

**【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10日提出  
**【計算期間】** 第31特定期間（自 2021年11月12日 至 2022年5月11日）

**【ファンド名】** マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>  
**【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】

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

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

<ファンドの特色>

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

\* 2022年5月末時点

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

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

## 4 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

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

※決算は原則として年6回(毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)です。

●将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

## 収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



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

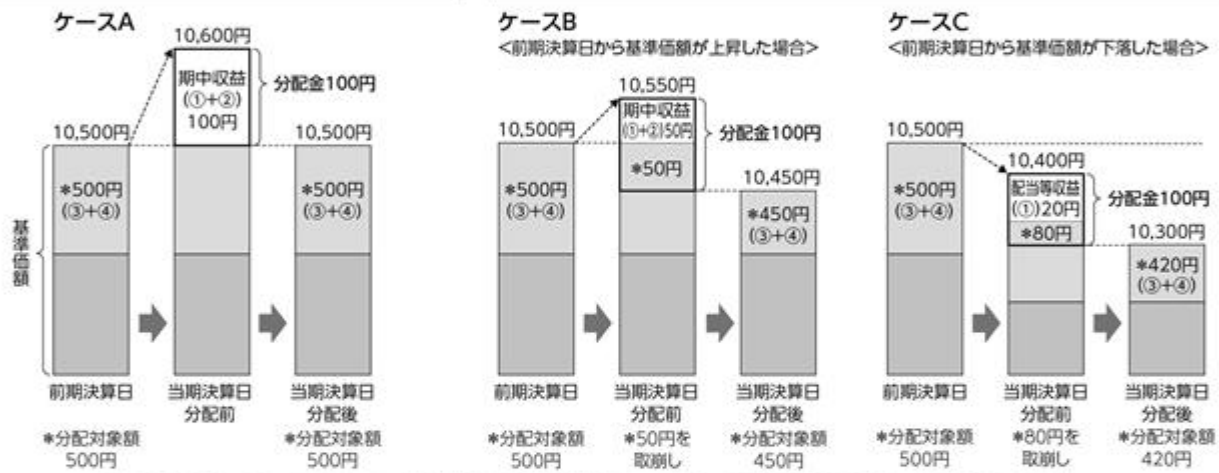
### 分配金額と基準価額の関係(イメージ)

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

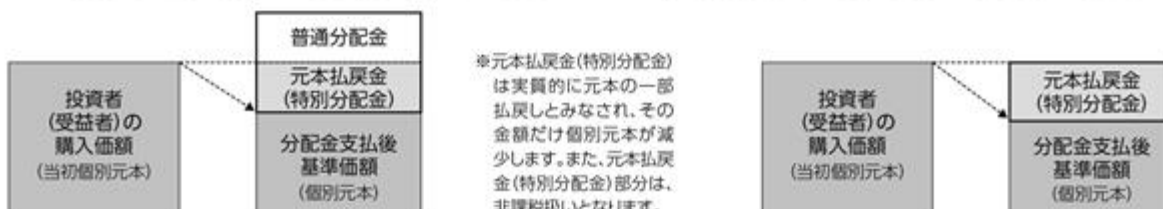
ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円  
 ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円  
 ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

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

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

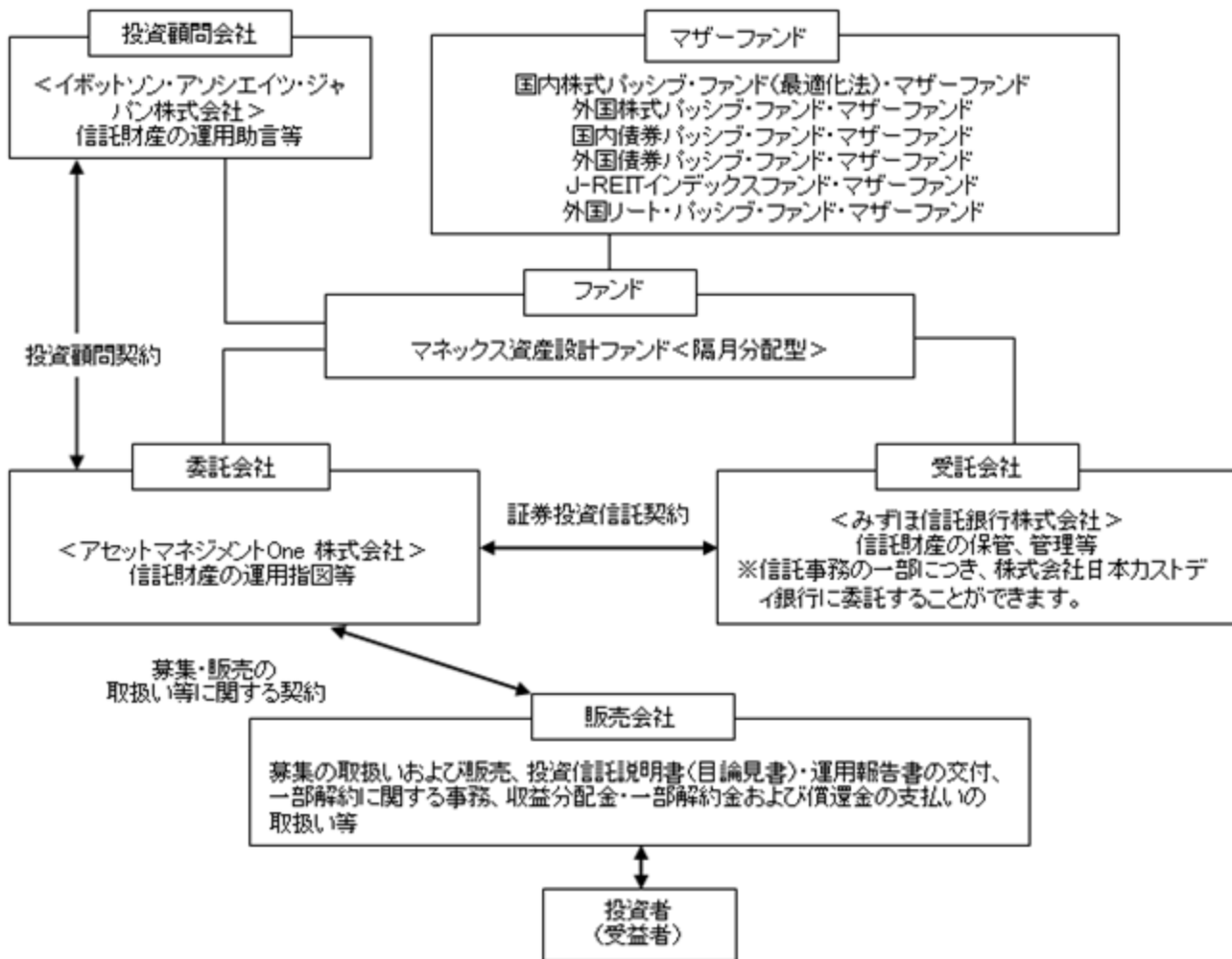
その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、 債券、不動産投信） 資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。  （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年6回（隔月）	目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

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

## （２）【ファンドの沿革】

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

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

- ・「投資顧問契約」の概要

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

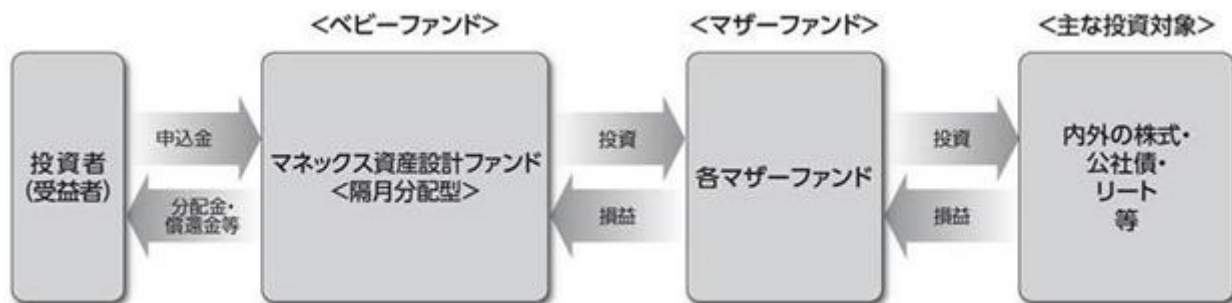
当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。



## ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（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「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

（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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>

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% <sup>2</sup>
------------------	--------------------	---------	--------------------

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

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

#### <投資対象>

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

#### <投資態度>

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

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

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

分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

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

リート(REIT)とは

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

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

#### <運用プロセス>

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

#### (2)【投資対象】

##### 1.投資の対象とする資産(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

##### 2.有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる1)から6)までのアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券ならびに7)から28)までの有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- 2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 5) J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- 6) 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 7) 株券または新株引受権証券
- 8) 国債証券
- 9) 地方債証券
- 10) 特別の法律により法人の発行する債券
- 11) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 12) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 13) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 14) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 15) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 16) コマーシャル・ペーパー
- 17) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ)および新株予約権証券
- 18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)から17)までの証券または証書の性質を有するもの
- 19) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
- 20) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 21) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 22) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
- 23) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 25) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
- 26) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 27) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

28)外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの

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

### 3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

1)預金

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

3)コール・ローン

4)手形割引市場において売買される手形

5)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6)外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

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

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
-------	-----------------------------

基本方針	<p>この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）<sup>(注)</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>(注) 東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

**投資態度**

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

**運用プロセス**

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

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

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定

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

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



投資態度	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) <sup>(注)</sup> に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

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

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

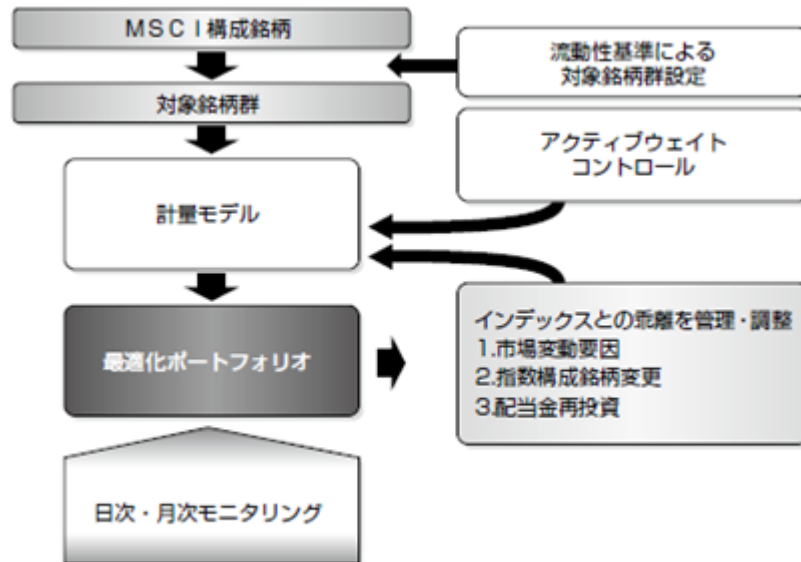
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝す

るためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

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

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

運用プロセス



流動性基準による対象銘柄群設定

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

最適化法によるポートフォリオの構築

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

インデックスとの乖離を管理

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

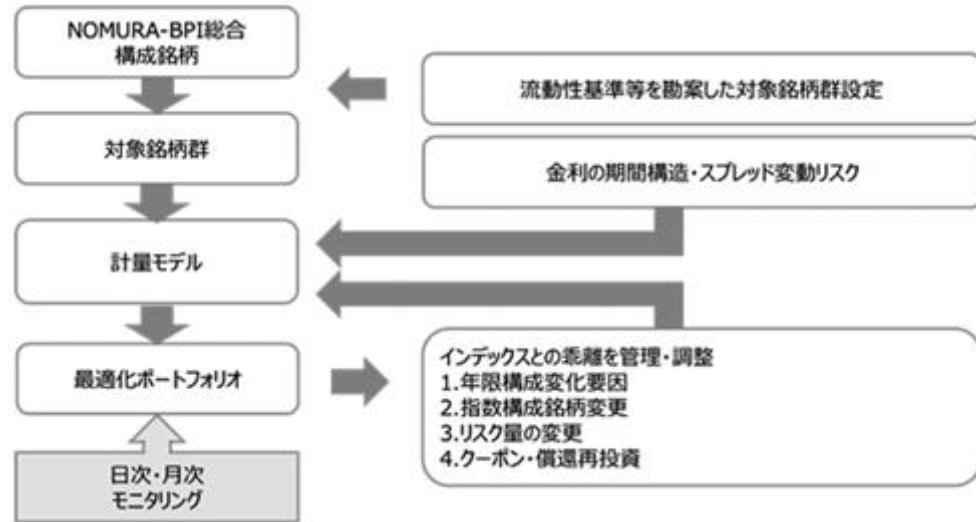
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

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

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合<sup>(注)</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>(注) NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村証券株式会社</p> <p>に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、</p> <p>信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一</p> <p>切責任を負いません。</p> </div>
<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>

## 運用プロセス



## 流動性基準等による対象銘柄群設定

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

## 最適化法によるポートフォリオの構築

1. 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因
  2. 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因
- 1.、2.が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

## インデックスとの乖離を管理

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

組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

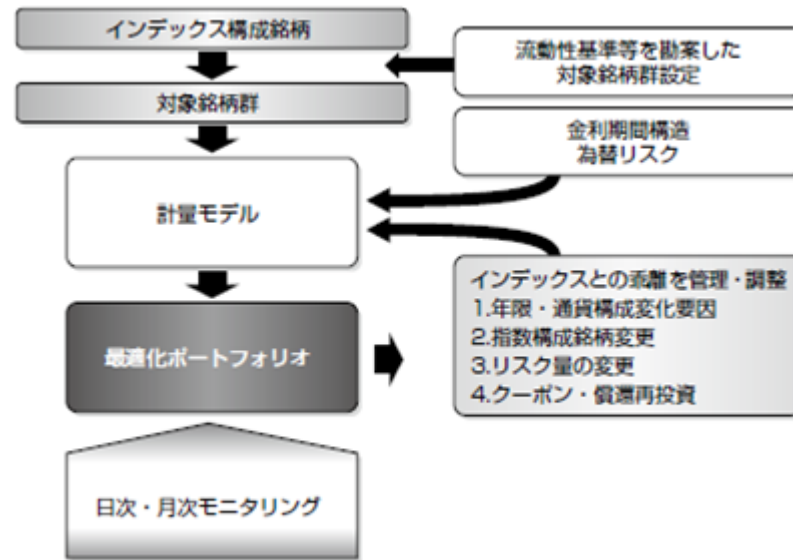
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

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

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

## 運用プロセス



## 流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

## 最適化法によるポートフォリオの構築

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

## インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

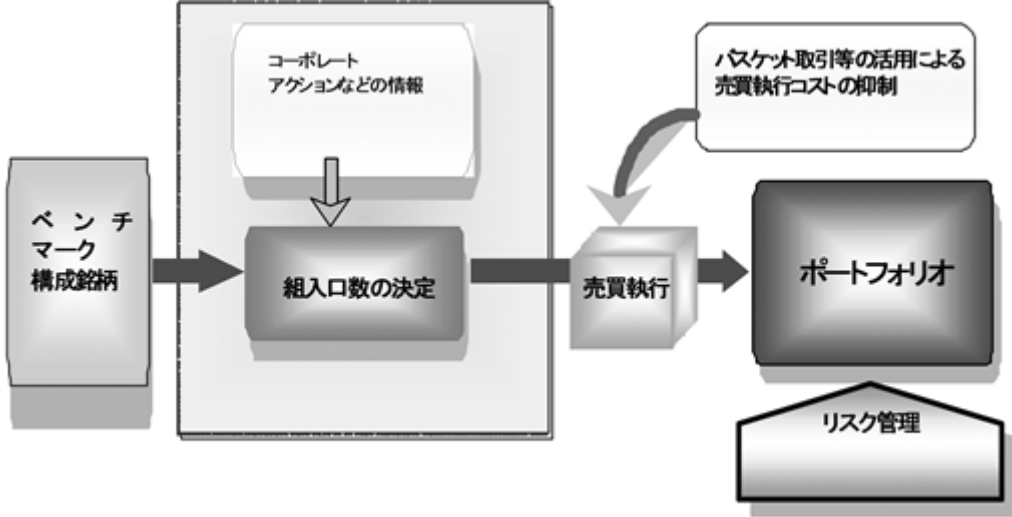
- ・年限・通貨構成変化要因
- ・指数構成銘柄変更
- ・リスク量の変更
- ・クーポン・償還再投資

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

ファンド名	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
-------	-------------------------------



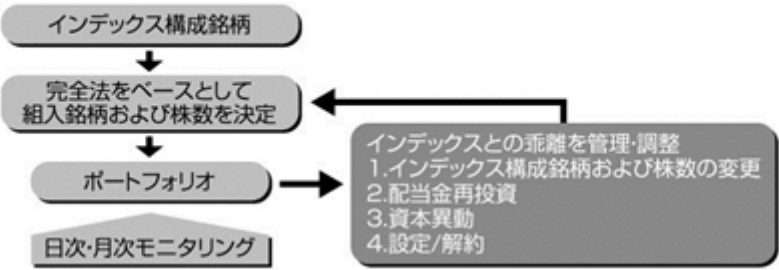
基本方針	<p>この投資信託は、東証REIT指数(配当込み)<sup>(注)</sup>の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注) 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>JPXは、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>JPXは、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数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REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>JPXは、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>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。</p> <p>JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、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。</p>
主な投資対象	<p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。</p>
投資態度	<p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数(配当込み)が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>

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

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) <sup>(注)</sup> に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	---

(注) S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門であるS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 R E I T インデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I T インデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&PDow Jones Indicesおよび/または特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S & P 先進国 R E I T インデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I T インデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I T インデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I T インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくは

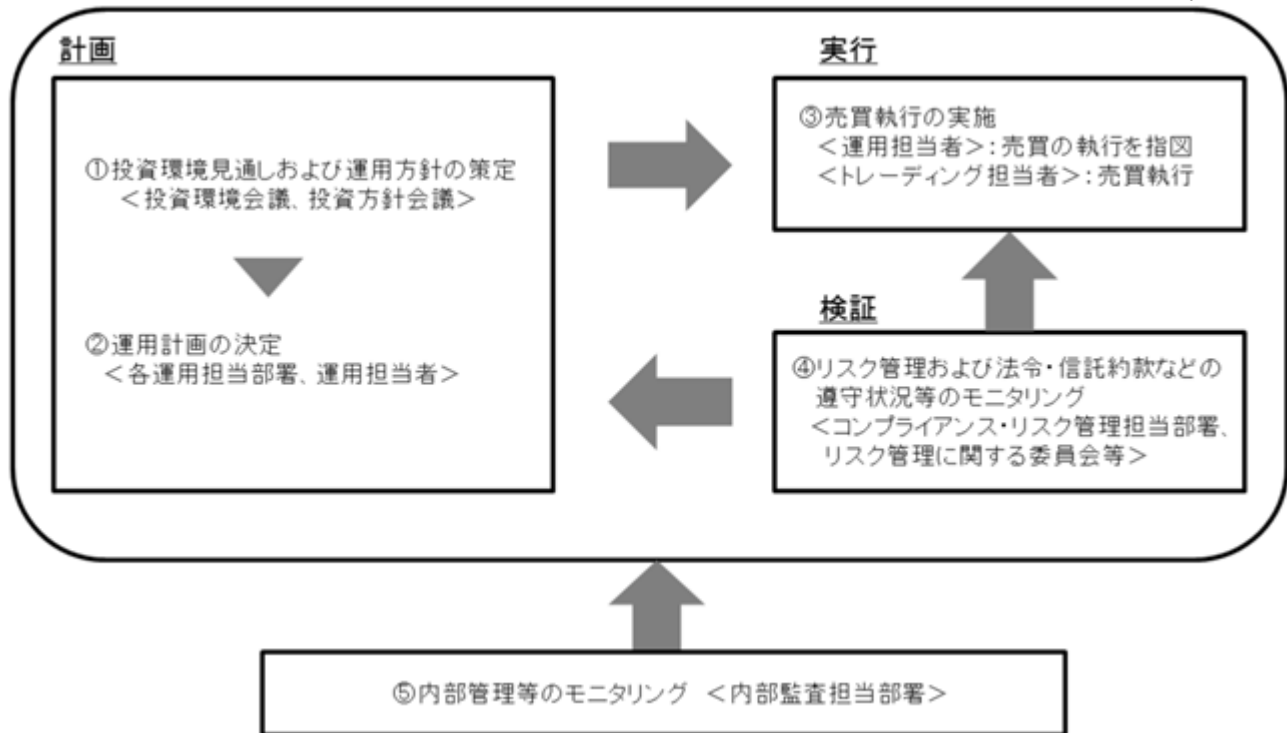
	<p>はS &amp; P 先進国 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&amp;P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&amp;P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&amp;P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。</p> <p>海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。）とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</li> </ol>
<p>運用プロセス</p>	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&amp;P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定]     B --&gt; C[ポートフォリオ]     C --&gt; D[日々・月次モニタリング]     D --&gt; E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約]     E --&gt; B   </pre>

<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>3. 株式への直接投資は行いません。</li> <li>4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</li> <li>5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>
---------------	---

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

### （3）【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

#### モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は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】

収益分配方針

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

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

原則として、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、利子配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。分配金額については、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

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

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金の



ある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

c.毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の支払い

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

### (5)【投資制限】

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

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

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

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

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

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

#### 投資する株式等の範囲(約款第19条)

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

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

#### 信用取引の指図および範囲(約款第22条)

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

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

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

#### 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

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

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

3)委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第24条)

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

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

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

4)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第25条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条の2）

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

#### 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1. 2.の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
  1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1) 1. 2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

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

#### 公社債の借入れ（約款第28条）

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

4)上記1)の借入に係る品借料は信託財産中から支弁します。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

