,536,000	
イーグランド	2,100	1,372.00	2,881,200	
ムゲンエステート	8,500	510.00	4,335,000	
帝国繊維	14,600	1,550.00	22,630,000	
日本コークス工業	115,100	134.00	15,423,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	970.00	6,790,000	
ミタチ産業	3,400	879.00	2,988,600	
ＢＥＥＮＯＳ	6,800	1,449.00	9,853,200	
あさひ	11,100	1,325.00	14,707,500	
日本調剤	8,100	1,177.00	9,533,700	
コスモス薬品	13,500	11,260.00	152,010,000	
シップヘルスケアホールディングス	41,500	2,128.00	88,312,000	
トーエル	6,400	834.00	5,337,600	
ソフトクリエイトホールディングス	5,800	3,930.00	22,794,000	
セブン&アイ・ホールディングス	499,400	5,762.00	2,877,542,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	77,500	805.00	62,387,500	
明治電機工業	4,300	1,025.00	4,407,500	
ツルハホールディングス	29,200	6,430.00	187,756,000	
デリカフーズホールディングス	5,400	532.00	2,872,800	
スターティアホールディングス	3,000	533.00	1,599,000	
サンマルクホールディングス	10,600	1,487.00	15,762,200	
フェリシモ	3,000	1,163.00	3,489,000	
トリドールホールディングス	33,300	2,223.00	74,025,900	
帝人	122,600	1,390.00	170,414,000	
東レ	919,000	637.20	585,586,800	
クラレ	189,800	1,062.00	201,567,600	
旭化成	863,800	1,073.00	926,857,400	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	12,200	313.00	3,818,600	
稲葉製作所	7,400	1,281.00	9,479,400	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	3,325.00	13,300,000	
トーカロ	34,700	1,277.00	44,311,900	
アルファ	5,100	950.00	4,845,000	
ＳＵＭＣＯ	212,000	1,933.00	409,796,000	
川田テクノロジーズ	2,700	3,630.00	9,801,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4,400	5,830.00	25,652,000	
ジェイテックコーポレーション	1,700	1,687.00	2,867,900	
信和	8,400	798.00	6,703,200	
ビーロット	9,100	488.00	4,440,800	
ファーストブラザーズ	3,200	835.00	2,672,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	6,600	908.00	5,992,800	
シーアールイー	4,200	1,506.00	6,325,200	
プロパティエージェント	1,600	1,557.00	2,491,200	
ケイアイスター不動産	6,000	5,270.00	31,620,000	
アグレ都市デザイン	2,200	1,494.00	3,286,800	

グッドコムアセット	5,800	1,096.00	6,356,800	
ジェイ・エス・ビー	2,700	3,450.00	9,315,000	
ロードスターキャピタル	3,400	1,435.00	4,879,000	
テンポイノベーション	3,800	814.00	3,093,200	
グローバル・リンク・マネジメント	2,400	902.00	2,164,800	
フェイスネットワーク	1,700	1,327.00	2,255,900	
住江織物	2,500	1,978.00	4,945,000	
日本フエルト	7,900	421.00	3,325,900	
イチカワ	1,400	1,407.00	1,969,800	
エコナックホールディングス	23,400	90.00	2,106,000	
日東製網	1,500	1,349.00	2,023,500	
芦森工業	2,200	946.00	2,081,200	
アツギ	10,100	515.00	5,201,500	
ウイルプラスホールディングス	2,500	913.00	2,282,500	
ＪＭホールディングス	9,400	1,626.00	15,284,400	
コメダホールディングス	29,200	2,261.00	66,021,200	
サツドラホールディングス	6,200	659.00	4,085,800	
アレンザホールディングス	9,800	987.00	9,672,600	
串カツ田中ホールディングス	3,600	1,647.00	5,929,200	
バロックジャパンリミテッド	9,400	792.00	7,444,800	
クスリのアオキホールディングス	12,900	5,370.00	69,273,000	
ダイニック	3,500	716.00	2,506,000	
共和レザー	8,100	679.00	5,499,900	
ピーバンドットコム	1,900	555.00	1,054,500	
力の源ホールディングス	7,000	591.00	4,137,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	75,200	2,950.00	221,840,000	
アセンテック	4,600	690.00	3,174,000	
セーレン	26,400	2,053.00	54,199,200	
ソトー	5,100	854.00	4,355,400	
東海染工	1,400	1,167.00	1,633,800	
小松マテーレ	21,300	1,434.00	30,544,200	
ワコールホールディングス	31,400	1,827.00	57,367,800	
ホギメディカル	17,500	3,230.00	56,525,000	
クラウディアホールディングス	2,200	231.00	508,200	
ＴＳＩホールディングス	43,100	314.00	13,533,400	
マツオカコーポレーション	4,100	1,111.00	4,555,100	
ワールド	17,400	1,298.00	22,585,200	
ＴＩＳ	123,800	2,982.00	369,171,600	
ＪＮＳホールディングス	6,100	395.00	2,409,500	
グリー	60,800	918.00	55,814,400	
GMOペパボ	1,400	2,036.00	2,850,400	
コーエーテクモホールディングス	42,600	4,065.00	173,169,000	
三菱総合研究所	6,900	4,240.00	29,256,000	
ボルテージ	3,600	352.00	1,267,200	
電算	900	2,236.00	2,012,400	
ＡＧＳ	6,500	756.00	4,914,000	
ファインデックス	11,300	607.00	6,859,100	
ブレインパッド	11,300	1,115.00	12,599,500	
ＫＬａｂ	23,800	426.00	10,138,800	

ポールトゥウィンホールディングス	19,400	1,007.00	19,535,800	
ネクソン	302,400	2,893.00	874,843,200	
アイスタイル	34,300	155.00	5,316,500	
エムアップホールディングス	15,400	980.00	15,092,000	
エイチーム	8,900	692.00	6,158,800	
エニグモ	14,400	550.00	7,920,000	
テクノスジャパン	10,300	447.00	4,604,100	
ｅｎｉｓｈ	8,900	306.00	2,723,400	
コロプラ	43,800	634.00	27,769,200	
オルトプラス	10,000	306.00	3,060,000	
ブロードリーフ	66,200	362.00	23,964,400	
クロス・マーケティンググループ	5,100	877.00	4,472,700	
デジタルハーツホールディングス	6,100	1,638.00	9,991,800	
システム情報	10,000	922.00	9,220,000	
メディアドゥ	4,700	1,658.00	7,792,600	
じげん	37,700	296.00	11,159,200	
ブイキューブ	13,600	1,005.00	13,668,000	
エンカレッジ・テクノロジ	3,100	524.00	1,624,400	
サイバーリンクス	4,500	1,030.00	4,635,000	
ディー・エル・イー	9,000	290.00	2,610,000	
フィックスターズ	13,700	772.00	10,576,400	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,400	2,332.00	12,592,800	
オプティム	9,300	817.00	7,598,100	
セレス	5,000	1,332.00	6,660,000	
ＳＨＩＦＴ	7,300	22,000.00	160,600,000	
特種東海製紙	7,800	3,535.00	27,573,000	
ティーガイア	11,900	1,690.00	20,111,000	
セック	2,000	2,219.00	4,438,000	
テクマトリックス	22,600	1,836.00	41,493,600	
プロシップ	4,500	1,350.00	6,075,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,700	2,639.00	91,573,300	
GMOペイメントゲートウェイ	25,900	9,840.00	254,856,000	
ザッパラス	5,000	418.00	2,090,000	
システムリサーチ	3,900	1,930.00	7,527,000	
インターネットイニシアティブ	35,600	3,970.00	141,332,000	
さくらインターネット	14,400	566.00	8,150,400	
ヴィンクス	3,800	1,136.00	4,316,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,000	5,220.00	15,660,000	
ＳＲＡホールディングス	6,500	2,750.00	17,875,000	
システムインテグレータ	4,300	473.00	2,033,900	
朝日ネット	12,300	577.00	7,097,100	
ｅＢＡＳＥ	16,000	409.00	6,544,000	
アバント	14,300	1,156.00	16,530,800	
アドソル日進	4,800	1,569.00	7,531,200	
ＯＤＫソリューションズ	2,900	610.00	1,769,000	
フリービット	6,900	908.00	6,265,200	
コムチュア	15,000	2,715.00	40,725,000	
サイバーコム	2,100	1,109.00	2,328,900	

アステリア	9,600	885.00	8,496,000	
アイル	7,100	1,299.00	9,222,900	
王子ホールディングス	542,900	603.00	327,368,700	
日本製紙	60,500	1,047.00	63,343,500	
三菱製紙	18,700	303.00	5,666,100	
北越コーポレーション	84,800	679.00	57,579,200	
中越パルプ工業	5,200	943.00	4,903,600	
巴川製紙所	4,000	796.00	3,184,000	
大王製紙	61,900	1,549.00	95,883,100	
阿波製紙	3,600	329.00	1,184,400	
マークラインズ	6,700	2,530.00	16,951,000	
メディカル・データ・ビジョン	16,900	918.00	15,514,200	
ｇｕｍｉ	18,400	509.00	9,365,600	
ショーケース	2,900	436.00	1,264,400	
モバイルファクトリー	3,000	966.00	2,898,000	
テラスカイ	4,900	1,254.00	6,144,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,155.00	6,814,500	
ＰＣＩホールディングス	5,700	971.00	5,534,700	
パイプドＨＤ	2,400	2,649.00	6,357,600	
アイビーシー	2,100	484.00	1,016,400	
ネオジャパン	3,800	1,144.00	4,347,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,800	2,051.00	5,742,800	
ラクス	61,200	1,311.00	80,233,200	
ランドコンピュータ	3,200	907.00	2,902,400	
ダブルスタンダード	4,000	1,765.00	7,060,000	
オープンドア	7,900	1,745.00	13,785,500	
マイネット	4,800	507.00	2,433,600	
アカツキ	5,900	2,967.00	17,505,300	
ベネフィットジャパン	900	1,996.00	1,796,400	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,500	2,730.00	9,555,000	
カナミックネットワーク	14,900	488.00	7,271,200	
ノムラシステムコーポレーション	6,900	228.00	1,573,200	
レンゴー	118,100	780.00	92,118,000	
トーモク	7,700	1,554.00	11,965,800	
ザ・パック	9,500	2,343.00	22,258,500	
チェンジ	25,700	1,769.00	45,463,300	
シンクロ・フード	6,800	278.00	1,890,400	
オークネット	7,100	1,502.00	10,664,200	
キャピタル・アセット・プランニング	2,600	730.00	1,898,000	
セグエグループ	3,500	557.00	1,949,500	
エイトレッド	1,900	2,010.00	3,819,000	
マクロミル	27,900	1,125.00	31,387,500	
ビーグリー	3,100	1,313.00	4,070,300	
オロ	4,200	1,808.00	7,593,600	
ユーザーローカル	4,100	1,628.00	6,674,800	
テモナ	2,700	377.00	1,017,900	
ニーズウェル	3,300	666.00	2,197,800	
マネーフォワード	27,100	3,600.00	97,560,000	
サインポスト	4,300	828.00	3,560,400	

昭和電工	116,100	2,466.00	286,302,600	
住友化学	956,000	575.00	549,700,000	
住友精化	5,700	3,040.00	17,328,000	
日産化学	68,500	7,020.00	480,870,000	
ラサ工業	4,700	1,643.00	7,722,100	
クレハ	10,300	10,050.00	103,515,000	
多木化学	4,900	4,970.00	24,353,000	
テイカ	9,100	1,187.00	10,801,700	
石原産業	22,700	1,054.00	23,925,800	
片倉コープアグリ	3,200	1,309.00	4,188,800	
日本曹達	16,200	3,500.00	56,700,000	
東ソー	183,100	1,836.00	336,171,600	
トクヤマ	41,500	1,770.00	73,455,000	
セントラル硝子	21,200	2,417.00	51,240,400	
東亞合成	70,500	1,039.00	73,249,500	
大阪ソーダ	11,700	3,215.00	37,615,500	
関東電化工業	27,500	973.00	26,757,500	
デンカ	47,400	3,490.00	165,426,000	
イビデン	69,400	4,650.00	322,710,000	
信越化学工業	223,000	18,015.00	4,017,345,000	
日本カーバイド工業	4,800	1,380.00	6,624,000	
電算システムホールディングス	5,500	2,559.00	14,074,500	
堺化学工業	9,100	1,880.00	17,108,000	
第一稀元素化学工業	12,000	974.00	11,688,000	
エア・ウォーター	119,700	1,690.00	202,293,000	
日本酸素ホールディングス	122,000	2,332.00	284,504,000	
日本化学工業	4,000	2,325.00	9,300,000	
東邦アセチレン	2,900	1,134.00	3,288,600	
日本パーカライジング	63,500	926.00	58,801,000	
高圧ガス工業	20,400	655.00	13,362,000	
チタン工業	1,500	1,707.00	2,560,500	
四国化成工業	16,600	1,240.00	20,584,000	
戸田工業	2,800	2,424.00	6,787,200	
ステラ　ケミファ	6,700	2,475.00	16,582,500	
保土谷化学工業	4,000	3,660.00	14,640,000	
日本触媒	21,300	5,240.00	111,612,000	
大日精化工業	10,500	1,955.00	20,527,500	
カネカ	32,500	3,455.00	112,287,500	
協和キリン	152,200	2,627.00	399,829,400	
三菱瓦斯化学	117,600	1,995.00	234,612,000	
三井化学	115,300	3,015.00	347,629,500	
ＪＳＲ	124,200	3,505.00	435,321,000	
東京応化工業	21,000	6,930.00	145,530,000	
大阪有機化学工業	10,700	2,785.00	29,799,500	
三菱ケミカルホールディングス	869,900	815.90	709,751,410	
ＫＨネオケム	21,400	2,492.00	53,328,800	
ダイセル	187,700	788.00	147,907,600	
住友ベークライト	20,300	4,280.00	86,884,000	
積水化学工業	272,300	1,747.00	475,708,100	
日本ゼオン	113,500	1,376.00	156,176,000	

アイカ工業	35,200	2,969.00	104,508,800	
ＵＢＥ	62,800	2,071.00	130,058,800	
積水樹脂	19,500	1,762.00	34,359,000	
タキロンシーアイ	28,900	555.00	16,039,500	
旭有機材	7,500	1,897.00	14,227,500	
ニチバン	7,700	1,727.00	13,297,900	
リケンテクノス	30,800	426.00	13,120,800	
大倉工業	6,500	1,828.00	11,882,000	
積水化成品工業	17,200	418.00	7,189,600	
群栄化学工業	2,900	2,694.00	7,812,600	
タイガースポリマー	7,100	432.00	3,067,200	
ミライアル	4,300	1,663.00	7,150,900	
ダイキアクシス	5,300	720.00	3,816,000	
ダイキョーニシカワ	28,100	513.00	14,415,300	
竹本容器	4,800	787.00	3,777,600	
森六ホールディングス	7,000	1,787.00	12,509,000	
恵和	3,600	4,485.00	16,146,000	
日本化薬	98,500	1,107.00	109,039,500	
カーリットホールディングス	12,500	640.00	8,000,000	
ソルクシーズ	11,400	382.00	4,354,800	
ＣＬホールディングス	2,700	1,079.00	2,913,300	
プレステージ・インターナショナル	48,800	605.00	29,524,000	
フェイス	3,600	734.00	2,642,400	
プロトコーポレーション	14,200	1,031.00	14,640,200	
ハイマックス	3,600	1,281.00	4,611,600	
アミューズ	7,100	1,935.00	13,738,500	
野村総合研究所	249,500	3,285.00	819,607,500	
ドリームインキュベータ	3,700	2,000.00	7,400,000	
サイバネットシステム	9,500	843.00	8,008,500	
クイック	8,600	1,478.00	12,710,800	
ＴＡＣ	7,400	227.00	1,679,800	
ＣＥホールディングス	6,900	452.00	3,118,800	
日本システム技術	2,500	2,492.00	6,230,000	
電通グループ	130,000	4,730.00	614,900,000	
インテージホールディングス	15,400	1,533.00	23,608,200	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,100	1,250.00	7,625,000	
東邦システムサイエンス	3,700	902.00	3,337,400	
ぴあ	4,300	3,035.00	13,050,500	
イオンファンタジー	5,000	2,180.00	10,900,000	
ソースネクスト	57,400	173.00	9,930,200	
シーティーエス	14,700	878.00	12,906,600	
ネクシィーズグループ	4,400	522.00	2,296,800	
インフォコム	14,600	2,073.00	30,265,800	
メディカルシステムネットワーク	12,500	448.00	5,600,000	
日本精化	10,000	1,901.00	19,010,000	
扶桑化学工業	11,500	3,770.00	43,355,000	
トリケミカル研究所	13,700	2,302.00	31,537,400	
シンプレクス・ホールディングス	21,100	1,793.00	37,832,300	
ＨＥＲＯＺ	3,800	892.00	3,389,600	
ラクスル	15,100	2,334.00	35,243,400	

ＩＰＳ	3,700	2,140.00	7,918,000	
ＦＩＧ	14,600	281.00	4,102,600	
システムサポート	4,900	1,016.00	4,978,400	
ＡＤＥＫＡ	58,400	2,413.00	140,919,200	
日油	43,200	4,750.00	205,200,000	
ミヨシ油脂	5,300	1,118.00	5,925,400	
新日本理化	21,000	261.00	5,481,000	
ハリマ化成グループ	9,700	782.00	7,585,400	
イーソル	8,200	618.00	5,067,600	
アルテリア・ネットワークス	15,500	1,348.00	20,894,000	
東海ソフト	2,100	947.00	1,988,700	
ウイングアーク１ｓｔ	10,200	1,289.00	13,147,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,000	1,495.00	4,485,000	
サーバーワークス	2,300	1,958.00	4,503,400	
東名	1,200	743.00	891,600	
ヴィッツ	1,200	1,187.00	1,424,400	
トビラシステムズ	2,700	757.00	2,043,900	
Ｓａｎｓａｎ	45,700	1,117.00	51,046,900	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,400	636.00	1,526,400	
ギフティ	11,800	930.00	10,974,000	
花王	294,400	5,171.00	1,522,342,400	
第一工業製薬	4,800	2,546.00	12,220,800	
石原ケミカル	6,600	1,277.00	8,428,200	
日華化学	4,600	800.00	3,680,000	
ニイタカ	2,700	2,327.00	6,282,900	
三洋化成工業	8,000	5,000.00	40,000,000	
ベース	2,300	6,130.00	14,099,000	
ＪＭＤＣ	16,700	5,400.00	90,180,000	
武田薬品工業	1,069,700	3,811.00	4,076,626,700	
アステラス製薬	1,163,600	1,920.50	2,234,693,800	
住友ファーマ	84,000	1,216.00	102,144,000	
塩野義製薬	166,800	7,110.00	1,185,948,000	
わかもと製薬	15,200	270.00	4,104,000	
日本新薬	33,600	8,590.00	288,624,000	
中外製薬	425,700	3,696.00	1,573,387,200	
科研製薬	20,700	3,940.00	81,558,000	
エーザイ	158,700	5,535.00	878,404,500	
理研ビタミン	13,400	1,662.00	22,270,800	
ロート製薬	68,200	3,355.00	228,811,000	
小野薬品工業	297,700	3,435.00	1,022,599,500	
久光製薬	33,600	3,460.00	116,256,000	
有機合成薬品工業	9,300	272.00	2,529,600	
持田製薬	16,400	3,650.00	59,860,000	
参天製薬	248,300	1,075.00	266,922,500	
扶桑薬品工業	4,700	2,091.00	9,827,700	
日本ケミファ	1,000	1,930.00	1,930,000	
ツムラ	41,100	3,220.00	132,342,000	
日医工	41,200	784.00	32,300,800	
テルモ	385,100	3,761.00	1,448,361,100	

Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	34,000	2,953.00	100,402,000	
キッセイ薬品工業	22,600	2,557.00	57,788,200	
生化学工業	24,100	836.00	20,147,600	
栄研化学	22,700	1,606.00	36,456,200	
日水製薬	5,200	980.00	5,096,000	
鳥居薬品	7,300	3,115.00	22,739,500	
ＪＣＲファーマ	38,400	2,295.00	88,128,000	
東和薬品	19,600	2,860.00	56,056,000	
富士製薬工業	8,100	970.00	7,857,000	
ゼリア新薬工業	23,200	1,984.00	46,028,800	
第一三共	1,042,200	3,283.00	3,421,542,600	
キョーリン製薬ホールディングス	26,400	1,867.00	49,288,800	
大幸薬品	20,500	583.00	11,951,500	
ダイト	8,800	2,664.00	23,443,200	
大塚ホールディングス	275,000	4,439.00	1,220,725,000	
大正製薬ホールディングス	30,000	5,020.00	150,600,000	
ペプチドリーム	71,400	1,949.00	139,158,600	
大日本塗料	15,900	785.00	12,481,500	
日本ペイントホールディングス	500,800	982.00	491,785,600	
関西ペイント	130,500	1,756.00	229,158,000	
神東塗料	9,100	155.00	1,410,500	
中国塗料	30,600	964.00	29,498,400	
日本特殊塗料	9,400	808.00	7,595,200	
藤倉化成	16,900	465.00	7,858,500	
太陽ホールディングス	19,600	3,155.00	61,838,000	
ＤＩＣ	53,600	2,496.00	133,785,600	
サカタインクス	26,500	989.00	26,208,500	
東洋インキＳＣホールディングス	27,300	1,978.00	53,999,400	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	10,800	813.00	8,780,400	
アルプス技研	10,400	1,895.00	19,708,000	
サニックス	22,800	274.00	6,247,200	
ダイオーズ	2,800	1,043.00	2,920,400	
日本空調サービス	13,900	810.00	11,259,000	
オリエンタルランド	148,600	17,855.00	2,653,253,000	
フォーカスシステムズ	8,700	891.00	7,751,700	
ダスキン	29,400	2,774.00	81,555,600	
パーク２４	79,500	1,856.00	147,552,000	
明光ネットワークジャパン	15,300	577.00	8,828,100	
ファルコホールディングス	6,100	2,103.00	12,828,300	
クレスコ	9,700	1,897.00	18,400,900	
フジ・メディア・ホールディングス	125,400	1,137.00	142,579,800	
秀英予備校	3,100	418.00	1,295,800	
田谷	1,700	553.00	940,100	
ラウンドワン	36,300	1,349.00	48,968,700	
リゾートトラスト	58,100	2,167.00	125,902,700	
オービック	42,100	18,730.00	788,533,000	
ジャストシステム	19,000	5,280.00	100,320,000	
ＴＤＣソフト	11,400	1,139.00	12,984,600	
Ｚホールディングス	1,925,700	444.00	855,010,800	
ビー・エム・エル	16,500	3,335.00	55,027,500	

トレンドマイクロ	69,400	7,190.00	498,986,000	
りらいあコミュニケーションズ	19,200	1,048.00	20,121,600	
ＩＤホールディングス	8,600	831.00	7,146,600	
リソー教育	59,300	364.00	21,585,200	
日本オラクル	21,700	8,250.00	179,025,000	
早稲田アカデミー	7,300	1,037.00	7,570,100	
アルファシステムズ	3,100	3,780.00	11,718,000	
フューチャー	28,200	1,740.00	49,068,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,600	1,348.00	10,244,800	
ＳＢテクノロジー	5,800	2,048.00	11,878,400	
トーセ	3,600	729.00	2,624,400	
ユー・エス・エス	145,600	2,169.00	315,806,400	
オービックビジネスコンサルタント	12,700	4,475.00	56,832,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	60,800	2,974.00	180,819,200	
アイティフォー	16,200	811.00	13,138,200	
東京個別指導学院	11,400	581.00	6,623,400	
東計電算	1,500	5,310.00	7,965,000	
サイバーエージェント	306,300	1,368.00	419,018,400	
楽天グループ	646,900	863.00	558,274,700	
エックスネット	2,200	992.00	2,182,400	
クリーク・アンド・リバー社	6,800	1,987.00	13,511,600	
モーニングスター	22,800	533.00	12,152,400	
テー・オー・ダブリュー	25,200	320.00	8,064,000	
大塚商会	72,300	4,015.00	290,284,500	
サイボウズ	17,800	1,196.00	21,288,800	
山田コンサルティンググループ	6,700	1,161.00	7,778,700	
セントラルスポーツ	4,900	2,339.00	11,461,100	
パラカ	3,700	1,779.00	6,582,300	
電通国際情報サービス	18,400	3,945.00	72,588,000	
ＡＣＣＥＳＳ	15,100	558.00	8,425,800	
デジタルガレージ	22,100	4,125.00	91,162,500	
イーエムシステムズ	22,100	947.00	20,928,700	
ウェザーニューズ	4,300	6,310.00	27,133,000	
ＣＩＪ	10,600	760.00	8,056,000	
ビジネスエンジニアリング	1,500	3,920.00	5,880,000	
日本エンタープライズ	13,600	163.00	2,216,800	
WOWOW	6,200	1,542.00	9,560,400	
スカラ	11,200	762.00	8,534,400	
インテリジェント　ウェイブ	6,800	576.00	3,916,800	
フルキャストホールディングス	11,100	2,308.00	25,618,800	
エン・ジャパン	21,700	3,075.00	66,727,500	
あすか製薬ホールディングス	14,600	1,179.00	17,213,400	
サワイグループホールディングス	28,600	4,120.00	117,832,000	
富士フイルムホールディングス	239,200	7,194.00	1,720,804,800	
コニカミノルタ	290,300	486.00	141,085,800	
資生堂	253,500	5,308.00	1,345,578,000	
ライオン	152,400	1,351.00	205,892,400	
高砂香料工業	8,800	2,639.00	23,223,200	
マンダム	27,900	1,238.00	34,540,200	
ミルボン	16,800	5,080.00	85,344,000	