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

外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3)上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第37条）

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑧同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

### 3【投資リスク】

#### <基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

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

各資産（国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート）への資産配分は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

#### リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。

当ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

#### 為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。

#### 信用リスク

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

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

#### 流動性リスク

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

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認める場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了(繰上償還)する場合があります。

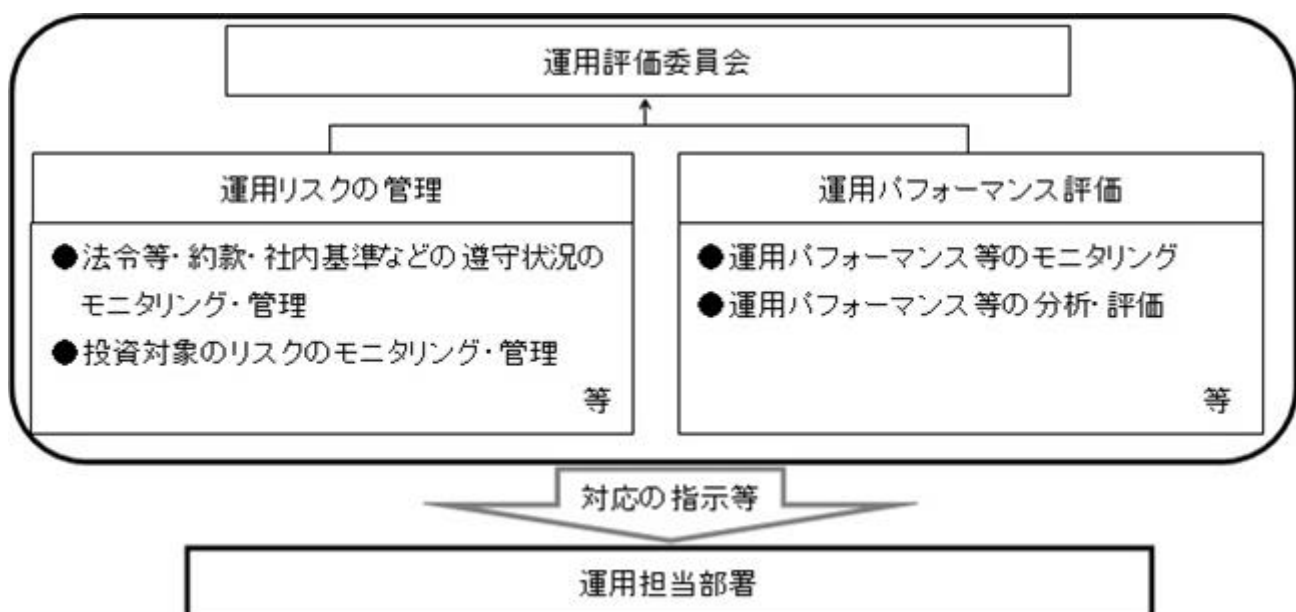
#### 注意事項

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

#### <リスク管理体制>

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

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



- ・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。

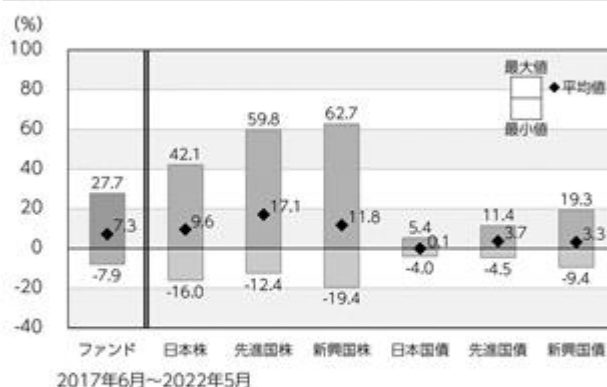


## <参考情報>

### 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



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または高標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または高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】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## 1. 信託財産留保額

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

## 2. その他の費用

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

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

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

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

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

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上場不動産投資信託(リート)は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託(リート)の費用は表示しておりません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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

## 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、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 >

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

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

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

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

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

### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

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	422,139,449	98.74
内 日本	422,139,449	98.74
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,378,061	1.26
純資産総額	427,517,510	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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。

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。

## 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。

#### J-REITインデックスファンド・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（％）
投資証券		177,176,373,800	97.32
	内 日本	177,176,373,800	97.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,870,548,719	2.68
純資産総額		182,046,922,519	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（％）
不動産投信指数先物取引（買建）		4,688,022,000	2.58
	内 日本	4,688,022,000	2.58

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

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

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

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年5月31日現在

資産の種類		時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		6,258,702,652	10.25
内	オーストラリア	4,057,910,789	6.65
内	シンガポール	2,146,721,111	3.52
内	香港	54,070,752	0.09
投資証券		54,592,880,164	89.40
内	アメリカ	46,397,426,759	75.98
内	イギリス	3,169,322,013	5.19
内	カナダ	1,167,246,647	1.91
内	フランス	1,091,000,135	1.79
内	香港	900,340,190	1.47
内	ベルギー	784,436,517	1.28
内	スペイン	263,230,130	0.43
内	ニュージーランド	212,167,557	0.35
内	ガンジー	169,096,468	0.28
内	韓国	147,042,799	0.24
内	オランダ	118,516,659	0.19
内	アイルランド	74,099,709	0.12
内	イスラエル	44,328,918	0.07
内	ドイツ	35,722,335	0.06
内	イタリア	18,903,328	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		211,996,937	0.35
純資産総額		61,063,579,753	100.00

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

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

#### (2) 【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

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	99,738,983	1.2793 127,606,054	1.2812 127,785,585	- -	29.89
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	17,659,398	5.7464 101,479,730	5.9498 105,069,886	- -	24.58
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	32,407,197	3.1033 100,572,495	3.2079 103,959,047	- -	24.32



4	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	12,475,526	2.3526 29,351,170	2.4363 30,394,123	- -	7.11
5	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	14,352,119	2.0661 29,654,348	2.0634 29,614,162	- -	6.93
6	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	14,409,019	1.6886 24,332,510	1.7570 25,316,646	- -	5.92

(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	98.74
合計	98.74

(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。

## 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。

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。

#### J-REITインデックスファンド・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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	18,602	699,154.59 13,005,673,782	700,000.00 13,021,400,000	- -	7.15
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	15,956	666,642.80 10,636,952,666	639,000.00 10,195,884,000	- -	5.60
3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	26,106	359,507.86 9,385,312,357	343,000.00 8,954,358,000	- -	4.92
4	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	80,507	107,944.53 8,690,290,881	108,900.00 8,767,212,300	- -	4.82
5	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	51,599	169,652.53 8,753,901,258	167,800.00 8,658,312,200	- -	4.76

6	GLP投資法人 日本	投資証券	51,678	185,094.98 9,565,338,729	165,700.00 8,563,044,600	- -	4.70
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	23,958	327,972.26 7,857,559,450	318,500.00 7,630,623,000	- -	4.19
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	31,792	191,371.50 6,084,082,900	186,200.00 5,919,670,400	- -	3.25
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	15,954	358,328.62 5,716,774,878	360,500.00 5,751,417,000	- -	3.16
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	35,920	148,616.33 5,338,298,920	143,800.00 5,165,296,000	- -	2.84
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	10,903	415,488.63 4,530,072,636	410,500.00 4,475,681,500	- -	2.46
12	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	22,652	200,372.88 4,538,846,625	190,400.00 4,312,940,800	- -	2.37
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	48,434	86,368.93 4,183,192,854	79,500.00 3,850,503,000	- -	2.12
14	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	5,510	643,947.49 3,548,150,698	670,000.00 3,691,700,000	- -	2.03
15	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	19,533	184,340.78 3,600,728,541	183,100.00 3,576,492,300	- -	1.96
16	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	6,285	583,665.26 3,668,336,206	556,000.00 3,494,460,000	- -	1.92
17	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	8,504	455,044.08 3,869,694,890	410,500.00 3,490,892,000	- -	1.92
18	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	10,759	327,016.15 3,518,366,788	324,000.00 3,485,916,000	- -	1.91
19	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	4,936	745,332.54 3,678,961,426	662,000.00 3,267,632,000	- -	1.79
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	48,883	64,316.56 3,143,986,880	66,800.00 3,265,384,400	- -	1.79
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	70,229	42,229.19 2,965,714,011	42,800.00 3,005,801,200	- -	1.65
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	5,594	506,369.66 2,832,631,928	531,000.00 2,970,414,000	- -	1.63
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	18,765	155,555.50 2,918,999,094	154,100.00 2,891,686,500	- -	1.59
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	18,763	155,887.00 2,924,907,903	152,200.00 2,855,728,600	- -	1.57
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	21,560	116,730.96 2,516,719,538	118,000.00 2,544,080,000	- -	1.40

26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	7,423	337,507.27 2,505,316,539	339,000.00 2,516,397,000	- -	1.38
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	11,417	220,601.61 2,518,608,635	214,100.00 2,444,379,700	- -	1.34
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	14,885	174,779.89 2,601,598,733	162,100.00 2,412,858,500	- -	1.33
29	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	3,373	750,588.45 2,531,734,863	695,000.00 2,344,235,000	- -	1.29
30	NTT都市開発リート投資法人 日本	投資証券	15,295	157,651.61 2,411,281,403	152,100.00 2,326,369,500	- -	1.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年5月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.32
合計	97.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	238,074	18,168.02 4,325,333,757	16,316.00 3,884,416,479	- -	6.36
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	28,974	92,546.76 2,681,449,996	88,936.71 2,576,852,316	- -	4.22
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	49,098	44,542.24 2,186,935,008	43,049.07 2,113,623,322	- -	3.46
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	91,349	18,354.70 1,676,683,757	18,142.99 1,657,344,642	- -	2.71
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	140,113	11,382.94 1,594,897,960	11,560.69 1,619,803,756	- -	2.65
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	182,115	8,696.28 1,583,724,185	8,891.36 1,619,250,663	- -	2.65
7	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	105,783	16,343.67 1,728,883,139	14,581.32 1,542,456,122	- -	2.53
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	45,002	29,240.19 1,315,867,125	27,040.77 1,216,888,781	- -	1.99
9	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	110,050	10,672.71 1,174,532,730	10,017.04 1,102,376,055	- -	1.81
10	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	271,510	3,701.94 1,005,114,927	3,957.84 1,074,593,871	- -	1.76

11	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	547,568	2,008.67 1,099,887,281	1,873.94 1,026,110,125	- -	1.68
12	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	46,878	23,664.34 1,109,337,033	21,614.92 1,013,264,402	- -	1.66
13	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	43,125	24,173.54 1,042,484,078	23,081.64 995,395,996	- -	1.63
14	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	192,227	5,066.78 973,972,527	4,941.21 949,834,628	- -	1.56
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	128,578	7,297.64 938,316,146	7,359.25 946,238,160	- -	1.55
16	MID AMERICA アメリカ	投資証券	37,156	25,186.18 935,817,967	23,567.56 875,676,341	- -	1.43
17	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	122,704	6,996.09 858,448,904	6,848.97 840,397,021	- -	1.38
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	37,366	22,467.24 839,511,091	21,304.65 796,069,764	- -	1.30
19	LINK REIT 香港	投資証券	679,920	1,121.66 762,641,123	1,164.32 791,650,573	- -	1.30
20	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	21,024	40,610.48 853,794,733	37,012.94 778,160,153	- -	1.27
21	SEGRO PLC イギリス	投資証券	387,527	2,007.39 777,921,279	1,826.27 707,729,089	- -	1.16
22	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	61,437	10,330.85 634,696,717	10,917.08 670,712,736	- -	1.10
23	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	173,832	4,146.23 720,748,309	3,856.55 670,392,981	- -	1.10
24	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	45,820	14,998.68 687,239,975	14,446.70 661,947,922	- -	1.08
25	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	93,340	6,489.48 605,728,947	7,043.85 657,473,649	- -	1.08
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	32,948	19,914.32 656,137,079	18,587.88 612,433,661	- -	1.00
27	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	230,198	2,376.83 547,143,770	2,653.94 610,933,291	- -	1.00
28	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	198,815	2,994.03 595,259,981	3,043.70 605,134,289	- -	0.99
29	UDR INC アメリカ	投資証券	96,420	6,820.82 657,664,355	6,229.72 600,669,978	- -	0.98
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	55,675	9,806.23 545,962,308	9,915.76 552,060,015	- -	0.90

(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(%)
投資信託受益証券	10.25
投資証券	89.40
合計	99.65

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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。

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-E U	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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0406月	買建	2,337	4,354,321,770	4,688,022,000	2.58

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

直近日(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12特定期間末 (2012年11月12日)	652	653	0.6218	0.6233
第13特定期間末 (2013年5月13日)	824	825	0.8225	0.8240
第14特定期間末 (2013年11月11日)	736	738	0.8118	0.8133
第15特定期間末 (2014年5月12日)	712	713	0.8414	0.8429
第16特定期間末 (2014年11月11日)	684	685	0.9368	0.9383
第17特定期間末 (2015年5月11日)	622	623	1.0095	1.0110
第18特定期間末 (2015年11月11日)	534	535	0.9947	0.9962
第19特定期間末 (2016年5月11日)	498	499	0.9354	0.9369



第20特定期間末 (2016年11月11日)	482	483	0.9205	0.9220
第21特定期間末 (2017年5月11日)	492	493	1.0090	1.0105
第22特定期間末 (2017年11月13日)	477	478	1.0570	1.0585
第23特定期間末 (2018年5月11日)	448	449	1.0565	1.0580
第24特定期間末 (2018年11月12日)	428	428	1.0434	1.0449
第25特定期間末 (2019年5月13日)	411	411	1.0361	1.0376
第26特定期間末 (2019年11月11日)	430	431	1.0940	1.0955
第27特定期間末 (2020年5月11日)	370	371	0.9993	1.0008
第28特定期間末 (2020年11月11日)	401	401	1.1046	1.1061
第29特定期間末 (2021年5月11日)	421	421	1.2325	1.2340
第30特定期間末 (2021年11月11日)	433	433	1.3083	1.3098
第31特定期間末 (2022年5月11日)	418	419	1.2591	1.2606
2021年5月末日	420	-	1.2424	-
6月末日	427	-	1.2594	-
7月末日	427	-	1.2608	-
8月末日	430	-	1.2790	-
9月末日	422	-	1.2751	-
10月末日	432	-	1.3050	-
11月末日	426	-	1.2864	-
12月末日	436	-	1.3196	-
2022年1月末日	418	-	1.2609	-
2月末日	418	-	1.2511	-
3月末日	439	-	1.3155	-
4月末日	428	-	1.2927	-
5月末日	427	-	1.2862	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第12特定期間	0.0045
第13特定期間	0.0045
第14特定期間	0.0045
第15特定期間	0.0045
第16特定期間	0.0045
第17特定期間	0.0045
第18特定期間	0.0045
第19特定期間	0.0045
第20特定期間	0.0045

第21特定期間	0.0045
第22特定期間	0.0045
第23特定期間	0.0045
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第12特定期間	1.0
第13特定期間	33.0
第14特定期間	0.8
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.9
第17特定期間	8.2
第18特定期間	1.0
第19特定期間	5.5
第20特定期間	1.1
第21特定期間	10.1
第22特定期間	5.2
第23特定期間	0.4
第24特定期間	0.8
第25特定期間	0.3
第26特定期間	6.0
第27特定期間	8.2
第28特定期間	11.0
第29特定期間	12.0
第30特定期間	6.5
第31特定期間	3.4

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第12特定期間	3,810,000	71,430,000
第13特定期間	22,800,000	69,530,000
第14特定期間	13,700,000	108,500,000
第15特定期間	52,399,738	112,932,769
第16特定期間	31,449,359	147,724,782
第17特定期間	44,688,338	158,989,550
第18特定期間	22,117,058	100,883,651
第19特定期間	21,980,050	26,586,206
第20特定期間	10,137,344	18,761,221
第21特定期間	9,179,637	45,104,386

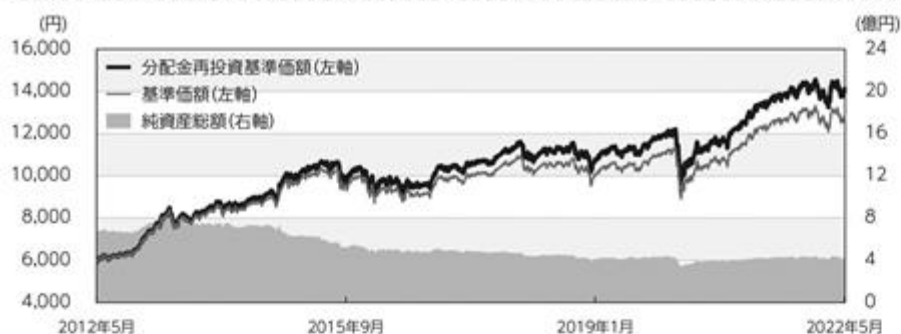
第22特定期間	6,636,994	43,222,568
第23特定期間	4,576,025	31,482,595
第24特定期間	6,951,749	21,627,662
第25特定期間	6,012,015	19,263,147
第26特定期間	13,077,272	16,654,903
第27特定期間	11,204,748	33,518,095
第28特定期間	4,242,197	12,089,221
第29特定期間	7,387,321	28,854,017
第30特定期間	7,665,051	18,275,352
第31特定期間	8,633,053	7,395,440

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2022年5月31日

## 基準価額・純資産の推移 (2012年5月31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、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。

(設定日:2007年1月26日)

## 分配の推移(税引前)

2021年 9月	15円
2021年11月	15円
2022年 1月	15円
2022年 3月	15円
2022年 5月	15円
直近1年間累計	90円
設定来累計	1,875円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	29.89
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	24.58
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	24.32
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	7.11
5	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.93
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.92

## ■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

○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

### ■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

### ■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

### ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	7.15
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.60
3	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.92
4	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.82
5	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.76

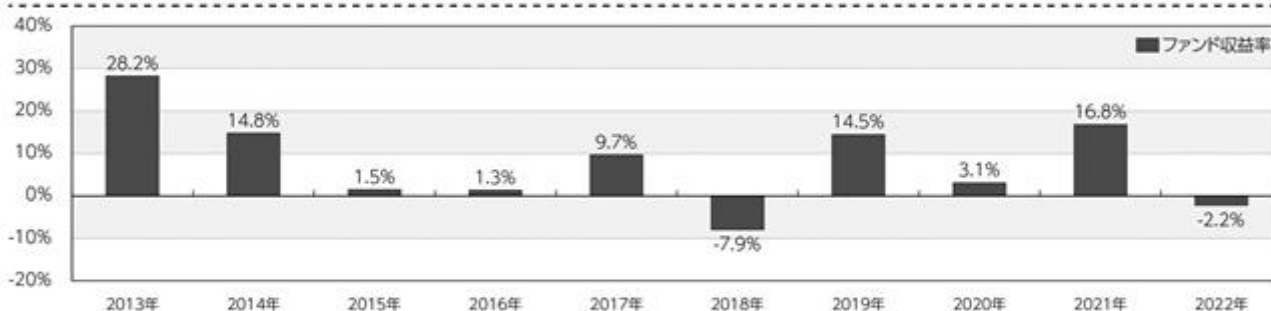
### ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	6.36
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.22
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.46
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.71
5	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.65

## 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。

※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】

#### ・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、法兰克福の銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所のいずれかの休業日に該当する日(以下「海外休業日」という場合があります。)には、お申込みの受付は行いません。

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

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

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

#### ・お申込価額(発行価格)

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### ・お申込手数料

ありません。

#### ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金(解約)手続等】

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

・ 解約価額

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

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

す。  
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

信託期間は2007年1月26日から無期限です。

ただし、下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### (4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎奇数月の12日から翌奇数月の11日までとします。



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

#### (5)【その他】

##### イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

#### ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対し異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定に従います。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ハ. 関係法人との契約の更改

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

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

#### ニ. 公告

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

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

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

#### ホ. 運用報告書

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

#### 4【受益者の権利等】

##### 収益分配金請求権

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

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

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

##### 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

##### 一部解約請求権

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

##### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2021年11月12日から2022年5月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【マネックス資産設計ファンド&lt;隔月分配型&gt;】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年11月11日現在	当期 2022年5月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,261,171	6,493,945
親投資信託受益証券	428,040,829	412,996,307
流動資産合計	434,302,000	419,490,252
資産合計	434,302,000	419,490,252
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	496,807	498,663
未払解約金	99,999	25,534
未払受託者報酬	30,487	31,612
未払委託者報酬	350,718	363,730
その他未払費用	2,686	2,785
流動負債合計	980,697	922,324
負債合計	980,697	922,324
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	331,204,771	332,442,384
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	102,116,532	86,125,544
(分配準備積立金)	111,397,243	110,560,014
元本等合計	433,321,303	418,567,928
純資産合計	433,321,303	418,567,928
負債純資産合計	434,302,000	419,490,252

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2021年5月12日 至 2021年11月11日	当期 自 2021年11月12日 至 2022年5月11日
<b>営業収益</b>		
受取利息	8	12
有価証券売買等損益	28,078,065	13,679,522
<b>営業収益合計</b>	<b>28,078,073</b>	<b>13,679,510</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	619	455
受託者報酬	94,663	93,263
委託者報酬	1,089,218	1,073,139
その他費用	8,332	8,215
<b>営業費用合計</b>	<b>1,192,832</b>	<b>1,175,072</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>26,885,241</b>	<b>14,854,582</b>
経常利益又は経常損失( )	26,885,241	14,854,582
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>26,885,241</b>	<b>14,854,582</b>
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( )	67,775	178,851
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>79,488,850</b>	<b>102,116,532</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,068,565	2,469,254
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,068,565	2,469,254
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>4,883,284</b>	<b>1,928,862</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,883,284	1,928,862
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1,510,615	1,497,947
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>102,116,532</b>	<b>86,125,544</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2021年11月12日	至 2022年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年11月11日現在	2022年5月11日現在
1. 期首元本額	341,815,072円	331,204,771円
期中追加設定元本額	7,665,051円	8,633,053円
期中一部解約元本額	18,275,352円	7,395,440円
2. 受益権の総数	331,204,771口	332,442,384口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2021年5月12日 至 2021年11月11日	自 2021年11月12日 至 2022年5月11日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2021年5月12日 至2021年7月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(964,694円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(11,015,378円)、信託約款に規定される収益調整金(12,883,362円)及び分配準備積立金(90,138,017円)より分配対象収益は115,001,451円(1万口当たり3,383.05円)であり、うち509,900円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自2021年7月13日 至2021年9月13日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(875,062円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(7,704,684円)、信託約款に規定される収益調整金(13,386,787円)及び分配準備積立金(99,760,270円)より分配対象収益は121,726,803円(1万口当たり3,623.48円)であり、うち503,908円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年11月12日 至2022年1月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(535,437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(15,061,551円)及び分配準備積立金(110,513,508円)より分配対象収益は126,110,496円(1万口当たり3,802.78円)であり、うち497,440円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自2022年1月12日 至2022年3月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(572,377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(16,346,167円)及び分配準備積立金(110,380,226円)より分配対象収益は127,298,770円(1万口当たり3,804.92円)であり、うち501,844円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>

	(自2021年9月14日 至2021年11月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,427,884円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(4,965,314円)、信託約款に規定される収益調整金(14,016,693円)及び分配準備積立金(105,500,852円)より分配対象収益は125,910,743円(1万口当たり3,801.59円)であり、うち496,807円(1万口当たり15円)を分配金額としております。	(自2022年3月12日 至2022年5月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,005,539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(16,944,327円)及び分配準備積立金(109,053,138円)より分配対象収益は128,003,004円(1万口当たり3,850.38円)であり、うち498,663円(1万口当たり15円)を分配金額としております。
--	--	---

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前期	当期
	自 2021年5月12日 至 2021年11月11日	自 2021年11月12日 至 2022年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	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	前期	当期
	2021年11月11日現在	2022年5月11日現在



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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 2021年11月11日現在	当期 2022年5月11日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	6,777,496	9,353,195
合計	6,777,496	9,353,195

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	前期 2021年11月11日現在	当期 2022年5月11日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3083円 (13,083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11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	32,407,197	100,572,495	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	99,738,983	127,606,054	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	12,475,526	29,351,170	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	17,659,398	101,479,730	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	14,352,119	29,654,348	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	14,409,019	24,332,510	
親投資信託受益証券 合計		191,042,242	412,996,307	
合計			412,996,307	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2022年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,422,028,389
株式	310,096,234,650
未収入金	27,337,725,471
未収配当金	4,811,807,106
前払金	166,345,000
差入委託証拠金	460,215,000
流動資産合計	347,294,355,616
資産合計	347,294,355,616
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	242,070,660
未払解約金	478,298,000
流動負債合計	720,368,660
負債合計	720,368,660
純資産の部	
元本等	
元本	111,675,457,342
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	234,898,529,614
元本等合計	346,573,986,956
純資産合計	346,573,986,956
負債純資産合計	347,294,355,616

## 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11月12日 至 2022年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	141,707,381,255円
同期中追加設定元本額	96,865,079,852円
同期中一部解約元本額	126,897,003,765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	2,677,840,818円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	7,016,723,937円
One DC 国内株式インデックスファンド	21,155,036,411円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,739,462,710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	1,430,341,754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)	3,675,468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)	439,854,013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)	295,696,014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)	427,312,236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)	3,042,295円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	44,378,387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>	33,889,382,522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	1,079,185,464円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,588,409,944円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,885,034,898円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	346,755,795円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,118,127,159円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,135,451,394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)	43,746,342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)	130,483,065円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	383,749,936円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	536,857,884円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	286,464,877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)	19,228,190円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,579,789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)	2,037,870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 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)	33,647,617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)	83,299,098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
しあわせの一步・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)	52,271,443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)	4,837,998円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,326,685円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,541,085円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,238,655円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,986,349円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	29,667,657円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	524,809,679円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	614,518,697円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,763,449,957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)	26,330,401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)	278,073,038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)	68,866,959円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,027,957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)	329,144,666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)	20,003,833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)	70,259,709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)	163,105,491円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	222,153,866円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	34,974,273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	720,883,492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〕	1,789,123,520円
計	111,675,457,342円
2. 受益権の総数	111,675,457,342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11月12日 至 2022年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	--

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年5月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
株式	14,019,246,911	
合計	14,019,246,911	

（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11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	2022年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち		評価損益（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	9,536,435,000	-		241,905,000
合計	9,536,435,000	-		241,905,000

## （注）時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	2022年5月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.1034円 (31,034円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

2022年5月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	



極洋	5,900	3,215.00	18,968,500
日本水産	165,700	568.00	94,117,600
マルハニチロ	25,200	2,417.00	60,908,400
雪国まいたけ	12,400	1,018.00	12,623,200
カネコ種苗	4,900	1,766.00	8,653,400
サカタのタネ	19,700	4,335.00	85,399,500
ホクト	13,900	1,994.00	27,716,600
ホクリヨウ	2,500	663.00	1,657,500
ショーボンドホールディングス	22,800	5,540.00	126,312,000
ミライト・ホールディングス	54,700	1,817.00	99,389,900
タマホーム	10,300	2,603.00	26,810,900
サンヨーホームズ	2,100	730.00	1,533,000
日本アクア	6,800	595.00	4,046,000
ファーストコーポレーション	4,300	789.00	3,392,700
ベステラ	3,400	1,179.00	4,008,600
Robot Home	28,300	197.00	5,575,100
キャンディル	2,900	517.00	1,499,300
住石ホールディングス	29,700	167.00	4,959,900
日鉄鉱業	3,700	5,680.00	21,016,000
三井松島ホールディングス	7,100	1,894.00	13,447,400
I N P E X	628,200	1,478.00	928,479,600
石油資源開発	19,900	2,540.00	50,546,000
K & O エナジーグループ	7,400	1,641.00	12,143,400
ダイセキ環境ソリューション	3,300	1,022.00	3,372,600
第一カッター興業	4,000	1,316.00	5,264,000
明豊ファシリティワークス	5,500	676.00	3,718,000
安藤・間	82,000	878.00	71,996,000
東急建設	48,300	591.00	28,545,300
コムシスホールディングス	54,700	2,700.00	147,690,000
ビーアールホールディングス	22,500	305.00	6,862,500
高松コンストラクショングループ	9,900	2,164.00	21,423,600
東建コーポレーション	4,700	8,440.00	39,668,000
ソネック	1,900	991.00	1,882,900
ヤマウラ	8,100	929.00	7,524,900
オリエンタル白石	57,200	231.00	13,213,200
大成建設	103,900	3,440.00	357,416,000
大林組	382,900	878.00	336,186,200
清水建設	357,200	679.00	242,538,800
飛島建設	10,500	1,011.00	10,615,500
長谷工コーポレーション	112,900	1,382.00	156,027,800
松井建設	14,700	622.00	9,143,400
銭高組	1,400	3,685.00	5,159,000
鹿島建設	280,600	1,398.00	392,278,800
不動テトラ	8,400	1,528.00	12,835,200
大末建設	4,100	1,473.00	6,039,300
鉄建建設	8,400	1,827.00	15,346,800
西松建設	23,700	4,050.00	95,985,000
三井住友建設	88,300	418.00	36,909,400
大豊建設	5,700	4,415.00	25,165,500
佐田建設	8,700	444.00	3,862,800

ナカノフドー建設	9,700	304.00	2,948,800
奥村組	22,100	3,075.00	67,957,500
東鉄工業	17,300	2,165.00	37,454,500
イチケン	2,800	1,787.00	5,003,600
富士ピー・エス	4,900	478.00	2,342,200
浅沼組	4,400	5,000.00	22,000,000
戸田建設	158,900	731.00	116,155,900
熊谷組	19,400	2,680.00	51,992,000
北野建設	2,400	2,054.00	4,929,600
植木組	3,400	1,366.00	4,644,400
矢作建設工業	16,800	759.00	12,751,200
ピーエス三菱	13,000	559.00	7,267,000
日本ハウスホールディングス	26,700	406.00	10,840,200
大東建託	40,200	11,460.00	460,692,000
新日本建設	16,700	713.00	11,907,100
東亜道路工業	2,000	4,995.00	9,990,000
日本道路	3,400	7,030.00	23,902,000
東亜建設工業	9,400	2,808.00	26,395,200
日本国土開発	35,700	535.00	19,099,500
若築建設	6,400	1,927.00	12,332,800
東洋建設	44,000	855.00	37,620,000
五洋建設	151,800	611.00	92,749,800
世紀東急工業	18,900	751.00	14,193,900
福田組	4,200	4,625.00	19,425,000
日本ドライケミカル	3,000	1,511.00	4,533,000
住友林業	95,500	1,901.00	181,545,500
日本基礎技術	10,500	728.00	7,644,000
巴コーポレーション	16,500	460.00	7,590,000
大和ハウス工業	344,900	3,008.00	1,037,459,200
ライト工業	23,000	1,873.00	43,079,000
積水ハウス	407,700	2,196.50	895,513,050
日特建設	8,300	738.00	6,125,400
北陸電気工事	7,900	739.00	5,838,100
ユアテック	22,500	673.00	15,142,500
日本リーテック	8,000	1,071.00	8,568,000
四電工	4,100	1,720.00	7,052,000
中電工	17,400	2,109.00	36,696,600
関電工	63,800	820.00	52,316,000
きんでん	84,900	1,505.00	127,774,500
東京エネシス	12,700	930.00	11,811,000
トーエネック	4,000	3,330.00	13,320,000
住友電設	9,700	2,273.00	22,048,100
日本電設工業	19,900	1,596.00	31,760,400
エクシオグループ	57,400	2,162.00	124,098,800
新日本空調	9,700	1,791.00	17,372,700
日本工営	7,600	2,899.00	22,032,400
九電工	28,400	2,831.00	80,400,400
三機工業	25,500	1,475.00	37,612,500
日揮ホールディングス	117,500	1,426.00	167,555,000
中外炉工業	3,900	1,459.00	5,690,100

ヤマト	10,900	732.00	7,978,800
太平電業	8,200	2,635.00	21,607,000
高砂熱学工業	33,600	1,664.00	55,910,400
三晃金属工業	1,600	2,579.00	4,126,400
N E C ネットズエスアイ	40,600	1,835.00	74,501,000
朝日工業社	5,100	1,550.00	7,905,000
明星工業	22,800	665.00	15,162,000
大気社	18,200	3,115.00	56,693,000
ダイダン	8,300	2,111.00	17,521,300
日比谷総合設備	12,000	1,846.00	22,152,000
ニッポン	34,700	1,690.00	58,643,000
日清製粉グループ本社	134,000	1,735.00	232,490,000
日東富士製粉	1,400	3,935.00	5,509,000
昭和産業	11,200	2,607.00	29,198,400
鳥越製粉	10,700	650.00	6,955,000
中部飼料	13,900	973.00	13,524,700
フィード・ワン	16,000	638.00	10,208,000
東洋精糖	1,600	977.00	1,563,200
日本甜菜製糖	6,600	1,672.00	11,035,200
D M 三井製糖ホールディングス	11,000	1,887.00	20,757,000
塩水港精糖	15,700	207.00	3,249,900
日新製糖	6,100	1,721.00	10,498,100
L I F U L L	36,400	217.00	7,898,800
ミクシィ	27,400	2,252.00	61,704,800
ジェイエイシーリクルートメント	9,600	1,751.00	16,809,600
日本M & A センターホールディングス	196,000	1,423.00	278,908,000
メンバーズ	3,400	3,310.00	11,254,000
中広	900	380.00	342,000
U T グループ	17,300	2,545.00	44,028,500
アイティメディア	5,700	1,661.00	9,467,700
E ・ J ホールディングス	6,900	1,150.00	7,935,000
夢真ビーネックスグループ	39,000	1,339.00	52,221,000
コシダカホールディングス	31,900	716.00	22,840,400
アルトナー	2,900	839.00	2,433,100
パソナグループ	13,000	1,948.00	25,324,000
C D S	2,000	1,772.00	3,544,000
リンクアンドモチベーション	26,300	432.00	11,361,600
エス・エム・エス	40,600	3,035.00	123,221,000
サニーサイドアップグループ	4,200	780.00	3,276,000
パーソルホールディングス	119,500	2,291.00	273,774,500
リニカル	6,800	779.00	5,297,200
クックパッド	37,600	250.00	9,400,000
エスクリ	5,300	408.00	2,162,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,900	563.00	3,321,700
森永製菓	28,000	3,990.00	111,720,000
中村屋	2,900	3,110.00	9,019,000
江崎グリコ	32,800	3,750.00	123,000,000
名糖産業	5,300	1,610.00	8,533,000
井村屋グループ	6,800	2,257.00	15,347,600
不二家	7,000	2,395.00	16,765,000

山崎製パン	88,300	1,676.00	147,990,800
第一屋製パン	2,800	515.00	1,442,000
モロゾフ	3,100	3,045.00	9,439,500
亀田製菓	7,000	4,185.00	29,295,000
寿スピリッツ	11,700	6,540.00	76,518,000
カルビー	57,200	2,538.00	145,173,600
森永乳業	22,600	5,020.00	113,452,000
六甲バター	8,900	1,484.00	13,207,600
ヤクルト本社	88,600	6,630.00	587,418,000
明治ホールディングス	76,800	6,580.00	505,344,000
雪印メグミルク	29,300	1,906.00	55,845,800
プリマハム	15,700	2,147.00	33,707,900
日本ハム	46,700	4,065.00	189,835,500
林兼産業	3,200	493.00	1,577,600
丸大食品	12,100	1,487.00	17,992,700
S Foods	11,300	2,969.00	33,549,700
柿安本店	4,300	2,386.00	10,259,800
伊藤ハム米久ホールディングス	80,900	661.00	53,474,900
学情	4,900	919.00	4,503,100
スタジオアリス	5,300	2,186.00	11,585,800
クロスキャット	6,700	863.00	5,782,100
シミックホールディングス	6,300	1,440.00	9,072,000
エプコ	2,600	710.00	1,846,000
システナ	175,200	411.00	72,007,200
N J S	2,400	2,060.00	4,944,000
デジタルアーツ	6,600	6,960.00	45,936,000
日鉄ソリューションズ	18,900	3,680.00	69,552,000
総合警備保障	46,200	3,745.00	173,019,000
キューブシステム	6,200	891.00	5,524,200
いちご	137,400	266.00	36,548,400
WOW WORLD	1,700	1,040.00	1,768,000
日本駐車場開発	130,700	155.00	20,258,500
コア	5,200	1,402.00	7,290,400
カカクコム	87,700	2,800.00	245,560,000
アイロムグループ	4,300	1,870.00	8,041,000
セントケア・ホールディング	7,800	791.00	6,169,800
サイネックス	2,000	587.00	1,174,000
ルネサンス	8,300	876.00	7,270,800
ディップ	21,000	3,860.00	81,060,000
S B Sホールディングス	9,300	2,884.00	26,821,200
デジタルホールディングス	8,300	1,399.00	11,611,700
新日本科学	14,500	1,365.00	19,792,500
キャリアデザインセンター	2,800	1,042.00	2,917,600
ベネフィット・ワン	43,500	1,869.00	81,301,500
エムスリー	210,900	3,926.00	827,993,400
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	303.00	2,302,800
プラス	1,600	693.00	1,108,800
アウトソーシング	68,500	1,201.00	82,268,500
ウェルネット	11,600	451.00	5,231,600
ワールドホールディングス	4,800	2,310.00	11,088,000

ディー・エヌ・エー	45,500	1,897.00	86,313,500
博報堂DYホールディングス	161,400	1,502.00	242,422,800
ぐるなび	18,800	389.00	7,313,200
タカミヤ	14,700	334.00	4,909,800
ジャパンベストレスキューシステム	7,600	730.00	5,548,000
ファンコミュニケーションズ	29,000	423.00	12,267,000
ライク	4,000	2,134.00	8,536,000
ビジネス・ブレークスルー	4,600	408.00	1,876,800
エスプール	33,700	1,197.00	40,338,900
WDBホールディングス	5,400	2,566.00	13,856,400
手間いらず	1,700	4,885.00	8,304,500
ティア	7,200	432.00	3,110,400
CDG	1,300	1,286.00	1,671,800
アドウェイズ	17,800	778.00	13,848,400
バリューコマース	9,400	3,155.00	29,657,000
インフォマート	131,000	513.00	67,203,000
サッポロホールディングス	40,800	2,742.00	111,873,600
アサヒグループホールディングス	282,200	4,759.00	1,342,989,800
麒麟ホールディングス	461,300	1,942.00	895,844,600
宝ホールディングス	80,100	1,065.00	85,306,500
オエノンホールディングス	35,300	304.00	10,731,200
養命酒製造	3,800	1,731.00	6,577,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	85,500	1,458.00	124,659,000
サントリー食品インターナショナル	84,000	4,970.00	417,480,000
ダイドーグループホールディングス	6,400	5,020.00	32,128,000
伊藤園	38,100	5,580.00	212,598,000
キーコーヒー	12,000	2,053.00	24,636,000
ユニカフェ	4,000	915.00	3,660,000
ジャパンフーズ	1,400	1,142.00	1,598,800
日清オイリオグループ	15,300	3,100.00	47,430,000
不二製油グループ本社	27,200	1,862.00	50,646,400
かどや製油	1,300	3,535.00	4,595,500
J-オイルミルズ	11,800	1,605.00	18,939,000
ローソン	27,300	4,960.00	135,408,000
サンエー	9,000	4,105.00	36,945,000
カワチ薬品	9,600	2,085.00	20,016,000
エービーシー・マート	19,200	5,380.00	103,296,000
ハードオフコーポレーション	5,500	848.00	4,664,000
高千穂交易	4,700	1,544.00	7,256,800
アスクル	27,800	1,504.00	41,811,200
ゲオホールディングス	15,900	1,287.00	20,463,300
アダストリア	13,200	2,128.00	28,089,600
ジーフット	7,700	314.00	2,417,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	393.00	786,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,400	1,685.00	2,359,000
伊藤忠食品	2,800	4,855.00	13,594,000
くら寿司	12,900	3,035.00	39,151,500
キャンドウ	4,600	2,376.00	10,929,600
エレマテック	9,900	1,185.00	11,731,500

アイケイ	3,900	560.00	2,184,000
パルグループホールディングス	10,800	1,491.00	16,102,800
エディオン	56,500	1,232.00	69,608,000
あらた	9,600	3,720.00	35,712,000
サーラコーポレーション	25,100	625.00	15,687,500
ワッツ	6,000	715.00	4,290,000
トーメンデバイス	1,800	5,680.00	10,224,000
ハローズ	5,600	3,090.00	17,304,000
J Pホールディングス	30,700	208.00	6,385,600
フジオフードグループ本社	10,000	1,315.00	13,150,000
あみやき亭	2,900	2,896.00	8,398,400
東京エレクトロン デバイス	3,700	5,700.00	21,090,000
ひらまつ	26,200	186.00	4,873,200
フィールズ	10,800	1,006.00	10,864,800
双日	132,800	1,938.00	257,366,400
アルフレッサ ホールディングス	133,800	1,806.00	241,642,800
大黒天物産	4,000	4,880.00	19,520,000
ハニーズホールディングス	10,500	1,084.00	11,382,000
ファーマライズホールディングス	3,100	722.00	2,238,200
キッコーマン	85,300	7,220.00	615,866,000
味の素	264,200	3,042.00	803,696,400
ブルドックソース	5,100	1,876.00	9,567,600
キューピー	62,300	2,240.00	139,552,000
ハウス食品グループ本社	44,300	2,995.00	132,678,500
カゴメ	47,600	3,240.00	154,224,000
焼津水産化学工業	6,100	932.00	5,685,200
アリアケジャパン	11,500	5,050.00	58,075,000
ピエトロ	1,700	1,750.00	2,975,000
エバラ食品工業	2,800	2,819.00	7,893,200
やまみ	1,100	1,624.00	1,786,400
ニチレイ	53,800	2,387.00	128,420,600
横浜冷凍	33,100	856.00	28,333,600
東洋水産	58,800	4,170.00	245,196,000
イートアンドホールディングス	4,800	2,195.00	10,536,000
大冷	1,600	1,870.00	2,992,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,500	519.00	3,373,500
日清食品ホールディングス	45,900	8,950.00	410,805,000
永谷園ホールディングス	5,700	1,960.00	11,172,000
一正蒲鉾	5,300	815.00	4,319,500
フジッコ	11,700	2,010.00	23,517,000
ロック・フィールド	13,100	1,393.00	18,248,300
日本たばこ産業	673,100	2,267.50	1,526,254,250
ケンコーマヨネーズ	6,800	1,408.00	9,574,400
わらべや日洋ホールディングス	8,000	1,686.00	13,488,000
なとり	7,100	1,991.00	14,136,100
イフジ産業	2,000	1,008.00	2,016,000
ピックルスコーポレーション	6,000	1,273.00	7,638,000
ファーマフーズ	15,800	1,657.00	26,180,600
北の達人コーポレーション	43,700	185.00	8,084,500
ユーグレナ	64,100	822.00	52,690,200