ファンケル	55,100	2,406.00	132,570,600	
コーセー	25,600	11,800.00	302,080,000	
コタ	9,600	1,411.00	13,545,600	
シーボン	1,400	1,701.00	2,381,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	58,000	1,456.00	84,448,000	
ノエビアホールディングス	11,100	5,000.00	55,500,000	
アジュバンホールディングス	3,200	976.00	3,123,200	
新日本製薬	4,600	1,368.00	6,292,800	
エステー	8,800	1,464.00	12,883,200	
アグロ　カネショウ	4,600	1,167.00	5,368,200	
コニシ	21,800	1,526.00	33,266,800	
長谷川香料	23,500	2,588.00	60,818,000	
星光ＰＭＣ	7,800	566.00	4,414,800	
小林製薬	38,100	8,710.00	331,851,000	
荒川化学工業	10,800	1,022.00	11,037,600	
メック	9,900	2,284.00	22,611,600	
日本高純度化学	3,600	2,281.00	8,211,600	
タカラバイオ	35,600	2,082.00	74,119,200	
ＪＣＵ	14,700	3,310.00	48,657,000	
新田ゼラチン	8,500	623.00	5,295,500	
ＯＡＴアグリオ	5,600	1,165.00	6,524,000	
デクセリアルズ	35,400	2,815.00	99,651,000	
アース製薬	11,200	5,430.00	60,816,000	
北興化学工業	12,300	1,021.00	12,558,300	
大成ラミック	4,000	2,561.00	10,244,000	
クミアイ化学工業	50,700	910.00	46,137,000	
日本農薬	24,400	619.00	15,103,600	
富士興産	3,300	890.00	2,937,000	
ニチレキ	16,500	1,217.00	20,080,500	
ユシロ化学工業	6,900	1,020.00	7,038,000	
ビーピー・カストロール	4,900	1,224.00	5,997,600	
富士石油	34,200	280.00	9,576,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,600	1,193.00	5,487,800	
出光興産	146,900	3,615.00	531,043,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,047,200	477.40	977,333,280	
コスモエネルギーホールディングス	44,200	3,260.00	144,092,000	
テスホールディングス	11,800	1,356.00	16,000,800	
インフロニア・ホールディングス	173,700	955.00	165,883,500	
横浜ゴム	74,000	1,703.00	126,022,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	69,400	1,475.00	102,365,000	
ブリヂストン	382,000	4,763.00	1,819,466,000	
住友ゴム工業	118,600	1,145.00	135,797,000	
藤倉コンポジット	10,900	683.00	7,444,700	
オカモト	7,600	3,925.00	29,830,000	
アキレス	8,800	1,343.00	11,818,400	
フコク	6,000	943.00	5,658,000	
ニッタ	13,600	2,825.00	38,420,000	
クリエートメディック	3,800	984.00	3,739,200	
住友理工	26,400	560.00	14,784,000	
三ツ星ベルト	16,500	2,056.00	33,924,000	

バンドー化学	22,000	873.00	19,206,000	
ＡＧＣ	121,700	4,880.00	593,896,000	
日本板硝子	63,900	390.00	24,921,000	
石塚硝子	2,300	1,772.00	4,075,600	
有沢製作所	19,500	916.00	17,862,000	
日本山村硝子	5,200	793.00	4,123,600	
日本電気硝子	53,300	2,731.00	145,562,300	
オハラ	5,400	1,096.00	5,918,400	
住友大阪セメント	24,100	3,535.00	85,193,500	
太平洋セメント	77,300	2,094.00	161,866,200	
リソルホールディングス	1,500	4,465.00	6,697,500	
日本ヒューム	13,100	668.00	8,750,800	
日本コンクリート工業	26,100	310.00	8,091,000	
三谷セキサン	6,100	4,775.00	29,127,500	
アジアパイルホールディングス	20,600	429.00	8,837,400	
東海カーボン	110,800	1,038.00	115,010,400	
日本カーボン	7,000	4,225.00	29,575,000	
東洋炭素	8,600	2,795.00	24,037,000	
ノリタケカンパニーリミテド	7,300	4,170.00	30,441,000	
ＴＯＴＯ	92,200	4,295.00	395,999,000	
日本碍子	143,000	1,774.00	253,682,000	
日本特殊陶業	100,600	2,315.00	232,889,000	
ダントーホールディングス	8,700	239.00	2,079,300	
ＭＡＲＵＷＡ	4,700	15,710.00	73,837,000	
品川リフラクトリーズ	3,200	3,680.00	11,776,000	
黒崎播磨	2,300	4,090.00	9,407,000	
ヨータイ	8,700	1,365.00	11,875,500	
東京窯業	16,200	282.00	4,568,400	
ニッカトー	6,000	502.00	3,012,000	
フジミインコーポレーテッド	10,900	5,590.00	60,931,000	
クニミネ工業	4,400	971.00	4,272,400	
エーアンドエーマテリアル	2,500	857.00	2,142,500	
ニチアス	30,500	2,318.00	70,699,000	
日本製鉄	589,000	1,970.50	1,160,624,500	
神戸製鋼所	245,500	561.00	137,725,500	
中山製鋼所	20,400	426.00	8,690,400	
合同製鐵	7,000	1,251.00	8,757,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	346,100	1,481.00	512,574,100	
東京製鐵	43,700	1,401.00	61,223,700	
共英製鋼	14,600	1,296.00	18,921,600	
大和工業	23,800	4,205.00	100,079,000	
東京鐵鋼	5,800	1,290.00	7,482,000	
大阪製鐵	7,200	1,318.00	9,489,600	
淀川製鋼所	16,700	2,431.00	40,597,700	
丸一鋼管	41,400	2,803.00	116,044,200	
モリ工業	3,700	2,481.00	9,179,700	
大同特殊鋼	20,800	3,525.00	73,320,000	
日本高周波鋼業	3,800	332.00	1,261,600	
日本冶金工業	9,600	2,493.00	23,932,800	

山陽特殊製鋼	13,100	2,037.00	26,684,700	
愛知製鋼	7,500	2,135.00	16,012,500	
日立金属	145,000	2,041.00	295,945,000	
日本金属	3,400	1,161.00	3,947,400	
大平洋金属	8,300	3,485.00	28,925,500	
新日本電工	82,700	307.00	25,388,900	
栗本鐵工所	6,000	1,582.00	9,492,000	
虹　技	1,900	917.00	1,742,300	
日本鋳鉄管	1,400	1,006.00	1,408,400	
日本製鋼所	38,800	3,025.00	117,370,000	
三菱製鋼	8,600	1,050.00	9,030,000	
日亜鋼業	16,900	260.00	4,394,000	
日本精線	2,200	4,110.00	9,042,000	
エンビプロ・ホールディングス	8,900	947.00	8,428,300	
大紀アルミニウム工業所	19,000	1,338.00	25,422,000	
日本軽金属ホールディングス	34,000	1,651.00	56,134,000	
三井金属鉱業	36,300	3,225.00	117,067,500	
東邦亜鉛	7,300	2,728.00	19,914,400	
三菱マテリアル	85,200	2,016.00	171,763,200	
住友金属鉱山	163,800	5,495.00	900,081,000	
ＤＯＷＡホールディングス	34,900	5,420.00	189,158,000	
古河機械金属	21,800	1,277.00	27,838,600	
エス・サイエンス	65,600	28.00	1,836,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,500	1,226.00	19,003,000	
東邦チタニウム	24,100	1,448.00	34,896,800	
ＵＡＣＪ	19,700	2,171.00	42,768,700	
ＣＫサンエツ	2,700	3,950.00	10,665,000	
古河電気工業	40,800	2,127.00	86,781,600	
住友電気工業	492,000	1,434.00	705,528,000	
フジクラ	149,900	619.00	92,788,100	
昭和電線ホールディングス	11,700	1,722.00	20,147,400	
東京特殊電線	2,000	2,656.00	5,312,000	
タツタ電線	23,800	465.00	11,067,000	
カナレ電気	2,100	1,687.00	3,542,700	
平河ヒューテック	7,500	1,102.00	8,265,000	
リョービ	15,600	1,086.00	16,941,600	
アーレスティ	14,400	355.00	5,112,000	
アサヒホールディングス	53,900	2,091.00	112,704,900	
東洋製罐グループホールディングス	80,000	1,413.00	113,040,000	
ホッカンホールディングス	7,100	1,249.00	8,867,900	
コロナ	7,400	827.00	6,119,800	
横河ブリッジホールディングス	21,800	1,892.00	41,245,600	
駒井ハルテック	2,400	1,896.00	4,550,400	
高田機工	700	2,734.00	1,913,800	
三和ホールディングス	126,800	1,182.00	149,877,600	
文化シヤッター	41,700	964.00	40,198,800	
三協立山	16,900	597.00	10,089,300	
アルインコ	9,600	850.00	8,160,000	
東洋シヤッター	2,200	570.00	1,254,000	
ＬＩＸＩＬ	211,800	2,336.00	494,764,800	

日本フイルコン	9,300	510.00	4,743,000	
ノーリツ	24,300	1,496.00	36,352,800	
長府製作所	13,700	1,882.00	25,783,400	
リンナイ	24,700	8,130.00	200,811,000	
ユニプレス	20,900	767.00	16,030,300	
ダイニチ工業	6,500	626.00	4,069,000	
日東精工	16,300	502.00	8,182,600	
三洋工業	1,400	1,780.00	2,492,000	
岡部	23,700	660.00	15,642,000	
ジーテクト	16,100	1,272.00	20,479,200	
東プレ	23,500	1,107.00	26,014,500	
高周波熱錬	22,000	585.00	12,870,000	
東京製綱	8,300	840.00	6,972,000	
サンコール	11,600	505.00	5,858,000	
モリテックスチール	10,400	292.00	3,036,800	
パイオラックス	18,800	1,480.00	27,824,000	
エイチワン	12,900	597.00	7,701,300	
日本発条	120,300	846.00	101,773,800	
中央発條	6,500	690.00	4,485,000	
アドバネクス	1,800	1,733.00	3,119,400	
三浦工業	56,500	2,607.00	147,295,500	
タクマ	43,300	1,455.00	63,001,500	
テクノプロ・ホールディングス	77,900	2,970.00	231,363,000	
アトラグループ	2,400	256.00	614,400	
インターワークス	4,000	379.00	1,516,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,000	3,960.00	23,760,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	8,400	2,400.00	20,160,000	
ファーストロジック	2,400	768.00	1,843,200	
三機サービス	2,300	1,203.00	2,766,900	
Ｇｕｎｏｓｙ	7,100	980.00	6,958,000	
デザインワン・ジャパン	3,400	184.00	625,600	
イー・ガーディアン	5,000	2,774.00	13,870,000	
リブセンス	7,800	162.00	1,263,600	
ジャパンマテリアル	40,000	1,882.00	75,280,000	
ベクトル	18,200	1,179.00	21,457,800	
ウチヤマホールディングス	6,700	317.00	2,123,900	
チャーム・ケア・コーポレーション	9,700	1,298.00	12,590,600	
キャリアリンク	4,800	1,441.00	6,916,800	
ＩＢＪ	10,600	690.00	7,314,000	
アサンテ	5,800	1,470.00	8,526,000	
バリューＨＲ	10,700	1,308.00	13,995,600	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	10,700	3,400.00	36,380,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,000	1,150.00	5,750,000	
ＥＲＩホールディングス	3,600	1,272.00	4,579,200	
アビスト	2,100	2,770.00	5,817,000	
シグマクシス・ホールディングス	15,700	1,017.00	15,966,900	
ウィルグループ	9,700	1,070.00	10,379,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,100	163.00	2,624,300	

メドピア	9,700	2,594.00	25,161,800	
レアジョブ	2,500	758.00	1,895,000	
リクルートホールディングス	979,400	4,471.00	4,378,897,400	
エラン	17,900	957.00	17,130,300	
ツガミ	28,900	1,196.00	34,564,400	
オークマ	14,700	4,745.00	69,751,500	
芝浦機械	15,200	2,964.00	45,052,800	
アマダ	212,300	1,019.00	216,333,700	
アイダエンジニアリング	33,300	959.00	31,934,700	
滝澤鉄工所	4,100	1,290.00	5,289,000	
ＦＵＪＩ	59,200	2,165.00	128,168,000	
牧野フライス製作所	14,400	4,205.00	60,552,000	
オーエスジー	61,500	1,613.00	99,199,500	
ダイジェット工業	1,600	942.00	1,507,200	
旭ダイヤモンド工業	34,500	571.00	19,699,500	
ＤＭＧ森精機	78,000	1,621.00	126,438,000	
ソディック	29,200	740.00	21,608,000	
ディスコ	19,800	31,000.00	613,800,000	
日東工器	7,100	1,490.00	10,579,000	
日進工具	10,600	1,432.00	15,179,200	
パンチ工業	11,400	473.00	5,392,200	
冨士ダイス	6,300	637.00	4,013,100	
土木管理総合試験所	6,200	331.00	2,052,200	
ネットマーケティング	6,300	651.00	4,101,300	
日本郵政	1,627,400	909.90	1,480,771,260	
ベルシステム２４ホールディングス	18,700	1,465.00	27,395,500	
鎌倉新書	14,800	543.00	8,036,400	
ＳＭＮ	2,900	599.00	1,737,100	
一蔵	1,800	380.00	684,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,300	698.00	1,605,400	
エアトリ	8,100	2,974.00	24,089,400	
アトラエ	9,100	1,665.00	15,151,500	
ストライク	5,200	3,785.00	19,682,000	
ソラスト	31,900	831.00	26,508,900	
セラク	4,100	1,146.00	4,698,600	
インソース	13,200	1,976.00	26,083,200	
豊田自動織機	105,600	8,040.00	849,024,000	
豊和工業	7,000	806.00	5,642,000	
ＯＫＫ	4,900	1,311.00	6,423,900	
石川製作所	3,500	1,399.00	4,896,500	
東洋機械金属	8,900	586.00	5,215,400	
津田駒工業	2,600	572.00	1,487,200	
エンシュウ	3,000	672.00	2,016,000	
島精機製作所	19,700	1,785.00	35,164,500	
オプトラン	16,900	1,811.00	30,605,900	
ＮＣホールディングス	3,100	1,650.00	5,115,000	
イワキ	8,600	1,071.00	9,210,600	
フリュー	11,900	1,009.00	12,007,100	
ヤマシンフィルタ	25,000	343.00	8,575,000	
日阪製作所	15,800	754.00	11,913,200	

やまびこ	24,900	1,411.00	35,133,900	
野村マイクロ・サイエンス	4,600	3,655.00	16,813,000	
平田機工	6,200	4,735.00	29,357,000	
ペガサスミシン製造	13,700	609.00	8,343,300	
マルマエ	5,500	2,125.00	11,687,500	
タツモ	6,300	1,327.00	8,360,100	
ナブテスコ	75,000	2,792.00	209,400,000	
三井海洋開発	14,400	1,232.00	17,740,800	
レオン自動機	14,400	1,117.00	16,084,800	
ＳＭＣ	39,900	61,620.00	2,458,638,000	
ホソカワミクロン	9,200	2,404.00	22,116,800	
ユニオンツール	5,000	3,735.00	18,675,000	
オイレス工業	18,400	1,504.00	27,673,600	
日精エー・エス・ビー機械	4,800	2,942.00	14,121,600	
サトーホールディングス	17,700	1,818.00	32,178,600	
技研製作所	11,900	3,530.00	42,007,000	
日本エアーテック	6,200	1,049.00	6,503,800	
カワタ	4,200	958.00	4,023,600	
日精樹脂工業	9,200	966.00	8,887,200	
オカダアイヨン	4,300	1,549.00	6,660,700	
ワイエイシイホールディングス	5,400	1,443.00	7,792,200	
小松製作所	616,800	3,085.00	1,902,828,000	
住友重機械工業	76,200	2,760.00	210,312,000	
日立建機	54,500	3,080.00	167,860,000	
日工	18,200	612.00	11,138,400	
巴工業	5,200	2,298.00	11,949,600	
井関農機	12,000	1,258.00	15,096,000	
ＴＯＷＡ	11,600	1,967.00	22,817,200	
丸山製作所	2,600	1,514.00	3,936,400	
北川鉄工所	5,900	1,295.00	7,640,500	
シンニッタン	16,400	216.00	3,542,400	
ローツェ	6,700	10,150.00	68,005,000	
タカキタ	4,500	567.00	2,551,500	
クボタ	659,300	2,250.00	1,483,425,000	
荏原実業	6,300	2,404.00	15,145,200	
東洋エンジニアリング	18,000	616.00	11,088,000	
三菱化工機	4,300	1,941.00	8,346,300	
月島機械	23,900	1,035.00	24,736,500	
帝国電機製作所	9,300	1,656.00	15,400,800	
東京機械製作所	5,500	806.00	4,433,000	
新東工業	28,600	680.00	19,448,000	
澁谷工業	11,500	2,305.00	26,507,500	
アイチコーポレーション	19,500	894.00	17,433,000	
小森コーポレーション	33,800	756.00	25,552,800	
鶴見製作所	10,200	1,880.00	19,176,000	
住友精密工業	2,000	2,202.00	4,404,000	
日本ギア工業	5,200	258.00	1,341,600	
酒井重工業	2,400	3,050.00	7,320,000	
荏原製作所	54,400	5,960.00	324,224,000	
石井鐵工所	1,000	2,850.00	2,850,000	

西島製作所	11,900	1,313.00	15,624,700	
北越工業	12,400	874.00	10,837,600	
ダイキン工業	165,100	19,125.00	3,157,537,500	
オルガノ	3,900	8,760.00	34,164,000	
トーヨーカネツ	5,000	2,445.00	12,225,000	
栗田工業	72,000	4,435.00	319,320,000	
椿本チエイン	17,800	2,997.00	53,346,600	
大同工業	5,900	916.00	5,404,400	
日機装	38,700	829.00	32,082,300	
木村化工機	11,100	778.00	8,635,800	
レイズネクスト	20,000	1,079.00	21,580,000	
アネスト岩田	21,200	829.00	17,574,800	
ダイフク	71,300	7,820.00	557,566,000	
サムコ	3,500	2,383.00	8,340,500	
加藤製作所	6,500	777.00	5,050,500	
油研工業	1,700	1,695.00	2,881,500	
タダノ	69,300	903.00	62,577,900	
フジテック	46,400	2,643.00	122,635,200	
ＣＫＤ	38,200	1,646.00	62,877,200	
キトー	11,300	1,678.00	18,961,400	
平和	38,000	1,911.00	72,618,000	
理想科学工業	10,600	2,433.00	25,789,800	
ＳＡＮＫＹＯ	29,400	3,785.00	111,279,000	
日本金銭機械	13,800	730.00	10,074,000	
マースグループホールディングス	8,700	1,660.00	14,442,000	
フクシマガリレイ	9,000	3,730.00	33,570,000	
オーイズミ	4,800	465.00	2,232,000	
ダイコク電機	6,300	1,257.00	7,919,100	
竹内製作所	20,700	2,472.00	51,170,400	
アマノ	35,600	2,498.00	88,928,800	
ＪＵＫＩ	18,900	747.00	14,118,300	
サンデン	19,000	190.00	3,610,000	
ジャノメ	11,600	690.00	8,004,000	
ブラザー工業	162,500	2,297.00	373,262,500	
マックス	17,400	1,558.00	27,109,200	
モリタホールディングス	21,800	1,307.00	28,492,600	
グローリー	34,100	2,143.00	73,076,300	
新晃工業	12,700	1,575.00	20,002,500	
大和冷機工業	19,700	1,105.00	21,768,500	
セガサミーホールディングス	135,000	2,299.00	310,365,000	
日本ピストンリング	5,000	1,312.00	6,560,000	
リケン	5,600	2,444.00	13,686,400	
ＴＰＲ	17,300	1,274.00	22,040,200	
ツバキ・ナカシマ	29,900	899.00	26,880,100	
ホシザキ	39,800	8,000.00	318,400,000	
大豊工業	11,100	633.00	7,026,300	
日本精工	248,400	725.00	180,090,000	
ＮＴＮ	277,100	213.00	59,022,300	
ジェイテクト	125,700	938.00	117,906,600	
不二越	10,900	3,680.00	40,112,000	

ミネベアミツミ	228,600	2,472.00	565,099,200	
日本トムソン	35,100	503.00	17,655,300	
ＴＨＫ	76,800	2,610.00	200,448,000	
ユーシン精機	10,800	632.00	6,825,600	
前澤給装工業	9,800	907.00	8,888,600	
イーグル工業	16,100	1,029.00	16,566,900	
前澤工業	8,800	633.00	5,570,400	
日本ピラー工業	13,000	2,525.00	32,825,000	
キッツ	43,200	660.00	28,512,000	
日立製作所	654,600	6,383.00	4,178,311,800	
東芝	237,800	5,461.00	1,298,625,800	
三菱電機	1,330,700	1,355.00	1,803,098,500	
富士電機	79,900	5,790.00	462,621,000	
東洋電機製造	4,900	930.00	4,557,000	
安川電機	142,700	4,180.00	596,486,000	
シンフォニア　テクノロジー	15,500	1,270.00	19,685,000	
明電舎	21,800	2,337.00	50,946,600	
オリジン	3,300	1,330.00	4,389,000	
山洋電気	5,700	5,520.00	31,464,000	
デンヨー	11,000	1,598.00	17,578,000	
ＰＨＣホールディングス	21,000	1,586.00	33,306,000	
ベイカレント・コンサルティング	9,200	41,050.00	377,660,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,500	2,377.00	5,942,500	
アイモバイル	4,600	1,337.00	6,150,200	
キャリアインデックス	4,400	526.00	2,314,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	5,300	814.00	4,314,200	
船場	1,500	700.00	1,050,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	41,300	1,660.00	68,558,000	
フルテック	1,900	1,389.00	2,639,100	
グリーンズ	4,900	622.00	3,047,800	
ツナググループ・ホールディングス	3,100	268.00	830,800	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	3,900	466.00	1,817,400	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,900	712.00	1,352,800	
ウェルビー	8,400	926.00	7,778,400	
エル・ティー・エス	1,700	2,763.00	4,697,100	
ミダックホールディングス	5,900	1,965.00	11,593,500	
日総工産	10,100	633.00	6,393,300	
キュービーネットホールディングス	6,000	1,364.00	8,184,000	
ＲＰＡホールディングス	18,200	375.00	6,825,000	
三櫻工業	18,800	700.00	13,160,000	
マキタ	161,700	3,647.00	589,719,900	
東芝テック	14,600	4,375.00	63,875,000	
芝浦メカトロニクス	2,400	7,090.00	17,016,000	
マブチモーター	31,500	3,505.00	110,407,500	
日本電産	335,900	8,214.00	2,759,082,600	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,600	399.00	2,234,400	
トレックス・セミコンダクター	6,500	2,228.00	14,482,000	
東光高岳	7,600	1,687.00	12,821,200	

ダブル・スコープ	39,100	879.00	34,368,900	
宮越ホールディングス	5,100	831.00	4,238,100	
ダイヘン	14,100	3,745.00	52,804,500	
ヤーマン	22,200	1,150.00	25,530,000	
ＪＶＣケンウッド	110,800	198.00	21,938,400	
ミマキエンジニアリング	12,200	702.00	8,564,400	
Ｉ－ＰＥＸ	6,300	1,424.00	8,971,200	
日新電機	31,900	1,384.00	44,149,600	
大崎電気工業	24,400	500.00	12,200,000	
オムロン	113,300	7,215.00	817,459,500	
日東工業	17,100	1,537.00	26,282,700	
ＩＤＥＣ	16,800	2,278.00	38,270,400	
正興電機製作所	4,100	1,074.00	4,403,400	
不二電機工業	2,700	1,126.00	3,040,200	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	43,100	2,272.00	97,923,200	
サクサホールディングス	2,600	1,501.00	3,902,600	
メルコホールディングス	3,300	3,860.00	12,738,000	
テクノメディカ	3,100	1,544.00	4,786,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,800	897.00	3,408,600	
日本電気	169,100	5,420.00	916,522,000	
富士通	122,500	20,080.00	2,459,800,000	
沖電気工業	54,000	862.00	46,548,000	
岩崎通信機	5,800	800.00	4,640,000	
電気興業	7,000	2,448.00	17,136,000	
サンケン電気	12,400	4,795.00	59,458,000	
ナカヨ	2,100	1,072.00	2,251,200	
アイホン	7,200	2,002.00	14,414,400	
ルネサスエレクトロニクス	739,200	1,375.00	1,016,400,000	
セイコーエプソン	163,300	1,947.00	317,945,100	
ワコム	105,600	963.00	101,692,800	
アルバック	27,100	5,050.00	136,855,000	
アクセル	5,500	880.00	4,840,000	
ＥＩＺＯ	10,300	3,510.00	36,153,000	
ジャパンディスプレイ	464,800	71.00	33,000,800	
日本信号	32,700	915.00	29,920,500	
京三製作所	28,600	439.00	12,555,400	
能美防災	17,100	1,928.00	32,968,800	
ホーチキ	9,400	1,159.00	10,894,600	
星和電機	6,000	515.00	3,090,000	
エレコム	31,200	1,574.00	49,108,800	
パナソニック　ホールディングス	1,451,500	1,152.00	1,672,128,000	
シャープ	146,600	1,076.00	157,741,600	
アンリツ	87,600	1,445.00	126,582,000	
富士通ゼネラル	37,000	2,181.00	80,697,000	
ソニーグループ	852,500	10,840.00	9,241,100,000	
ＴＤＫ	197,100	4,040.00	796,284,000	
帝国通信工業	6,100	1,403.00	8,558,300	
タムラ製作所	51,300	544.00	27,907,200	
アルプスアルパイン	117,300	1,357.00	159,176,100	

池上通信機	4,200	604.00	2,536,800	
日本電波工業	13,600	1,145.00	15,572,000	
鈴木	6,700	755.00	5,058,500	
メイコー	14,700	3,500.00	51,450,000	
日本トリム	2,500	2,311.00	5,777,500	
ローランド　ディー．ジー．	8,000	3,325.00	26,600,000	
フォスター電機	13,400	718.00	9,621,200	
ＳＭＫ	3,200	2,147.00	6,870,400	
ヨコオ	9,700	2,541.00	24,647,700	
ティアック	21,300	115.00	2,449,500	
ホシデン	31,900	1,301.00	41,501,900	
ヒロセ電機	20,400	17,300.00	352,920,000	
日本航空電子工業	29,900	1,868.00	55,853,200	
ＴＯＡ	14,700	819.00	12,039,300	
マクセル	26,300	1,152.00	30,297,600	
古野電気	16,200	975.00	15,795,000	
ユニデンホールディングス	3,000	3,525.00	10,575,000	
スミダコーポレーション	12,700	839.00	10,655,300	
アイコム	4,900	2,424.00	11,877,600	
リオン	5,000	2,439.00	12,195,000	
本多通信工業	10,700	455.00	4,868,500	
横河電機	132,400	2,067.00	273,670,800	
新電元工業	5,100	2,848.00	14,524,800	
アズビル	79,700	3,785.00	301,664,500	
東亜ディーケーケー	6,900	915.00	6,313,500	
日本光電工業	55,000	3,145.00	172,975,000	
チノー	4,400	1,631.00	7,176,400	
共和電業	13,500	353.00	4,765,500	
日本電子材料	6,700	1,912.00	12,810,400	
堀場製作所	24,600	6,240.00	153,504,000	
アドバンテスト	101,200	8,550.00	865,260,000	
小野測器	5,800	475.00	2,755,000	
エスペック	10,700	1,708.00	18,275,600	
キーエンス	123,300	50,240.00	6,194,592,000	
日置電機	6,500	7,290.00	47,385,000	
シスメックス	109,300	7,838.00	856,693,400	
日本マイクロニクス	22,500	1,491.00	33,547,500	
メガチップス	12,100	3,250.00	39,325,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,900	2,842.00	16,767,800	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	10,700	663.00	7,094,100	
澤藤電機	1,700	1,478.00	2,512,600	
デンソー	288,600	7,602.00	2,193,937,200	
原田工業	6,600	923.00	6,091,800	
コーセル	15,100	765.00	11,551,500	
イリソ電子工業	11,400	3,095.00	35,283,000	
オプテックスグループ	22,300	1,646.00	36,705,800	
千代田インテグレ	5,600	2,104.00	11,782,400	
レーザーテック	58,400	17,500.00	1,022,000,000	
スタンレー電気	92,500	2,234.00	206,645,000	
岩崎電気	4,800	2,309.00	11,083,200	

ウシオ電機	68,000	1,698.00	115,464,000	
岡谷電機産業	9,900	276.00	2,732,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	11,700	292.00	3,416,400	
エノモト	3,800	1,539.00	5,848,200	
日本セラミック	12,600	2,258.00	28,450,800	
遠藤照明	6,300	830.00	5,229,000	
古河電池	9,700	1,185.00	11,494,500	
双信電機	6,500	530.00	3,445,000	
山一電機	9,500	1,715.00	16,292,500	
図研	8,900	2,950.00	26,255,000	
日本電子	27,600	5,910.00	163,116,000	
カシオ計算機	91,200	1,320.00	120,384,000	
ファナック	119,400	19,080.00	2,278,152,000	
日本シイエムケイ	25,700	525.00	13,492,500	
エンプラス	3,400	3,470.00	11,798,000	
大真空	17,800	1,122.00	19,971,600	
ローム	59,500	9,230.00	549,185,000	
浜松ホトニクス	95,300	5,730.00	546,069,000	
三井ハイテック	12,800	11,220.00	143,616,000	
新光電気工業	40,000	5,060.00	202,400,000	
京セラ	191,500	6,817.00	1,305,455,500	
協栄産業	1,400	1,298.00	1,817,200	
太陽誘電	64,200	5,340.00	342,828,000	
村田製作所	390,300	8,208.00	3,203,582,400	
双葉電子工業	23,400	669.00	15,654,600	
日東電工	82,300	8,980.00	739,054,000	
北陸電気工業	5,100	1,187.00	6,053,700	
東海理化電機製作所	35,800	1,385.00	49,583,000	
ニチコン	40,600	1,254.00	50,912,400	
日本ケミコン	12,900	1,944.00	25,077,600	
ＫＯＡ	19,900	1,580.00	31,442,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	49,100	359.00	17,626,900	
日立造船	112,700	693.00	78,101,100	
三菱重工業	209,100	4,562.00	953,914,200	
川崎重工業	96,900	2,356.00	228,296,400	
ＩＨＩ	85,000	2,984.00	253,640,000	
名村造船所	38,900	349.00	13,576,100	
サノヤスホールディングス	16,800	127.00	2,133,600	
スプリックス	3,900	1,182.00	4,609,800	
マネジメントソリューションズ	6,400	4,555.00	29,152,000	
プロレド・パートナーズ	2,900	528.00	1,531,200	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	3,100	405.00	1,255,500	
テノ．ホールディングス	1,600	618.00	988,800	
フロンティア・マネジメント	3,400	930.00	3,162,000	
ピアラ	2,100	857.00	1,799,700	
コプロ・ホールディングス	2,500	1,006.00	2,515,000	
ギークス	2,200	1,113.00	2,448,600	
カーブスホールディングス	35,700	701.00	25,025,700	
フォーラムエンジニアリング	8,700	836.00	7,273,200	

ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	2,400	1,851.00	4,442,400	
日本車輌製造	4,800	2,062.00	9,897,600	
三菱ロジスネクスト	18,000	757.00	13,626,000	
近畿車輌	1,500	1,206.00	1,809,000	
一家ホールディングス	2,500	535.00	1,337,500	
フルサト・マルカホールディングス	12,500	3,485.00	43,562,500	
ヤマエグループホールディングス	8,600	1,047.00	9,004,200	
藤久ホールディングス	3,300	690.00	2,277,000	
ＦＰＧ	45,100	827.00	37,297,700	
島根銀行	4,000	524.00	2,096,000	
じもとホールディングス	9,400	625.00	5,875,000	
全国保証	32,000	4,540.00	145,280,000	
めぶきフィナンシャルグループ	612,900	267.00	163,644,300	
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,400	1,169.00	12,157,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,400	1,771.00	29,044,400	
九州フィナンシャルグループ	260,900	398.00	103,838,200	
かんぽ生命保険	135,100	2,174.00	293,707,400	
ゆうちょ銀行	317,000	986.00	312,562,000	
あんしん保証	5,400	302.00	1,630,800	
富山第一銀行	31,600	327.00	10,333,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	732,500	480.00	351,600,000	
ジェイリース	4,500	1,388.00	6,246,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	78,900	790.00	62,331,000	
イントラスト	5,700	530.00	3,021,000	
日本モーゲージサービス	7,500	950.00	7,125,000	
ＣＡＳＡ	4,800	810.00	3,888,000	
アルヒ	19,800	996.00	19,720,800	
プレミアグループ	6,800	3,685.00	25,058,000	
日産自動車	1,604,900	519.40	833,585,060	
いすゞ自動車	416,100	1,537.00	639,545,700	
トヨタ自動車	6,664,500	2,245.00	14,961,802,500	
日野自動車	169,900	687.00	116,721,300	
三菱自動車工業	503,500	340.00	171,190,000	
エフテック	9,300	537.00	4,994,100	
レシップホールディングス	5,100	565.00	2,881,500	
ＧＭＢ	2,500	724.00	1,810,000	
ファルテック	2,500	632.00	1,580,000	
武蔵精密工業	30,300	1,337.00	40,511,100	
日産車体	20,000	579.00	11,580,000	
新明和工業	37,400	914.00	34,183,600	
極東開発工業	24,100	1,334.00	32,149,400	
トピー工業	10,900	1,020.00	11,118,000	
ティラド	3,300	2,270.00	7,491,000	
曙ブレーキ工業	74,700	153.00	11,429,100	
タチエス	23,400	1,031.00	24,125,400	
ＮＯＫ	60,900	1,122.00	68,329,800	

フタバ産業	32,800	386.00	12,660,800	
ＫＹＢ	13,400	2,914.00	39,047,600	
市光工業	16,200	373.00	6,042,600	
大同メタル工業	26,200	562.00	14,724,400	
プレス工業	64,000	396.00	25,344,000	
ミクニ	16,900	383.00	6,472,700	
太平洋工業	27,600	993.00	27,406,800	
河西工業	16,800	273.00	4,586,400	
アイシン	99,600	3,780.00	376,488,000	
マツダ	418,200	967.00	404,399,400	
今仙電機製作所	9,000	584.00	5,256,000	
本田技研工業	1,046,100	3,394.00	3,550,463,400	
スズキ	297,400	3,946.00	1,173,540,400	
ＳＵＢＡＲＵ	379,200	1,997.50	757,452,000	
安永	6,200	687.00	4,259,400	
ヤマハ発動機	177,600	2,765.00	491,064,000	
小糸製作所	72,500	4,570.00	331,325,000	
ＴＢＫ	15,000	343.00	5,145,000	
エクセディ	20,500	1,682.00	34,481,000	
ミツバ	23,800	351.00	8,353,800	
豊田合成	42,100	1,896.00	79,821,600	
愛三工業	21,300	755.00	16,081,500	
盟和産業	1,500	1,035.00	1,552,500	
日本プラスト	10,600	495.00	5,247,000	
ヨロズ	12,100	755.00	9,135,500	
エフ・シー・シー	22,200	1,342.00	29,792,400	
新家工業	3,200	1,562.00	4,998,400	
シマノ	53,100	22,965.00	1,219,441,500	
テイ・エス　テック	57,400	1,376.00	78,982,400	
三十三フィナンシャルグループ	12,000	1,445.00	17,340,000	
第四北越フィナンシャルグループ	20,900	2,530.00	52,877,000	
ひろぎんホールディングス	189,200	633.00	119,763,600	
マーキュリアホールディングス	6,000	571.00	3,426,000	
おきなわフィナンシャルグループ	11,900	2,219.00	26,406,100	
ダイレクトマーケティングミックス	14,500	1,609.00	23,330,500	
ポピンズ	3,000	1,937.00	5,811,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	10,500	2,427.00	25,483,500	
十六フィナンシャルグループ	17,200	2,221.00	38,201,200	
北國フィナンシャルホールディングス	12,100	4,325.00	52,332,500	
ネットプロテクションズホールディングス	40,700	606.00	24,664,200	
プロクレアホールディングス	14,100	1,820.00	25,662,000	
ジャムコ	7,900	779.00	6,154,100	
小野建	12,600	1,535.00	19,341,000	
はるやまホールディングス	6,500	455.00	2,957,500	
南陽	2,700	1,825.00	4,927,500	
ノジマ	21,700	2,998.00	65,056,600	
佐鳥電機	8,400	1,290.00	10,836,000	
カッパ・クリエイト	18,800	1,320.00	24,816,000	
エコートレーディング	2,600	579.00	1,505,400	

伯東	8,200	2,887.00	23,673,400	
コンドーテック	10,100	1,079.00	10,897,900	
中山福	7,200	344.00	2,476,800	
ライトオン	10,100	708.00	7,150,800	
ナガイレーベン	17,200	1,925.00	33,110,000	
三菱食品	12,900	3,260.00	42,054,000	
良品計画	154,200	1,187.00	183,035,400	
パリミキホールディングス	17,100	263.00	4,497,300	
松田産業	9,800	2,283.00	22,373,400	
第一興商	25,400	3,580.00	90,932,000	
メディパルホールディングス	137,800	2,222.00	306,191,600	
アドヴァングループ	12,900	780.00	10,062,000	
ＳＰＫ	5,400	1,295.00	6,993,000	
萩原電気ホールディングス	4,900	1,916.00	9,388,400	
アルビス	4,200	2,227.00	9,353,400	
アズワン	19,200	6,480.00	124,416,000	
スズデン	4,500	2,127.00	9,571,500	
尾家産業	2,800	892.00	2,497,600	
シモジマ	8,300	920.00	7,636,000	
ドウシシャ	12,600	1,566.00	19,731,600	
小津産業	3,000	2,000.00	6,000,000	
コナカ	15,400	336.00	5,174,400	
高速	7,800	1,489.00	11,614,200	
ハウス　オブ　ローゼ	1,800	1,664.00	2,995,200	
Ｇ－７ホールディングス	14,900	1,526.00	22,737,400	
たけびし	4,900	1,446.00	7,085,400	
イオン北海道	21,700	1,005.00	21,808,500	
コジマ	23,000	608.00	13,984,000	
ヒマラヤ	4,500	910.00	4,095,000	
コーナン商事	19,000	3,655.00	69,445,000	
ネットワンシステムズ	49,300	3,000.00	147,900,000	
エコス	4,800	1,976.00	9,484,800	
ワタミ	16,200	904.00	14,644,800	
マルシェ	4,500	471.00	2,119,500	
リックス	3,000	1,603.00	4,809,000	
システムソフト	32,200	97.00	3,123,400	
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	268,000	2,007.00	537,876,000	
丸文	11,500	687.00	7,900,500	
西松屋チェーン	28,400	1,531.00	43,480,400	
ゼンショーホールディングス	65,400	2,974.00	194,499,600	
ハピネット	10,800	1,505.00	16,254,000	
幸楽苑ホールディングス	8,200	1,242.00	10,184,400	
ハークスレイ	5,800	466.00	2,702,800	
橋本総業ホールディングス	2,600	1,980.00	5,148,000	
日本ライフライン	39,700	1,048.00	41,605,600	
サイゼリヤ	19,900	2,350.00	46,765,000	
タカショー	10,200	695.00	7,089,000	
ＶＴホールディングス	50,400	463.00	23,335,200	
アルゴグラフィックス	10,400	3,070.00	31,928,000	

魚力	3,500	2,188.00	7,658,000	
ＩＤＯＭ	40,600	655.00	26,593,000	
日本エム・ディ・エム	7,900	1,505.00	11,889,500	
ポプラ	3,700	138.00	510,600	
フジ・コーポレーション	7,100	1,121.00	7,959,100	
ユナイテッドアローズ	14,000	1,852.00	25,928,000	
進和	8,000	2,003.00	16,024,000	
エスケイジャパン	3,100	427.00	1,323,700	
ダイトロン	5,500	1,878.00	10,329,000	
ハイデイ日高	19,400	1,903.00	36,918,200	
シークス	18,400	1,003.00	18,455,200	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,800	199.00	1,552,200	
コロワイド	55,100	1,649.00	90,859,900	
ピーシーデポコーポレーション	15,600	309.00	4,820,400	
田中商事	3,100	602.00	1,866,200	
オーハシテクニカ	7,100	1,275.00	9,052,500	
壱番屋	9,500	4,805.00	45,647,500	
白銅	4,300	2,446.00	10,517,800	
トップカルチャー	5,000	282.00	1,410,000	
ＰＬＡＮＴ	3,400	671.00	2,281,400	
スギホールディングス	26,800	5,250.00	140,700,000	
ダイコー通産	1,500	1,305.00	1,957,500	
薬王堂ホールディングス	6,700	1,829.00	12,254,300	
島津製作所	171,000	4,350.00	743,850,000	
ＪＭＳ	11,200	576.00	6,451,200	
クボテック	3,100	256.00	793,600	
長野計器	9,600	1,112.00	10,675,200	
ブイ・テクノロジー	5,900	3,030.00	17,877,000	
スター精密	19,600	1,475.00	28,910,000	
東京計器	8,700	1,185.00	10,309,500	
愛知時計電機	5,600	1,477.00	8,271,200	
インターアクション	6,800	1,899.00	12,913,200	
オーバル	12,300	311.00	3,825,300	
東京精密	22,400	4,365.00	97,776,000	
マニー	52,700	1,427.00	75,202,900	
ニコン	202,500	1,479.00	299,497,500	
トプコン	64,000	1,629.00	104,256,000	
オリンパス	695,500	2,246.50	1,562,440,750	
理研計器	10,300	3,780.00	38,934,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	22,900	10,530.00	241,137,000	
キヤノン電子	12,500	1,484.00	18,550,000	
タムロン	10,200	2,400.00	24,480,000	
ＨＯＹＡ	265,500	12,625.00	3,351,937,500	
シード	6,500	523.00	3,399,500	
ノーリツ鋼機	12,200	2,120.00	25,864,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	15,300	853.00	13,050,900	
朝日インテック	149,200	2,405.00	358,826,000	
キヤノン	676,300	3,047.00	2,060,686,100	
リコー	359,800	992.00	356,921,600	

シチズン時計	150,500	490.00	73,745,000	
リズム	4,300	1,789.00	7,692,700	
大研医器	11,000	509.00	5,599,000	
メニコン	44,100	2,598.00	114,571,800	
シンシア	1,500	437.00	655,500	
中本パックス	3,800	1,569.00	5,962,200	
スノーピーク	17,700	2,193.00	38,816,100	
パラマウントベッドホールディングス	26,100	2,135.00	55,723,500	
トランザクション	7,900	971.00	7,670,900	
粧美堂	4,300	412.00	1,771,600	
ニホンフラッシュ	11,300	955.00	10,791,500	
前田工繊	14,100	2,604.00	36,716,400	
永大産業	17,200	273.00	4,695,600	
アートネイチャー	11,700	742.00	8,681,400	
バンダイナムコホールディングス	118,800	8,534.00	1,013,839,200	
アイフィスジャパン	3,700	634.00	2,345,800	
共立印刷	21,800	134.00	2,921,200	
ＳＨＯＥＩ	12,500	4,765.00	59,562,500	
フランスベッドホールディングス	17,600	876.00	15,417,600	
マーベラス	21,000	765.00	16,065,000	
パイロットコーポレーション	21,800	5,120.00	111,616,000	
萩原工業	8,600	1,068.00	9,184,800	
エイベックス	23,000	1,398.00	32,154,000	
フジシールインターナショナル	31,300	1,735.00	54,305,500	
タカラトミー	56,200	1,195.00	67,159,000	
広済堂ホールディングス	8,400	786.00	6,602,400	
エステールホールディングス	3,400	636.00	2,162,400	
レック	17,200	867.00	14,912,400	
タカノ	4,800	804.00	3,859,200	
三光合成	15,600	339.00	5,288,400	
プロネクサス	10,600	1,046.00	11,087,600	
ホクシン	9,600	177.00	1,699,200	
ウッドワン	4,200	1,295.00	5,439,000	
大建工業	7,600	2,094.00	15,914,400	
きもと	21,200	212.00	4,494,400	
凸版印刷	197,000	2,173.00	428,081,000	
大日本印刷	156,400	2,747.00	429,630,800	
共同印刷	3,800	2,743.00	10,423,400	
ＮＩＳＳＨＡ	26,500	1,513.00	40,094,500	
光村印刷	700	1,305.00	913,500	
藤森工業	11,700	3,555.00	41,593,500	
ヴィア・ホールディングス	17,400	149.00	2,592,600	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,200	1,910.00	15,662,000	
前澤化成工業	8,500	1,292.00	10,982,000	
未来工業	5,000	1,469.00	7,345,000	
アシックス	115,000	1,873.00	215,395,000	
ツツミ	3,400	1,935.00	6,579,000	
ウェーブロックホールディングス	5,200	682.00	3,546,400	
ＪＳＰ	8,000	1,471.00	11,768,000	
ニチハ	18,400	2,319.00	42,669,600	

ローランド	9,500	4,320.00	41,040,000	
エフピコ	25,000	2,701.00	67,525,000	
小松ウオール工業	4,200	1,846.00	7,753,200	
ヤマハ	79,100	4,935.00	390,358,500	
河合楽器製作所	3,700	2,908.00	10,759,600	
クリナップ	12,700	524.00	6,654,800	
ピジョン	82,200	2,088.00	171,633,600	
天馬	10,700	2,277.00	24,363,900	
兼松サステック	700	1,743.00	1,220,100	
キングジム	11,600	926.00	10,741,600	
象印マホービン	35,800	1,334.00	47,757,200	
リンテック	28,100	2,458.00	69,069,800	
信越ポリマー	24,400	1,037.00	25,302,800	
東リ	33,700	214.00	7,211,800	
イトーキ	25,300	357.00	9,032,100	
任天堂	76,800	56,220.00	4,317,696,000	
三菱鉛筆	21,100	1,325.00	27,957,500	
松風	5,300	1,577.00	8,358,100	
タカラスタンダード	26,000	1,298.00	33,748,000	
コクヨ	63,400	1,733.00	109,872,200	
ナカバヤシ	12,200	488.00	5,953,600	
ニフコ	45,400	2,715.00	123,261,000	
立川ブラインド工業	5,800	1,056.00	6,124,800	
グローブライド	11,500	2,448.00	28,152,000	
オカムラ	43,900	1,198.00	52,592,200	
バルカー	11,000	2,623.00	28,853,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,000	2,247.00	2,247,000	
伊藤忠商事	892,900	3,877.00	3,461,773,300	
丸紅	1,273,300	1,349.50	1,718,318,350	
スクロール	20,600	857.00	17,654,200	
高島	1,900	2,280.00	4,332,000	
ヨンドシーホールディングス	12,000	1,703.00	20,436,000	
三陽商会	6,200	814.00	5,046,800	
長瀬産業	68,100	1,904.00	129,662,400	
ナイガイ	3,700	306.00	1,132,200	
蝶理	7,500	1,936.00	14,520,000	
豊田通商	129,700	4,525.00	586,892,500	
オンワードホールディングス	77,700	247.00	19,191,900	
三共生興	17,300	546.00	9,445,800	
兼松	48,700	1,349.00	65,696,300	
美津濃	12,700	2,099.00	26,657,300	
ツカモトコーポレーション	1,700	1,213.00	2,062,100	
ルックホールディングス	4,300	1,549.00	6,660,700	
三井物産	1,017,900	3,308.00	3,367,213,200	
日本紙パルプ商事	6,800	3,810.00	25,908,000	
東京エレクトロン	86,400	54,210.00	4,683,744,000	
カメイ	15,400	1,045.00	16,093,000	
東都水産	700	4,440.00	3,108,000	
ＯＵＧホールディングス	2,000	2,651.00	5,302,000	
スターゼン	9,700	1,974.00	19,147,800	