紀文食品	9,700	1,029.00	9,981,300
スター・マイカ・ホールディングス	6,700	1,450.00	9,715,000
SREホールディングス	3,100	2,352.00	7,291,200
ADワークスグループ	24,600	147.00	3,616,200
片倉工業	12,800	2,481.00	31,756,800
グンゼ	7,500	3,770.00	28,275,000
ヒューリック	285,800	1,027.00	293,516,600
神栄	1,700	867.00	1,473,900
ラサ商事	6,200	970.00	6,014,000
アルペン	9,200	1,898.00	17,461,600
ハブ	4,000	474.00	1,896,000
ラクーンホールディングス	10,400	1,405.00	14,612,000
クオールホールディングス	15,100	1,078.00	16,277,800
アルコニックス	15,400	1,341.00	20,651,400
神戸物産	92,100	2,937.00	270,497,700
ソリトンシステムズ	6,200	1,278.00	7,923,600
ジンズホールディングス	7,700	4,270.00	32,879,000
ビックカメラ	73,100	1,123.00	82,091,300
DCMホールディングス	76,000	1,076.00	81,776,000
ペッパーフードサービス	16,800	371.00	6,232,800
ハイパー	2,000	467.00	934,000
MonotaRO	155,800	2,114.00	329,361,200
東京一番フーズ	3,200	594.00	1,900,800
DDホールディングス	6,400	513.00	3,283,200
あいホールディングス	17,600	1,648.00	29,004,800
ディーブイエックス	4,300	1,003.00	4,312,900
きちりホールディングス	3,400	368.00	1,251,200
アークランドサービスホールディングス	9,000	2,020.00	18,180,000
J.フロントリテイリング	143,500	969.00	139,051,500
ドトール・日レスホールディングス	20,700	1,501.00	31,070,700
マツキヨココカラ&カンパニー	74,500	4,270.00	318,115,000
ブロンコビリー	6,800	2,301.00	15,646,800
ZOZO	84,700	2,664.00	225,640,800
トレジャー・ファクトリー	3,600	974.00	3,506,400
物語コーポレーション	6,100	5,250.00	32,025,000
三越伊勢丹ホールディングス	205,400	960.00	197,184,000
東洋紡	48,300	1,078.00	52,067,400
ユニチカ	33,500	273.00	9,145,500
富士紡ホールディングス	5,300	3,180.00	16,854,000
日清紡ホールディングス	72,200	943.00	68,084,600
倉敷紡績	9,900	1,799.00	17,810,100
ダイワボウホールディングス	57,300	1,647.00	94,373,100
シキボウ	6,500	877.00	5,700,500
日東紡績	17,600	2,400.00	42,240,000
トヨタ紡織	48,600	2,010.00	97,686,000
マクニカ・富士エレホールディングス	29,400	2,695.00	79,233,000
Hamee	4,400	1,050.00	4,620,000
マーケットエンタープライズ	1,300	775.00	1,007,500
ラクト・ジャパン	4,200	1,990.00	8,358,000

ウエルシアホールディングス	65,200	2,629.00	171,410,800
クリエイトSDホールディングス	18,200	2,968.00	54,017,600
グリムス	5,500	1,597.00	8,783,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,900	733.00	15,319,700
八洲電機	9,000	945.00	8,505,000
メディアスホールディングス	7,100	971.00	6,894,100
レスターホールディングス	11,700	2,009.00	23,505,300
ジューテックホールディングス	2,800	1,054.00	2,951,200
丸善CHIホールディングス	14,900	378.00	5,632,200
大光	5,400	717.00	3,871,800
OCHIホールディングス	3,400	1,218.00	4,141,200
TOKAIホールディングス	59,700	865.00	51,640,500
黒谷	3,300	579.00	1,910,700
ミサワ	2,500	621.00	1,552,500
ティーライフ	1,700	1,429.00	2,429,300
Cominix	2,400	720.00	1,728,000
エー・ピーホールディングス	1,900	445.00	845,500
三洋貿易	12,000	961.00	11,532,000
チムニー	3,900	1,141.00	4,449,900
シュッピン	10,200	1,114.00	11,362,800
ビューティガレージ	2,000	2,601.00	5,202,000
オイシックス・ラ・大地	17,700	2,555.00	45,223,500
ウイン・パートナーズ	9,000	994.00	8,946,000
ネクステージ	25,000	1,965.00	49,125,000
ジョイフル本田	37,000	1,577.00	58,349,000
鳥貴族ホールディングス	4,300	1,704.00	7,327,200
ホットランド	9,300	1,359.00	12,638,700
すかいらーくホールディングス	156,000	1,526.00	238,056,000
SFPホールディングス	6,100	1,381.00	8,424,100
綿半ホールディングス	9,100	1,318.00	11,993,800
日本毛織	34,600	972.00	33,631,200
ダイトウボウ	19,900	92.00	1,830,800
トーア紡コーポレーション	3,500	383.00	1,340,500
ダイドーリミテッド	17,200	136.00	2,339,200
ヨシックスホールディングス	2,400	2,023.00	4,855,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	35,700	1,077.00	38,448,900
三栄建築設計	5,000	1,614.00	8,070,000
野村不動産ホールディングス	63,800	3,090.00	197,142,000
三重交通グループホールディングス	25,200	455.00	11,466,000
サムティ	19,200	2,052.00	39,398,400
ディア・ライフ	15,700	509.00	7,991,300
コーセーアールイー	3,700	626.00	2,316,200
地主	7,800	1,936.00	15,100,800
プレサンスコーポレーション	15,300	1,474.00	22,552,200
フィル・カンパニー	2,100	1,148.00	2,410,800
THEグローバル社	6,600	154.00	1,016,400
ハウスコム	900	1,115.00	1,003,500
日本管理センター	6,000	981.00	5,886,000



サンセイランディック	3,800	804.00	3,055,200
エストラスト	1,300	552.00	717,600
フージャースホールディングス	15,900	645.00	10,255,500
オープンハウスグループ	39,200	4,870.00	190,904,000
東急不動産ホールディングス	354,100	638.00	225,915,800
飯田グループホールディングス	102,900	2,116.00	217,736,400
イーグランド	1,900	1,400.00	2,660,000
ムゲンエステート	7,800	500.00	3,900,000
帝国繊維	13,400	1,560.00	20,904,000
日本コークス工業	105,800	129.00	13,648,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,400	947.00	6,060,800
ミタチ産業	3,100	881.00	2,731,100
B E E N O S	6,200	1,675.00	10,385,000
あさひ	10,200	1,315.00	13,413,000
日本調剤	7,400	1,196.00	8,850,400
コスモス薬品	12,400	11,950.00	148,180,000
シップヘルスケアホールディングス	38,100	2,094.00	79,781,400
トーエル	5,900	823.00	4,855,700
ソフトクリエイイトホールディングス	5,300	3,850.00	20,405,000
セブン&アイ・ホールディングス	458,900	5,636.00	2,586,360,400
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	71,200	817.00	58,170,400
明治電機工業	4,000	1,025.00	4,100,000
ツルハホールディングス	26,800	6,750.00	180,900,000
デリカフーズホールディングス	5,000	525.00	2,625,000
スターティアホールディングス	2,800	541.00	1,514,800
サンマルクホールディングス	9,700	1,493.00	14,482,100
フェリシモ	2,800	1,158.00	3,242,400
トリドールホールディングス	30,600	2,283.00	69,859,800
帝人	112,700	1,393.00	156,991,100
東レ	844,600	641.30	541,641,980
クラレ	174,400	1,058.00	184,515,200
旭化成	793,800	1,065.50	845,793,900
T O K Y O B A S E	11,200	311.00	3,483,200
稲葉製作所	6,800	1,292.00	8,785,600
宮地エンジニアリンググループ	3,700	3,315.00	12,265,500
トーカロ	31,900	1,274.00	40,640,600
アルファ	4,700	932.00	4,380,400
S U M C O	194,800	1,945.00	378,886,000
川田テクノロジーズ	2,500	3,560.00	8,900,000
R S T e c h n o l o g i e s	4,000	5,790.00	23,160,000
ジェイテックコーポレーション	1,600	1,656.00	2,649,600
信和	7,700	786.00	6,052,200
ビーロット	8,400	491.00	4,124,400
ファーストブラザーズ	2,900	820.00	2,378,000
A n d D o ホールディングス	6,100	893.00	5,447,300
シーアールイー	3,900	1,466.00	5,717,400
プロパティエージェント	1,500	1,496.00	2,244,000
ケイアイスター不動産	5,500	5,270.00	28,985,000
アグレ都市デザイン	2,000	1,558.00	3,116,000

グッドコムアセット	5,300	1,085.00	5,750,500
ジェイ・エス・ビー	2,500	3,355.00	8,387,500
ロードスターキャピタル	3,100	1,418.00	4,395,800
テンポイノベーション	3,500	807.00	2,824,500
グローバル・リンク・マネジメント	2,200	908.00	1,997,600
フェイスネットワーク	1,600	1,325.00	2,120,000
住江織物	2,300	1,920.00	4,416,000
日本フェルト	7,300	421.00	3,073,300
イチカワ	1,300	1,390.00	1,807,000
エコナックホールディングス	21,500	89.00	1,913,500
日東製網	1,400	1,323.00	1,852,200
芦森工業	2,000	958.00	1,916,000
アツギ	9,300	518.00	4,817,400
ウイルプラスホールディングス	2,300	941.00	2,164,300
J Mホールディングス	8,600	1,624.00	13,966,400
コメダホールディングス	26,800	2,228.00	59,710,400
サツドラホールディングス	5,700	645.00	3,676,500
アレンザホールディングス	9,000	983.00	8,847,000
串カツ田中ホールディングス	3,300	1,659.00	5,474,700
パロックジャパンリミテッド	8,600	789.00	6,785,400
クスリのアオキホールディングス	11,900	5,480.00	65,212,000
ダイニック	3,200	698.00	2,233,600
共和レザー	7,400	606.00	4,484,400
ピーバンドットコム	1,700	550.00	935,000
力の源ホールディングス	6,400	581.00	3,718,400
FOOD & LIFE COMPANIES	69,100	3,155.00	218,010,500
アセンテック	4,200	709.00	2,977,800
セーレン	24,300	2,031.00	49,353,300
ソトー	4,700	829.00	3,896,300
東海染工	1,300	1,133.00	1,472,900
小松マテーレ	19,600	1,411.00	27,655,600
ワコールホールディングス	28,900	1,829.00	52,858,100
ホギメディカル	16,100	3,155.00	50,795,500
クラウドディアホールディングス	2,000	230.00	460,000
T S Iホールディングス	39,600	309.00	12,236,400
マツオカコーポレーション	3,800	1,104.00	4,195,200
ワールド	16,000	1,334.00	21,344,000
T I S	113,800	2,966.00	337,530,800
J N Sホールディングス	5,600	393.00	2,200,800
グリー	55,900	904.00	50,533,600
G M Oペパボ	1,300	1,972.00	2,563,600
コーエーテクモホールディングス	39,100	4,250.00	166,175,000
三菱総合研究所	6,300	4,165.00	26,239,500
ボルテージ	3,300	357.00	1,178,100
電算	800	2,178.00	1,742,400
A G S	6,000	748.00	4,488,000
ファインデックス	10,400	596.00	6,198,400
ブレインパッド	10,400	1,125.00	11,700,000
K L a b	21,900	438.00	9,592,200

ポールトゥウィンホールディングス	17,800	1,000.00	17,800,000
ネクソン	277,900	2,976.00	827,030,400
アイスタイル	31,500	160.00	5,040,000
エムアップホールディングス	14,200	955.00	13,561,000
エイチーム	8,200	712.00	5,838,400
エニグモ	13,200	558.00	7,365,600
テクノスジャパン	9,500	449.00	4,265,500
e n i s h	8,200	309.00	2,533,800
コロプラ	40,300	625.00	25,187,500
オルトプラス	9,200	308.00	2,833,600
ブロードリーフ	60,800	366.00	22,252,800
クロス・マーケティンググループ	4,700	863.00	4,056,100
デジタルハーツホールディングス	5,600	1,665.00	9,324,000
システム情報	9,200	915.00	8,418,000
メディアドゥ	4,300	1,740.00	7,482,000
じげん	34,600	290.00	10,034,000
バイキューブ	12,500	1,026.00	12,825,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	521.00	1,458,800
サイバーリンクス	4,100	1,015.00	4,161,500
ディー・エル・イー	8,300	285.00	2,365,500
フィックスターズ	12,600	743.00	9,361,800
CARTA HOLDINGS	5,000	2,313.00	11,565,000
オブティム	8,500	833.00	7,080,500
セレス	4,600	1,495.00	6,877,000
S H I F T	6,700	21,340.00	142,978,000
特種東海製紙	7,200	3,490.00	25,128,000
ティーガイア	10,900	1,705.00	18,584,500
セック	1,800	2,178.00	3,920,400
テクマトリックス	20,800	1,594.00	33,155,200
プロシップ	4,100	1,376.00	5,641,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,900	2,574.00	82,110,600
GMOペイメントゲートウェイ	23,800	9,870.00	234,906,000
ザッパラス	4,600	422.00	1,941,200
システムリサーチ	3,600	1,921.00	6,915,600
インターネットイニシアティブ	32,700	3,905.00	127,693,500
さくらインターネット	13,200	566.00	7,471,200
ヴィンクス	3,500	1,069.00	3,741,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,800	4,915.00	13,762,000
S R Aホールディングス	6,000	2,790.00	16,740,000
システムインテグレータ	4,000	481.00	1,924,000
朝日ネット	11,300	573.00	6,474,900
e B A S E	14,700	418.00	6,144,600
アバント	13,100	1,200.00	15,720,000
アドソル日進	4,400	1,518.00	6,679,200
ODKソリューションズ	2,700	591.00	1,595,700
フリービット	6,300	911.00	5,739,300
コムチュア	13,800	2,906.00	40,102,800
サイバーコム	1,900	1,121.00	2,129,900

アステリア	8,800	877.00	7,717,600
アイル	6,500	1,335.00	8,677,500
王子ホールディングス	498,900	588.00	293,353,200
日本製紙	55,600	1,019.00	56,656,400
三菱製紙	17,200	298.00	5,125,600
北越コーポレーション	77,900	673.00	52,426,700
中越パルプ工業	4,800	937.00	4,497,600
巴川製紙所	3,700	764.00	2,826,800
大王製紙	56,900	1,513.00	86,089,700
阿波製紙	3,300	326.00	1,075,800
マークライNZ	6,200	2,528.00	15,673,600
メディカル・データ・ビジョン	15,500	957.00	14,833,500
gumi	16,900	530.00	8,957,000
ショーケース	2,700	433.00	1,169,100
モバイルファクトリー	2,800	1,009.00	2,825,200
テラスカイ	4,500	1,268.00	5,706,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,400	1,173.00	6,334,200
P C Iホールディングス	5,200	978.00	5,085,600
パイプドHD	2,200	2,647.00	5,823,400
アイビーシー	1,900	481.00	913,900
ネオジャパン	3,500	1,158.00	4,053,000
P R T I M E S	2,600	2,086.00	5,423,600
ラクス	56,200	1,402.00	78,792,400
ランドコンピュータ	2,900	871.00	2,525,900
ダブルスタンダード	3,700	1,765.00	6,530,500
オープンドア	7,300	1,641.00	11,979,300
マイネット	4,400	513.00	2,257,200
アカツキ	5,400	2,919.00	15,762,600
ベネフィットジャパン	800	2,092.00	1,673,600
U b i c o mホールディングス	3,200	2,603.00	8,329,600
カナミックネットワーク	13,700	492.00	6,740,400
ノムラシステムコーポレーション	6,300	224.00	1,411,200
レンゴー	108,500	761.00	82,568,500
トーモク	7,100	1,535.00	10,898,500
ザ・バック	8,700	2,340.00	20,358,000
チェンジ	23,600	1,771.00	41,795,600
シンクロ・フード	6,200	288.00	1,785,600
オークネット	6,500	1,684.00	10,946,000
キャピタル・アセット・プランニング	2,400	716.00	1,718,400
セグエグループ	3,200	553.00	1,769,600
エイトレッド	1,700	2,009.00	3,415,300
マクロミル	25,600	1,106.00	28,313,600
ビーグリー	2,800	1,360.00	3,808,000
オロ	3,900	1,848.00	7,207,200
ユーザーローカル	3,800	1,640.00	6,232,000
テモナ	2,500	361.00	902,500
ニーズウェル	3,000	678.00	2,034,000
マネーフォワード	24,900	3,695.00	92,005,500
サインポスト	4,000	849.00	3,396,000

昭和電工	106,700	2,391.00	255,119,700
住友化学	878,600	569.00	499,923,400
住友精化	5,200	3,050.00	15,860,000
日産化学	63,000	6,960.00	438,480,000
ラサ工業	4,300	1,589.00	6,832,700
クレハ	9,500	9,660.00	91,770,000
多木化学	4,500	4,865.00	21,892,500
テイカ	8,400	1,189.00	9,987,600
石原産業	20,900	1,013.00	21,171,700
片倉コープアグリ	2,900	1,255.00	3,639,500
日本曹達	14,900	3,750.00	55,875,000
東ソー	168,300	1,814.00	305,296,200
トクヤマ	38,100	1,756.00	66,903,600
セントラル硝子	19,500	2,396.00	46,722,000
東亜合成	64,800	1,034.00	67,003,200
大阪ソーダ	10,800	3,150.00	34,020,000
関東電化工業	25,300	951.00	24,060,300
デンカ	43,600	3,420.00	149,112,000
イビデン	63,800	4,630.00	295,394,000
信越化学工業	204,900	17,840.00	3,655,416,000
日本カーバイド工業	4,400	1,372.00	6,036,800
電算システムホールディングス	5,100	2,523.00	12,867,300
堺化学工業	8,400	1,851.00	15,548,400
第一稀元素化学工業	11,000	967.00	10,637,000
エア・ウォーター	110,000	1,681.00	184,910,000
日本酸素ホールディングス	112,100	2,284.00	256,036,400
日本化学工業	3,700	2,293.00	8,484,100
東邦アセチレン	2,700	1,130.00	3,051,000
日本パーカライジング	58,400	910.00	53,144,000
高圧ガス工業	18,700	652.00	12,192,400
チタン工業	1,400	1,720.00	2,408,000
四国化成工業	15,300	1,246.00	19,063,800
戸田工業	2,600	2,469.00	6,419,400
ステラ ケミファ	6,200	2,421.00	15,010,200
保土谷化学工業	3,700	3,750.00	13,875,000
日本触媒	19,600	5,270.00	103,292,000
大日精化工業	9,600	1,917.00	18,403,200
カネカ	29,900	3,415.00	102,108,500
協和キリン	139,900	2,754.00	385,284,600
三菱瓦斯化学	108,100	1,975.00	213,497,500
三井化学	106,000	3,000.00	318,000,000
J S R	114,100	3,720.00	424,452,000
東京応化工業	19,300	6,910.00	133,363,000
大阪有機化学工業	9,800	2,703.00	26,489,400
三菱ケミカルホールディングス	799,400	797.50	637,521,500
K Hネオケム	19,700	2,632.00	51,850,400
ダイセル	172,500	827.00	142,657,500
住友ベークライト	18,700	4,295.00	80,316,500
積水化学工業	250,200	1,707.00	427,091,400
日本ゼオン	104,300	1,365.00	142,369,500

アイカ工業	32,300	3,045.00	98,353,500
UBE	57,700	2,037.00	117,534,900
積水樹脂	17,900	1,735.00	31,056,500
タキロンシーアイ	26,600	535.00	14,231,000
旭有機材	6,900	1,881.00	12,978,900
ニチバン	7,100	1,655.00	11,750,500
リケンテクノス	28,300	425.00	12,027,500
大倉工業	6,000	1,783.00	10,698,000
積水化成成品工業	15,800	422.00	6,667,600
群栄化学工業	2,700	2,672.00	7,214,400
タイガースポリマー	6,500	433.00	2,814,500
ミライアル	4,000	1,663.00	6,652,000
ダイキアクシス	4,900	718.00	3,518,200
ダイキョーニシカワ	25,800	511.00	13,183,800
竹本容器	4,400	790.00	3,476,000
森六ホールディングス	6,400	1,791.00	11,462,400
恵和	3,300	4,615.00	15,229,500
日本化薬	90,500	1,099.00	99,459,500
カーリットホールディングス	11,500	640.00	7,360,000
ソルクシーズ	10,500	370.00	3,885,000
CLホールディングス	2,500	1,058.00	2,645,000
プレステージ・インターナショナル	44,800	598.00	26,790,400
フェイス	3,300	710.00	2,343,000
プロトコーポレーション	13,000	1,053.00	13,689,000
ハイマックス	3,300	1,265.00	4,174,500
アミューズ	6,500	1,938.00	12,597,000
野村総合研究所	229,300	3,395.00	778,473,500
ドリームインキュベータ	3,400	1,990.00	6,766,000
サイバネットシステム	8,700	775.00	6,742,500
クイック	7,900	1,478.00	11,676,200
TAC	6,800	228.00	1,550,400
CEホールディングス	6,300	460.00	2,898,000
日本システム技術	2,300	2,436.00	5,602,800
電通グループ	119,500	4,665.00	557,467,500
インテージホールディングス	14,200	1,546.00	21,953,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,600	1,208.00	6,764,800
東邦システムサイエンス	3,400	892.00	3,032,800
ぴあ	4,000	2,963.00	11,852,000
イオンファンタジー	4,600	2,003.00	9,213,800
ソースネクスト	52,800	170.00	8,976,000
シーティーエス	13,500	856.00	11,556,000
ネクシィーズグループ	4,000	513.00	2,052,000
インフォコム	13,400	2,035.00	27,269,000
メディカルシステムネットワーク	11,500	436.00	5,014,000
日本精化	9,200	1,911.00	17,581,200
扶桑化学工業	10,600	3,865.00	40,969,000
トリケミカル研究所	12,600	2,355.00	29,673,000
シンプレクス・ホールディングス	19,400	1,764.00	34,221,600
HEROZ	3,500	911.00	3,188,500
ラクスル	13,900	2,346.00	32,609,400