セイコーホールディングス	19,200	2,157.00	41,414,400	
山善	53,600	969.00	51,938,400	
椿本興業	2,600	3,660.00	9,516,000	
住友商事	828,500	2,051.00	1,699,253,500	
ＢＩＰＲＯＧＹ	41,700	2,881.00	120,137,700	
内田洋行	5,600	4,870.00	27,272,000	
三菱商事	962,600	4,341.00	4,178,646,600	
第一実業	5,800	3,605.00	20,909,000	
キヤノンマーケティングジャパン	33,300	3,060.00	101,898,000	
西華産業	6,500	1,617.00	10,510,500	
佐藤商事	10,500	1,148.00	12,054,000	
菱洋エレクトロ	7,900	2,081.00	16,439,900	
東京産業	11,800	706.00	8,330,800	
ユアサ商事	12,000	2,922.00	35,064,000	
神鋼商事	3,000	3,695.00	11,085,000	
トルク	5,400	202.00	1,090,800	
阪和興業	25,600	3,175.00	81,280,000	
正栄食品工業	8,700	3,920.00	34,104,000	
カナデン	10,900	926.00	10,093,400	
菱電商事	10,600	1,690.00	17,914,000	
ニプロ	99,000	1,010.00	99,990,000	
岩谷産業	31,300	5,170.00	161,821,000	
ナイス	4,500	1,818.00	8,181,000	
ニチモウ	1,800	2,548.00	4,586,400	
極東貿易	3,900	2,232.00	8,704,800	
アステナホールディングス	18,300	436.00	7,978,800	
兼松エレクトロニクス	7,300	3,790.00	27,667,000	
三愛オブリ	32,000	954.00	30,528,000	
稲畑産業	28,200	2,170.00	61,194,000	
ＧＳＩクレオス	6,400	1,222.00	7,820,800	
明和産業	12,400	737.00	9,138,800	
クワザワホールディングス	5,400	496.00	2,678,400	
キムラタン	76,400	21.00	1,604,400	
ゴールドウイン	23,400	6,360.00	148,824,000	
ユニ・チャーム	262,300	4,220.00	1,106,906,000	
デサント	24,900	2,302.00	57,319,800	
キング	6,500	515.00	3,347,500	
ワキタ	27,100	1,081.00	29,295,100	
ヤマトインターナショナル	11,500	285.00	3,277,500	
東邦ホールディングス	40,800	2,138.00	87,230,400	
サンゲツ	34,200	1,558.00	53,283,600	
ミツウロコグループホールディングス	18,000	995.00	17,910,000	
シナネンホールディングス	4,800	3,295.00	15,816,000	
伊藤忠エネクス	29,700	1,088.00	32,313,600	
サンリオ	40,100	2,680.00	107,468,000	
サンワ　テクノス	7,700	1,353.00	10,418,100	
リョーサン	14,400	2,413.00	34,747,200	
新光商事	19,300	949.00	18,315,700	
トーホー	5,800	1,100.00	6,380,000	
三信電気	6,000	1,518.00	9,108,000	

東陽テクニカ	13,300	1,036.00	13,778,800	
モスフードサービス	17,600	2,998.00	52,764,800	
加賀電子	11,700	3,075.00	35,977,500	
三益半導体工業	10,500	2,294.00	24,087,000	
都築電気	6,600	1,477.00	9,748,200	
ソーダニッカ	12,500	653.00	8,162,500	
立花エレテック	9,800	1,626.00	15,934,800	
木曽路	18,100	2,077.00	37,593,700	
ＳＲＳホールディングス	19,100	816.00	15,585,600	
千趣会	24,400	397.00	9,686,800	
タカキュー	10,800	105.00	1,134,000	
リテールパートナーズ	20,400	1,118.00	22,807,200	
ケーヨー	24,800	973.00	24,130,400	
上新電機	14,600	1,898.00	27,710,800	
日本瓦斯	65,100	1,856.00	120,825,600	
ロイヤルホールディングス	23,500	2,075.00	48,762,500	
東天紅	700	922.00	645,400	
いなげや	15,500	1,321.00	20,475,500	
チヨダ	12,500	698.00	8,725,000	
ライフコーポレーション	11,800	2,860.00	33,748,000	
リンガーハット	16,200	2,182.00	35,348,400	
ＭｒＭａｘＨＤ	16,800	606.00	10,180,800	
テンアライド	13,500	310.00	4,185,000	
ＡＯＫＩホールディングス	25,900	631.00	16,342,900	
オークワ	20,400	874.00	17,829,600	
コメリ	20,700	2,778.00	57,504,600	
青山商事	26,900	678.00	18,238,200	
しまむら	15,600	11,590.00	180,804,000	
はせがわ	7,300	266.00	1,941,800	
高島屋	95,100	1,236.00	117,543,600	
松屋	25,500	776.00	19,788,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	61,700	883.00	54,481,100	
近鉄百貨店	4,700	2,524.00	11,862,800	
丸井グループ	102,900	2,287.00	235,332,300	
クレディセゾン	83,600	1,540.00	128,744,000	
アクシアル　リテイリング	9,900	3,145.00	31,135,500	
井筒屋	6,300	298.00	1,877,400	
イオン	491,200	2,389.00	1,173,476,800	
イズミ	23,200	2,763.00	64,101,600	
フォーバル	5,600	811.00	4,541,600	
平和堂	23,900	1,963.00	46,915,700	
フジ	34,300	2,326.00	79,781,800	
ヤオコー	15,200	6,810.00	103,512,000	
ゼビオホールディングス	18,200	915.00	16,653,000	
ケーズホールディングス	120,400	1,363.00	164,105,200	
ＰＡＬＴＡＣ	18,800	4,610.00	86,668,000	
三谷産業	21,000	317.00	6,657,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6,700	643.00	4,308,100	
日産東京販売ホールディングス	20,100	224.00	4,502,400	
新生銀行	87,600	2,301.00	201,567,600	

あおぞら銀行	74,900	2,647.00	198,260,300	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,231,700	762.90	6,279,963,930	
りそなホールディングス	1,487,900	553.60	823,701,440	
三井住友トラスト・ホールディングス	243,100	4,121.00	1,001,815,100	
三井住友フィナンシャルグループ	909,800	3,935.00	3,580,063,000	
千葉銀行	425,000	753.00	320,025,000	
群馬銀行	239,700	375.00	89,887,500	
武蔵野銀行	19,000	1,781.00	33,839,000	
千葉興業銀行	30,700	269.00	8,258,300	
筑波銀行	52,200	199.00	10,387,800	
七十七銀行	40,000	1,698.00	67,920,000	
秋田銀行	8,500	1,691.00	14,373,500	
山形銀行	13,700	874.00	11,973,800	
岩手銀行	8,600	1,948.00	16,752,800	
東邦銀行	106,300	203.00	21,578,900	
東北銀行	6,400	998.00	6,387,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	107,700	2,376.00	255,895,200	
静岡銀行	310,100	852.00	264,205,200	
スルガ銀行	117,600	416.00	48,921,600	
八十二銀行	288,000	453.00	130,464,000	
山梨中央銀行	14,300	1,001.00	14,314,300	
大垣共立銀行	25,300	1,905.00	48,196,500	
福井銀行	11,300	1,349.00	15,243,700	
清水銀行	5,400	1,503.00	8,116,200	
富山銀行	2,100	1,946.00	4,086,600	
滋賀銀行	24,100	2,492.00	60,057,200	
南都銀行	20,000	2,039.00	40,780,000	
百五銀行	123,500	342.00	42,237,000	
京都銀行	45,900	5,640.00	258,876,000	
紀陽銀行	43,500	1,419.00	61,726,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	79,700	885.00	70,534,500	
山陰合同銀行	77,900	655.00	51,024,500	
中国銀行	104,500	959.00	100,215,500	
鳥取銀行	4,400	1,194.00	5,253,600	
伊予銀行	168,600	631.00	106,386,600	
百十四銀行	13,600	1,710.00	23,256,000	
四国銀行	19,600	803.00	15,738,800	
阿波銀行	19,600	2,146.00	42,061,600	
大分銀行	7,500	1,893.00	14,197,500	
宮崎銀行	8,000	2,086.00	16,688,000	
佐賀銀行	7,500	1,454.00	10,905,000	
琉球銀行	29,200	822.00	24,002,400	
セブン銀行	398,300	246.00	97,981,800	
みずほフィナンシャルグループ	1,681,000	1,592.50	2,676,992,500	
高知銀行	4,700	735.00	3,454,500	
山口フィナンシャルグループ	148,800	734.00	109,219,200	
芙蓉総合リース	13,200	7,120.00	93,984,000	
みずほリース	19,300	3,035.00	58,575,500	
東京センチュリー	24,300	4,130.00	100,359,000	
ＳＢＩホールディングス	165,700	2,891.00	479,038,700	

日本証券金融	52,800	942.00	49,737,600	
アイフル	225,100	380.00	85,538,000	
日本アジア投資	10,500	235.00	2,467,500	
長野銀行	4,300	1,307.00	5,620,100	
名古屋銀行	9,200	3,120.00	28,704,000	
北洋銀行	191,000	242.00	46,222,000	
愛知銀行	4,600	4,760.00	21,896,000	
中京銀行	4,600	1,696.00	7,801,600	
大光銀行	4,400	1,274.00	5,605,600	
愛媛銀行	18,400	930.00	17,112,000	
トマト銀行	4,700	1,016.00	4,775,200	
京葉銀行	55,800	502.00	28,011,600	
栃木銀行	63,400	251.00	15,913,400	
北日本銀行	4,100	1,555.00	6,375,500	
東和銀行	23,100	539.00	12,450,900	
福島銀行	14,900	217.00	3,233,300	
大東銀行	6,400	654.00	4,185,600	
リコーリース	11,900	3,410.00	40,579,000	
イオンフィナンシャルサービス	73,000	1,203.00	87,819,000	
アコム	264,700	343.00	90,792,100	
ジャックス	14,300	3,260.00	46,618,000	
オリエントコーポレーション	362,900	124.00	44,999,600	
オリックス	797,500	2,363.50	1,884,891,250	
三菱ＨＣキャピタル	475,200	587.00	278,942,400	
ジャフコ　グループ	51,300	1,524.00	78,181,200	
九州リースサービス	6,600	575.00	3,795,000	
トモニホールディングス	101,400	330.00	33,462,000	
大和証券グループ本社	981,400	627.70	616,024,780	
野村ホールディングス	2,049,200	491.70	1,007,591,640	
岡三証券グループ	102,800	351.00	36,082,800	
丸三証券	39,800	510.00	20,298,000	
東洋証券	43,100	179.00	7,714,900	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	146,700	383.00	56,186,100	
光世証券	2,600	468.00	1,216,800	
水戸証券	35,100	260.00	9,126,000	
いちよし証券	24,500	563.00	13,793,500	
松井証券	65,700	810.00	53,217,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	210,600	5,315.00	1,119,339,000	
日本取引所グループ	327,600	1,891.00	619,491,600	
マネックスグループ	110,600	550.00	60,830,000	
極東証券	17,200	696.00	11,971,200	
岩井コスモホールディングス	12,700	1,226.00	15,570,200	
アイザワ証券グループ	20,800	642.00	13,353,600	
フィデアホールディングス	12,300	1,302.00	16,014,600	
池田泉州ホールディングス	149,800	190.00	28,462,000	
アニコム　ホールディングス	41,200	630.00	25,956,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	292,700	3,935.00	1,151,774,500	
マネーパートナーズグループ	14,400	241.00	3,470,400	

スパークス・グループ	62,000	254.00	15,748,000	
小林洋行	2,800	225.00	630,000	
第一生命ホールディングス	624,500	2,658.00	1,659,921,000	
東京海上ホールディングス	411,800	7,009.00	2,886,306,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,600	477.00	3,148,200	
イー・ギャランティ	19,800	2,054.00	40,669,200	
アサックス	7,300	582.00	4,248,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,500	1,960.00	10,780,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	331,800	1,699.00	563,728,200	
アドバンスクリエイト	6,500	921.00	5,986,500	
三井不動産	581,100	2,733.00	1,588,146,300	
三菱地所	842,700	1,846.00	1,555,624,200	
平和不動産	22,500	3,965.00	89,212,500	
東京建物	126,600	1,809.00	229,019,400	
京阪神ビルディング	19,700	1,340.00	26,398,000	
住友不動産	268,200	3,375.00	905,175,000	
太平洋興発	5,100	638.00	3,253,800	
テーオーシー	22,900	672.00	15,388,800	
東京楽天地	2,100	3,955.00	8,305,500	
レオパレス２１	139,100	189.00	26,289,900	
スターツコーポレーション	18,300	2,376.00	43,480,800	
フジ住宅	15,700	617.00	9,686,900	
空港施設	13,700	550.00	7,535,000	
明和地所	6,400	596.00	3,814,400	
ゴールドクレスト	10,600	1,698.00	17,998,800	
リログループ	71,100	1,873.00	133,170,300	
エスリード	5,300	1,669.00	8,845,700	
日神グループホールディングス	22,000	449.00	9,878,000	
日本エスコン	25,000	746.00	18,650,000	
タカラレーベン	56,600	295.00	16,697,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	6,800	845.00	5,746,000	
イオンモール	67,300	1,558.00	104,853,400	
毎日コムネット	4,700	700.00	3,290,000	
ファースト住建	5,000	1,104.00	5,520,000	
ランド	730,800	11.00	8,038,800	
カチタス	33,200	2,959.00	98,238,800	
東祥	9,700	1,628.00	15,791,600	
トーセイ	18,500	1,116.00	20,646,000	
穴吹興産	3,000	2,246.00	6,738,000	
サンフロンティア不動産	18,500	1,076.00	19,906,000	
ＦＪネクストホールディングス	13,200	1,006.00	13,279,200	
インテリックス	3,100	639.00	1,980,900	
ランドビジネス	5,400	237.00	1,279,800	
サンネクスタグループ	4,400	1,159.00	5,099,600	
グランディハウス	9,300	530.00	4,929,000	
東武鉄道	130,000	2,983.00	387,790,000	
相鉄ホールディングス	42,500	2,251.00	95,667,500	
東急	334,500	1,596.00	533,862,000	
京浜急行電鉄	167,000	1,309.00	218,603,000	
小田急電鉄	192,000	1,896.00	364,032,000	

京王電鉄	67,000	4,770.00	319,590,000	
京成電鉄	89,800	3,270.00	293,646,000	
富士急行	15,500	3,875.00	60,062,500	
新京成電鉄	3,200	2,686.00	8,595,200	
東日本旅客鉄道	228,900	6,756.00	1,546,448,400	
西日本旅客鉄道	158,100	4,868.00	769,630,800	
東海旅客鉄道	107,400	16,540.00	1,776,396,000	
西武ホールディングス	173,100	1,321.00	228,665,100	
鴻池運輸	20,900	1,154.00	24,118,600	
西日本鉄道	36,100	2,595.00	93,679,500	
ハマキョウレックス	9,400	2,947.00	27,701,800	
サカイ引越センター	6,300	4,650.00	29,295,000	
近鉄グループホールディングス	126,200	3,735.00	471,357,000	
阪急阪神ホールディングス	157,600	3,460.00	545,296,000	
南海電気鉄道	56,300	2,457.00	138,329,100	
京阪ホールディングス	55,000	2,918.00	160,490,000	
神戸電鉄	3,100	3,235.00	10,028,500	
名古屋鉄道	135,800	2,169.00	294,550,200	
山陽電気鉄道	9,700	2,071.00	20,088,700	
アルプス物流	9,100	1,081.00	9,837,100	
トランコム	3,600	6,980.00	25,128,000	
ヤマトホールディングス	180,600	2,445.00	441,567,000	
山九	33,100	3,980.00	131,738,000	
日新	10,000	1,592.00	15,920,000	
丸運	7,500	241.00	1,807,500	
丸全昭和運輸	9,900	3,245.00	32,125,500	
センコーグループホールディングス	64,200	890.00	57,138,000	
トナミホールディングス	2,900	3,565.00	10,338,500	
ニッコンホールディングス	42,300	1,989.00	84,134,700	
日本石油輸送	900	2,564.00	2,307,600	
福山通運	19,600	3,730.00	73,108,000	
セイノーホールディングス	81,900	1,081.00	88,533,900	
エスライン	4,000	874.00	3,496,000	
神奈川中央交通	3,200	3,300.00	10,560,000	
日立物流	24,900	8,560.00	213,144,000	
丸和運輸機関	25,400	1,501.00	38,125,400	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	12,300	1,129.00	13,886,700	
日本郵船	107,800	9,720.00	1,047,816,000	
商船三井	209,000	3,300.00	689,700,000	
川崎汽船	39,700	7,720.00	306,484,000	
ＮＳユナイテッド海運	6,800	3,910.00	26,588,000	
明治海運	14,200	742.00	10,536,400	
飯野海運	56,800	743.00	42,202,400	
共栄タンカー	2,300	1,175.00	2,702,500	
九州旅客鉄道	95,200	2,570.00	244,664,000	
ＳＧホールディングス	234,500	2,342.00	549,199,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	42,500	7,810.00	331,925,000	
日本航空	289,300	2,192.00	634,145,600	
ＡＮＡホールディングス	320,600	2,455.00	787,073,000	

ビーウィズ	3,500	1,452.00	5,082,000	
パスコ	2,500	1,317.00	3,292,500	
ＴＲＥホールディングス	20,000	2,122.00	42,440,000	
人・夢・技術グループ	5,200	2,206.00	11,471,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,000	2,625.00	7,875,000	
シルバーライフ	2,700	1,377.00	3,717,900	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,055.00	2,055,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	5,900	3,100.00	18,290,000	
コーア商事ホールディングス	8,400	864.00	7,257,600	
国際紙パルプ商事	26,900	295.00	7,935,500	
ナルミヤ・インターナショナル	3,000	856.00	2,568,000	
ブックオフグループホールディングス	7,800	1,024.00	7,987,200	
ギフトホールディングス	2,100	2,142.00	4,498,200	
三菱倉庫	38,400	3,140.00	120,576,000	
三井倉庫ホールディングス	13,300	2,441.00	32,465,300	
住友倉庫	42,500	2,043.00	86,827,500	
澁澤倉庫	7,300	2,256.00	16,468,800	
ヤマタネ	6,200	1,681.00	10,422,200	
東陽倉庫	21,000	301.00	6,321,000	
乾汽船	8,400	1,645.00	13,818,000	
日本トランスシティ	26,600	605.00	16,093,000	
ケイヒン	2,300	1,371.00	3,153,300	
中央倉庫	7,600	949.00	7,212,400	
川西倉庫	2,500	1,139.00	2,847,500	
安田倉庫	10,100	984.00	9,938,400	
ファイズホールディングス	2,800	700.00	1,960,000	
東洋埠頭	2,800	1,431.00	4,006,800	
上組	68,300	2,227.00	152,104,100	
サンリツ	3,600	784.00	2,822,400	
キムラユニティー	3,500	1,468.00	5,138,000	
キユーソー流通システム	6,500	1,078.00	7,007,000	
近鉄エクスプレス	24,400	3,095.00	75,518,000	
東海運	7,700	297.00	2,286,900	
エーアイテイー	8,100	1,553.00	12,579,300	
内外トランスライン	5,000	1,910.00	9,550,000	
ショーエイコーポレーション	3,700	585.00	2,164,500	
日本コンセプト	4,100	1,341.00	5,498,100	
ＴＢＳホールディングス	74,900	1,751.00	131,149,900	
日本テレビホールディングス	111,500	1,269.00	141,493,500	
朝日放送グループホールディングス	12,400	705.00	8,742,000	
テレビ朝日ホールディングス	32,100	1,495.00	47,989,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	113,200	457.00	51,732,400	
テレビ東京ホールディングス	9,000	1,994.00	17,946,000	
日本ＢＳ放送	4,600	1,020.00	4,692,000	
ビジョン	22,200	1,314.00	29,170,800	
スマートバリュー	3,100	552.00	1,711,200	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	11,800	2,083.00	24,579,400	
ワイヤレスゲート	5,500	297.00	1,633,500	

コネクシオ	9,500	1,457.00	13,841,500	
日本通信	110,900	172.00	19,074,800	
クロップス	2,500	986.00	2,465,000	
日本電信電話	1,430,200	3,842.00	5,494,828,400	
ＫＤＤＩ	973,600	4,318.00	4,204,004,800	
ソフトバンク	2,022,700	1,508.00	3,050,231,600	
光通信	15,400	15,040.00	231,616,000	
エムティーアイ	12,100	446.00	5,396,600	
ＧＭＯインターネット	46,800	2,425.00	113,490,000	
ファイバーゲート	6,100	1,186.00	7,234,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,100	290.00	899,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	72,600	3,135.00	227,601,000	
学研ホールディングス	18,800	866.00	16,280,800	
ゼンリン	21,700	917.00	19,898,900	
昭文社ホールディングス	4,100	399.00	1,635,900	
インプレスホールディングス	11,200	225.00	2,520,000	
東京電力ホールディングス	1,018,300	525.00	534,607,500	
中部電力	405,700	1,324.00	537,146,800	
関西電力	502,500	1,252.00	629,130,000	
中国電力	207,200	893.00	185,029,600	
北陸電力	121,500	539.00	65,488,500	
東北電力	311,500	748.00	233,002,000	
四国電力	119,400	784.00	93,609,600	
九州電力	273,800	867.00	237,384,600	
北海道電力	118,200	520.00	61,464,000	
沖縄電力	28,900	1,226.00	35,431,400	
電源開発	110,900	1,852.00	205,386,800	
エフオン	8,200	532.00	4,362,400	
イーレックス	19,200	1,870.00	35,904,000	
レノバ	26,700	1,584.00	42,292,800	
東京瓦斯	254,700	2,507.00	638,532,900	
大阪瓦斯	240,600	2,403.00	578,161,800	
東邦瓦斯	59,300	3,000.00	177,900,000	
北海道瓦斯	6,800	1,556.00	10,580,800	
広島ガス	25,700	329.00	8,455,300	
西部ガスホールディングス	14,500	2,048.00	29,696,000	
静岡ガス	34,300	893.00	30,629,900	
メタウォーター	14,200	2,043.00	29,010,600	
アイネット	6,700	1,226.00	8,214,200	
松竹	8,400	12,920.00	108,528,000	
東宝	78,800	4,875.00	384,150,000	
エイチ・アイ・エス	28,200	2,108.00	59,445,600	
東映	4,200	17,100.00	71,820,000	
ラックランド	3,900	2,950.00	11,505,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	355,600	2,440.00	867,664,000	
共立メンテナンス	23,200	4,775.00	110,780,000	
イチネンホールディングス	13,400	1,226.00	16,428,400	
建設技術研究所	7,400	2,299.00	17,012,600	
スペース	9,100	917.00	8,344,700	

アインホールディングス	17,500	5,510.00	96,425,000	
燦ホールディングス	5,700	1,572.00	8,960,400	
ピー・シー・エー	7,800	1,287.00	10,038,600	
スバル興業	700	8,420.00	5,894,000	
東京テアトル	5,200	1,217.00	6,328,400	
タナベ経営	4,400	654.00	2,877,600	
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	1,487.00	5,799,300	
ナガワ	4,000	9,010.00	36,040,000	
東京都競馬	9,700	3,880.00	37,636,000	
常磐興産	5,000	1,250.00	6,250,000	
カナモト	22,300	1,946.00	43,395,800	
ＤＴＳ	24,900	3,015.00	75,073,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	62,100	5,320.00	330,372,000	
シーイーシー	14,300	1,209.00	17,288,700	
カプコン	125,900	3,385.00	426,171,500	
西尾レントオール	11,600	2,791.00	32,375,600	
アイ・エス・ビー	6,200	998.00	6,187,600	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	73,700	23.00	1,695,100	
日本空港ビルデング	48,500	5,460.00	264,810,000	
トランス・コスモス	16,500	3,175.00	52,387,500	
乃村工藝社	55,700	864.00	48,124,800	
ジャステック	7,800	1,136.00	8,860,800	
ＳＣＳＫ	92,500	2,126.00	196,655,000	
藤田観光	5,700	2,325.00	13,252,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,100	1,483.00	12,012,300	
日本管財	14,000	2,787.00	39,018,000	
トーカイ	11,000	1,748.00	19,228,000	
白洋舎	1,500	1,230.00	1,845,000	
セコム	128,100	9,134.00	1,170,065,400	
日本システムウエア	5,100	2,281.00	11,633,100	
セントラル警備保障	6,300	2,125.00	13,387,500	
アイネス	12,500	1,515.00	18,937,500	
丹青社	25,900	780.00	20,202,000	
メイテック	15,400	6,430.00	99,022,000	
ＴＫＣ	21,900	3,480.00	76,212,000	
富士ソフト	13,800	6,820.00	94,116,000	
応用地質	13,900	1,920.00	26,688,000	
船井総研ホールディングス	25,900	2,135.00	55,296,500	
ＮＳＤ	41,900	2,317.00	97,082,300	
進学会ホールディングス	4,400	317.00	1,394,800	
丸紅建材リース	900	1,744.00	1,569,600	
オオバ	8,700	781.00	6,794,700	
コナミホールディングス	48,500	7,610.00	369,085,000	
いであ	3,400	1,763.00	5,994,200	
学究社	4,200	1,592.00	6,686,400	
ベネッセホールディングス	43,300	2,260.00	97,858,000	
イオンディライト	16,000	2,876.00	46,016,000	
ナック	6,500	952.00	6,188,000	