I P S	3,400	2,212.00	7,520,800	
F I G	13,400	282.00	3,778,800	
システムサポート	4,500	1,051.00	4,729,500	
A D E K A	53,700	2,368.00	127,161,600	
日油	39,700	4,760.00	188,972,000	
ミヨシ油脂	4,900	1,106.00	5,419,400	
新日本理化	19,300	265.00	5,114,500	
ハリマ化成グループ	8,900	774.00	6,888,600	
イーソル	7,500	582.00	4,365,000	
アルテリア・ネットワークス	14,200	1,345.00	19,099,000	
東海ソフト	1,900	936.00	1,778,400	
ウイングアーク1st	9,400	1,270.00	11,938,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,489.00	4,169,200	
サーバーワークス	2,100	2,017.00	4,235,700	
東名	1,100	759.00	834,900	
ヴィッツ	1,100	1,173.00	1,290,300	
トピラシステムズ	2,500	759.00	1,897,500	
Sansan	42,000	1,165.00	48,930,000	
Link-U	2,200	664.00	1,460,800	
ギフトィ	10,800	932.00	10,065,600	
花王	270,600	5,233.00	1,416,049,800	
第一工業製薬	4,400	2,534.00	11,149,600	
石原ケミカル	6,100	1,274.00	7,771,400	
日華化学	4,200	805.00	3,381,000	
ニイタカ	2,500	2,383.00	5,957,500	
三洋化成工業	7,400	5,030.00	37,222,000	
ベース	2,100	5,890.00	12,369,000	
J M D C	15,300	4,535.00	69,385,500	
武田薬品工業	983,000	3,735.00	3,671,505,000	
アステラス製薬	1,069,300	1,956.00	2,091,550,800	
住友ファーマ	77,200	1,252.00	96,654,400	
塩野義製薬	153,300	6,965.00	1,067,734,500	
わかもと製薬	14,000	269.00	3,766,000	
日本新薬	30,900	8,640.00	266,976,000	
中外製薬	391,200	3,717.00	1,454,090,400	
科研製薬	19,000	3,855.00	73,245,000	
エーザイ	145,800	5,556.00	810,064,800	
理研ビタミン	12,300	1,650.00	20,295,000	
ロート製薬	62,700	3,345.00	209,731,500	
小野薬品工業	273,600	3,237.00	885,643,200	
久光製薬	30,900	3,580.00	110,622,000	
有機合成薬品工業	8,500	271.00	2,303,500	
持田製薬	15,100	3,695.00	55,794,500	
参天製薬	228,200	1,064.00	242,804,800	
扶桑薬品工業	4,300	2,109.00	9,068,700	
日本ケミファ	900	1,911.00	1,719,900	
ツムラ	37,800	3,155.00	119,259,000	
日医工	37,900	772.00	29,258,800	
テルモ	353,900	3,794.00	1,342,696,600	

H・U・グループホールディングス	31,200	2,900.00	90,480,000	
キッセイ薬品工業	20,800	2,615.00	54,392,000	
生化学工業	22,100	843.00	18,630,300	
栄研化学	20,900	1,648.00	34,443,200	
日水製薬	4,800	971.00	4,660,800	
鳥居薬品	6,700	3,090.00	20,703,000	
JCRファーマ	35,300	2,280.00	80,484,000	
東和薬品	18,000	2,715.00	48,870,000	
富士製薬工業	7,400	951.00	7,037,400	
ゼリア新薬工業	21,300	1,971.00	41,982,300	
第一三共	957,800	3,189.00	3,054,424,200	
キョーリン製薬ホールディングス	24,300	1,821.00	44,250,300	
大幸薬品	18,800	592.00	11,129,600	
ダイト	8,100	2,687.00	21,764,700	
大塚ホールディングス	252,700	4,421.00	1,117,186,700	
大正製薬ホールディングス	27,600	5,140.00	141,864,000	
ペプチドリーム	65,600	1,932.00	126,739,200	
大日本塗料	14,600	779.00	11,373,400	
日本ペイントホールディングス	460,200	1,027.00	472,625,400	
関西ペイント	119,900	1,808.00	216,779,200	
神東塗料	8,400	153.00	1,285,200	
中国塗料	28,100	945.00	26,554,500	
日本特殊塗料	8,600	810.00	6,966,000	
藤倉化成	15,500	460.00	7,130,000	
太陽ホールディングス	18,000	3,095.00	55,710,000	
D I C	49,300	2,498.00	123,151,400	
サカタインクス	24,400	997.00	24,326,800	
東洋インキS Cホールディングス	25,100	1,969.00	49,421,900	
T & K T O K A	9,900	809.00	8,009,100	
アルプス技研	9,600	1,916.00	18,393,600	
サニックス	21,000	263.00	5,523,000	
ダイオーズ	2,600	1,036.00	2,693,600	
日本空調サービス	12,800	801.00	10,252,800	
オリエンタルランド	136,600	17,715.00	2,419,869,000	
フォーカスシステムズ	8,000	888.00	7,104,000	
ダスキン	27,000	2,778.00	75,006,000	
パーク24	73,100	1,766.00	129,094,600	
明光ネットワークジャパン	14,100	577.00	8,135,700	
ファルコホールディングス	5,600	2,059.00	11,530,400	
クレスコ	8,900	1,864.00	16,589,600	
フジ・メディア・ホールディングス	115,200	1,122.00	129,254,400	
秀英予備校	2,800	420.00	1,176,000	
田谷	1,600	549.00	878,400	
ラウンドワン	33,400	1,272.00	42,484,800	
リゾートトラスト	53,400	2,064.00	110,217,600	
オービック	38,700	18,710.00	724,077,000	
ジャストシステム	17,500	5,270.00	92,225,000	
T D C ソフト	10,500	1,122.00	11,781,000	
Zホールディングス	1,769,700	447.00	791,055,900	
ビー・エム・エル	15,200	3,300.00	50,160,000	



トレンドマイクロ	63,800	7,200.00	459,360,000
りらいあコミュニケーションズ	17,600	1,012.00	17,811,200
IDホールディングス	7,900	824.00	6,509,600
リソー教育	54,500	354.00	19,293,000
日本オラクル	19,900	8,620.00	171,538,000
早稲田アカデミー	6,700	1,021.00	6,840,700
アルファシステムズ	2,800	3,790.00	10,612,000
フューチャー	25,900	1,720.00	44,548,000
CAC Holdings	7,000	1,366.00	9,562,000
SBテクノロジー	5,300	2,085.00	11,050,500
トーセ	3,300	715.00	2,359,500
ユー・エス・エス	133,800	2,414.00	322,993,200
オービックビジネスコンサルタント	11,700	4,400.00	51,480,000
伊藤忠テクノソリューションズ	55,900	3,095.00	173,010,500
アイティフォー	14,900	801.00	11,934,900
東京個別指導学院	10,500	583.00	6,121,500
東計電算	1,400	5,780.00	8,092,000
サイバーエージェント	281,500	1,401.00	394,381,500
楽天グループ	594,500	827.00	491,651,500
エクスネット	2,000	992.00	1,984,000
クリーク・アンド・リバー社	6,200	1,922.00	11,916,400
モーニングスター	21,000	529.00	11,109,000
テー・オー・ダブリュー	23,200	316.00	7,331,200
大塚商会	66,400	4,150.00	275,560,000
サイボウズ	16,400	1,238.00	20,303,200
山田コンサルティンググループ	6,200	1,167.00	7,235,400
セントラルスポーツ	4,500	2,293.00	10,318,500
パラカ	3,400	1,691.00	5,749,400
電通国際情報サービス	16,900	3,970.00	67,093,000
ACCESS	13,900	563.00	7,825,700
デジタルガレージ	20,300	4,065.00	82,519,500
イーエムシステムズ	20,300	943.00	19,142,900
ウェザーニューズ	4,000	6,580.00	26,320,000
CIJ	9,700	754.00	7,313,800
ビジネスエンジニアリング	1,400	3,905.00	5,467,000
日本エンタープライズ	12,500	164.00	2,050,000
WOWOW	5,700	1,524.00	8,686,800
スカラ	10,300	746.00	7,683,800
インテリジェント ウェイブ	6,200	583.00	3,614,600
フルキャストホールディングス	10,200	2,190.00	22,338,000
エン・ジャパン	19,900	3,090.00	61,491,000
あすか製薬ホールディングス	13,400	1,154.00	15,463,600
サワイグループホールディングス	26,300	4,190.00	110,197,000
富士フイルムホールディングス	219,800	7,205.00	1,583,659,000
コニカミノルタ	266,800	485.00	129,398,000
資生堂	233,000	5,377.00	1,252,841,000
ライオン	140,100	1,428.00	200,062,800
高砂香料工業	8,100	2,584.00	20,930,400
マンダム	25,600	1,258.00	32,204,800
ミルボン	15,400	5,110.00	78,694,000

ファンケル	50,600	2,350.00	118,910,000
コーセー	23,500	11,920.00	280,120,000
コタ	8,800	1,412.00	12,425,600
シーボン	1,300	1,695.00	2,203,500
ポーラ・オルビスホールディングス	53,300	1,505.00	80,216,500
ノエビアホールディングス	10,200	5,080.00	51,816,000
アジュバンホールディングス	2,900	970.00	2,813,000
新日本製薬	4,200	1,355.00	5,691,000
エステー	8,100	1,436.00	11,631,600
アグロ カネショウ	4,200	1,169.00	4,909,800
コニシ	20,000	1,511.00	30,220,000
長谷川香料	21,600	2,539.00	54,842,400
星光PMC	7,200	581.00	4,183,200
小林製薬	35,000	8,920.00	312,200,000
荒川化学工業	9,900	1,010.00	9,999,000
メック	9,100	2,462.00	22,404,200
日本高純度化学	3,300	2,312.00	7,629,600
タカラバイオ	32,700	2,131.00	69,683,700
JCU	13,500	3,375.00	45,562,500
新田ゼラチン	7,800	613.00	4,781,400
OATアグリオ	5,100	1,089.00	5,553,900
デクセリアルズ	32,500	3,320.00	107,900,000
アース製薬	10,300	5,480.00	56,444,000
北興化学工業	11,300	973.00	10,994,900
大成ラミック	3,700	2,542.00	9,405,400
クミアイ化学工業	46,600	898.00	41,846,800
日本農薬	22,400	611.00	13,686,400
富士興産	3,000	885.00	2,655,000
ニチレキ	15,200	1,227.00	18,650,400
ユシロ化学工業	6,300	1,009.00	6,356,700
ビーピー・カストロール	4,500	1,219.00	5,485,500
富士石油	31,400	289.00	9,074,600
MORESCO	4,200	1,177.00	4,943,400
出光興産	135,000	3,350.00	452,250,000
ENEOSホールディングス	1,881,400	464.30	873,534,020
コスモエネルギーホールディングス	40,600	3,050.00	123,830,000
テスホールディングス	10,800	1,418.00	15,314,400
インフロニア・ホールディングス	159,600	951.00	151,779,600
横浜ゴム	68,000	1,651.00	112,268,000
TOYO TIRE	63,800	1,455.00	92,829,000
ブリヂストン	351,100	4,708.00	1,652,978,800
住友ゴム工業	109,000	1,137.00	123,933,000
藤倉コンポジット	10,000	677.00	6,770,000
オカモト	7,000	3,865.00	27,055,000
アキレス	8,100	1,321.00	10,700,100
フコク	5,500	935.00	5,142,500
ニッタ	12,500	2,815.00	35,187,500
クリエートメディック	3,500	974.00	3,409,000
住友理工	24,300	549.00	13,340,700
三ツ星ベルト	15,200	1,980.00	30,096,000

バンドー化学	20,200	856.00	17,291,200
A G C	111,800	4,815.00	538,317,000
日本板硝子	58,700	383.00	22,482,100
石塚硝子	2,100	1,744.00	3,662,400
有沢製作所	17,900	905.00	16,199,500
日本山村硝子	4,800	774.00	3,715,200
日本電気硝子	49,000	2,701.00	132,349,000
オハラ	5,000	1,089.00	5,445,000
住友大阪セメント	22,100	3,405.00	75,250,500
太平洋セメント	71,000	2,055.00	145,905,000
リソルホールディングス	1,400	4,390.00	6,146,000
日本ヒューム	12,000	662.00	7,944,000
日本コンクリート工業	24,000	307.00	7,368,000
三谷セキサン	5,600	4,620.00	25,872,000
アジアパイルホールディングス	18,900	434.00	8,202,600
東海カーボン	101,800	1,052.00	107,093,600
日本カーボン	6,400	4,080.00	26,112,000
東洋炭素	7,900	2,731.00	21,574,900
ノリタケカンパニーリミテド	6,700	4,175.00	27,972,500
T O T O	84,700	4,415.00	373,950,500
日本碍子	131,400	1,810.00	237,834,000
日本特殊陶業	92,500	2,248.00	207,940,000
ダントーホールディングス	8,000	244.00	1,952,000
M A R U W A	4,300	15,500.00	66,650,000
品川リフラクトリーズ	2,900	3,635.00	10,541,500
黒崎播磨	2,100	4,005.00	8,410,500
ヨータイ	8,000	1,334.00	10,672,000
東京窯業	14,900	278.00	4,142,200
ニッカトー	5,500	479.00	2,634,500
フジインコーポレーテッド	10,000	5,640.00	56,400,000
クニミネ工業	4,000	936.00	3,744,000
エーアンドエーマテリアル	2,300	855.00	1,966,500
ニチアス	28,000	2,207.00	61,796,000
日本製鉄	541,300	2,073.00	1,122,114,900
神戸製鋼所	225,600	553.00	124,756,800
中山製鋼所	18,700	410.00	7,667,000
合同製鉄	6,400	1,219.00	7,801,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	318,100	1,500.00	477,150,000
東京製鉄	40,200	1,308.00	52,581,600
共英製鋼	13,400	1,259.00	16,870,600
大和工業	21,900	4,085.00	89,461,500
東京鐵鋼	5,300	1,242.00	6,582,600
大阪製鉄	6,600	1,262.00	8,329,200
淀川製鋼所	15,300	2,289.00	35,021,700
丸一鋼管	38,000	2,700.00	102,600,000
モリ工業	3,400	2,426.00	8,248,400
大同特殊鋼	19,100	3,510.00	67,041,000
日本高周波鋼業	3,500	328.00	1,148,000
日本冶金工業	8,800	2,036.00	17,916,800

山陽特殊製鋼	12,000	1,967.00	23,604,000
愛知製鋼	6,900	2,065.00	14,248,500
日立金属	133,300	2,038.00	271,665,400
日本金属	3,100	1,140.00	3,534,000
大平洋金属	7,600	2,500.00	19,000,000
新日本電工	76,000	300.00	22,800,000
栗本鐵工所	5,500	1,582.00	8,701,000
虹 技	1,700	962.00	1,635,400
日本鑄鉄管	1,300	1,008.00	1,310,400
日本製鋼所	35,700	2,626.00	93,748,200
三菱製鋼	7,900	1,026.00	8,105,400
日亜鋼業	15,500	259.00	4,014,500
日本精線	2,000	4,080.00	8,160,000
エンビプロ・ホールディングス	8,200	883.00	7,240,600
大紀アルミニウム工業所	17,500	1,277.00	22,347,500
日本軽金属ホールディングス	31,200	1,626.00	50,731,200
三井金属鉱業	33,400	3,085.00	103,039,000
東邦亜鉛	6,700	2,535.00	16,984,500
三菱マテリアル	78,300	1,984.00	155,347,200
住友金属鉱山	150,500	5,003.00	752,951,500
DOWAホールディングス	32,100	5,140.00	164,994,000
古河機械金属	20,000	1,247.00	24,940,000
エス・サイエンス	60,300	28.00	1,688,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,200	1,281.00	18,190,200
東邦チタニウム	22,100	1,645.00	36,354,500
UACJ	18,100	2,116.00	38,299,600
CKサンエツ	2,500	3,870.00	9,675,000
古河電気工業	37,500	2,123.00	79,612,500
住友電気工業	452,100	1,416.00	640,173,600
フジクラ	137,800	593.00	81,715,400
昭和電線ホールディングス	10,800	1,670.00	18,036,000
東京特殊電線	1,800	2,687.00	4,836,600
タツタ電線	21,900	458.00	10,030,200
カナレ電気	1,900	1,672.00	3,176,800
平河ヒューテック	6,900	1,052.00	7,258,800
リョービ	14,300	1,055.00	15,086,500
アーレスティ	13,200	352.00	4,646,400
アサヒホールディングス	49,500	2,040.00	100,980,000
東洋製罐グループホールディングス	73,500	1,386.00	101,871,000
ホッカインホールディングス	6,500	1,238.00	8,047,000
コロナ	6,800	825.00	5,610,000
横河ブリッジホールディングス	20,000	1,890.00	37,800,000
駒井ハルテック	2,200	1,872.00	4,118,400
高田機工	600	2,712.00	1,627,200
三和ホールディングス	116,500	1,149.00	133,858,500
文化シャッター	38,300	944.00	36,155,200
三協立山	15,500	587.00	9,098,500
アルインコ	8,800	847.00	7,453,600
東洋シャッター	2,000	565.00	1,130,000
LIXIL	194,600	2,404.00	467,818,400

日本ファイルコン	8,500	506.00	4,301,000
ノーリツ	22,300	1,499.00	33,427,700
長府製作所	12,600	1,871.00	23,574,600
リンナイ	22,700	8,740.00	198,398,000
ユニプレス	19,200	755.00	14,496,000
ダイニチ工業	6,000	625.00	3,750,000
日東精工	15,000	498.00	7,470,000
三洋工業	1,300	1,785.00	2,320,500
岡部	21,800	647.00	14,104,600
ジーテクト	14,800	1,255.00	18,574,000
東プレ	21,600	1,062.00	22,939,200
高周波熱錬	20,200	571.00	11,534,200
東京製綱	7,600	844.00	6,414,400
サンコール	10,700	500.00	5,350,000
モリテックスチール	9,600	301.00	2,889,600
パイオラックス	17,300	1,443.00	24,963,900
エイチワン	11,900	585.00	6,961,500
日本発条	110,600	828.00	91,576,800
中央発條	6,000	670.00	4,020,000
アドパネクス	1,700	1,740.00	2,958,000
三浦工業	51,900	2,722.00	141,271,800
タクマ	39,800	1,433.00	57,033,400
テクノプロ・ホールディングス	71,600	2,870.00	205,492,000
アトラグループ	2,200	253.00	556,600
インターワークス	3,700	375.00	1,387,500
アイ・アールジャパンホールディングス	5,500	3,885.00	21,367,500
KeepPer 技研	7,700	2,382.00	18,341,400
ファーストロジック	2,200	776.00	1,707,200
三機サービス	2,100	1,153.00	2,421,300
Gunosy	6,500	939.00	6,103,500
デザインワン・ジャパン	3,100	182.00	564,200
イー・ガーディアン	4,600	2,900.00	13,340,000
リブセンス	7,200	163.00	1,173,600
ジャパンマテリアル	36,800	1,876.00	69,036,800
ベクトル	16,700	1,193.00	19,923,100
ウチヤマホールディングス	6,200	306.00	1,897,200
チャーム・ケア・コーポレーション	8,900	1,100.00	9,790,000
キャリアリンク	4,400	1,443.00	6,349,200
IBJ	9,700	689.00	6,683,300
アサンテ	5,300	1,480.00	7,844,000
バリューHR	9,800	1,279.00	12,534,200
M&Aキャピタルパートナーズ	9,800	3,195.00	31,311,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,147.00	5,276,200
ERIホールディングス	3,300	1,268.00	4,184,400
アピスト	1,900	2,742.00	5,209,800
シグマクシス・ホールディングス	14,400	1,118.00	16,099,200
ウィルグループ	8,900	1,102.00	9,807,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,800	165.00	2,442,000

メドピア	8,900	2,569.00	22,864,100
レアジョブ	2,300	755.00	1,736,500
リクルートホールディングス	900,100	4,376.00	3,938,837,600
エラン	16,400	951.00	15,596,400
ツガミ	26,600	1,205.00	32,053,000
オークマ	13,500	4,725.00	63,787,500
芝浦機械	14,000	2,837.00	39,718,000
アマダ	195,100	1,014.00	197,831,400
アイダエンジニアリング	30,600	950.00	29,070,000
滝澤鉄工所	3,800	1,288.00	4,894,400
F U J I	54,400	2,152.00	117,068,800
牧野フライス製作所	13,200	4,125.00	54,450,000
オーエスジー	56,500	1,647.00	93,055,500
ダイジェット工業	1,500	942.00	1,413,000
旭ダイヤモンド工業	31,700	567.00	17,973,900
D M G 森精機	71,700	1,623.00	116,369,100
ソディック	26,800	739.00	19,805,200
ディスコ	18,200	31,700.00	576,940,000
日東工器	6,500	1,470.00	9,555,000
日進工具	9,700	1,427.00	13,841,900
パンチ工業	10,500	464.00	4,872,000
富士ダイス	5,800	640.00	3,712,000
土木管理総合試験所	5,700	325.00	1,852,500
ネットマーケティング	5,800	706.00	4,094,800
日本郵政	1,495,600	893.00	1,335,570,800
ベルシステム24ホールディングス	17,200	1,413.00	24,303,600
鎌倉新書	13,600	559.00	7,602,400
S M N	2,700	590.00	1,593,000
一蔵	1,700	393.00	668,100
グローバルキッズCOMPANY	2,100	692.00	1,453,200
エアトリ	7,400	2,840.00	21,016,000
アトラエ	8,400	1,640.00	13,776,000
ストライク	4,800	3,835.00	18,408,000
ソラスト	29,300	830.00	24,319,000
セラク	3,800	1,177.00	4,472,600
インソース	12,100	1,978.00	23,933,800
豊田自動織機	97,000	8,280.00	803,160,000
豊和工業	6,400	764.00	4,889,600
O K K	4,500	1,254.00	5,643,000
石川製作所	3,200	1,337.00	4,278,400
東洋機械金属	8,200	579.00	4,747,800
津田駒工業	2,400	565.00	1,356,000
エンシュウ	2,800	654.00	1,831,200
島精機製作所	18,100	1,910.00	34,571,000
オプトラン	15,500	1,851.00	28,690,500
N C ホールディングス	2,800	1,663.00	4,656,400
イワキ	7,900	1,045.00	8,255,500
フリーー	10,900	1,041.00	11,346,900
ヤマシンフィルタ	23,000	342.00	7,866,000
日阪製作所	14,500	750.00	10,875,000

やまびこ	22,900	1,355.00	31,029,500
野村マイクロ・サイエンス	4,200	3,535.00	14,847,000
平田機工	5,700	4,770.00	27,189,000
ペガサスミシン製造	12,600	594.00	7,484,400
マルマエ	5,100	2,099.00	10,704,900
タツモ	5,800	1,286.00	7,458,800
ナプテスコ	68,900	2,963.00	204,150,700
三井海洋開発	13,200	1,195.00	15,774,000
レオン自動機	13,200	1,105.00	14,586,000
S M C	36,700	61,150.00	2,244,205,000
ホソカワミクロン	8,500	2,460.00	20,910,000
ユニオンツール	4,600	3,745.00	17,227,000
オイレス工業	16,900	1,499.00	25,333,100
日精エー・エス・ビー機械	4,400	2,929.00	12,887,600
サトーホールディングス	16,300	1,846.00	30,089,800
技研製作所	10,900	3,520.00	38,368,000
日本エアテック	5,700	1,032.00	5,882,400
カワタ	3,900	1,099.00	4,286,100
日精樹脂工業	8,500	950.00	8,075,000
オカダアイヨン	4,000	1,493.00	5,972,000
ワイエイシイホールディングス	5,000	1,443.00	7,215,000
小松製作所	566,800	2,960.00	1,677,728,000
住友重機械工業	70,000	2,807.00	196,490,000
日立建機	50,100	2,920.00	146,292,000
日工	16,700	608.00	10,153,600
巴工業	4,800	2,276.00	10,924,800
井関農機	11,000	1,214.00	13,354,000
T O W A	10,700	1,986.00	21,250,200
丸山製作所	2,400	1,517.00	3,640,800
北川鉄工所	5,400	1,250.00	6,750,000
シンニッタン	15,100	212.00	3,201,200
ローツェ	6,200	10,290.00	63,798,000
タカキタ	4,100	567.00	2,324,700
クボタ	605,900	2,237.50	1,355,701,250
荏原実業	5,800	2,239.00	12,986,200
東洋エンジニアリング	16,500	606.00	9,999,000
三菱化工機	4,000	1,919.00	7,676,000
月島機械	22,000	1,029.00	22,638,000
帝国電機製作所	8,500	1,630.00	13,855,000
東京機械製作所	5,100	801.00	4,085,100
新東工業	26,300	673.00	17,699,900
澁谷工業	10,600	2,307.00	24,454,200
アイチコーポレーション	17,900	880.00	15,752,000
小森コーポレーション	31,100	703.00	21,863,300
鶴見製作所	9,400	1,803.00	16,948,200
住友精密工業	1,800	2,203.00	3,965,400
日本ギア工業	4,800	258.00	1,238,400
酒井重工業	2,200	3,075.00	6,765,000
荏原製作所	50,000	5,820.00	291,000,000
石井鐵工所	900	2,833.00	2,549,700

西島製作所	10,900	1,244.00	13,559,600
北越工業	11,400	834.00	9,507,600
ダイキン工業	151,700	20,405.00	3,095,438,500
オルガノ	3,600	8,660.00	31,176,000
トーヨーカネツ	4,600	2,385.00	10,971,000
栗田工業	66,200	4,510.00	298,562,000
椿本チエイン	16,400	2,933.00	48,101,200
大同工業	5,400	893.00	4,822,200
日機装	35,600	819.00	29,156,400
木村化工機	10,200	751.00	7,660,200
レイズネクスト	18,400	1,070.00	19,688,000
アネスト岩田	19,500	838.00	16,341,000
ダイフク	65,500	7,480.00	489,940,000
サムコ	3,200	2,400.00	7,680,000
加藤製作所	6,000	762.00	4,572,000
油研工業	1,600	1,684.00	2,694,400
タダノ	63,700	911.00	58,030,700
フジテック	42,600	2,560.00	109,056,000
C K D	35,100	1,630.00	57,213,000
キトー	10,400	1,637.00	17,024,800
平和	34,900	1,878.00	65,542,200
理想科学工業	9,700	2,353.00	22,824,100
S A N K Y O	27,000	3,780.00	102,060,000
日本金銭機械	12,700	649.00	8,242,300
マースグループホールディングス	8,000	1,629.00	13,032,000
フクシマガリレイ	8,300	3,670.00	30,461,000
オーイズミ	4,400	436.00	1,918,400
ダイコク電機	5,800	1,231.00	7,139,800
竹内製作所	19,000	2,419.00	45,961,000
アマノ	32,700	2,457.00	80,343,900
J U K I	17,400	702.00	12,214,800
サンデン	17,500	189.00	3,307,500
ジャノメ	10,700	686.00	7,340,200
ブラザー工業	149,300	2,293.00	342,344,900
マックス	16,000	1,576.00	25,216,000
モリタホールディングス	20,000	1,296.00	25,920,000
グローリー	31,300	2,136.00	66,856,800
新晃工業	11,700	1,572.00	18,392,400
大和冷機工業	18,100	1,084.00	19,620,400
セガサミーホールディングス	124,100	2,207.00	273,888,700
日本ピストンリング	4,600	1,298.00	5,970,800
リケン	5,100	2,383.00	12,153,300
T P R	15,900	1,238.00	19,684,200
ツバキ・ナカシマ	27,500	897.00	24,667,500
ホシザキ	36,600	7,520.00	275,232,000
大豊工業	10,200	623.00	6,354,600
日本精工	228,300	700.00	159,810,000
N T N	254,700	209.00	53,232,300
ジェイテクト	115,500	925.00	106,837,500
不二越	10,000	3,620.00	36,200,000



ミネベアミツミ	210,100	2,430.00	510,543,000
日本トムソン	32,300	486.00	15,697,800
THK	70,600	2,585.00	182,501,000
ユーシン精機	9,900	665.00	6,583,500
前澤給装工業	9,000	904.00	8,136,000
イーグル工業	14,800	1,017.00	15,051,600
前澤工業	8,100	628.00	5,086,800
日本ピラー工業	11,900	2,460.00	29,274,000
キッツ	39,700	647.00	25,685,900
日立製作所	601,600	6,314.00	3,798,502,400
東芝	218,500	5,322.00	1,162,857,000
三菱電機	1,222,900	1,326.50	1,622,176,850
富士電機	73,400	5,620.00	412,508,000
東洋電機製造	4,500	936.00	4,212,000
安川電機	131,100	4,205.00	551,275,500
シンフォニアテクノロジー	14,200	1,238.00	17,579,600
明電舎	20,000	2,275.00	45,500,000
オリジン	3,000	1,162.00	3,486,000
山洋電気	5,200	5,330.00	27,716,000
デンヨー	10,100	1,591.00	16,069,100
PHCホールディングス	19,300	1,601.00	30,899,300
ベイクレント・コンサルティング	8,500	42,450.00	360,825,000
Orchestra Holdings	2,300	2,428.00	5,584,400
アイモバイル	4,200	1,321.00	5,548,200
キャリアインデックス	4,000	538.00	2,152,000
MS-Japan	4,900	822.00	4,027,800
船場	1,400	691.00	967,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	38,000	1,636.00	62,168,000
フルテック	1,700	1,355.00	2,303,500
グリーンズ	4,500	624.00	2,808,000
ツナググループ・ホールディングス	2,800	263.00	736,400
GAMEWITH	3,600	474.00	1,706,400
MS&Consulting	1,700	695.00	1,181,500
ウェルビー	7,700	916.00	7,053,200
エル・ティー・エス	1,600	2,706.00	4,329,600
ミダックホールディングス	5,400	2,015.00	10,881,000
日総工産	9,300	631.00	5,868,300
キュービーネットホールディングス	5,500	1,317.00	7,243,500
RPAホールディングス	16,700	390.00	6,513,000
三櫻工業	17,300	686.00	11,867,800
マキタ	148,600	3,798.00	564,382,800
東芝テック	13,400	4,340.00	58,156,000
芝浦メカトロニクス	2,200	7,090.00	15,598,000
マブチモーター	28,900	3,440.00	99,416,000
日本電産	308,700	8,266.00	2,551,714,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,100	390.00	1,989,000
トレックス・セミコンダクター	6,000	2,237.00	13,422,000
東光高岳	7,000	1,616.00	11,312,000

ダブル・スコープ	35,900	851.00	30,550,900
宮越ホールディングス	4,700	834.00	3,919,800
ダイヘン	13,000	3,715.00	48,295,000
ヤーマン	20,400	1,173.00	23,929,200
JVCケンウッド	101,800	193.00	19,647,400
ミマキエンジニアリング	11,200	678.00	7,593,600
I - P E X	5,800	1,438.00	8,340,400
日新電機	29,300	1,338.00	39,203,400
大崎電気工業	22,400	500.00	11,200,000
オムロン	104,100	7,050.00	733,905,000
日東工業	15,700	1,539.00	24,162,300
I D E C	15,400	2,264.00	34,865,600
正興電機製作所	3,800	1,073.00	4,077,400
不二電機工業	2,500	1,121.00	2,802,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	39,600	2,234.00	88,466,400
サクサホールディングス	2,400	1,500.00	3,600,000
メルコホールディングス	3,000	3,820.00	11,460,000
テクノメディカ	2,800	1,545.00	4,326,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,500	877.00	3,069,500
日本電気	155,400	5,290.00	822,066,000
富士通	112,600	19,150.00	2,156,290,000
沖電気工業	49,600	866.00	42,953,600
岩崎通信機	5,300	810.00	4,293,000
電気興業	6,400	2,438.00	15,603,200
サンケン電気	11,400	4,825.00	55,005,000
ナカヨ	1,900	1,058.00	2,010,200
アイホン	6,600	1,702.00	11,233,200
ルネサスエレクトロニクス	679,300	1,370.00	930,641,000
セイコーエプソン	150,100	1,960.00	294,196,000
ワコム	97,000	920.00	89,240,000
アルバック	24,900	5,090.00	126,741,000
アクセル	5,100	865.00	4,411,500
E I Z O	9,500	3,405.00	32,347,500
ジャパンディスプレイ	427,100	68.00	29,042,800
日本信号	30,100	888.00	26,728,800
京三製作所	26,300	431.00	11,335,300
能美防災	15,700	1,854.00	29,107,800
ホーチキ	8,600	1,197.00	10,294,200
星和電機	5,500	513.00	2,821,500
エレコム	28,700	1,493.00	42,849,100
パナソニック ホールディングス	1,333,900	1,134.00	1,512,642,600
シャープ	134,700	1,104.00	148,708,800
アンリツ	80,500	1,494.00	120,267,000
富士通ゼネラル	34,000	2,249.00	76,466,000
ソニーグループ	783,400	10,720.00	8,398,048,000
T D K	181,100	4,030.00	729,833,000
帝国通信工業	5,600	1,403.00	7,856,800
タムラ製作所	47,100	542.00	25,528,200
アルプスアルパイン	107,800	1,284.00	138,415,200

池上通信機	3,900	600.00	2,340,000
日本電波工業	12,500	1,075.00	13,437,500
鈴木	6,200	755.00	4,681,000
メイコー	13,500	3,745.00	50,557,500
日本トリム	2,300	2,314.00	5,322,200
ローランド ディー・ジー	7,400	3,180.00	23,532,000
フォスター電機	12,300	721.00	8,868,300
S M K	2,900	2,128.00	6,171,200
ヨコオ	8,900	2,509.00	22,330,100
ティアック	19,600	114.00	2,234,400
ホシデン	29,300	1,278.00	37,445,400
ヒロセ電機	18,700	17,430.00	325,941,000
日本航空電子工業	27,500	1,818.00	49,995,000
T O A	13,500	756.00	10,206,000
マクセル	24,200	1,144.00	27,684,800
古野電気	14,900	972.00	14,482,800
ユニデンホールディングス	2,800	3,485.00	9,758,000
スミダコーポレーション	11,700	789.00	9,231,300
アイコム	4,500	2,435.00	10,957,500
リオン	4,600	2,466.00	11,343,600
本多通信工業	9,800	471.00	4,615,800
横河電機	121,700	2,264.00	275,528,800
新電元工業	4,700	2,846.00	13,376,200
アズビル	73,200	3,830.00	280,356,000
東亜ディーケーケー	6,300	912.00	5,745,600
日本光電工業	50,500	3,160.00	159,580,000
チノー	4,000	1,620.00	6,480,000
共和電業	12,400	339.00	4,203,600
日本電子材料	6,200	1,901.00	11,786,200
堀場製作所	22,600	6,320.00	142,832,000
アドバンテスト	93,000	8,530.00	793,290,000
小野測器	5,300	471.00	2,496,300
エスペック	9,800	1,745.00	17,101,000
キーエンス	113,300	50,330.00	5,702,389,000
日置電機	6,000	7,080.00	42,480,000
シスメックス	100,400	7,717.00	774,786,800
日本マイクロニクス	20,700	1,493.00	30,905,100
メガチップス	11,100	3,275.00	36,352,500
O B A R A G R O U P	5,400	2,901.00	15,665,400
I M A G I C A G R O U P	9,800	635.00	6,223,000
澤藤電機	1,600	1,440.00	2,304,000
デンソー	265,200	7,241.00	1,920,313,200
原田工業	6,100	914.00	5,575,400
コーセル	13,900	772.00	10,730,800
イリソ電子工業	10,500	3,110.00	32,655,000
オブテックスグループ	20,500	1,833.00	37,576,500
千代田インテグレ	5,100	2,087.00	10,643,700
レーザーテック	53,700	18,125.00	973,312,500
スタンレー電気	85,000	2,235.00	189,975,000
岩崎電気	4,400	2,282.00	10,040,800

ウシオ電機	62,500	1,678.00	104,875,000
岡谷電機産業	9,100	269.00	2,447,900
ヘリオス テクノ ホールディング	10,800	285.00	3,078,000
エノモト	3,500	1,592.00	5,572,000
日本セラミック	11,600	2,312.00	26,819,200
遠藤照明	5,800	800.00	4,640,000
古河電池	8,900	1,184.00	10,537,600
双信電機	6,000	529.00	3,174,000
山一電機	8,700	1,700.00	14,790,000
図研	8,200	2,647.00	21,705,400
日本電子	25,400	5,870.00	149,098,000
カシオ計算機	83,800	1,331.00	111,537,800
ファナック	109,700	19,595.00	2,149,571,500
日本シイエムケイ	23,600	523.00	12,342,800
エンプラス	3,100	3,420.00	10,602,000
大真空	16,400	1,077.00	17,662,800
ローム	54,700	9,160.00	501,052,000
浜松ホトニクス	87,600	5,740.00	502,824,000
三井ハイテック	11,800	11,030.00	130,154,000
新光電気工業	36,800	5,060.00	186,208,000
京セラ	176,000	6,877.00	1,210,352,000
協栄産業	1,300	1,311.00	1,704,300
太陽誘電	59,000	4,955.00	292,345,000
村田製作所	358,700	8,061.00	2,891,480,700
双葉電子工業	21,500	662.00	14,233,000
日東電工	75,600	8,990.00	679,644,000
北陸電気工業	4,700	1,128.00	5,301,600
東海理化電機製作所	32,900	1,354.00	44,546,600
ニチコン	37,300	1,203.00	44,871,900
日本ケミコン	11,900	1,859.00	22,122,100
K O A	18,300	1,553.00	28,419,900
三井E & Sホールディングス	45,100	355.00	16,010,500
日立造船	103,600	683.00	70,758,800
三菱重工業	192,200	4,382.00	842,220,400
川崎重工業	89,100	2,262.00	201,544,200
I H I	78,100	3,095.00	241,719,500
名村造船所	35,700	328.00	11,709,600
サノヤスホールディングス	15,400	127.00	1,955,800
スプリックス	3,600	1,177.00	4,237,200
マネジメントソリューションズ	5,900	4,415.00	26,048,500
プロレド・パートナーズ	2,700	572.00	1,544,400
and factory	2,800	412.00	1,153,600
テノ・ホールディングス	1,500	629.00	943,500
フロンティア・マネジメント	3,100	928.00	2,876,800
ピアラ	1,900	810.00	1,539,000
コプロ・ホールディングス	2,300	1,009.00	2,320,700
ギークス	2,000	1,137.00	2,274,000
カーブスホールディングス	32,800	682.00	22,369,600
フォーラムエンジニアリング	8,000	829.00	6,632,000

FAST FITNESS JAPAN	2,200	1,827.00	4,019,400	
日本車輛製造	4,400	2,047.00	9,006,800	
三菱ロジスネクスト	16,500	773.00	12,754,500	
近畿車輛	1,400	1,136.00	1,590,400	
一家ホールディングス	2,300	527.00	1,212,100	
フルサト・マルカホールディングス	11,500	3,570.00	41,055,000	
ヤマエグループホールディングス	7,900	1,051.00	8,302,900	
藤久ホールディングス	3,000	687.00	2,061,000	
F P G	41,400	790.00	32,706,000	
島根銀行	3,700	519.00	1,920,300	
じもとホールディングス	8,600	608.00	5,228,800	
全国保証	29,400	4,555.00	133,917,000	
めぶきフィナンシャルグループ	563,300	254.00	143,078,200	
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,600	1,161.00	11,145,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,100	1,699.00	25,654,900	
九州フィナンシャルグループ	239,800	391.00	93,761,800	
かんぽ生命保険	124,200	2,061.00	255,976,200	
ゆうちょ銀行	291,300	970.00	282,561,000	
あんしん保証	5,000	284.00	1,420,000	
富山第一銀行	29,000	328.00	9,512,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	673,200	456.00	306,979,200	
ジェイリース	4,100	1,512.00	6,199,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	72,500	760.00	55,100,000	
イントラスト	5,200	517.00	2,688,400	
日本モーゲージサービス	6,900	955.00	6,589,500	
C A S A	4,400	803.00	3,533,200	
アルヒ	18,200	975.00	17,745,000	
プレミアグループ	6,200	3,770.00	23,374,000	
日産自動車	1,474,900	499.70	737,007,530	
いすゞ自動車	382,400	1,469.00	561,745,600	
トヨタ自動車	6,124,600	2,082.00	12,751,417,200	
日野自動車	156,100	685.00	106,928,500	
三菱自動車工業	462,700	340.00	157,318,000	
エフテック	8,500	530.00	4,505,000	
レシップホールディングス	4,700	551.00	2,589,700	
G M B	2,300	711.00	1,635,300	
ファルテック	2,300	631.00	1,451,300	
武蔵精密工業	27,800	1,298.00	36,084,400	
日産車体	18,400	570.00	10,488,000	
新明和工業	34,400	956.00	32,886,400	
極東開発工業	22,100	1,306.00	28,862,600	
トビー工業	10,000	1,240.00	12,400,000	
ティラド	3,000	2,245.00	6,735,000	
曙ブレーキ工業	68,600	148.00	10,152,800	
タチエス	21,500	1,004.00	21,586,000	
N O K	56,000	1,137.00	63,672,000	

フタバ産業	30,100	366.00	11,016,600
K Y B	12,300	2,799.00	34,427,700
市光工業	14,900	367.00	5,468,300
大同メタル工業	24,100	549.00	13,230,900
プレス工業	58,800	381.00	22,402,800
ミクニ	15,500	376.00	5,828,000
太平洋工業	25,400	973.00	24,714,200
河西工業	15,400	272.00	4,188,800
アイシン	91,500	3,705.00	339,007,500
マツダ	384,300	940.00	361,242,000
今仙電機製作所	8,300	574.00	4,764,200
本田技研工業	961,400	3,247.00	3,121,665,800
スズキ	273,300	3,840.00	1,049,472,000
S U B A R U	348,500	1,934.50	674,173,250
安永	5,700	666.00	3,796,200
ヤマハ発動機	163,200	2,744.00	447,820,800
小糸製作所	66,600	4,595.00	306,027,000
T B K	13,800	343.00	4,733,400
エクセディ	18,800	1,622.00	30,493,600
ミツバ	21,900	347.00	7,599,300
豊田合成	38,700	1,872.00	72,446,400
愛三工業	19,600	718.00	14,072,800
盟和産業	1,400	1,011.00	1,415,400
日本プラスト	9,700	488.00	4,733,600
ヨロズ	11,100	725.00	8,047,500
エフ・シー・シー	20,400	1,342.00	27,376,800
新家工業	2,900	1,554.00	4,506,600
シマノ	48,800	22,035.00	1,075,308,000
テイ・エス テック	52,800	1,361.00	71,860,800
三十三フィナンシャルグループ	11,000	1,401.00	15,411,000
第四北越フィナンシャルグループ	19,200	2,464.00	47,308,800
ひろぎんホールディングス	173,900	613.00	106,600,700
マーキュリアホールディングス	5,500	584.00	3,212,000
おきなわフィナンシャルグループ	10,900	2,198.00	23,958,200
ダイレクトマーケティングミックス	13,300	1,564.00	20,801,200
ポピンズ	2,800	1,926.00	5,392,800
L I T A L I C O	9,600	2,472.00	23,731,200
十六フィナンシャルグループ	15,800	2,202.00	34,791,600
北國フィナンシャルホールディングス	11,100	4,360.00	48,396,000
ネットプロテクションズホールディングス	37,400	582.00	21,766,800
プロクレアホールディングス	13,000	1,797.00	23,361,000
ジャムコ	7,300	787.00	5,745,100
小野建	11,600	1,475.00	17,110,000
はるやまホールディングス	6,000	446.00	2,676,000
南陽	2,500	1,784.00	4,460,000
ノジマ	19,900	2,904.00	57,789,600
佐鳥電機	7,700	1,260.00	9,702,000
カップ・クリエイト	17,300	1,342.00	23,216,600
エコートレーディング	2,400	581.00	1,394,400