福井コンピュータホールディングス	6,100	3,260.00	19,886,000	
ダイセキ	23,700	4,525.00	107,242,500	
ステップ	4,800	1,754.00	8,419,200	
日鉄物産	9,100	5,230.00	47,593,000	
泉州電業	3,600	4,955.00	17,838,000	
元気寿司	3,800	2,463.00	9,359,400	
トラスコ中山	27,800	1,942.00	53,987,600	
ヤマダホールディングス	501,160	471.00	236,046,360	
オートバックスセブン	43,900	1,398.00	61,372,200	
モリト	9,900	777.00	7,692,300	
アークランドサカモト	20,900	1,550.00	32,395,000	
ニトリホールディングス	53,200	12,195.00	648,774,000	
グルメ杵屋	10,800	1,002.00	10,821,600	
愛眼	7,400	197.00	1,457,800	
ケーユーホールディングス	7,100	1,068.00	7,582,800	
吉野家ホールディングス	46,800	2,386.00	111,664,800	
加藤産業	17,700	3,350.00	59,295,000	
北恵	3,500	875.00	3,062,500	
イノテック	8,100	1,351.00	10,943,100	
イエローハット	22,500	1,634.00	36,765,000	
松屋フーズホールディングス	6,500	3,750.00	24,375,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,100	1,489.00	13,549,900	
ＪＫホールディングス	10,400	1,032.00	10,732,800	
サガミホールディングス	20,100	1,098.00	22,069,800	
日伝	10,500	2,143.00	22,501,500	
関西フードマーケット	12,600	1,342.00	16,909,200	
ミロク情報サービス	11,800	1,279.00	15,092,200	
北沢産業	6,900	211.00	1,455,900	
杉本商事	6,300	2,165.00	13,639,500	
因幡電機産業	34,900	2,583.00	90,146,700	
王将フードサービス	8,900	6,080.00	54,112,000	
プレナス	15,000	1,929.00	28,935,000	
ミニストップ	10,000	1,414.00	14,140,000	
アークス	25,000	2,061.00	51,525,000	
バローホールディングス	28,900	2,001.00	57,828,900	
東テク	4,300	2,633.00	11,321,900	
ミスミグループ本社	168,200	2,848.00	479,033,600	
アルテック	8,900	246.00	2,189,400	
ベルク	6,000	5,440.00	32,640,000	
大　庄	7,300	1,031.00	7,526,300	
タキヒヨー	3,900	1,053.00	4,106,700	
ファーストリテイリング	17,900	57,480.00	1,028,892,000	
ソフトバンクグループ	800,800	4,989.00	3,995,191,200	
蔵王産業	2,100	1,949.00	4,092,900	
スズケン	51,000	3,950.00	201,450,000	
サンドラッグ	50,400	2,926.00	147,470,400	
サックスバー　ホールディングス	12,700	514.00	6,527,800	
ジェコス	9,300	792.00	7,365,600	
ヤマザワ	2,600	1,501.00	3,902,600	
やまや	2,800	2,487.00	6,963,600	

グローセル	15,400	406.00	6,252,400	
ベルーナ	28,700	717.00	20,577,900	
合計	146,560,760		342,399,039,710	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ＭＨＡＭ外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年5月9日現在
資産の部	
流動資産	
預金	301,735,939
コール・ローン	136,507,078
派生商品評価勘定	871,623
未収配当金	172,224
差入委託証拠金	547,677,574
流動資産合計	986,964,438
資産合計	986,964,438
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,800,767
流動負債合計	18,800,767
負債合計	18,800,767
純資産の部	
元本等	
元本	313,867,793
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	654,295,878
元本等合計	968,163,671
純資産合計	968,163,671
負債純資産合計	986,964,438

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11日 至　2022年5月9日
１．　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。
２．　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。
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	2022年5月9日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,170,263,221円
同期中追加設定元本額	3,203,577,865円
同期中一部解約元本額	20,059,973,293円
元本の内訳	
ファンド名	
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	120,224円
コア資産形成ファンド	81,675円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	193,911,234円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	7,113,024円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	945,743円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	16,138,410円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	95,557,483円
計	313,867,793円
２．　受益権の総数	313,867,793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11日 至　2022年5月9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、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。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年5月9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 該当事項はありません。 (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）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）
株式関連

種類	2022年5月9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	986,606,918	－	968,677,774	△17,929,144
合計	986,606,918	－	968,677,774	△17,929,144

（注）時価の算定方法
　　株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年5月9日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.0846円 (30,846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

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）

	2022年5月9日現在
資産の部	
流動資産	
預金	12,519,160,323
コール・ローン	180,630,976
株式	686,395,105,437
投資信託受益証券	1,263,435,741
投資証券	16,199,798,195
派生商品評価勘定	1,087,504
未収入金	34,907,285
未収配当金	763,587,779
差入委託証拠金	4,567,353,823
流動資産合計	721,925,067,063
資産合計	721,925,067,063
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	518,972,346
未払解約金	986,679,000
流動負債合計	1,505,651,346
負債合計	1,505,651,346
純資産の部	
元本等	
元本	121,262,425,171
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	599,156,990,546
元本等合計	720,419,415,717
純資産合計	720,419,415,717
負債純資産合計	721,925,067,063

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11日 至　2022年5月9日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年5月9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	99,269,068,268円
同期中追加設定元本額	101,058,117,768円
同期中一部解約元本額	79,064,760,865円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,278,793,190円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	4,425,622円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	15,932,302円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	85,057,975円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	20,739,797円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	11,198,670円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	10,891,172円
たわらノーロード　先進国株式	31,465,504,199円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	307,036,452円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,568,652,378円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	611,711,553円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	69,060,997円
たわらノーロード　バランス（標準型）	568,950,871円
たわらノーロード　バランス（積極型）	706,200,245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）	922,478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）	138,230,900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）	425,268,431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）	326,675,449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）	489,174,691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）	1,186,513円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	19,981,260円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,359,073円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	10,781,697円
たわらノーロード　全世界株式	272,972,800円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	52,461,120,146円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	2,394,627,813円
Ｏｎｅグローバルバランス	2,662,307円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	149,537,962円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	774,675,235円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	988,304,895円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	93,183,119円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	259,067,552円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	240,327,964円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,659,398円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	604,464,010円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	123,370,292円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	167,447,225円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	168,723,784円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	306,043,035円
投資のソムリエ	6,000,870,379円
クルーズコントロール	60,207,326円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	364,969,273円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	187,982,755円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	151,962,057円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	242,751,652円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,354,950,594円
ワールドアセットバランス（基本コース）	172,543,309円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	181,024,347円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	24,791,104円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	12,038,274円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	842,702円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	34,701,801円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	100,077,506円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	277,730,985円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	152,141,457円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	21,076,069円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	10,941,846円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	8,271,709円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	33,877,250円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,176,080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）	1,080,114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）	1,203,616円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	10,092,199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）	719,029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）	1,054,128円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	126,341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）	36,823,913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）	961,920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）	234,435,297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）	63,272,639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）	1,174,174,136円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	204,231,568円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,081,641,331円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	152,686,053円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,420,265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）	1,911,209円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	2,729,970円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	9,671,205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）	26,921,019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）	51,509,794円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,499,178円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,565,426円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,429,943円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	426,300円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,621,072円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,164,003円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	181,645,039円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	279,076,282円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	918,614,135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）	73,547,192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）	42,452,786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）	292,605,645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）	12,034,464円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,149,200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）	114,373,711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）	10,445,432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）	36,700,049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）	56,825,664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）	115,899,925円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	7,680,689円
コア資産形成ファンド	4,990,560円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,498,944,478円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	138,557,765円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	14,276,245円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,047,190,665円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,740,190,203円
計	121,262,425,171円
２．　受益権の総数	121,262,425,171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11日 至　2022年5月9日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年5月9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	2022年5月9日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△49,827,967,224
投資信託受益証券	△37,857,286
投資証券	△192,539,911
合計	△50,058,364,421

（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（2022年2月16日から2022年5月9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	2022年5月9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	7,144,898,538	－	7,145,760,075	△861,537
アメリカ・ドル	5,173,380,000	－	5,174,916,317	△1,536,317
イギリス・ポンド	228,572,120	－	228,360,555	211,565
オーストラリア・ドル	160,069,892	－	159,829,940	239,952
カナダ・ドル	376,182,622	－	375,891,882	290,740
ユーロ	1,206,693,904	－	1,206,761,381	△67,477
合計	7,144,898,538	－	7,145,760,075	△861,537

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
２．　計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
３．　換算において円未満の端数は切捨てております。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年5月9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	10,878,634,665	－	10,361,611,360	△517,023,305
合計	10,878,634,665	－	10,361,611,360	△517,023,305

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

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年5月9日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.9410円 (59,410円)

附属明細表
第１　有価証券明細表
（１）株式

2022年5月9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	49,187	2,295.450	112,906,299.150	
	ABBOTT LABORATORIES	190,124	112.270	21,345,221.480	
	AES CORP	69,518	20.940	1,455,706.920	
	ABIOMED INC	5,195	257.540	1,337,920.300	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	96,318	137.670	13,260,099.060	
	ADVANCED MICRO DEVICES	175,505	95.340	16,732,646.700	
	ADOBE INC	50,994	391.010	19,939,163.940	
	CHUBB LTD	47,353	209.160	9,904,353.480	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	23,497	235.820	5,541,062.540	

ALLEGHANY CORP	1,177	831.260	978,393.020	
ALLSTATE CORP	31,858	130.560	4,159,380.480	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	73,705	195.430	14,404,168.150	
AMGEN INC	60,160	236.500	14,227,840.000	
HESS CORP	30,949	117.250	3,628,770.250	
AMERICAN EXPRESS CO	70,601	167.150	11,800,957.150	
AMERICAN ELECTRIC POWER	53,809	99.650	5,362,066.850	
AFLAC INC	69,897	58.230	4,070,102.310	
AMERICAN INTL GROUP	91,992	62.230	5,724,662.160	
AMERCO	980	540.420	529,611.600	
ANALOG DEVICES	57,444	156.130	8,968,731.720	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	76,154	53.260	4,055,962.040	
VALERO ENERGY CORP	43,931	129.180	5,675,006.580	
ANSYS INC	9,632	261.590	2,519,634.880	
APPLE INC	1,768,650	157.280	278,173,272.000	
APPLIED MATERIALS INC	96,440	112.500	10,849,500.000	
ALBEMARLE CORP	13,127	242.410	3,182,116.070	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	58,645	89.730	5,262,215.850	
AMEREN CORP	25,790	92.650	2,389,443.500	
ARROW ELECTRONICS INC	8,479	124.930	1,059,281.470	
AUTODESK INC	23,622	193.770	4,577,234.940	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	45,096	216.940	9,783,126.240	
AUTOZONE INC	2,325	2,000.000	4,650,000.000	
AVERY DENNISON CORP	8,463	177.340	1,500,828.420	
BALL CORP	36,110	71.910	2,596,670.100	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	140,677	318.880	44,859,081.760	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84,453	43.760	3,695,663.280	
BAXTER INTERNATIONAL INC	53,593	72.790	3,901,034.470	
BECTON DICKINSON & CO	31,363	257.970	8,090,713.110	
AMETEK INC	23,531	123.130	2,897,372.030	
VERIZON COMM INC	446,460	48.270	21,550,624.200	
WR BERKLEY CORP	23,787	68.780	1,636,069.860	
BEST BUY CO INC	24,718	91.410	2,259,472.380	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	501.460	1,233,090.140	
YUM! BRANDS INC	32,468	115.390	3,746,482.520	
FIRSTENERGY CORP	60,981	42.680	2,602,669.080	
BOEING CO	59,809	148.900	8,905,560.100	
ROBERT HALF INTL INC	11,897	97.060	1,154,722.820	
BORGWARNER INC	27,800	37.970	1,055,566.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	151,050	40.850	6,170,392.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,979	106.970	1,388,363.630	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,635	114.270	1,443,801.450	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,566	1,315.900	3,376,599.400	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	238,719	76.670	18,302,585.730	
ONEOK INC	47,748	65.600	3,132,268.800	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	149.100	1,176,548.100	
UNITED RENTALS INC	7,998	295.460	2,363,089.080	
SEMPRA ENERGY	34,200	164.900	5,639,580.000	
FEDEX CORP	27,905	210.210	5,865,910.050	
VERISIGN INC	10,834	172.050	1,863,989.700	
AMPHENOL CORP	61,627	70.420	4,339,773.340	
BROWN-FORMAN CORP	35,212	64.620	2,275,399.440	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	6.070	617,713.550	
CSX CORP	235,532	34.780	8,191,802.960	
COTERRA ENERGY INC	83,065	32.550	2,703,765.750	
CAMPBELL SOUP CO	21,404	49.670	1,063,136.680	
CONSTELLATION BRANDS INC	18,281	247.470	4,523,999.070	
CARDINAL HEALTH INC	31,396	58.270	1,829,444.920	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	93,250	15.920	1,484,540.000	
CATERPILLAR INC	57,858	214.650	12,419,219.700	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,845	120.190	1,303,460.550	
CITRIX SYSTEMS INC	14,230	101.000	1,437,230.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	10.910	1,059,066.430	
CERNER CORP	32,630	94.000	3,067,220.000	
JPMORGAN CHASE & CO	318,197	123.720	39,367,332.840	
CHURCH & DWIGHT CO INC	25,740	95.730	2,464,090.200	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,116	126.460	2,164,489.360	
CINTAS CORP	9,996	383.940	3,837,864.240	
CISCO SYSTEMS INC	451,753	49.330	22,284,975.490	
CLOROX COMPANY	13,725	153.940	2,112,826.500	
COCA-COLA CO/THE	441,612	64.740	28,589,960.880	
COPART INC	23,200	109.620	2,543,184.000	
COGNEX CORP	20,432	54.340	1,110,274.880	
COLGATE-PALMOLIVE CO	87,757	76.840	6,743,247.880	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	28,772	172.520	4,963,745.440	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,572	308.110	2,024,898.920	
NRG ENERGY, INC.	23,951	41.400	991,571.400	
COMCAST CORP-CL A	487,904	40.000	19,516,160.000	
CONAGRA BRANDS INC	54,302	35.590	1,932,608.180	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,437	93.980	3,612,309.260	
CMS ENERGY CORP	32,783	67.750	2,221,048.250	
COOPER COS INC	4,961	337.550	1,674,585.550	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	22,195	53.140	1,179,442.300	

CORNING INC	87,516	36.860	3,225,839.760	
SEALED AIR CORP	17,099	65.600	1,121,694.400	
HEICO CORP-CL A	7,767	113.040	877,981.680	
CUMMINS INC	14,486	201.720	2,922,115.920	
DR HORTON INC	34,127	70.020	2,389,572.540	
DANAHER CORP	69,019	249.240	17,202,295.560	
MOODY'S CORP	18,536	300.440	5,568,955.840	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	57,939	75.520	4,375,553.280	
TARGET CORP	51,176	225.210	11,525,346.960	
DEERE & CO	31,550	377.460	11,908,863.000	
MORGAN STANLEY	144,318	84.230	12,155,905.140	
REPUBLIC SERVICES INC	22,337	135.190	3,019,739.030	
COSTAR GROUP INC	43,151	59.110	2,550,655.610	
THE WALT DISNEY CO	195,081	110.290	21,515,483.490	
DOLLAR TREE INC	24,098	164.390	3,961,470.220	
DOVER CORP	14,180	133.010	1,886,081.800	
OMNICOM GROUP	23,813	77.380	1,842,649.940	
DTE ENERGY CO	21,376	129.680	2,772,039.680	
DUKE ENERGY CORP	84,611	111.320	9,418,896.520	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	130.100	1,813,463.900	
EBAY INC	67,552	48.810	3,297,213.120	
BANK OF AMERICA CORP	791,799	37.450	29,652,872.550	
CITIGROUP INC	212,547	51.620	10,971,676.140	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,111	105.890	1,494,213.790	
EATON CORP PLC	42,576	147.290	6,271,019.040	
CADENCE DESIGN SYS INC	29,947	146.370	4,383,342.390	
DISH NETWORK CORP	24,416	22.220	542,523.520	
ECOLAB INC	27,896	165.200	4,608,419.200	
PERKINELMER INC	12,304	147.870	1,819,392.480	
ELECTRONIC ARTS INC	31,297	115.290	3,608,231.130	
SALESFORCE INC	105,934	169.700	17,976,999.800	
ERIE INDEMNITY CO	2,431	170.180	413,707.580	
EMERSON ELECTRIC CO	65,594	88.010	5,772,927.940	
ATMOS ENERGY CORP	12,557	114.900	1,442,799.300	
ENTERGY CORP	21,918	119.270	2,614,159.860	
EOG RESOURCES INC	61,586	132.220	8,142,900.920	
EQUIFAX INC	13,653	205.100	2,800,230.300	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	25,477	240.300	6,122,123.100	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	17,397	108.050	1,879,745.850	
EXXON MOBIL CORP	454,626	91.690	41,684,657.940	
FMC CORP	12,931	119.000	1,538,789.000	
NEXTERA ENERGY INC	209,875	72.470	15,209,641.250	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,101	378.170	1,550,875.170	
FAIR ISAAC CORP	2,962	349.890	1,036,374.180	
ASSURANT INC	5,823	188.580	1,098,101.340	
FASTENAL CO	62,823	53.160	3,339,670.680	
FIFTH THIRD BANCORP	69,838	37.510	2,619,623.380	

M&T BANK CORP	18,103	170.480	3,086,199.440	
FISERV INC	63,058	95.710	6,035,281.180	
FORD MOTOR CO	432,243	14.210	6,142,173.030	
FRANKLIN RESOURCES INC	29,162	25.010	729,341.620	
FREEPORT-MCMORAN INC	156,473	37.880	5,927,197.240	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	651.600	827,532.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	23,216	164.480	3,818,567.680	
DENTSPLY SIRONA INC	21,462	40.590	871,142.580	
GENERAL DYNAMICS CORP	26,170	239.600	6,270,332.000	
GENERAL MILLS INC	65,491	71.400	4,676,057.400	
GENUINE PARTS CO	13,551	130.790	1,772,335.290	
GILEAD SCIENCES INC	137,962	61.180	8,440,515.160	
GARTNER INC	8,920	252.810	2,255,065.200	
MCKESSON CORP	15,944	333.990	5,325,136.560	
NVIDIA CORP	269,156	186.750	50,264,883.000	
GENERAL ELECTRIC CO	117,466	78.230	9,189,365.180	
WW GRAINGER INC	4,840	477.920	2,313,132.800	
HALLIBURTON CO	96,275	37.350	3,595,871.250	
MONSTER BEVERAGE CORP	40,926	86.670	3,547,056.420	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	36,152	312.960	11,314,129.920	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,020	243.830	5,125,306.600	
HASBRO INC	14,977	91.920	1,376,685.840	
HENRY SCHEIN INC	15,048	85.760	1,290,516.480	
HEICO CORP	5,185	137.010	710,396.850	
HERSHEY FOODS CORP	15,684	226.050	3,545,368.200	
HP INC	123,459	37.090	4,579,094.310	
F5 INC	6,924	170.500	1,180,542.000	
CROWN HOLDINGS INC NPR	14,587	105.500	1,538,928.500	
JUNIPER NETWORKS INC	37,136	32.070	1,190,951.520	
HOLOGIC INC	28,297	74.110	2,097,090.670	
HOME DEPOT INC	112,295	294.310	33,049,541.450	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,012	79.260	1,586,151.120	
HORMEL FOODS CORP	30,733	52.010	1,598,423.330	
CENTERPOINT ENERGY INC	71,846	30.730	2,207,827.580	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	212.740	766,289.480	
HUMANA INC	14,200	430.660	6,115,372.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,171	175.790	1,612,170.090	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	145,438	13.350	1,941,597.300	
BIOGEN INC	16,349	193.610	3,165,329.890	
IDEX CORP	7,766	188.060	1,460,473.960	
ILLINOIS TOOL WORKS	34,544	209.270	7,229,022.880	
INTUIT INC	28,703	395.710	11,358,064.130	
IDEXX LABORATORIES INC	9,134	366.640	3,348,889.760	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	25,943	134.220	3,482,069.460	

INTEL CORP	437,958	44.300	19,401,539.400	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	27,504	122.150	3,359,613.600	
INTERNATIONAL PAPER CO	41,902	48.160	2,018,000.320	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	44,364	32.780	1,454,251.920	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	13,899	137.810	1,915,421.190	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	184.990	1,508,038.480	
INCYTE CORP	19,005	75.200	1,429,176.000	
JOHNSON & JOHNSON	283,884	176.370	50,068,621.080	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	38,109	72.110	2,748,039.990	
KLA CORPORATION	15,907	331.350	5,270,784.450	
DEVON ENERGY CORP	71,171	69.690	4,959,906.990	
KELLOGG CO	24,358	72.730	1,771,557.340	
KEYCORP	105,421	19.540	2,059,926.340	
KIMBERLY-CLARK CORP	36,242	137.600	4,986,899.200	
BLACKROCK INC/NEW YORK	16,316	628.620	10,256,563.920	
KROGER CO	75,628	53.850	4,072,567.800	
LAM RESEARCH CORP	15,473	478.230	7,399,652.790	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,157	407.520	2,101,580.640	
PACKAGING CORP OF AMERICA	10,772	162.470	1,750,126.840	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,689	95.370	1,686,999.930	
PLUG POWER INC	56,149	19.410	1,089,852.090	
LENNAR CORP	27,333	78.540	2,146,733.820	
ELI LILLY & CO	87,481	296.900	25,973,108.900	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	52.820	1,487,199.920	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	57.180	1,025,637.660	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	78,366	179.920	14,099,610.720	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,470	121.080	3,931,467.600	
LOCKHEED MARTIN CORP	26,590	449.430	11,950,343.700	
LOEWS CORP	23,530	64.440	1,516,273.200	
LOWE'S COS INC	72,212	192.290	13,885,645.480	
DOMINION ENERGY INC	89,405	84.020	7,511,808.100	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	38.310	1,547,762.310	
MCCORMICK & CO INC	25,192	97.540	2,457,227.680	
MCDONALD'S CORPORATION	80,547	250.780	20,199,576.660	
S&P GLOBAL INC	38,084	345.760	13,167,923.840	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	287.320	1,279,723.280	
MARKEL CORPORATION	1,506	1,329.020	2,001,504.120	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	66,008	100.520	6,635,124.160	
MARSH & MCLENNAN COS	53,891	161.770	8,717,947.070	