伯東	7,500	2,858.00	21,435,000
コンドーテック	9,300	1,082.00	10,062,600
中山福	6,600	345.00	2,277,000
ライトオン	9,300	698.00	6,491,400
ナガイレーベン	15,800	1,917.00	30,288,600
三菱食品	11,900	3,165.00	37,663,500
良品計画	141,700	1,249.00	176,983,300
パリミキホールディングス	15,700	258.00	4,050,600
松田産業	9,000	2,176.00	19,584,000
第一興商	23,300	3,535.00	82,365,500
メディバルホールディングス	126,600	2,225.00	281,685,000
アドヴァングループ	11,900	773.00	9,198,700
S P K	5,000	1,313.00	6,565,000
萩原電気ホールディングス	4,500	1,883.00	8,473,500
アルビス	3,900	2,206.00	8,603,400
アズワン	17,600	6,260.00	110,176,000
スズデン	4,100	1,982.00	8,126,200
尾家産業	2,600	888.00	2,308,800
シモジマ	7,600	898.00	6,824,800
ドウシシャ	11,600	1,550.00	17,980,000
小津産業	2,800	2,000.00	5,600,000
コナカ	14,200	332.00	4,714,400
高速	7,200	1,527.00	10,994,400
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,661.00	2,823,700
G - 7ホールディングス	13,700	1,507.00	20,645,900
たけびし	4,500	1,447.00	6,511,500
イオン北海道	19,900	1,037.00	20,636,300
コジマ	21,100	600.00	12,660,000
ヒマラヤ	4,100	913.00	3,743,300
コーナン商事	17,500	3,545.00	62,037,500
ネットワンシステムズ	45,300	3,045.00	137,938,500
エコス	4,400	2,010.00	8,844,000
ワタミ	14,900	899.00	13,395,100
マルシェ	4,100	463.00	1,898,300
リックス	2,800	1,561.00	4,370,800
システムソフト	29,600	102.00	3,019,200
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	246,300	1,959.00	482,501,700
丸文	10,600	686.00	7,271,600
西松屋チェーン	26,100	1,539.00	40,167,900
ゼンショーホールディングス	60,100	2,925.00	175,792,500
ハビネット	9,900	1,498.00	14,830,200
幸楽苑ホールディングス	7,500	1,252.00	9,390,000
ハークスレイ	5,300	456.00	2,416,800
橋本総業ホールディングス	2,400	1,961.00	4,706,400
日本ライフライン	36,500	1,056.00	38,544,000
サイゼリヤ	18,300	2,335.00	42,730,500
タカショー	9,400	698.00	6,561,200
V Tホールディングス	46,300	456.00	21,112,800
アルゴグラフィックス	9,600	2,958.00	28,396,800

魚力	3,200	2,178.00	6,969,600	
I D O M	37,300	670.00	24,991,000	
日本エム・ディ・エム	7,300	1,519.00	11,088,700	
ポブラ	3,400	137.00	465,800	
フジ・コーポレーション	6,500	1,133.00	7,364,500	
ユナイテッドアローズ	12,900	1,781.00	22,974,900	
進和	7,400	2,019.00	14,940,600	
エスケイジャパン	2,800	427.00	1,195,600	
ダイトロン	5,100	2,015.00	10,276,500	
ハイデイ日高	17,800	1,907.00	33,944,600	
シークス	16,900	991.00	16,747,900	
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	7,200	213.00	1,533,600	
コロワイド	50,600	1,620.00	81,972,000	
ピーシーデポコーポレーション	14,300	312.00	4,461,600	
田中商事	2,800	610.00	1,708,000	
オーハシテクニカ	6,500	1,274.00	8,281,000	
壱番屋	8,700	4,895.00	42,586,500	
白銅	4,000	2,386.00	9,544,000	
トップカルチャー	4,600	278.00	1,278,800	
P L A N T	3,100	666.00	2,064,600	
スギホールディングス	24,600	5,270.00	129,642,000	
ダイコー通産	1,400	1,288.00	1,803,200	
薬王堂ホールディングス	6,200	1,849.00	11,463,800	
島津製作所	157,100	4,555.00	715,590,500	
J M S	10,300	573.00	5,901,900	
クボテック	2,800	255.00	714,000	
長野計器	8,800	1,129.00	9,935,200	
ブイ・テクノロジー	5,400	3,075.00	16,605,000	
スター精密	18,000	1,468.00	26,424,000	
東京計器	8,000	1,122.00	8,976,000	
愛知時計電機	5,100	1,452.00	7,405,200	
インターアクション	6,200	1,950.00	12,090,000	
オーバル	11,300	306.00	3,457,800	
東京精密	20,600	4,575.00	94,245,000	
マニー	48,400	1,402.00	67,856,800	
ニコン	186,100	1,452.00	270,217,200	
トプコン	58,800	1,602.00	94,197,600	
オリンパス	639,200	2,283.00	1,459,293,600	
理研計器	9,500	3,915.00	37,192,500	
S C R E E Nホールディングス	21,000	10,700.00	224,700,000	
キヤノン電子	11,500	1,483.00	17,054,500	
タムロン	9,400	2,345.00	22,043,000	
H O Y A	244,000	12,390.00	3,023,160,000	
シード	6,000	494.00	2,964,000	
ノーリツ鋼機	11,200	2,055.00	23,016,000	
A & Dホロンホールディングス	14,100	843.00	11,886,300	
朝日インテック	137,100	2,409.00	330,273,900	
キヤノン	621,500	3,172.00	1,971,398,000	
リコー	330,700	1,042.00	344,589,400	



シチズン時計	138,300	493.00	68,181,900
リズム	4,000	1,652.00	6,608,000
大研医器	10,100	506.00	5,110,600
メニコン	40,500	2,548.00	103,194,000
シンシア	1,400	407.00	569,800
中本パックス	3,500	1,563.00	5,470,500
スノーピーク	16,300	2,098.00	34,197,400
パラマウントベッドホールディングス	24,000	2,064.00	49,536,000
トランザクション	7,300	996.00	7,270,800
粧美堂	4,000	419.00	1,676,000
ニホンフラッシュ	10,400	923.00	9,599,200
前田工織	13,000	2,681.00	34,853,000
永大産業	15,800	271.00	4,281,800
アートネイチャー	10,800	725.00	7,830,000
バンダイナムコホールディングス	109,200	8,422.00	919,682,400
アイフィスジャパン	3,400	643.00	2,186,200
共立印刷	20,000	134.00	2,680,000
SHOEI	11,500	4,595.00	52,842,500
フランスベッドホールディングス	16,200	870.00	14,094,000
マーベラス	19,300	752.00	14,513,600
パイロットコーポレーション	20,000	5,030.00	100,600,000
萩原工業	7,900	1,058.00	8,358,200
エイベックス	21,100	1,338.00	28,231,800
フジシールインターナショナル	28,800	1,720.00	49,536,000
タカラトミー	51,600	1,175.00	60,630,000
広済堂ホールディングス	7,700	776.00	5,975,200
エステールホールディングス	3,100	638.00	1,977,800
レック	15,800	857.00	13,540,600
タカノ	4,400	797.00	3,506,800
三光合成	14,300	339.00	4,847,700
プロネクサス	9,700	1,044.00	10,126,800
ホクシン	8,800	148.00	1,302,400
ウッドワン	3,900	1,243.00	4,847,700
大建工業	7,000	2,048.00	14,336,000
きもと	19,500	210.00	4,095,000
凸版印刷	181,000	2,113.00	382,453,000
大日本印刷	143,700	2,714.00	390,001,800
共同印刷	3,500	2,643.00	9,250,500
N I S S H A	24,400	1,456.00	35,526,400
光村印刷	600	1,301.00	780,600
藤森工業	10,800	3,540.00	38,232,000
ヴィア・ホールディングス	16,000	148.00	2,368,000
TAKARA & COMPANY	7,500	1,920.00	14,400,000
前澤化成工業	7,800	1,286.00	10,030,800
未来工業	4,600	1,445.00	6,647,000
アシックス	105,700	1,928.00	203,789,600
ツツミ	3,100	1,890.00	5,859,000
ウェーブロックホールディングス	4,800	696.00	3,340,800
J S P	7,400	1,469.00	10,870,600
ニチハ	16,900	2,329.00	39,360,100

ローランド	8,700	4,380.00	38,106,000
エフピコ	23,000	2,823.00	64,929,000
小松ウオール工業	3,900	1,832.00	7,144,800
ヤマハ	72,700	5,020.00	364,954,000
河合楽器製作所	3,400	2,930.00	9,962,000
クリナップ	11,700	536.00	6,271,200
ピジョン	75,500	2,073.00	156,511,500
天馬	9,800	2,219.00	21,746,200
兼松サステック	600	1,719.00	1,031,400
キングジム	10,700	931.00	9,961,700
象印マホービン	32,900	1,352.00	44,480,800
リンテック	25,800	2,387.00	61,584,600
信越ポリマー	22,400	1,024.00	22,937,600
東リ	31,000	210.00	6,510,000
イトーキ	23,300	353.00	8,224,900
任天堂	70,600	58,190.00	4,108,214,000
三菱鉛筆	19,400	1,309.00	25,394,600
松風	4,900	1,567.00	7,678,300
タカラスタANDARD	23,900	1,293.00	30,902,700
コクヨ	58,300	1,726.00	100,625,800
ナカバヤシ	11,200	490.00	5,488,000
ニフコ	41,700	2,680.00	111,756,000
立川ブラインド工業	5,300	1,035.00	5,485,500
グローブライド	10,600	2,429.00	25,747,400
オカムラ	40,300	1,168.00	47,070,400
バルカー	10,100	2,595.00	26,209,500
MUTOHホールディングス	900	2,210.00	1,989,000
伊藤忠商事	820,600	3,555.00	2,917,233,000
丸紅	1,170,200	1,283.00	1,501,366,600
スクロール	18,900	830.00	15,687,000
高島	1,700	2,418.00	4,110,600
ヨンドシーホールディングス	11,000	1,713.00	18,843,000
三陽商会	5,700	815.00	4,645,500
長瀬産業	62,600	1,858.00	116,310,800
ナイガイ	3,400	290.00	986,000
蝶理	6,900	1,932.00	13,330,800
豊田通商	119,200	4,400.00	524,480,000
オンワードホールディングス	71,400	247.00	17,635,800
三共生興	15,900	547.00	8,697,300
兼松	44,800	1,332.00	59,673,600
美津濃	11,700	2,078.00	24,312,600
ツカモトコーポレーション	1,600	1,206.00	1,929,600
ルックホールディングス	4,000	1,523.00	6,092,000
三井物産	935,400	3,109.00	2,908,158,600
日本紙パルプ商事	6,200	3,730.00	23,126,000
東京エレクトロン	79,400	54,920.00	4,360,648,000
カメイ	14,200	1,012.00	14,370,400
東都水産	600	4,465.00	2,679,000
OUGホールディングス	1,800	2,628.00	4,730,400
スターゼン	8,900	1,946.00	17,319,400

セイコーホールディングス	17,600	2,251.00	39,617,600
山善	49,300	938.00	46,243,400
椿本興業	2,400	3,690.00	8,856,000
住友商事	761,400	1,803.50	1,373,184,900
B I P R O G Y	38,300	2,822.00	108,082,600
内田洋行	5,100	4,770.00	24,327,000
三菱商事	884,600	4,114.00	3,639,244,400
第一実業	5,300	3,560.00	18,868,000
キヤノンマーケティングジャパン	30,600	3,065.00	93,789,000
西華産業	6,000	1,593.00	9,558,000
佐藤商事	9,600	1,119.00	10,742,400
菱洋エレクトロ	7,300	2,091.00	15,264,300
東京産業	10,800	695.00	7,506,000
ユアサ商事	11,000	2,819.00	31,009,000
神鋼商事	2,800	3,580.00	10,024,000
トルク	5,000	201.00	1,005,000
阪和興業	23,500	3,045.00	71,557,500
正栄食品工業	8,000	3,920.00	31,360,000
カナデン	10,000	916.00	9,160,000
菱電商事	9,700	1,665.00	16,150,500
ニプロ	91,000	1,010.00	91,910,000
岩谷産業	28,800	5,080.00	146,304,000
ナイス	4,100	1,852.00	7,593,200
ニチモウ	1,700	2,619.00	4,452,300
極東貿易	3,600	2,525.00	9,090,000
アステナホールディングス	16,800	432.00	7,257,600
兼松エレクトロニクス	6,700	3,760.00	25,192,000
三愛オブリ	29,400	958.00	28,165,200
稲畑産業	25,900	2,104.00	54,493,600
G S I クレオス	5,900	1,191.00	7,026,900
明和産業	11,400	700.00	7,980,000
クワザワホールディングス	5,000	490.00	2,450,000
キムラタン	70,200	22.00	1,544,400
ゴールドウイン	21,500	6,390.00	137,385,000
ユニ・チャーム	241,100	4,274.00	1,030,461,400
デザート	22,900	2,250.00	51,525,000
キング	6,000	506.00	3,036,000
ワキタ	24,900	1,066.00	26,543,400
ヤマトインターナショナル	10,600	282.00	2,989,200
東邦ホールディングス	37,500	2,123.00	79,612,500
サンゲツ	31,400	1,564.00	49,109,600
ミツウロコグループホールディングス	16,500	981.00	16,186,500
シナネンホールディングス	4,400	3,230.00	14,212,000
伊藤忠エネクス	27,300	1,055.00	28,801,500
サンリオ	36,900	2,521.00	93,024,900
サンワ テクノス	7,100	1,375.00	9,762,500
リョーサン	13,200	2,335.00	30,822,000
新光商事	17,700	937.00	16,584,900
トーヨー	5,300	1,089.00	5,771,700
三信電気	5,500	1,510.00	8,305,000

東陽テクニカ	12,200	1,051.00	12,822,200
モスフードサービス	16,200	3,015.00	48,843,000
加賀電子	10,800	3,045.00	32,886,000
三益半導体工業	9,600	2,226.00	21,369,600
都築電気	6,100	1,419.00	8,655,900
ソーダニッカ	11,500	619.00	7,118,500
立花エレテック	9,000	1,618.00	14,562,000
木曽路	16,600	2,088.00	34,660,800
S R Sホールディングス	17,600	808.00	14,220,800
千趣会	22,400	397.00	8,892,800
タカキュー	9,900	103.00	1,019,700
リテールパートナーズ	18,700	1,136.00	21,243,200
ケーヨー	22,800	934.00	21,295,200
上新電機	13,400	1,903.00	25,500,200
日本瓦斯	59,800	1,857.00	111,048,600
ロイヤルホールディングス	21,600	2,074.00	44,798,400
東天紅	600	921.00	552,600
いなげや	14,200	1,314.00	18,658,800
チヨダ	11,500	705.00	8,107,500
ライフコーポレーション	10,800	2,833.00	30,596,400
リンガーハット	14,900	2,213.00	32,973,700
M r M a x H D	15,400	602.00	9,270,800
テンアライド	12,400	311.00	3,856,400
A O K Iホールディングス	23,800	625.00	14,875,000
オークワ	18,700	877.00	16,399,900
コメリ	19,000	2,765.00	52,535,000
青山商事	24,700	687.00	16,968,900
しまむら	14,300	11,490.00	164,307,000
はせがわ	6,700	264.00	1,768,800
高島屋	87,400	1,192.00	104,180,800
松屋	23,400	756.00	17,690,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	56,700	864.00	48,988,800
近鉄百貨店	4,300	2,533.00	10,891,900
丸井グループ	94,600	2,179.00	206,133,400
クレディセゾン	76,800	1,489.00	114,355,200
アクシアル リテイリング	9,100	3,025.00	27,527,500
井筒屋	5,800	297.00	1,722,600
イオン	451,400	2,355.00	1,063,047,000
イズミ	21,300	2,795.00	59,533,500
フォーバル	5,100	823.00	4,197,300
平和堂	22,000	1,973.00	43,406,000
フジ	31,500	2,271.00	71,536,500
ヤオコー	14,000	6,930.00	97,020,000
ゼビオホールディングス	16,700	907.00	15,146,900
ケーズホールディングス	110,600	1,360.00	150,416,000
P A L T A C	17,300	4,510.00	78,023,000
三谷産業	19,300	308.00	5,944,400
O l y m p i cグループ	6,200	629.00	3,899,800
日産東京販売ホールディングス	18,500	219.00	4,051,500
新生銀行	80,500	2,175.00	175,087,500

あおぞら銀行	68,800	2,581.00	177,572,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,564,900	728.60	5,511,786,140	
りそなホールディングス	1,367,400	515.90	705,441,660	
三井住友トラスト・ホールディングス	223,400	3,986.00	890,472,400	
三井住友フィナンシャルグループ	836,100	3,837.00	3,208,115,700	
千葉銀行	390,600	711.00	277,716,600	
群馬銀行	220,300	358.00	78,867,400	
武蔵野銀行	17,500	1,723.00	30,152,500	
千葉興業銀行	28,200	265.00	7,473,000	
筑波銀行	48,000	192.00	9,216,000	
七十七銀行	36,800	1,605.00	59,064,000	
秋田銀行	7,800	1,656.00	12,916,800	
山形銀行	12,600	854.00	10,760,400	
岩手銀行	7,900	1,890.00	14,931,000	
東邦銀行	97,700	200.00	19,540,000	
東北銀行	5,900	990.00	5,841,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	99,000	2,251.00	222,849,000	
静岡銀行	285,000	798.00	227,430,000	
スルガ銀行	108,100	405.00	43,780,500	
八十二銀行	264,700	447.00	118,320,900	
山梨中央銀行	13,100	979.00	12,824,900	
大垣共立銀行	23,300	1,866.00	43,477,800	
福井銀行	10,400	1,334.00	13,873,600	
清水銀行	5,000	1,487.00	7,435,000	
富山銀行	1,900	1,866.00	3,545,400	
滋賀銀行	22,100	2,434.00	53,791,400	
南都銀行	18,400	2,000.00	36,800,000	
百五銀行	113,500	328.00	37,228,000	
京都銀行	42,200	5,480.00	231,256,000	
紀陽銀行	40,000	1,401.00	56,040,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	73,200	867.00	63,464,400	
山陰合同銀行	71,600	640.00	45,824,000	
中国銀行	96,000	940.00	90,240,000	
鳥取銀行	4,000	1,167.00	4,668,000	
伊予銀行	154,900	611.00	94,643,900	
百十四銀行	12,500	1,684.00	21,050,000	
四国銀行	18,000	788.00	14,184,000	
阿波銀行	18,000	2,125.00	38,250,000	
大分銀行	6,900	1,797.00	12,399,300	
宮崎銀行	7,400	2,044.00	15,125,600	
佐賀銀行	6,900	1,441.00	9,942,900	
琉球銀行	26,800	805.00	21,574,000	
セブン銀行	366,000	244.00	89,304,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,544,800	1,538.00	2,375,902,400	
高知銀行	4,300	721.00	3,100,300	
山口フィナンシャルグループ	136,700	705.00	96,373,500	
芙蓉総合リース	12,100	7,400.00	89,540,000	
みずほリース	17,700	2,995.00	53,011,500	
東京センチュリー	22,300	4,165.00	92,879,500	
SBIホールディングス	152,300	2,862.00	435,882,600	

日本証券金融	48,500	910.00	44,135,000
アイフル	206,900	347.00	71,794,300
日本アジア投資	9,600	239.00	2,294,400
長野銀行	4,000	1,281.00	5,124,000
名古屋銀行	8,500	2,973.00	25,270,500
北洋銀行	175,500	235.00	41,242,500
愛知銀行	4,200	4,890.00	20,538,000
中京銀行	4,200	1,573.00	6,606,600
大光銀行	4,000	1,247.00	4,988,000
愛媛銀行	16,900	905.00	15,294,500
トマト銀行	4,300	1,016.00	4,368,800
京葉銀行	51,300	482.00	24,726,600
栃木銀行	58,300	243.00	14,166,900
北日本銀行	3,800	1,573.00	5,977,400
東和銀行	21,200	520.00	11,024,000
福島銀行	13,700	213.00	2,918,100
大東銀行	5,900	654.00	3,858,600
リコーリース	10,900	3,380.00	36,842,000
イオンフィナンシャルサービス	67,100	1,178.00	79,043,800
アコム	243,300	335.00	81,505,500
ジャックス	13,100	3,205.00	41,985,500
オリエントコーポレーション	333,500	123.00	41,020,500
オリックス	732,900	2,293.50	1,680,906,150
三菱HCキャピタル	436,700	574.00	250,665,800
ジャフコグループ	47,100	1,524.00	71,780,400
九州リースサービス	6,100	569.00	3,470,900
トモニホールディングス	93,200	320.00	29,824,000
大和証券グループ本社	901,900	608.70	548,986,530
野村ホールディングス	1,883,200	473.20	891,130,240
岡三証券グループ	94,500	347.00	32,791,500
丸三証券	36,600	506.00	18,519,600
東洋証券	39,600	179.00	7,088,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	134,800	376.00	50,684,800
光世証券	2,400	460.00	1,104,000
水戸証券	32,300	256.00	8,268,800
いちよし証券	22,500	558.00	12,555,000
松井証券	60,400	828.00	50,011,200
SOMPOホールディングス	193,500	5,018.00	970,983,000
日本取引所グループ	301,100	1,889.50	568,928,450
マネックスグループ	101,600	513.00	52,120,800
極東証券	15,800	684.00	10,807,200
岩井コスモホールディングス	11,700	1,241.00	14,519,700
アイザワ証券グループ	19,100	641.00	12,243,100
フィデアホールディングス	11,300	1,280.00	14,464,000
池田泉州ホールディングス	137,700	184.00	25,336,800
アニコムホールディングス	37,900	627.00	23,763,300
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	269,000	3,755.00	1,010,095,000
マネーパートナーズグループ	13,200	238.00	3,141,600