MASCO CORP	24,668	53.060	1,308,884.080	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	6,858	346.000	2,372,868.000	
METLIFE INC	76,528	67.540	5,168,701.120	
MEDTRONIC PLC	144,459	103.450	14,944,283.550	
ACTIVISION BLIZZARD INC	85,934	77.840	6,689,102.560	
CVS HEALTH CORP	141,557	100.690	14,253,374.330	
MERCK & CO.INC.	271,813	88.390	24,025,551.070	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	47,958	55.130	2,643,924.540	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,705	251.490	2,692,200.450	
MICROSOFT CORP	768,762	274.730	211,201,984.260	
MICRON TECH INC	119,887	70.350	8,434,050.450	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	59,470	67.560	4,017,793.200	
3M CO	63,252	149.530	9,458,071.560	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	149.770	945,198.470	
ENTEGRIS INC	14,422	115.060	1,659,395.320	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,578	241.960	1,349,652.880	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,189	206.510	3,756,210.390	
ILLUMINA INC	16,449	249.050	4,096,623.450	
XCEL ENERGY INC	58,007	73.080	4,239,151.560	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,061	79.550	800,352.550	
NETAPP INC	24,953	72.990	1,821,319.470	
NEWELL BRANDS INC	41,984	22.480	943,800.320	
NEWMONT CORP	84,401	72.870	6,150,300.870	
NOVAVAX INC	8,342	57.300	477,996.600	
NVR INC	376	4,415.620	1,660,273.120	
NIKE INC-CL B	137,223	114.490	15,710,661.270	
NORDSON CORP	4,856	209.820	1,018,885.920	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,839	255.740	6,608,065.860	
EVERSOURCE ENERGY	37,428	90.400	3,383,491.200	
NISOURCE INC	45,459	29.490	1,340,585.910	
NORTHERN TRUST CORP	21,751	105.350	2,291,467.850	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,024	468.700	7,510,448.800	
WELLS FARGO & CO	428,305	44.550	19,080,987.750	
NUCOR CORP	31,778	136.550	4,339,285.900	
CHENIERE ENERGY INC	25,939	147.270	3,820,036.530	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,799	127.040	5,818,304.960	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	103,065	64.940	6,693,041.100	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10,909	280.340	3,058,229.060	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,044	608.400	4,285,569.600	
ORACLE CORP	176,341	72.490	12,782,959.090	
PACCAR INC	37,599	84.500	3,177,115.500	

PTC INC	11,726	110.410	1,294,667.660	
EXELON CORP	107,970	47.060	5,081,068.200	
PARKER HANNIFIN CORP	14,240	271.540	3,866,729.600	
PAYCHEX INC	34,695	124.160	4,307,731.200	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,332	280.410	2,336,376.120	
PPL CORPORATION	85,923	29.230	2,511,529.290	
PEPSICO INC	148,763	170.410	25,350,702.830	
PENTAIR PLC	17,214	50.480	868,962.720	
PFIZER INC	603,972	49.040	29,618,786.880	
ESSENTIAL UTILITIES INC	27,898	44.610	1,244,529.780	
CONOCOPHILLIPS	139,773	107.690	15,052,154.370	
PG&E CORP	161,265	12.560	2,025,488.400	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	25,590	270.180	6,913,906.200	
ALTRIA GROUP INC	201,649	56.570	11,407,283.930	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	46,451	166.620	7,739,665.620	
BROWN & BROWN INC	26,763	58.240	1,558,677.120	
GARMIN LTD	17,341	106.030	1,838,666.230	
PPG INDUSTRIES INC	24,618	128.530	3,164,151.540	
IPG PHOTONICS CORP	3,586	101.000	362,186.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	47,402	503.360	23,860,270.720	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,282	125.830	2,929,574.060	
QUEST DIAGNOSTICS	13,048	136.300	1,778,442.400	
PROCTER & GAMBLE CO	260,624	156.000	40,657,344.000	
PROGRESSIVE CORP	64,561	109.460	7,066,847.060	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56,393	69.430	3,915,365.990	
PULTE GROUP INC	29,380	42.790	1,257,170.200	
GLOBAL PAYMENTS INC	32,283	121.000	3,906,243.000	
QUALCOMM INC	120,532	140.580	16,944,388.560	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	20,402	97.220	1,983,482.440	
EXACT SCIENCES CORP	18,866	55.000	1,037,630.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,659	623.050	7,264,139.950	
RESMED INC	15,598	202.050	3,151,575.900	
US BANCORP	150,183	49.290	7,402,520.070	
SEAGEN INC	14,899	123.440	1,839,132.560	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	39,388	46.540	1,833,117.520	
ROSS STORES INC	38,805	96.240	3,734,593.200	
ROLLINS INC	25,920	34.030	882,057.600	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,669	439.300	5,126,191.700	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,593	214.510	2,701,324.430	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,519	69.850	1,852,352.150	
RPM INTERNATIONAL INC	13,691	84.360	1,154,972.760	
ACCENTURE PLC-CL A	67,832	295.740	20,060,635.680	

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	149,102	65.730	9,800,474.460	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,092	212.500	2,782,050.000	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	27,241	171.640	4,675,645.240	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	64,694	98.270	6,357,479.380	
BOOKING HOLDINGS INC	4,388	2,194.230	9,628,281.240	
SCHLUMBERGER LTD	147,948	43.030	6,366,202.440	
SCHWAB (CHARLES) CORP	155,288	67.420	10,469,516.960	
POOL CORP	4,438	394.300	1,749,903.400	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,960	120.330	2,762,776.800	
BUNGE LTD	14,313	115.230	1,649,286.990	
SEI INVESTMENTS CO	14,981	55.490	831,295.690	
ANTHEM INC	25,999	504.640	13,120,135.360	
AMERISOURCEBERGEN CORP	15,652	159.010	2,488,824.520	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,849	70.260	1,745,890.740	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26,307	273.380	7,191,807.660	
CENTENE CORP	62,490	84.030	5,251,034.700	
SVB FINANCIAL GROUP	6,303	493.740	3,112,043.220	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	59.400	882,446.400	
SNAP-ON INC	6,252	218.130	1,363,748.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	40,770	106.680	4,349,343.600	
ADVANCE AUTO PARTS	7,015	202.860	1,423,062.900	
EDISON INTERNATIONAL	38,351	70.300	2,696,075.300	
SOUTHERN CO	116,718	74.670	8,715,333.060	
TRUIST FINANCIAL CORP	142,294	49.060	6,980,943.640	
SOUTHWEST AIRLINES	14,171	46.120	653,566.520	
AT&T INC	766,600	20.030	15,354,998.000	
CHEVRON CORP	207,097	170.690	35,349,386.930	
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,045	121.030	2,183,986.350	
STATE STREET CORP	39,623	70.130	2,778,760.990	
STARBUCKS CORP	125,186	76.520	9,579,232.720	
STEEL DYNAMICS INC	22,935	79.660	1,827,002.100	
STRYKER CORP	36,186	240.080	8,687,534.880	
NETFLIX INC	47,448	180.970	8,586,664.560	
NORTONLIFELOCK INC	65,805	24.700	1,625,383.500	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	49.440	827,131.200	
SYNOPSYS INC	16,447	274.710	4,518,155.370	
SYSCO CORP	56,592	82.480	4,667,708.160	
INTUITIVE SURGICAL INC	37,904	224.850	8,522,714.400	
TELEFLEX INC	5,347	269.610	1,441,604.670	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,349	7.840	872,976.160	

TERADYNE INC	18,196	105.920	1,927,320.320	
TEXAS INSTRUMENTS INC	99,632	167.450	16,683,378.400	
TEXTRON INC	21,583	68.540	1,479,298.820	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	42,335	546.680	23,143,697.800	
GLOBE LIFE INC	9,737	100.030	973,992.110	
DAVITA INC	6,813	102.960	701,466.480	
TRACTOR SUPPLY CO	12,716	202.560	2,575,752.960	
BIO-TECHNE CORP	4,303	372.930	1,604,717.790	
TRIMBLE INC	27,466	64.080	1,760,021.280	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,035	363.910	1,468,376.850	
TYSON FOODS INC	32,029	90.820	2,908,873.780	
UGI CORP	25,006	37.690	942,476.140	
UNION PACIFIC CORP	69,019	229.590	15,846,072.210	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	160,724	95.300	15,316,997.200	
UNITEDHEALTH GROUP INC	101,431	499.620	50,676,956.220	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	127.800	1,034,668.800	
VF CORP	37,034	47.610	1,763,188.740	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	27.910	1,883,003.970	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,852	253.930	6,818,528.360	
VULCAN MATERIALS CO	14,881	169.880	2,527,984.280	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	78,807	43.990	3,466,719.930	
WALMART INC	165,404	149.560	24,737,822.240	
WASTE MANAGEMENT INC	43,942	161.780	7,108,936.760	
WATERS CORP	6,859	327.930	2,249,271.870	
WEBSTER FINANCIAL CORP	21,208	48.160	1,021,377.280	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,027	306.340	2,458,991.180	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,307	140.840	1,733,317.880	
VAIL RESORTS INC	4,389	248.470	1,090,534.830	
WESTERN DIGITAL CORP	35,249	59.450	2,095,553.050	
WABTEC CORP	17,222	89.800	1,546,535.600	
WHIRLPOOL CORP	7,053	191.090	1,347,757.770	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,520	105.710	1,957,749.200	
WYNN RESORTS LTD	12,220	66.300	810,186.000	
NASDAQ INC	13,278	152.290	2,022,106.620	
CME GROUP INC	38,510	210.370	8,101,348.700	
WILLIAMS COS INC	127,577	36.670	4,678,248.590	
LKQ CORP	31,694	50.870	1,612,273.780	
ALLIANT ENERGY CORP	23,323	58.740	1,369,993.020	
WEC ENERGY GROUP INC	35,339	100.660	3,557,223.740	
CARMAX INC	18,373	94.700	1,739,923.100	
TJX COMPANIES INC	127,789	60.410	7,719,733.490	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,884	342.590	2,015,799.560	

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.720	539,727.280	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	21,528	53.970	1,161,866.160	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,928	134.750	1,742,048.000	
SIGNATURE BANK	6,557	234.860	1,539,977.020	
CBRE GROUP INC	37,223	81.220	3,023,252.060	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	22.590	356,447.610	
REGIONS FINANCIAL CORP	105,364	21.120	2,225,287.680	
DOMINO'S PIZZA INC	4,070	341.790	1,391,085.300	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,783	444.940	2,128,148.020	
T-MOBILE US INC	66,788	126.800	8,468,718.400	
LAS VEGAS SANDS CORP	38,350	34.290	1,315,021.500	
MOSAIC CO/THE	40,897	64.050	2,619,452.850	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	265.040	1,111,312.720	
CELANESE CORP	11,567	148.990	1,723,367.330	
DEXCOM INC	10,401	351.890	3,660,007.890	
EXPEDIA GROUP INC	15,713	132.330	2,079,301.290	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,694	99.820	2,464,955.080	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,408	266.600	3,307,972.800	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	23.540	848,240.360	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	60,297	99.810	6,018,243.570	
LIVE NATION	18,413	92.510	1,703,386.630	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,008	1,354.530	4,074,426.240	
TRANSDIGM GROUP INC	5,847	584.120	3,415,349.640	
MASTERCARD INC	94,448	347.120	32,784,789.760	
WESTERN UNION CO	46,712	16.960	792,235.520	
OWENS CORNING	10,366	94.930	984,044.380	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,114	103.210	1,559,915.940	
AERCAP HOLDINGS NV	13,522	46.260	625,527.720	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,660	5.020	93,673.200	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	12,312	141.840	1,746,334.080	
DELTA AIR LINES INC	15,786	41.000	647,226.000	
INSULET CORP	7,813	205.570	1,606,118.410	
DISCOVER FINANCIAL	32,818	111.010	3,643,126.180	
TE CONNECTIVITY LTD	35,357	127.310	4,501,299.670	
MASIMO CORP	5,688	129.230	735,060.240	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,748	317.050	4,041,753.400	
VMWARE INC	22,568	100.630	2,271,017.840	
MERCADOLIBRE INC	4,794	927.550	4,446,674.700	
ULTA BEAUTY INC	5,573	389.430	2,170,293.390	

INVESCO LTD	38,530	18.460	711,263.800	
MSCI INC	8,860	405.610	3,593,704.600	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	167,373	98.940	16,559,884.620	
VISA INC	179,802	202.820	36,467,441.640	
KEURIG DR PEPPER INC	81,648	36.960	3,017,710.080	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20,056	149.010	2,988,544.560	
MARATHON PETROLEUM CORP	65,217	95.920	6,255,614.640	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,542	70.910	960,263.220	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	229,576	19.300	4,430,816.800	
XYLEM INC	17,109	85.210	1,457,857.890	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,220	110.220	3,220,628.400	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,719	216.250	1,020,483.750	
SPLUNK INC	18,329	103.370	1,894,668.730	
EPAM SYSTEMS INC	6,415	347.000	2,226,005.000	
ZILLOW GROUP INC	8,060	37.370	301,202.200	
HCA HEALTHCARE INC	27,377	227.350	6,224,160.950	
VERISK ANALYTICS INC	16,630	185.420	3,083,534.600	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,554	152.640	1,000,402.560	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,723	224.260	1,956,219.980	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	19,735	144.910	2,859,798.850	
NXP SEMICONDUCTOR NV	29,373	177.580	5,216,057.340	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	14,445	84.340	1,218,291.300	
LEAR CORP	7,051	130.980	923,539.980	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,131	111.250	1,238,323.750	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,542	62.400	1,656,220.800	
DOLLAR GENERAL CORP	25,074	233.560	5,856,283.440	
FORTINET INC	14,882	266.370	3,964,118.340	
HORIZON PHARMA PLC	24,103	86.780	2,091,658.340	
TESLA INC	91,958	865.650	79,603,442.700	
GENERAC HOLDINGS INC	7,096	241.690	1,715,032.240	
ENPHASE ENERGY INC	14,290	165.890	2,370,568.100	
GENERAL MOTORS CO	144,099	39.580	5,703,438.420	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	41.820	1,640,598.600	
APTIV PLC	29,162	101.840	2,969,858.080	
PHILLIPS 66	51,476	96.360	4,960,227.360	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,158	77.200	706,997.600	
META PLATFORMS INC	254,714	203.770	51,903,071.780	
IQVIA HOLDINGS INC	20,457	213.820	4,374,115.740	
DIAMONDBACK ENERGY INC	18,618	142.930	2,661,070.740	

SERVICENOW INC	21,107	456.740	9,640,411.180	
PALO ALTO NETWORKS INC	10,431	504.870	5,266,298.970	
WORKDAY INC	20,746	189.460	3,930,537.160	
ABBVIE INC	189,808	152.830	29,008,356.640	
ZOETIS INC	50,463	169.210	8,538,844.230	
NEWS CORP/NEW-CL A	40,345	17.110	690,302.950	
CDW CORP	14,923	170.620	2,546,162.260	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	35.030	1,485,727.390	
TWILIO INC	18,377	107.380	1,973,322.260	
COUPA SOFTWARE INC	8,176	76.020	621,539.520	
SNAP INC	120,480	24.920	3,002,361.600	
TRADE DESK INC A	48,596	48.920	2,377,316.320	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,265	61.400	1,367,071.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	40.250	356,011.250	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	40.220	799,211.620	
OKTA INC	14,677	102.450	1,503,658.650	
BLACK KNIGHT INC	17,653	70.910	1,251,774.230	
BAKER HUGHES CO	88,694	32.130	2,849,738.220	
BROADCOM INC	44,310	580.100	25,704,231.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9,285	76.410	709,466.850	
MONGODB INC	6,448	299.710	1,932,530.080	
BURLINGTON STORES INC	7,274	196.700	1,430,795.800	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	42,679	23.790	1,015,333.410	
VEEVA SYSTEMS INC	15,572	174.860	2,722,919.920	
TWITTER INC	86,209	49.800	4,293,208.200	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	16,816	45.750	769,332.000	
EVERGY INC	23,678	68.100	1,612,471.800	
ALLEGION PLC	9,404	112.570	1,058,608.280	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14,074	54.890	772,521.860	
STERIS PLC	10,112	224.710	2,272,267.520	
DOCUSIGN INC	19,673	74.570	1,467,015.610	
WIX.COM LTD	5,855	71.950	421,267.250	
DROPBOX INC	30,479	21.140	644,326.060	
KKR & CO INC	58,985	53.550	3,158,646.750	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	29.880	150,894.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	24,609	96.380	2,371,815.420	
MODERNA INC	38,060	134.400	5,115,264.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	29,828	143.480	4,279,721.440	
ARAMARK	22,573	35.830	808,790.590	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	13.760	824,058.880	
CIGNA CORP	35,380	266.900	9,442,922.000	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	45.580	1,493,656.600	
DOW INC	79,358	67.930	5,390,788.940	
AMCOR PLC	170,579	12.810	2,185,116.990	

PINTEREST INC	63,965	22.690	1,451,365.850	
PELOTON INTERACTIVE INC	27,064	15.700	424,904.800	
FOX CORP-A	36,565	34.600	1,265,149.000	
FOX CORP-B	15,511	32.060	497,282.660	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	14.650	623,884.900	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	21,024	164.810	3,464,965.440	
CHEWY INC	9,648	27.400	264,355.200	
AVANTOR INC	57,365	31.090	1,783,477.850	
LYFT INC	26,175	20.510	536,849.250	
DYNATRACE INC	20,512	35.640	731,047.680	
CLOUDFLARE INC	29,127	65.610	1,911,022.470	
TRADEWEB MARKETS INC	10,585	63.870	676,063.950	
CARRIER GLOBAL CORP	88,615	37.780	3,347,874.700	
OTIS WORLDWIDE CORP	43,684	74.580	3,257,952.720	
INMODE LTD	5,754	24.350	140,109.900	
UBER TECHNOLOGIES INC	155,782	26.070	4,061,236.740	
CORTEVA INC	81,329	55.740	4,533,278.460	
MATCH GROUP INC	29,019	74.070	2,149,437.330	
BILL.COM HOLDINGS INC	8,262	121.000	999,702.000	
BLACKSTONE INC	73,278	101.490	7,436,984.220	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	3,343	47.050	157,288.150	
CARLYLE GROUP INC	17,850	37.690	672,766.500	
10X GENOMICS INC	8,136	51.190	416,481.840	
DATADOG INC	24,410	110.000	2,685,100.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	82.620	1,843,086.960	
UPSTART HOLDINGS INC	4,442	83.890	372,639.380	
INGERSOLL RAND INC	42,467	43.800	1,860,054.600	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,653	295.240	1,668,991.720	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	18,691	28.790	538,113.890	
DRAFTKINGS INC	35,534	13.150	467,272.100	
ASANA INC	7,477	25.000	186,925.000	
UNITY SOFTWARE INC	5,698	57.340	326,723.320	
AON PLC	24,306	286.290	6,958,564.740	
SOFI TECHNOLOGIES INC	57,384	6.440	369,552.960	
WARNER BROS DISCOVERY INC	239,503	17.750	4,251,178.250	
BENTLEY SYSTEMS INC	17,230	38.490	663,182.700	
COINBASE GLOBAL INC	4,176	103.740	433,218.240	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	24.950	462,273.600	
IAC/INTERACTIVECORP	7,652	77.160	590,428.320	
AIRBNB INC	32,639	135.840	4,433,681.760	
ZENDESK INC	12,612	113.880	1,436,254.560	
CONSTELLATION ENERGY CORP	33,319	60.270	2,008,136.130	
ROYALTY PHARMA PLC	37,502	39.720	1,489,579.440	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	46.750	1,386,418.000	
VIATRIS INC	132,223	9.950	1,315,618.850	

CAESARS ENTERTAINMENT INC	23,146	59.950	1,387,602.700	
SNOWFLAKE INC	23,352	155.270	3,625,865.040	
DOORDASH INC	11,653	72.110	840,297.830	
ARISTA NETWORKS INC	25,635	110.980	2,844,972.300	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	39,016	52.900	2,063,946.400	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	181,564	9.480	1,721,226.720	
FNF GROUP	31,255	40.740	1,273,328.700	
MARVELL TECHNOLOGY INC	87,288	57.750	5,040,882.000	
ROBINHOOD MARKETS INC	20,748	10.120	209,969.760	
LUCID GROUP INC	44,910	18.150	815,116.500	
GRAB HOLDINGS LTD	113,116	3.010	340,479.160	
CATALENT INC	18,217	98.830	1,800,386.110	
SYNCHRONY FINANCIAL	62,486	38.050	2,377,592.300	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	45,607	40.010	1,824,736.070	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,756	126.380	474,683.280	
WAYFAIR INC	7,350	66.170	486,349.500	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	20,242	138.780	2,809,184.760	
HUBSPOT INC	5,077	356.380	1,809,341.260	
QORVO INC	11,596	107.120	1,242,163.520	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,603	109.750	285,679.250	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,342	114.570	1,757,732.940	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5,852	251.810	1,473,592.120	
GODADDY INC	17,571	76.980	1,352,615.580	
KORNIT DIGITAL LTD	5,217	64.190	334,879.230	
ETSY INC	13,841	86.380	1,195,585.580	
TRANSUNION	20,148	84.440	1,701,297.120	
BLOCK INC	53,667	96.190	5,162,228.730	
DUPONT DE NEMOURS INC	57,647	65.420	3,771,266.740	
CARVANA CO	8,245	46.480	383,227.600	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,409	48.710	1,091,542.390	
TELADOC HEALTH INC	15,648	33.450	523,425.600	
WESTROCK CO	27,826	53.400	1,485,908.400	
KRAFT HEINZ CO	75,414	43.590	3,287,296.260	
NOVOCURE LTD	10,423	73.170	762,650.910	
FORTIVE CORP	38,676	60.780	2,350,727.280	
WASTE CONNECTIONS INC	27,976	126.750	3,545,958.000	
ALPHABET INC-CL A	32,387	2,314.930	74,973,637.910	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	143,387	15.690	2,249,742.030	
PAYPAL HOLDINGS INC	119,328	81.680	9,746,711.040	

	SEA LTD ADR	34,567	76.200	2,634,005.400	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	34,012	29.340	997,912.080	
	SUNRUN INC	17,098	23.410	400,264.180	
	ZILLOW GROUP INC-C	16,321	38.050	621,014.050	
	ALPHABET INC-CL C	30,851	2,313.200	71,364,533.200	
	ZSCALER INC	9,288	172.940	1,606,266.720	
	CABLE ONE INC	570	1,127.190	642,498.300	
	LINDE PLC	54,943	308.660	16,958,706.380	
	ROKU INC	12,563	96.830	1,216,475.290	
	AVALARA INC	10,495	78.420	823,017.900	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,270	459.770	6,101,147.900	
	VISTRA CORP	42,712	26.620	1,136,993.440	
アメリカ・ドル　小計		34,380,625		3,855,826,065.050 (504,264,932,789)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	14.570	669,680.910	
	ASHTEAD GROUP	49,729	38.790	1,928,987.910	
	SEVERN TRENT PLC	30,135	29.960	902,844.600	
	BARCLAYS PLC	1,812,763	1.486	2,693,765.810	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.701	583,845.390	
	BT GROUP PLC	1,005,980	1.757	1,767,506.860	
	BUNZL PLC	38,046	30.280	1,152,032.880	
	AVIVA PLC	399,688	4.149	1,658,305.510	
	CRODA INTERNATIONAL	14,503	70.380	1,020,721.140	
	DIAGEO PLC	249,166	37.835	9,427,195.610	
	SCHRODERS PLC	12,178	28.200	343,419.600	
	DCC PLC	11,135	61.920	689,479.200	
	NATIONAL GRID PLC	400,532	11.795	4,724,274.940	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.370	534,179.040	
	BAE SYSTEMS PLC	353,005	7.560	2,668,717.800	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	240,158	33.000	7,925,214.000	
	HALMA PLC	35,487	23.270	825,782.490	
	NEXT PLC	13,982	59.480	831,649.360	
	IMPERIAL BRANDS PLC	106,272	16.575	1,761,458.400	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	22.980	459,048.480	
	ANGLO AMERICAN PLC	135,768	34.885	4,736,266.680	
	COMPASS GROUP PLC	190,828	16.500	3,148,662.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,177,738	5.020	10,932,244.760	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	587,598	2.398	1,409,060.000	
	UNILEVER PLC	274,289	35.970	9,866,175.330	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,616	10.920	782,046.720	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	43,040	15.880	683,475.200	
	PEARSON PLC	86,953	7.676	667,451.220	
	PERSIMMON PLC	35,252	20.390	718,788.280	

PRUDENTIAL PLC	307,481	9.206	2,830,670.080	
RIO TINTO PLC	120,197	54.400	6,538,716.800	
VODAFONE GROUP PLC	3,040,627	1.204	3,660,914.900	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	75,166	63.240	4,753,497.840	
RELX PLC	213,407	23.070	4,923,299.490	
RENTOKIL INITIAL PLC	204,183	5.252	1,072,369.110	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	847,047	0.803	680,178.740	
NATWEST GROUP PLC	606,899	2.095	1,271,453.400	
ST JAMES'S PLACE PLC	64,417	12.155	782,988.630	
SSE PLC	116,055	18.280	2,121,485.400	
BP PLC	2,095,958	4.266	8,941,356.820	
SAGE GROUP PLC(THE)	99,190	6.946	688,973.740	
SMITHS GROUP PLC	37,796	14.825	560,325.700	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,696	113.250	984,822.000	
STANDARD CHARTERED PLC	289,493	5.600	1,621,160.800	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,640,996	0.433	3,308,551.260	
TAYLOR WIMPLEY PLC	359,514	1.234	443,640.270	
TESCO PLC	827,233	2.714	2,245,110.360	
3I GROUP PLC	107,283	12.605	1,352,302.210	
SMITH & NEPHEW PLC	93,066	13.035	1,213,115.310	
GLAXOSMITHKLINE PLC	554,322	17.690	9,805,956.180	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	36,606	72.960	2,670,773.760	
WPP PLC	120,328	9.708	1,168,144.220	
ASTRAZENECA PLC	166,396	103.220	17,175,395.120	
WHITBREAD PLC	16,795	27.040	454,136.800	
INTERTEK GROUP PLC	17,114	49.230	842,522.220	
BURBERRY GROUP PLC	41,060	15.240	625,754.400	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,052	49.220	1,036,179.440	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.279	437,789.060	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	23.450	500,071.250	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	40.070	455,195.200	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	17.350	320,194.250	
AVEVA GROUP PLC	10,907	21.440	233,846.080	
ABRDN PLC	213,433	1.822	388,874.920	
EXPERIAN PLC	99,462	26.460	2,631,764.520	
MONDI PLC	42,399	15.860	672,448.140	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.452	312,233.780	
OCADO GROUP PLC	46,768	8.002	374,237.530	
INFORMA PLC	157,970	5.678	896,953.660	
GLENCORE PLC	1,051,528	4.876	5,127,250.520	
ENTAIN PLC	61,865	13.710	848,169.150	
COCA-COLA HBC AG	21,338	15.480	330,312.240	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	87,616	5.772	505,719.550	

	FERGUSON PLC	24,640	93.320	2,299,404.800	
	M&G PLC	270,401	2.092	565,678.890	
	JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.235	311,442.300	
	SHELL PLC	826,364	22.995	19,002,240.180	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.794	642,166.400	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.135	552,979.940	
イギリス・ポンド　小計		30,964,835		196,695,047.480 (31,656,100,941)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	115,189	28.560	3,289,797.840	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	152,152	32.400	4,929,724.800	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,182	688.500	2,190,807.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	112,553	18.700	2,104,741.100	
	ICL GROUP LTD	72,257	36.460	2,634,490.220	
	NICE LTD	6,507	658.000	4,281,606.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	110.500	1,927,120.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	253.200	1,182,950.400	
イスラエル・シュケル　小計		483,952		22,541,237.360 (866,399,507)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,170	77.800	1,413,626.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	311,649	26.760	8,339,727.240	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	390,220	23.830	9,298,942.600	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	189,907	20.830	3,955,762.810	
	TELSTRA CORP LTD	484,907	3.970	1,925,080.790	
	ASX LTD	20,036	84.540	1,693,843.440	
	BHP GROUP LTD	541,832	46.800	25,357,737.600	
	AMPOL LTD	22,528	33.040	744,325.120	
	COMPUTERSHARE LT	55,283	24.270	1,341,718.410	
	CSL LIMITED	50,909	268.160	13,651,757.440	
	REA GROUP LTD	6,134	112.150	687,928.100	
	TRANSURBAN GROUP	336,379	14.300	4,810,219.700	
	COCHLEAR LTD	7,511	219.390	1,647,838.290	
	ORIGIN ENERGY LTD	204,918	7.010	1,436,475.180	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	183,228	102.400	18,762,547.200	
	RIO TINTO LIMITED	40,398	109.260	4,413,885.480	
	APA GROUP	125,299	11.340	1,420,890.660	
	ARISTOCRAT LEISU	65,513	32.140	2,105,587.820	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.630	1,304,104.320	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	49,035	39.310	1,927,565.850	
	ORICA LTD	43,659	15.910	694,614.690	
	LEND LEASE CORP LTD	65,475	11.790	771,950.250	
	BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	18.450	928,496.250	

	MACQUARIE GROUP LTD	35,596	186.900	6,652,892.400	
	SUNCORP GROUP LTD	127,921	11.310	1,446,786.510	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	348,607	31.620	11,022,953.340	
	NEWCREST MINING LTD	100,257	26.430	2,649,792.510	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.500	619,624.500	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	171,012	12.640	2,161,591.680	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	131,418	9.420	1,237,957.560	
	REECE LTD	31,558	16.820	530,805.560	
	SANTOS LTD	352,203	8.050	2,835,234.150	
	SONIC HEALTHCARE	51,568	35.940	1,853,353.920	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	27.060	703,154.100	
	TABCORP HOLDINGS LTD	227,460	5.150	1,171,419.000	
	WESFARMERS LTD	121,938	49.600	6,048,124.800	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	104,861	31.390	3,291,586.790	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	125,505	38.150	4,788,015.750	
	SEEK LTD	38,405	25.310	972,030.550	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,284	66.290	416,566.360	
	MINERAL RESOURCES LTD	16,953	56.360	955,471.080	
	BRAMBLES LTD	127,620	10.480	1,337,457.600	
	CROWN RESORTS LTD	35,145	12.820	450,558.900	
	EVOLUTION MINING LTD	224,674	3.810	856,007.940	
	AURIZON HOLDINGS LTD	235,025	4.030	947,150.750	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	11.220	888,994.260	
	XERO LTD	14,590	86.570	1,263,056.300	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	24.800	589,768.800	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	7.630	1,224,386.100	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.250	970,372.000	
	SOUTH32 LTD(AUD)	489,406	4.630	2,265,949.780	
	COLES GROUP LTD	146,272	18.670	2,730,898.240	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	41.370	613,227.510	
オーストラリア・ドル　小計		7,524,784		172,129,813.980 (15,784,303,942)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	48,157	73.910	3,559,283.870	
	BARRICK GOLD CORP	194,489	28.880	5,616,842.320	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	23,190	10.050	233,059.500	
	BANK OF MONTREAL	70,933	134.810	9,562,477.730	
	BANK OF NOVA SCOTIA	132,876	82.070	10,905,133.320	
	NATIONAL BANK OF CANADA	37,640	91.160	3,431,262.400	
	BCE INC	7,697	69.500	534,941.500	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	151,267	62.420	9,442,086.140	

BAUSCH HEALTH COS INC	30,250	20.690	625,872.500	
SAPUTO INC	26,668	26.820	715,235.760	
BLACKBERRY LTD	49,855	7.240	360,950.200	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	59,247	17.790	1,054,004.130	
CGI INC	24,878	102.420	2,548,004.760	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	55.260	904,219.380	
CAE INC	32,283	30.640	989,151.120	
CAMECO CORP	45,781	30.710	1,405,934.510	
ROGERS COMM-CL B	34,794	66.960	2,329,806.240	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	49,499	139.820	6,920,950.180	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	124,126	82.040	10,183,297.040	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	169.450	1,037,711.800	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,111	38.820	353,689.020	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	75,779	149.890	11,358,514.310	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	39.820	864,611.660	
OPEN TEXT CORP	25,976	49.360	1,282,175.360	
EMPIRE CO LTD	16,169	42.050	679,906.450	
KINROSS GOLD CORP	123,889	6.330	784,217.370	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	67.420	895,742.120	
FORTIS INC	54,125	62.930	3,406,086.250	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	66,080	33.020	2,181,961.600	
TELUS CORP	31,890	32.280	1,029,409.200	
GREAT WEST LIFECO INC	26,893	33.970	913,555.210	
IMPERIAL OIL LTD	27,505	68.020	1,870,890.100	
ENBRIDGE INC	215,904	58.470	12,623,906.880	
IGM FINANCIAL INC	12,478	37.420	466,926.760	
MANULIFE FINANCIAL CORP	210,735	24.960	5,259,945.600	
LOBLAW CO LTD	18,965	111.760	2,119,528.400	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	94,400	55.210	5,211,824.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	31,727	77.020	2,443,613.540	
SUN LIFE FINANCIAL INC	63,767	63.680	4,060,682.560	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,909	675.770	1,965,814.930	
METRO INC	28,229	68.970	1,946,954.130	
EMERA INC	30,854	62.110	1,916,341.940	
ONEX CORP	7,000	74.390	520,730.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	31.340	605,582.820	
POWER CORP OF CANADA	59,749	36.860	2,202,348.140	
QUEBECOR INC-B	17,195	29.540	507,940.300	
ROYAL BANK OF CANADA	155,542	129.590	20,156,687.780	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	99,112	93.280	9,245,167.360	
SHAW COMM INC-B	45,342	37.560	1,703,045.520	

	SUNCOR ENERGY INC	160,650	47.700	7,663,005.000	
	LUNDIN MINING CORP	68,762	11.010	757,069.620	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	51,746	51.430	2,661,296.780	
	THOMSON REUTERS CORP	17,791	121.620	2,163,741.420	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	109.130	1,054,741.450	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	196,299	92.970	18,249,918.030	
	TC ENERGY CORP	103,542	71.430	7,396,005.060	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,698	117.230	1,136,896.540	
	WESTON (GEORGE) LTD	8,379	155.340	1,301,593.860	
	INTACT FINANCIAL CORP	18,757	177.060	3,321,114.420	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	51,554	56.890	2,932,907.060	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,190	1,979.250	4,334,557.500	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,864	193.980	3,853,218.720	
	TOURMALINE OIL CORP	33,964	72.070	2,447,785.480	
	KEYERA CORP	24,571	31.820	781,849.220	
	PARKLAND CORP	15,665	35.060	549,214.900	
	ALTAGAS LTD	34,755	29.180	1,014,150.900	
	PEMBINA PIPELINE CORP	59,037	50.770	2,997,308.490	
	DOLLARAMA INC	32,237	70.540	2,273,997.980	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	142,169	26.280	3,736,201.320	
	NORTHLAND POWER INC	25,030	39.250	982,427.500	
	TMX GROUP LTD	4,887	133.470	652,267.890	
	IVANHOE MINES LTD	64,027	9.740	623,622.980	
	NUTRIEN LTD	61,558	133.680	8,229,073.440	
	TFI INTERNATIONAL INC	9,399	108.340	1,018,287.660	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	12,150	25.340	307,881.000	
	WSP GLOBAL INC	13,164	145.330	1,913,124.120	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,011	66.930	803,896.230	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	17,254	38.130	657,895.020	
	NUVEI CORP	7,929	63.980	507,297.420	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	11,764	46.460	546,555.440	
	AIR CANADA	18,814	21.890	411,838.460	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,472	67.650	2,196,730.800	
	SHOPIFY INC	11,999	486.070	5,832,353.930	
	FIRSTSERVICE CORP	5,101	157.270	802,234.270	
	CANOPY GROWTH CORP	20,287	7.670	155,601.290	
	HYDRO ONE LTD	37,626	34.900	1,313,147.400	
カナダ・ドル　小計		4,198,531		268,518,832.310 (27,141,883,570)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	213,200	4.020	857,064.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	198,410	33.070	6,561,418.700	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	8.060	317,564.000	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	72,800	9.620	700,336.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.795	605,148.430	
	KEPPEL CORP LTD	144,600	6.790	981,834.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	370,598	11.940	4,424,940.120	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	855,130	2.740	2,343,056.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	166,400	5.370	893,568.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,666	29.560	3,832,926.960	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	7.030	306,508.000	
	VENTURE CORP LTD	22,300	18.110	403,853.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,400	4.340	843,696.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.960	1,214,096.400	
シンガポール・ドル　小計		3,518,287		24,286,009.810 (2,285,556,383)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	303,566	6.648	2,018,106.760	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	60.960	1,157,203.680	
	NESTLE SA-REGISTERED	303,569	123.360	37,448,271.840	
	CIE FINANC RICHEMONT	55,361	104.900	5,807,368.900	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	75,230	346.100	26,037,103.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,316	181.450	964,588.200	
	SIKA INHABER	15,252	274.700	4,189,724.400	
	SGS SA-REG	650	2,423.000	1,574,950.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	236,856	84.670	20,054,597.520	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,827	160.200	613,085.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	435	2,236.000	972,660.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	17.100	360,331.200	
	SWISSCOM AG-REG	2,998	585.400	1,755,029.200	
	ABB LTD	175,875	28.670	5,042,336.250	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,351	35.750	691,798.250	
	GEBERIT AG	3,639	515.000	1,874,085.000	
	LONZA GROUP AG-REG	7,834	549.400	4,303,999.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	10,080.000	1,179,360.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	105,800.000	1,163,800.000	
	GIVAUDAN-REG	964	3,616.000	3,485,824.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,462	447.300	7,363,452.600	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,786	378.600	1,433,379.600	
	HOLCIM LTD	58,461	47.790	2,793,851.190	
	TEMENOS GROUP	7,082	101.850	721,301.700	
	BACHEM HOLDING AG	2,630	74.700	196,461.000	
	SONOVA HOLDING AG	6,012	349.000	2,098,188.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,959	256.200	1,526,695.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	11,500	111.100	1,277,650.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	235.200	736,176.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,026	45.060	226,471.560	

	SCHINDLER NAMEN	1,661	181.400	301,305.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,073	549.000	1,687,077.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	836.500	677,565.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	95.600	800,363.200	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,497	1,010.500	2,523,218.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,896	46.980	1,216,594.080	
	SWISS RE LTD	32,843	78.160	2,567,008.880	
	ALCON INC	55,647	68.220	3,796,238.340	
	VIFOR PHARMA AG	5,556	174.200	967,855.200	
	UBS GROUP AG	374,142	16.900	6,322,999.800	
	VAT GROUP AG	3,145	277.800	873,681.000	
スイス・フラン　小計		1,884,596		160,801,757.050 (21,237,088,054)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	72,757	419.300	30,507,010.100	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,042	364.800	15,336,921.600	
	ERICSSON LM-B SHS	324,469	77.010	24,987,357.690	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	293.700	7,564,243.500	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	186.100	10,875,125.700	
	LUNDBERGS B	7,859	433.300	3,405,304.700	
	SKF AB-B SHS	28,236	162.000	4,574,232.000	
	SANDVIK AB	124,173	178.700	22,189,715.100	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	178,021	107.100	19,066,049.100	
	SKANSKA AB-B SHS	33,216	170.850	5,674,953.600	
	SWEDBANK AB	94,382	152.600	14,402,693.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	69,136	179.200	12,389,171.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	97.820	15,850,361.520	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	160.800	3,891,038.400	
	VOLVO AB-B SHS	155,325	157.620	24,482,326.500	
	SWEDISH MATCH AB	167,443	76.500	12,809,389.500	
	TELE2 AB-B SHS	48,914	129.500	6,334,363.000	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	238.500	3,647,142.000	
	INDUSTRIVARDEN C	9,760	235.400	2,297,504.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	151.500	4,076,410.500	
	SECURITAS AB-B SHS	15,716	105.700	1,661,181.200	
	INVESTOR AB-B SHS	198,720	172.800	34,338,816.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	121.980	10,037,368.260	
	ASSA ABLOY AB-B	109,448	232.400	25,435,715.200	
	TELIA CO AB	283,582	39.960	11,331,936.720	
	LUNDIN ENERGY AB	21,720	428.800	9,313,536.000	
	BOLIDEN AB	29,779	392.400	11,685,279.600	
	ALFA LAVAL AB	27,935	255.900	7,148,566.500	
	KINNEVIK AB-B	22,633	169.700	3,840,820.100	
	FASTIGHETS AB BALDER	12,157	430.000	5,227,510.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	87.160	4,163,546.040	

	NIBE INDUSTRIER AB	160,889	84.560	13,604,773.840	
	HEXAGON AB-B SHS	215,068	117.900	25,356,517.200	
	SAGAX AB	19,038	219.800	4,184,552.400	
	EPIROC AB-A	73,781	185.050	13,653,174.050	
	EPIROC AB-B	41,205	158.150	6,516,570.750	
	ESSITY AB-B	68,868	253.000	17,423,604.000	
	EQT AB	31,718	251.900	7,989,764.200	
	EMBRACER GROUP AB	51,636	70.750	3,653,247.000	
	LIFCO AB	26,835	185.200	4,969,842.000	
	EVOLUTION AB	19,180	1,022.800	19,617,304.000	
	NORDEA BANK ABP	350,614	96.430	33,809,708.020	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	225.500	3,504,044.500	
	SINCH AB	59,403	41.080	2,440,275.240	
スウェーデン・クローナ　小計		3,653,878		525,268,965.730 (6,881,023,451)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,908	861.000	9,391,788.000	
	A P MOLLER A/S	640	21,010.000	13,446,400.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	20,260.000	7,273,340.000	
	DANSKE BANK A/S	72,887	108.150	7,882,729.050	
	GENMAB A/S	7,190	2,209.000	15,882,710.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,915	455.800	10,900,457.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,843.000	1,608,939.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	179,966	781.300	140,607,435.800	
	GN STORE NORD A/S	15,343	229.500	3,521,218.500	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	113,252	164.620	18,643,544.240	
	COLOPLAST-B	12,609	899.400	11,340,534.600	
	DSV A/S	22,036	1,110.000	24,459,960.000	
	DEMANT A/S	11,367	295.900	3,363,495.300	
	TRYG A/S	37,118	158.700	5,890,626.600	
	PANDORA A/S	9,912	539.600	5,348,515.200	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,433	542.000	6,738,686.000	
	AMBU A/S B	15,501	90.540	1,403,460.540	
	ORSTED A/S	20,637	734.400	15,155,812.800	
デンマーク・クローネ　小計		566,946		302,859,652.630 (5,602,903,574)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	156,778	7.650	1,199,351.700	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	51,768	8.820	456,593.760	
	FISHER & PAYKEL	60,887	21.950	1,336,469.650	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	4.890	1,071,095.820	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.750	361,295.500	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	4.630	611,886.910	
ニュージーランド・ドル　小計		683,462		5,036,693.340 (419,909,124)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	245.900	11,189,433.600	
	NORSK HYDRO ASA	153,213	72.560	11,117,135.280	

	TELENOR ASA	71,764	130.500	9,365,202.000	
	SCHIBSTED ASA	8,211	179.800	1,476,337.800	
	ORKLA ASA	72,906	75.800	5,526,274.800	
	EQUINOR ASA	108,570	337.150	36,604,375.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,042	474.600	7,613,533.200	
	AKER BP ASA	15,719	354.800	5,577,101.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,304	195.500	3,187,432.000	
	ADEVINTA ASA	24,382	61.350	1,495,835.700	
	DNB BANK ASA	104,666	183.100	19,164,344.600	
	SCHIBSTED ASA	8,058	163.400	1,316,677.200	
ノルウェー・クローネ　小計		645,339		113,633,682.880 (1,557,917,792)	
ユーロ	CRH PLC	84,988	36.990	3,143,706.120	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	18,348	99.380	1,823,424.240	
	KERRY GROUP PLC-A	17,775	100.250	1,781,943.750	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	78.660	1,372,695.660	
	UMICORE	18,962	39.780	754,308.360	
	AIR LIQUIDE	52,388	160.820	8,425,038.160	
	AIRBUS SE	62,803	107.500	6,751,322.500	
	AXA SA	205,045	22.795	4,674,000.770	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	72,106	26.260	1,893,503.560	
	ADIDAS AG	20,499	181.360	3,717,698.640	
	ASSICURAZIONI GENERALI	118,133	17.735	2,095,088.750	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	159.000	496,080.000	
	DANONE	71,115	56.100	3,989,551.500	
	SAFRAN SA	36,923	95.420	3,523,192.660	
	INTESA SANPAOLO	1,698,613	1.880	3,193,392.440	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,364	79.060	2,716,817.840	
	ACCOR SA	18,305	30.500	558,302.500	
	BOUYGUES	28,068	30.740	862,810.320	
	BNP PARIBAS	118,317	50.590	5,985,657.030	
	THALES SA	11,069	121.050	1,339,902.450	
	CAPGEMINI SA	16,708	183.750	3,070,095.000	
	UNICREDIT SPA	216,987	8.230	1,785,803.010	
	KONINKLIJKE DSM NV	19,072	145.400	2,773,068.800	
	COMMERZBANK AG	112,781	6.120	690,219.720	
	EIFFAGE	8,993	93.280	838,867.040	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	46,809	34.100	1,596,186.900	
	UNITED INTERNET	10,010	30.440	304,704.400	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,955	28.360	168,883.800	
	PUBLICIS GROUPE	25,936	54.560	1,415,068.160	
	FAURECIA	11,287	20.020	225,965.740	
	IBERDROLA SA	645,640	10.665	6,885,750.600	
	ENI SPA	278,887	13.604	3,793,978.740	
	JERONIMO MARTINS	34,644	19.670	681,447.480	
	KESKO OYJ-B	23,725	23.700	562,282.500	

KBC GROUPE	27,733	65.000	1,802,645.000	
HANNOVER RUECK SE	7,306	138.550	1,012,246.300	
WARTSILA OYJ	50,956	7.344	374,220.860	
L'OREAL	26,923	316.000	8,507,668.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	29,809	561.900	16,749,677.100	
GEA GROUP AG	17,490	35.400	619,146.000	
BOLLORE	114,808	4.450	510,895.600	
MEDIOBANCA SPA	60,688	9.648	585,517.820	
MICHELIN(CGDE)-B	18,693	117.100	2,188,950.300	
CONTINENTAL AG	8,829	61.320	541,394.280	
DEUTSCHE POST AG-REG	104,369	38.980	4,068,303.620	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	13.945	310,847.990	
OMV AG	17,896	48.790	873,145.840	
VERBUND AG	7,320	88.350	646,722.000	
PERNOD-RICARD	22,709	183.200	4,160,288.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	16,854	76.920	1,296,409.680	
RENAULT SA	19,671	23.170	455,777.070	
REPSOL SA	158,826	14.835	2,356,183.710	
REMY COINTREAU	1,986	172.500	342,585.000	
MERCK KGAA	14,538	164.750	2,395,135.500	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	52,550	53.530	2,813,001.500	
RWE AG	68,191	40.630	2,770,600.330	
SEB SA	2,596	108.600	281,925.600	
SOCIETE GENERALE-A	81,367	22.565	1,836,046.350	
VINCI S.A.	60,035	90.390	5,426,563.650	
SODEXO	9,822	69.460	682,236.120	
SOFINA	1,449	283.200	410,356.800	
SOLVAY SA	9,984	92.340	921,922.560	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	57,407	127.000	7,290,689.000	
VIVENDI SE	90,999	10.935	995,074.060	
SAP SE	112,272	91.640	10,288,606.080	
TELEFONICA S.A	563,665	4.717	2,658,807.800	
TOTALENERGIES SE	269,087	50.600	13,615,802.200	
VALEO	26,570	17.190	456,738.300	
E.ON SE	236,021	9.668	2,281,851.020	
VOEST-ALPINE AG	10,593	23.940	253,596.420	
HENKEL AG & CO KGAA	10,815	60.400	653,226.000	
SIEMENS AG-REG	81,744	114.640	9,371,132.160	
UPM-KYMMENE OYJ	61,276	31.540	1,932,645.040	
ING GROEP NV-CVA	423,971	8.702	3,689,395.640	
PUMA AG	10,980	66.340	728,413.200	
BAYER AG	104,605	59.860	6,261,655.300	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	17.950	1,050,703.250	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	21,171	61.380	1,299,475.980	

MERCEDES-BENZ GROUP AG	89,857	62.080	5,578,322.560	
BASF SE	99,004	47.435	4,696,254.740	
BEIERSDORF AG	10,944	91.280	998,968.320	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,634	53.860	788,187.240	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,767	58.580	1,392,270.860	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	278.500	1,444,858.000	
ORANGE	228,345	11.574	2,642,865.030	
SAMPO OYJ-A SHS	52,583	44.300	2,329,426.900	
RANDSTAD NV	11,897	48.600	578,194.200	
ALLIANZ SE	43,484	195.700	8,509,818.800	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	281,622	4.463	1,256,878.980	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	113,114	27.410	3,100,454.740	
HERMES INTL	3,399	1,042.000	3,541,758.000	
ENDESA S.A.	30,147	19.680	593,292.960	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	6.911	499,955.560	
ERSTE GROUP BANK AG	39,151	28.560	1,118,152.560	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14,999	216.700	3,250,283.300	
ARCELOR MITTAL (NL)	67,059	26.320	1,764,992.880	
DASSAULT SYSTEMES SA	74,638	39.495	2,947,827.810	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	24.220	570,889.620	
HEINEKEN NV	29,631	90.000	2,666,790.000	
AKZO NOBEL	19,812	80.500	1,594,866.000	
ASML HOLDING NV	44,435	524.400	23,301,714.000	
AEGON NV	196,332	4.762	934,932.980	
VOLKSWAGEN AG	3,315	200.800	665,652.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	20,877	145.860	3,045,119.220	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	718,852	4.589	3,298,811.820	
KERING	8,029	457.900	3,676,479.100	
CNP ASSURANCES	14,608	20.900	305,307.200	
FORTUM OYJ	43,311	15.370	665,690.070	
AGEAS	18,136	44.000	797,984.000	
UCB SA	13,322	102.000	1,358,844.000	
NEMETSCHEK SE	5,104	65.260	333,087.040	
CARREFOUR SA	64,831	20.590	1,334,870.290	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	28.230	499,021.710	
NOKIA OYJ	583,729	4.767	2,782,636.140	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	100,110	24.690	2,471,715.900	
WOLTERS KLUWER-CVA	28,827	93.540	2,696,477.580	
SANOFI	122,372	97.050	11,876,202.600	
STMICROELECTRONICS NV	73,813	34.765	2,566,108.940	
ELISA OYJ	14,618	54.260	793,172.680	
BANCO SANTANDER SA	1,827,364	2.650	4,842,514.600	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	18.945	928,513.390	

QIAGEN N.V.	26,264	43.290	1,136,968.560	
DEUTSCHE BANK AG-REG	223,697	9.315	2,083,737.550	
BMW VORZUG	7,256	71.100	515,901.600	
ENEL SPA	900,710	6.008	5,411,465.680	
COLRUYT NV	5,030	34.360	172,830.800	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	344,247	17.302	5,956,161.590	
SARTORIUS AG	2,847	330.400	940,648.800	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	49.500	546,084.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	137,849	27.290	3,761,899.210	
RATIONAL AG	516	519.000	267,804.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	112.600	547,911.600	
BECHTLE AG	8,139	40.770	331,827.030	
KONINKLIJKE KPN NV	358,749	3.324	1,192,481.670	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	84.540	1,249,416.660	
TELEPERFORMANCE	5,991	317.000	1,899,147.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,373	161.300	3,286,164.900	
EURAZEO	3,311	69.150	228,955.650	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	84.000	950,712.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	71.400	774,904.200	
INDITEX	123,463	20.250	2,500,125.750	
ESSILORLUXOTTICA	31,990	155.050	4,960,049.500	
SNAM SPA	210,122	5.228	1,098,517.810	
CREDIT AGRICOLE SA	138,901	9.965	1,384,148.460	
ORPEA	5,291	32.260	170,687.660	
ENAGAS	24,864	20.730	515,430.720	
WENDEL	2,354	88.850	209,152.900	
TENARIS SA	55,855	14.535	811,852.420	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.260	236,154.360	
ATLANTIA SPA	48,155	22.850	1,100,341.750	
PROXIMUS	14,640	16.545	242,218.800	
TERNA SPA	159,225	7.582	1,207,243.950	
BIOMERIEUX	4,870	90.260	439,566.200	
GRIFOLS SA	31,982	18.625	595,664.750	
FERROVIAL SA	46,452	23.670	1,099,518.840	
LANXESS AG	7,376	35.820	264,208.320	
NESTE OYJ	45,715	43.190	1,974,430.850	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	20,487	11.000	225,357.000	
RECORDATI SPA	10,908	42.110	459,335.880	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.778	564,923.950	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	188.800	1,134,310.400	
KONE OYJ	39,369	43.010	1,693,260.690	
ELIA GROUP	2,918	149.000	434,782.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	295.700	919,331.300	
ENGIE	203,977	11.138	2,271,895.820	
ALSTOM	38,519	22.330	860,129.270	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	8.144	529,457.720	

IPSEN SA	3,873	94.650	366,579.450	
ARKEMA SA	6,392	116.250	743,070.000	
LEGRAND SA	29,484	81.280	2,396,459.520	
AMPLIFON SPA	12,300	35.460	436,158.000	
ADP	3,975	132.750	527,681.250	
ORION OYJ	13,559	35.650	483,378.350	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.820	642,772.920	
SYMRISE AG	14,802	102.400	1,515,724.800	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,552	39.130	999,849.760	
PRYSMIAN SPA	30,112	29.710	894,627.520	
DIASORIN SPA	2,429	120.650	293,058.850	
CAIXABANK	494,492	2.950	1,458,751.400	
BUREAU VERITAS SA	31,295	25.900	810,540.500	
GETLINK	44,292	17.310	766,694.520	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	21.130	624,623.930	
AMADEUS IT GROUP SA	48,952	60.000	2,937,120.000	
BRENNTAG SE	17,236	69.020	1,189,628.720	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	25.100	619,643.700	
EDENRED	26,160	46.000	1,203,360.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.874	303,132.270	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	93.220	765,242.980	
KION GROUP AG	7,874	49.110	386,692.140	
VONOVIA SE	78,465	34.260	2,688,210.900	
KNORR-BREMSE AG	7,195	69.060	496,886.700	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	30,120	51.020	1,536,722.400	
FERRARI NV	14,047	188.100	2,642,240.700	
CNH INDUSTRIAL NV	112,387	13.495	1,516,662.560	
AROUNDTOWN SA	113,225	4.620	523,099.500	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,858	33.910	300,374.780	
MONCLER SPA	23,707	42.720	1,012,763.040	
NEXI SPA	58,847	9.354	550,454.830	
PROSUS NV	98,079	42.210	4,139,914.590	
JDE PEET'S BV	7,893	26.920	212,479.560	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	17.165	798,309.820	
INPOST SA	22,392	6.024	134,889.400	
EURONEXT NV	10,081	72.880	734,703.280	
IMCD NV	5,720	130.950	749,034.000	
WORLDLINE SA	24,912	37.440	932,705.280	
NN GROUP NV	29,715	45.580	1,354,409.700	
FINECOBANK SPA	71,819	12.350	886,964.650	
ARGENX SE	4,531	294.200	1,333,020.200	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	81,698	20.785	1,698,092.930	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	47,088	25.965	1,222,639.920	
EUROAPI SASU	5,320	13.514	71,894.480	
ZALANDO SE	26,225	33.420	876,439.500	
STELLANTIS NV	219,223	13.144	2,881,467.110	

	AENA SME SA	9,001	133.150	1,198,483.150	
	CELLNEX TELECOM SAU	58,193	41.800	2,432,467.400	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	20.200	457,934.000	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	11.240	593,865.400	
	EXOR NV	10,514	63.900	671,844.600	
	SCOUT24 SE	10,048	59.240	595,243.520	
	COVESTRO AG	20,258	38.420	778,312.360	
	HELLOFRESH SE	17,856	35.600	635,673.600	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	93,424	52.090	4,866,456.160	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.002	530,118.770	
	AMUNDI SA	6,292	54.100	340,397.200	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.902	414,685.850	
	ADYEN NV	2,124	1,417.600	3,010,982.400	
	UNIPER SE	11,072	21.980	243,362.560	
	DELIVERY HERO SE	17,246	29.560	509,791.760	
ユーロ　小計		19,685,009		458,795,057.000 (63,143,963,695)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	172,000	14.680	2,524,960.000	
	CLP HOLDINGS LTD	171,296	76.000	13,018,496.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	57,314	52.750	3,023,313.500	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	133,591	327.600	43,764,411.600	
	MTR CORP	192,441	42.750	8,226,852.750	
	HANG SENG BANK LTD	79,896	140.100	11,193,429.600	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	129,972	31.800	4,133,109.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	54.050	8,178,846.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,245,406	8.540	10,635,767.240	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	213,904	43.100	9,219,262.400	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	372,495	29.700	11,063,101.500	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	29.250	5,062,180.500	
	SINO LAND CO	443,200	10.660	4,724,512.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	146,065	92.800	13,554,832.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	44.750	2,372,645.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	154,656	94.650	14,638,190.400	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	17.480	3,111,440.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	233,000	12.500	2,912,500.000	
	AIA GROUP LTD	1,298,516	74.000	96,090,184.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	11.280	5,224,174.080	
	SANDS CHINA LTD	260,600	16.500	4,299,900.000	

	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	26.900	3,766,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	114,400	18.960	2,169,024.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	160,135	36.550	5,852,934.250	
	ESR CAYMAN LTD	216,400	23.900	5,171,960.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	7.760	1,912,840.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	161,300	19.400	3,129,220.000	
	WH GROUP LTD	931,500	5.320	4,955,580.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	305,445	55.050	16,814,747.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	234,195	53.700	12,576,271.500	
香港・ドル　小計		8,832,769		333,320,685.170 (5,553,122,615)	
合計		117,023,013		686,395,105,437 (686,395,105,437)	

（２）株式以外の有価証券

2022年5月9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	108,264.000	1,178,994.960	
		GOODMAN GROUP	181,923.000	3,747,613.800	
		GPT GROUP	219,223.000	1,082,961.620	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	978,132.520	
		SCENTRE GROUP	611,542.000	1,724,548.440	
		STOCKLAND	259,328.000	1,011,379.200	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	711,277.760	
	オーストラリア・ドル　小計		2,199,646.000	10,434,908.300 (956,881,091)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	421,678.000	1,184,915.180	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	568,831.000	1,274,181.440	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	6,264.000	8,143.200	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	206,400.000	385,968.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	235,000.000	404,200.000	
	シンガポール・ドル　小計		1,438,173.000	3,257,407.820 (306,554,650)	
投資信託受益証券　合計			3,637,819	1,263,435,741 (1,263,435,741)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	64,312.000	798,111.920	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,940.000	2,816,279.200	
		AMERICAN TOWER CORP	48,832.000	11,918,426.240	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	157,479.000	1,066,132.830	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,036.000	3,194,097.480	
	BOSTON PROPERTIES INC	15,660.000	1,865,419.200	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	11,305.000	1,682,297.050	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	46,131.000	8,423,520.600	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	30,389.000	4,287,280.120	
	DUKE REALTY TRUST	41,687.000	2,074,345.120	
	EQUINIX INC	9,564.000	6,823,340.160	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,531.000	1,210,565.130	
	EQUITY RESIDENTIAL	39,977.000	3,057,041.190	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,117.000	2,230,681.310	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,436.000	2,622,443.760	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	60,560.000	1,856,164.000	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,593,191.600	
	INVITATION HOMES INC	63,432.000	2,409,781.680	
	IRON MOUNTAIN INC	30,120.000	1,633,708.800	
	KIMCO REALTY	71,173.000	1,707,440.270	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	57,601.000	1,061,010.420	
	MID AMERICA	12,263.000	2,263,136.650	
	PROLOGIS INC	79,144.000	11,149,806.720	
	PUBLIC STORAGE	16,700.000	5,625,896.000	
	REALTY INCOME CORP	60,450.000	3,996,954.000	
	REGENCY CENTERS CORP	15,613.000	1,070,739.540	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,147.000	4,155,367.230	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	36,454.000	4,426,244.680	
	SUN COMMUNITIES INC	11,536.000	1,903,670.720	
	UDR INC	34,357.000	1,719,567.850	
	VENTAS INC	42,297.000	2,409,660.090	
	VICI PROPERTIES INC	103,285.000	2,987,002.200	
	VORNADO REALTY TRUST	16,223.000	588,408.210	
	WELLTOWER INC	48,613.000	4,298,847.590	
	WEYERHAEUSER CO	83,265.000	3,342,257.100	
	WP CAREY INC	20,717.000	1,611,989.770	
アメリカ・ドル　小計		1,489,061.000	115,880,826.430 (15,154,894,480)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	114,313.000	560,819.570	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	551,361.980	
	SEGRO PLC	126,044.000	1,397,827.960	
イギリス・ポンド　小計		317,449.000	2,510,009.510 (403,960,931)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	412,899.480	

		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	328,867.200	
	カナダ・ドル　小計		23,146.000	741,766.680 (74,977,776)	
	ユーロ	COVIVIO	5,066.000	333,849.400	
		GECINA SA	5,045.000	524,680.000	
		KLEPIERRE	17,716.000	387,271.760	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	905,220.800	
	ユーロ　小計		41,362.000	2,151,021.960 (296,045,152)	
	香港・ドル	LINK REIT	241,816.000	16,201,672.000	
	香港・ドル　小計		241,816.000	16,201,672.000 (269,919,856)	
投資証券　合計			2,112,834	16,199,798,195 (16,199,798,195)	
合計				17,463,233,936 (17,463,233,936)	

（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	605銘柄	70.00	－	－	73.80
	投資証券	36銘柄	－	－	2.10	
イギリス・ポンド	株式	78銘柄	4.39	－	－	4.55
	投資証券	3銘柄	－	－	0.06	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.12	－	－	0.12
オーストラリア・ドル	株式	53銘柄	2.19	－	－	2.38
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.13	－	
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.77	－	－	3.87
	投資証券	2銘柄	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.32	－	－	0.37
	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.04	－	
スイス・フラン	株式	41銘柄	2.95	－	－	3.02
スウェーデン・クローナ	株式	44銘柄	0.96	－	－	0.98
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.78	－	－	0.80
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.06	－	－	0.06
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.22	－	－	0.22
ユーロ	株式	228銘柄	8.76	－	－	9.01
	投資証券	4銘柄	－	－	0.04	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.77	－	－	0.83
	投資証券	1銘柄	－	－	0.04	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	472,779,780円
Ⅱ　負債総額	1,170,838円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	471,608,942円
Ⅳ　発行済数量	462,854,096口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0189円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	679,388,487,235円
Ⅱ　負債総額	1,198,975,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	678,189,512,235円
Ⅳ　発行済数量	529,333,395,415口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2812円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	169,190,326,297円
Ⅱ　負債総額	15,945,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	169,174,381,297円
Ⅳ　発行済数量	81,989,753,025口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0634円

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	365,879,219,303円
Ⅱ　負債総額	3,380,095,764円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	362,499,123,539円
Ⅳ　発行済数量	113,000,854,013口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.2079円

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

2022年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	981,480,813円
Ⅱ　負債総額	8,072,090円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	973,408,723円
Ⅳ　発行済数量	313,867,793口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1013円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	709,669,677,956円
Ⅱ　負債総額	316,555,645円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	709,353,122,311円
Ⅳ　発行済数量	119,222,164,545口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.9498円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【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（2022年5月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2022年5月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年5月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,452,789,008,552
追加型株式投資信託	805	14,589,312,732,441
単位型公社債投資信託	27	53,315,324,234
単位型株式投資信託	221	1,214,512,547,109
合計	1,079	17,309,929,612,336

３【委託会社等の経理状況】

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

2. 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期事業年度の財務諸表及び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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第37期事業年度（自2021年4月1日至2022年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）		第37期 （2022年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		36,734		31,421
金銭の信託		25,670		30,332
未収委託者報酬		16,804		17,567
未収運用受託報酬		5,814		4,348
未収投資助言報酬		317		309
未収収益		7		5
前払費用		724		1,167
その他		2,419		2,673
流動資産計		88,493		87,826
固定資産				
有形固定資産		1,119		1,268
建物	※1	915	※1	1,109
器具備品	※1	202	※1	158
建設仮勘定		0		-
無形固定資産		3,991		4,561
ソフトウエア		2,878		3,107
ソフトウエア仮勘定		1,109		1,449
電話加入権		3		3
投資その他の資産		11,153		10,153
投資有価証券		261		241
関係会社株式		5,299		5,349
長期差入保証金		1,324		1,102
繰延税金資産		3,676		3,092
その他		591		367
固定資産計		16,264		15,983
資産合計		104,757		103,810

（単位：百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	3,730	1,445
未払金	7,337	7,616
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	9
未払手数料	6,889	7,430
その他未払金	437	175
未払費用	9,713	8,501
未払法人税等	4,199	2,683
未払消費税等	2,106	1,330
賞与引当金	1,789	1,933
役員賞与引当金	76	69
流動負債計	28,954	23,581
固定負債		
退職給付引当金	2,292	2,507
時効後支払損引当金	157	147
固定負債計	2,450	2,655
負債合計	31,404	26,236
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	51,800	56,020
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	51,676	55,896
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	19,996	24,216
株主資本計	73,353	77,573
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△0	△0
評価・換算差額等計	△0	△0
純資産合計	73,353	77,573
負債・純資産合計	104,757	103,810

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第36期 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）		第37期 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	89,905		108,563	
運用受託報酬	17,640		16,716	
投資助言報酬	1,103		1,587	
その他営業収益	781		12	
営業収益計		109,430		126,879
営業費用				
支払手数料	37,003		45,172	
広告宣伝費	424		391	
公告費	0		0	
調査費	30,794		36,488	
調査費	11,302		10,963	
委託調査費	19,491		25,525	
委託計算費	543		557	
営業雑経費	938		842	
通信費	46		35	
印刷費	680		606	
協会費	71		66	
諸会費	23		26	
支払販売手数料	116		106	
営業費用計		69,704		83,453
一般管理費				
給料	10,586		10,377	
役員報酬	163		168	
給料・手当	9,030		8,995	
賞与	1,392		1,213	
交際費	8		6	
寄付金	7		15	
旅費交通費	50		40	
租税公課	912		367	
不動産賃借料	1,499		1,674	
退職給付費用	524		495	
固定資産減価償却費	1,078		1,389	
福利厚生費	44		42	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	1,789		1,933	
役員賞与引当金繰入額	76		69	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,793		3,901	
事務用消耗品費	68		45	
器具備品費	0		0	
諸経費	152		217	
一般管理費計		20,594		20,578
営業利益		19,132		22,848

（単位：百万円）

	第36期 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）		第37期 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	27		13	
受取配当金	2		※1　559	
時効成立分配金・償還金	0		0	
為替差益	7		7	
金銭の信託運用益	1,229		―	
雑収入	13		19	
時効後支払損引当金戻入額	13		10	
営業外収益計		1,293		610
営業外費用				
投資信託償還損	0		―	
金銭の信託運用損	―		743	
早期割増退職金	48		20	
雑損失	0		―	
営業外費用計		48		764
経常利益		20,376		22,694
特別利益				
固定資産売却益	―		0	
特別利益計		―		0
特別損失				
固定資産除却損	1		5	
投資有価証券売却損	―		6	
ゴルフ会員権売却損	―		3	
オフィス再編費用	―		※2　509	
特別損失計		1		525
税引前当期純利益		20,375		22,169
法人税、住民税及び事業税		7,418		6,085
法人税等調整額		△1,168		584
法人税等合計		6,249		6,669
当期純利益		14,125		15,499

（３）【株主資本等変動計算書】

第36期（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,871	49,674	71,227
当期変動額									
剰余金の配当							△12,000	△12,000	△12,000
当期純利益							14,125	14,125	14,125
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	2,125	2,125
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△0	△0	71,227
当期変動額			
剰余金の配当			△12,000
当期純利益			14,125
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,125
当期末残高	△0	△0	73,353

第37期（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							△11,280	△11,280	△11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△0	△0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			△11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	4,219
当期末残高	△0	△0	77,573

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 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 (2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6. 収益及び費用の計上基準	**当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。** **(1) 委託者報酬** **委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年１回又は２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。** **(2) 運用受託報酬** **運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年１回又は２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。** **(3) 投資助言報酬** **投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年１回又は４回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。** **(4) 成功報酬** **成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。**
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 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
当社は、当事業年度において、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、当事業年度において、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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万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。

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。

（未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（会計基準適用指針第31号　2021年6月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分法相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2022年4月1日に開始する事業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

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
建物	407	415
器具備品	978	966

（損益計算書関係）

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

（百万円）

	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）
受取配当金	-	543

※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

（株主資本等変動計算書関係）

第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（百万円）	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 A種種類株式	12,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日

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

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

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

2022年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期（2021年3月31日現在）

	貸借対照表計上額（百万円）	時価（百万円）	差額（百万円）
（1）金銭の信託	25,670	25,670	－
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	－
資産計	25,672	25,672	－

第37期（2022年3月31日現在）

	貸借対照表計上額（百万円）	時価（百万円）	差額（百万円）
（1）金銭の信託	30,332	30,332	－
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	－
資産計	30,334	30,334	－

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

（注2）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期（2021年3月31日現在）

	1年以内（百万円）	1年超5年以内（百万円）	5年超10年以内（百万円）	10年超（百万円）
（1）現金・預金	36,734	－	－	－
（2）金銭の信託	25,670	－	－	－
（3）未収委託者報酬	16,804	－	－	－
（4）未収運用受託報酬	5,814	－	－	－
（5）投資有価証券				
その他有価証券(投資信託)	－	1	－	－
合計	85,024	1	－	－

第37期（2022年3月31日現在）

	1年以内（百万円）	1年超5年以内（百万円）	5年超10年以内（百万円）	10年超（百万円）
（1）現金・預金	31,421	－	－	－
（2）金銭の信託	30,332	－	－	－
（3）未収委託者報酬	17,567	－	－	－
（4）未収運用受託報酬	4,348	－	－	－
（5）投資有価証券				
その他有価証券(投資信託)	－	1	－	－
合計	83,670	1	－	－

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
（1）金銭の信託	－	6,932	－	6,932
（2）投資有価証券	－	－	－	－
その他有価証券	－	－	－	－
資産計	－	6,932	－	6,932

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号　2019年7月4日）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、投資有価証券1百万円となります。

（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、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	259	239
関係会社株式		
非上場株式	5,299	5,349

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（第36期の貸借対照表計上額5,299百万円、第37期の貸借対照表計上額5,349百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2．その他有価証券

第36期（2021年3月31日現在）

（百万円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額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。

第37期（2022年3月31日現在）

（百万円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額239百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
投資信託	0	－	0

（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。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
株式	13	－	6

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（百万円）

	第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,422	2,479
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	△4	△14
退職給付の支払額	△245	△185
過去勤務費用の発生額	△1	－
その他	1	－
退職給付債務の期末残高	2,479	2,576

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（百万円）

	第36期（2021年3月31日現在）	第37期（2022年3月31日現在）
非積立型制度の退職給付債務	2,479	2,576
未積立退職給付債務	2,479	2,576
未認識数理計算上の差異	△84	△35
未認識過去勤務費用	△102	△33
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507
退職給付引当金	2,292	2,507
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

	第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	41	34
過去勤務費用の費用処理額	69	69
その他	△7	△3
確定給付制度に係る退職給付費用	409	398

（注）上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において48百万円、当事業年度において20百万円を営業外費用に計上しております。

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～3.76%	1.00%～3.76%

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100百万円、当事業年度97百万円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
繰延税金資産	（百万円）	（百万円）
未払事業税	260	156
未払事業所税	10	10
賞与引当金	547	592
未払法定福利費	92	92
運用受託報酬	1,410	845
資産除去債務	18	13
減価償却超過額（一括償却資産）	25	12
減価償却超過額	51	58
繰延資産償却超過額（税法上）	301	292
退職給付引当金	701	767
時効後支払損引当金	48	45
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	166
投資有価証券評価損	28	28
その他	3	2
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産小計	3,676	3,092
評価性引当額	－	－
繰延税金資産合計	3,676	3,092
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	3,676	3,092

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	84,609百万円	76,763百万円
資産合計	84,609百万円	76,763百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	5,570百万円	4,740百万円
負債合計	5,570百万円	4,740百万円
純資産	79,038百万円	72,022百万円

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

のれん	59,074百万円	55,263百万円
顧客関連資産	29,793百万円	25,175百万円

（2）損益計算書項目

	第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,823百万円	△8,429百万円
経常利益	△8,823百万円	△8,429百万円
税引前当期純利益	△8,823百万円	△8,429百万円
当期純利益	△7,288百万円	△7,015百万円
1株当たり当期純利益	△182,220円85銭	△175,380円68銭
（注）営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	5,016百万円	4,618百万円

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1．収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
委託者報酬	108,259百万円
運用受託報酬	14,425百万円
投資助言報酬	1,587百万円
成功報酬（注）	2,594百万円
その他営業収益	12百万円
合計	126,879百万円

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

2．収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

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36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）及び第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

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。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	6,435	未払手数料	1,457
	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	未払手数料	2,524

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	7,789	未払手数料	1,592
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	16,373	未払手数料	2,651

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
1株当たり純資産額	1,833,828円44銭	1,939,327円79銭
1株当たり当期純利益金額	353,145円08銭	387,499円36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36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	―	―
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

４【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（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通りです。

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社北都銀行	12,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社七十七銀行	24,600	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社（※1）	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社名古屋銀行	25,090	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社西京銀行（※1）	23,490	日本において銀行業務を営んでおります。
第一勧業信用組合	（※2）15,487	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	（※3）3,000	「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。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ＯＫＢ証券株式会社（※1）	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	（※4）7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2021年3月末日現在

（※1）新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

（※2）出資の総額

（※3）2021年10月1日現在

（※4）2020年12月31日現在

２【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率５％以上を記載します。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2021年8月10日	有価証券報告書
2021年8月10日	有価証券届出書
2022年2月10日	半期報告書
2022年2月10日	有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

２０２２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

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　長谷川　敬

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２０２２年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２２年７月８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

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア資産形成ファンドの２０２１年５月１１日から２０２２年５月９日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア資産形成ファンドの２０２２年５月９日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。