スパークス・グループ	57,000	244.00	13,908,000
小林洋行	2,600	226.00	587,600
第一生命ホールディングス	573,900	2,477.00	1,421,550,300
東京海上ホールディングス	378,400	6,750.00	2,554,200,000
アドバンテッジリスクマネジメント	6,100	485.00	2,958,500
イー・ギャランティ	18,200	2,012.00	36,618,400
アサックス	6,700	584.00	3,912,800
NECキャピタルソリューション	5,100	1,955.00	9,970,500
T&Dホールディングス	304,900	1,599.00	487,535,100
アドバンスクリエイト	6,000	925.00	5,550,000
三井不動産	534,000	2,646.50	1,413,231,000
三菱地所	774,400	1,790.50	1,386,563,200
平和不動産	20,700	3,740.00	77,418,000
東京建物	116,300	1,743.00	202,710,900
京阪神ビルディング	18,100	1,269.00	22,968,900
住友不動産	246,500	3,331.00	821,091,500
太平洋興発	4,700	618.00	2,904,600
テーオーシー	21,000	628.00	13,188,000
東京楽天地	1,900	3,905.00	7,419,500
レオパレス21	127,800	190.00	24,282,000
スターツコーポレーション	16,800	2,307.00	38,757,600
フジ住宅	14,400	610.00	8,784,000
空港施設	12,600	536.00	6,753,600
明和地所	5,900	588.00	3,469,200
ゴールドクレスト	9,700	1,656.00	16,063,200
リログループ	65,300	1,824.00	119,107,200
エスリード	4,900	1,641.00	8,040,900
日神グループホールディングス	20,200	444.00	8,968,800
日本エスコン	23,000	733.00	16,859,000
タカラレーベン	52,000	291.00	15,132,000
A V A N T I A	6,200	832.00	5,158,400
イオンモール	61,800	1,537.00	94,986,600
毎日コムネット	4,300	700.00	3,010,000
ファースト住建	4,600	1,101.00	5,064,600
ランド	671,600	11.00	7,387,600
カチタス	30,500	2,943.00	89,761,500
東祥	8,900	1,259.00	11,205,100
トーセイ	17,000	1,092.00	18,564,000
穴吹興産	2,800	2,229.00	6,241,200
サンフロンティア不動産	17,000	1,040.00	17,680,000
FJネクストホールディングス	12,100	1,011.00	12,233,100
インテリックス	2,800	632.00	1,769,600
ランドビジネス	5,000	236.00	1,180,000
サンネクスタグループ	4,000	1,108.00	4,432,000
グランディハウス	8,500	520.00	4,420,000
東武鉄道	119,500	2,958.00	353,481,000
相鉄ホールディングス	39,100	2,237.00	87,466,700
東急	307,400	1,567.00	481,695,800
京浜急行電鉄	153,500	1,286.00	197,401,000
小田急電鉄	176,400	1,881.00	331,808,400

京王電鉄	61,600	4,680.00	288,288,000
京成電鉄	82,500	3,295.00	271,837,500
富士急行	14,200	3,810.00	54,102,000
新京成電鉄	2,900	2,672.00	7,748,800
東日本旅客鉄道	210,400	6,578.00	1,384,011,200
西日本旅客鉄道	145,300	4,728.00	686,978,400
東海旅客鉄道	98,700	16,085.00	1,587,589,500
西武ホールディングス	159,100	1,293.00	205,716,300
鴻池運輸	19,200	1,112.00	21,350,400
西日本鉄道	33,200	2,569.00	85,290,800
ハマキョウレックス	8,600	2,884.00	24,802,400
サカイ引越センター	5,800	4,550.00	26,390,000
近鉄グループホールディングス	116,000	3,720.00	431,520,000
阪急阪神ホールディングス	144,800	3,405.00	493,044,000
南海電気鉄道	51,700	2,481.00	128,267,700
京阪ホールディングス	50,500	2,921.00	147,510,500
神戸電鉄	2,800	3,210.00	8,988,000
名古屋鉄道	124,800	2,159.00	269,443,200
山陽電気鉄道	8,900	2,066.00	18,387,400
アルプス物流	8,400	1,054.00	8,853,600
トランコム	3,300	7,070.00	23,331,000
ヤマトホールディングス	166,000	2,420.00	401,720,000
山九	30,400	3,680.00	111,872,000
日新	9,200	1,597.00	14,692,400
丸運	6,900	239.00	1,649,100
丸全昭和運輸	9,100	3,165.00	28,801,500
センコーグループホールディングス	59,000	874.00	51,566,000
トナミホールディングス	2,700	3,570.00	9,639,000
ニッコンホールディングス	38,900	1,956.00	76,088,400
日本石油輸送	800	2,595.00	2,076,000
福山通運	18,000	3,655.00	65,790,000
セイノーホールディングス	75,300	1,064.00	80,119,200
エスライン	3,700	866.00	3,204,200
神奈川中央交通	2,900	3,255.00	9,439,500
日立物流	22,900	8,510.00	194,879,000
丸和運輸機関	23,300	1,690.00	39,377,000
C & F ロジホールディングス	11,300	1,088.00	12,294,400
日本郵船	99,100	9,770.00	968,207,000
商船三井	192,100	3,280.00	630,088,000
川崎汽船	36,500	8,570.00	312,805,000
N S ユナイテッド海運	6,200	3,810.00	23,622,000
明治海運	13,000	715.00	9,295,000
飯野海運	52,200	664.00	34,660,800
共栄タンカー	2,100	1,078.00	2,263,800
九州旅客鉄道	87,500	2,563.00	224,262,500
S Gホールディングス	215,500	2,334.00	502,977,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	39,100	7,550.00	295,205,000
日本航空	265,900	2,139.00	568,760,100
A N Aホールディングス	294,600	2,423.00	713,815,800



ビーウィズ	3,200	1,401.00	4,483,200
パスコ	2,300	1,296.00	2,980,800
TREホールディングス	18,400	1,937.00	35,640,800
人・夢・技術グループ	4,800	2,264.00	10,867,200
西本Wismettacホールディングス	2,800	2,548.00	7,134,400
シルバーライフ	2,500	1,350.00	3,375,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	2,023.00	1,820,700
Genky DrugStores	5,400	3,115.00	16,821,000
コア商事ホールディングス	7,700	841.00	6,475,700
国際紙パルプ商事	24,700	293.00	7,237,100
ナルミヤ・インターナショナル	2,800	840.00	2,352,000
ブックオフグループホールディングス	7,200	1,033.00	7,437,600
ギフトホールディングス	1,900	2,089.00	3,969,100
三菱倉庫	35,300	3,020.00	106,606,000
三井倉庫ホールディングス	12,200	2,652.00	32,354,400
住友倉庫	39,100	2,010.00	78,591,000
澁澤倉庫	6,700	2,218.00	14,860,600
ヤマタネ	5,700	1,659.00	9,456,300
東陽倉庫	19,300	303.00	5,847,900
乾汽船	7,700	1,638.00	12,612,600
日本トランスシティ	24,400	572.00	13,956,800
ケイヒン	2,100	1,380.00	2,898,000
中央倉庫	7,000	951.00	6,657,000
川西倉庫	2,300	1,100.00	2,530,000
安田倉庫	9,300	961.00	8,937,300
ファイズホールディングス	2,600	779.00	2,025,400
東洋埠頭	2,600	1,408.00	3,660,800
上組	62,800	2,178.00	136,778,400
サンリツ	3,300	780.00	2,574,000
キムラユニティー	3,200	1,441.00	4,611,200
キューソー流通システム	6,000	1,063.00	6,378,000
近鉄エクスプレス	22,400	3,040.00	68,096,000
東海運	7,100	296.00	2,101,600
エーアイティー	7,400	1,534.00	11,351,600
内外トランスライン	4,600	1,862.00	8,565,200
ショーエイコーポレーション	3,400	571.00	1,941,400
日本コンセプト	3,800	1,306.00	4,962,800
TBSホールディングス	68,800	1,743.00	119,918,400
日本テレビホールディングス	102,500	1,247.00	127,817,500
朝日放送グループホールディングス	11,400	706.00	8,048,400
テレビ朝日ホールディングス	29,500	1,487.00	43,866,500
スカパーJSATホールディングス	104,000	455.00	47,320,000
テレビ東京ホールディングス	8,300	1,983.00	16,458,900
日本BS放送	4,200	1,020.00	4,284,000
ビジョン	20,400	1,222.00	24,928,800
スマートバリュー	2,800	521.00	1,458,800
USEN-NEXT HOLDINGS	10,800	2,066.00	22,312,800
ワイヤレスゲート	5,100	296.00	1,509,600

コネクシオ	8,700	1,425.00	12,397,500
日本通信	101,900	194.00	19,768,600
クロップス	2,300	980.00	2,254,000
日本電信電話	1,314,300	3,841.00	5,048,226,300
KDDI	894,700	4,317.00	3,862,419,900
ソフトバンク	1,858,800	1,513.50	2,813,293,800
光通信	14,200	15,030.00	213,426,000
エムティーアイ	11,100	447.00	4,961,700
GMOインターネット	43,000	2,454.00	105,522,000
ファイバーゲート	5,600	1,180.00	6,608,000
アйдママーケティングコミュニケーション	2,800	283.00	792,400
KADOKAWA	66,700	3,090.00	206,103,000
学研ホールディングス	17,300	882.00	15,258,600
ゼンリン	19,900	916.00	18,228,400
昭文社ホールディングス	3,800	401.00	1,523,800
インプレスホールディングス	10,300	225.00	2,317,500
東京電力ホールディングス	935,800	505.00	472,579,000
中部電力	372,800	1,342.00	500,297,600
関西電力	461,800	1,279.00	590,642,200
中国電力	190,400	914.00	174,025,600
北陸電力	111,700	561.00	62,663,700
東北電力	286,300	775.00	221,882,500
四国電力	109,700	800.00	87,760,000
九州電力	251,600	887.00	223,169,200
北海道電力	108,600	513.00	55,711,800
沖縄電力	26,600	1,244.00	33,090,400
電源開発	101,900	1,829.00	186,375,100
エフオン	7,500	541.00	4,057,500
イーレックス	17,600	1,887.00	33,211,200
レノバ	24,500	1,867.00	45,741,500
東京瓦斯	234,100	2,511.00	587,825,100
大阪瓦斯	221,100	2,418.00	534,619,800
東邦瓦斯	54,500	3,030.00	165,135,000
北海道瓦斯	6,200	1,529.00	9,479,800
広島ガス	23,600	321.00	7,575,600
西部ガスホールディングス	13,300	2,024.00	26,919,200
静岡ガス	31,500	905.00	28,507,500
メタウォーター	13,000	1,994.00	25,922,000
アイネット	6,200	1,246.00	7,725,200
松竹	7,700	12,810.00	98,637,000
東宝	72,400	4,825.00	349,330,000
エイチ・アイ・エス	25,900	2,014.00	52,162,600
東映	3,900	16,890.00	65,871,000
ラックランド	3,600	2,958.00	10,648,800
エヌ・ティ・ティ・データ	326,800	2,274.00	743,143,200
共立メンテナンス	21,300	4,620.00	98,406,000
イチネンホールディングス	12,300	1,225.00	15,067,500
建設技術研究所	6,800	2,311.00	15,714,800
スペース	8,400	916.00	7,694,400

アインホールディングス	16,100	5,690.00	91,609,000
燦ホールディングス	5,200	1,560.00	8,112,000
ピー・シー・エー	7,200	1,303.00	9,381,600
スバル興業	600	8,370.00	5,022,000
東京テアトル	4,800	1,207.00	5,793,600
タナベ経営	4,000	627.00	2,508,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,600	1,487.00	5,353,200
ナガワ	3,700	9,040.00	33,448,000
東京都競馬	8,900	3,740.00	33,286,000
常磐興産	4,600	1,220.00	5,612,000
カナモト	20,500	1,932.00	39,606,000
D T S	22,900	2,950.00	67,555,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	57,100	5,390.00	307,769,000
シーイーシー	13,100	1,199.00	15,706,900
カブコン	115,700	3,360.00	388,752,000
西尾レントオール	10,700	2,670.00	28,569,000
アイ・エス・ビー	5,700	1,023.00	5,831,100
アゴーラ ホスピタリティグループ	67,700	23.00	1,557,100
日本空港ビルデング	44,600	5,200.00	231,920,000
トランス・コスモス	15,200	3,095.00	47,044,000
乃村工藝社	51,200	857.00	43,878,400
ジャステック	7,200	1,143.00	8,229,600
S C S K	85,000	2,173.00	184,705,000
藤田観光	5,200	2,206.00	11,471,200
K N T - C Tホールディングス	7,400	1,443.00	10,678,200
日本管財	12,900	2,576.00	33,230,400
トーカイ	10,100	1,694.00	17,109,400
白洋舎	1,400	1,265.00	1,771,000
セコム	117,700	9,385.00	1,104,614,500
日本システムウエア	4,700	2,262.00	10,631,400
セントラル警備保障	5,800	2,141.00	12,417,800
アイネス	11,500	1,451.00	16,686,500
丹青社	23,800	767.00	18,254,600
メイテック	14,200	6,300.00	89,460,000
T K C	20,100	3,470.00	69,747,000
富士ソフト	12,700	6,750.00	85,725,000
応用地質	12,800	1,909.00	24,435,200
船井総研ホールディングス	23,800	2,022.00	48,123,600
N S D	38,500	2,333.00	89,820,500
進学会ホールディングス	4,000	317.00	1,268,000
丸紅建材リース	800	1,735.00	1,388,000
オオバ	8,000	774.00	6,192,000
コナミホールディングス	44,600	7,710.00	343,866,000
いであ	3,100	1,794.00	5,561,400
学究社	3,900	1,585.00	6,181,500
ベネッセホールディングス	39,800	2,360.00	93,928,000
イオンディライト	14,700	2,904.00	42,688,800
ナック	6,000	944.00	5,664,000

福井コンピュータホールディングス	5,600	3,190.00	17,864,000	
ダイセキ	21,800	4,790.00	104,422,000	
ステップ	4,400	1,762.00	7,752,800	
日鉄物産	8,400	5,120.00	43,008,000	
泉州電業	3,300	4,850.00	16,005,000	
元気寿司	3,500	2,463.00	8,620,500	
トラスコ中山	25,500	1,891.00	48,220,500	
ヤマダホールディングス	460,560	470.00	216,463,200	
オートバックスセブン	40,300	1,362.00	54,888,600	
モリト	9,100	763.00	6,943,300	
アークランドサカモト	19,200	1,518.00	29,145,600	
ニトリホールディングス	48,900	12,985.00	634,966,500	
グルメ杵屋	9,900	1,004.00	9,939,600	
愛眼	6,800	199.00	1,353,200	
ケーユーホールディングス	6,500	1,044.00	6,786,000	
吉野家ホールディングス	43,000	2,391.00	102,813,000	
加藤産業	16,300	3,350.00	54,605,000	
北恵	3,200	870.00	2,784,000	
イノテック	7,400	1,342.00	9,930,800	
イエローハット	20,700	1,648.00	34,113,600	
松屋フーズホールディングス	6,000	3,755.00	22,530,000	
JBC Cホールディングス	8,400	1,502.00	12,616,800	
J Kホールディングス	9,600	1,016.00	9,753,600	
サガミホールディングス	18,500	1,115.00	20,627,500	
日伝	9,600	2,130.00	20,448,000	
関西フードマーケット	11,600	1,332.00	15,451,200	
ミロク情報サービス	10,800	1,298.00	14,018,400	
北沢産業	6,300	218.00	1,373,400	
杉本商事	5,800	2,146.00	12,446,800	
因幡電機産業	32,100	2,544.00	81,662,400	
王将フードサービス	8,200	6,100.00	50,020,000	
プレナス	13,800	1,942.00	26,799,600	
ミニストップ	9,200	1,380.00	12,696,000	
アークス	23,000	2,060.00	47,380,000	
パローホールディングス	26,600	1,976.00	52,561,600	
東テク	4,000	2,569.00	10,276,000	
ミスミグループ本社	154,600	2,807.00	433,962,200	
アルテック	8,200	246.00	2,017,200	
ベルク	5,500	5,360.00	29,480,000	
大 庄	6,700	1,030.00	6,901,000	
タキヒヨー	3,600	1,038.00	3,736,800	
ファーストリテイリング	16,400	59,000.00	967,600,000	
ソフトバンクグループ	735,900	4,883.00	3,593,399,700	
蔵王産業	1,900	1,900.00	3,610,000	
スズケン	46,900	3,870.00	181,503,000	
サンドラッグ	46,300	2,943.00	136,260,900	
サックスパー ホールディングス	11,700	521.00	6,095,700	
ジェコス	8,500	792.00	6,732,000	
ヤマザワ	2,400	1,500.00	3,600,000	
やまや	2,600	2,479.00	6,445,400	

グローセル	14,200	406.00	5,765,200	
ペルーナ	26,400	703.00	18,559,200	
合計	134,685,360		310,096,234,650	

(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11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,486,955,556
コール・ローン	8,301,489,197
株式	620,914,884,142
投資信託受益証券	1,123,290,348
投資証券	14,071,839,720
派生商品評価勘定	9,703,863
未収入金	44,528,847,021
未収配当金	751,578,036
差入委託証拠金	4,544,620,224
流動資産合計	699,733,208,107
資産合計	
699,733,208,107	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	850,278,864
未払解約金	31,979,248,000
流動負債合計	32,829,526,864
負債合計	
32,829,526,864	
純資産の部	
元本等	
元本	116,054,588,763
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	550,849,092,480
元本等合計	666,903,681,243
純資産合計	666,903,681,243
負債純資産合計	699,733,208,107

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	115,916,372,811円
同期中追加設定元本額	51,254,486,612円
同期中一部解約元本額	51,116,270,660円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,294,940,771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	31,666,467,377円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	307,680,995円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,576,358,177円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	620,933,570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)	425,565,688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)	327,051,649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)	489,640,943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)	1,217,485円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	20,735,847円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,388,193円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,040,072円
たわらノーロード 全世界株式	282,174,871円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	52,498,126,863円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,411,602,791円
Oneグローバルバランス	1,635,543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	771,631,597円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	988,223,773円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	93,148,613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	240,451,176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	2,406,256,328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>	148,220,022円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	186,211,841円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	155,292,810円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	119,845,256円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	653,877,129円
ワールドアセットバランス(基本コース)	170,860,090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)	23,229,077円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,757,176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)	33,144,824円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	101,554,481円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	255,344,181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)	13,972,887円



投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	10,211,329円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,743,178円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	33,935,995円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,081,819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 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)	21,674,948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)	63,265,470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)	204,232,262円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,051,547,653円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	61,719,980円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	7,689,244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)	2,337,780円
しあわせの一步・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)	27,921,356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)	52,904,509円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,584,181円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	21,103,551円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,477,915円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	440,944円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,731,997円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	23,781,576円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	186,810,914円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	287,205,646円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	942,052,049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)	69,193,074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)	297,767,360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)	12,032,540円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,450,496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)	117,179,603円

D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	10,686,469円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	37,532,569円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	58,080,672円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	118,676,562円
動的パッケージファンド<DC年金>	2,294,390円
コア資産形成ファンド	1,455,801円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,498,978,112円
MHAM外国株式インデックスファンド	138,497,271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]	308,257,825円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,740,169,836円
計	116,054,588,763円
2. 受益権の総数	116,054,588,763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11月12日 至 2022年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年5月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	64,381,707,193	
投資信託受益証券	75,386,083	
投資証券	1,120,677,797	
合計	65,577,771,073	

(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11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2022年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
アメリカ・ドル	41,283,345,136	-	41,332,784,136	49,439,000
イギリス・ポンド	29,966,773,770	-	30,006,061,785	39,288,015
イスラエル・シェケル	2,006,991,769	-	2,009,439,825	2,448,056
オーストラリア・ドル	18,985,000	-	18,855,100	129,900
カナダ・ドル	984,850,782	-	987,577,685	2,726,903
シンガポール・ドル	1,529,404,532	-	1,531,185,509	1,780,977
シンガポール・ドル	206,670,190	-	207,001,466	331,276
スイス・フラン	206,670,190	-	207,001,466	331,276
スウェーデン・クローナ	1,539,908,120	-	1,539,642,990	265,130
デンマーク・クローネ	557,239,400	-	559,854,510	2,615,110
ニュージーランド・ドル	370,872,400	-	370,858,710	13,690
ノルウェー・クローネ	29,455,560	-	29,525,904	70,344
ユーロ	109,874,400	-	109,876,730	2,330
ユーロ	3,604,184,713	-	3,604,343,922	159,209
香港・ドル	358,134,500	-	358,560,000	425,500

合計	41,283,345,136	-	41,332,784,136	49,439,000
----	----------------	---	----------------	------------

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 株式関連

種類	2022年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	14,046,678,498	-	13,255,542,497	791,136,001
合計	14,046,678,498	-	13,255,542,497	791,136,001

## (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11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.7465円 (57,465円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2022年5月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	45,958	2,177.180	100,058,838.440	
	ABBOTT LABORATORIES	177,640	106.750	18,963,070.000	
	AES CORP	69,518	19.960	1,387,579.280	

ABIOMED INC	4,472	237.630	1,062,681.360	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	90,043	129.130	11,627,252.590	
ADVANCED MICRO DEVICES	163,896	88.730	14,542,492.080	
ADOBE INC	47,666	393.030	18,734,167.980	
CHUBB LTD	43,247	204.870	8,860,012.890	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	21,819	230.680	5,033,206.920	
ALLEGHANY CORP	1,177	831.110	978,216.470	
ALLSTATE CORP	29,578	129.590	3,833,013.020	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	69,187	194.770	13,475,551.990	
AMGEN INC	56,363	240.710	13,567,137.730	
HESS CORP	28,302	105.770	2,993,502.540	
AMERICAN EXPRESS CO	65,693	161.830	10,631,098.190	
AMERICAN ELECTRIC POWER	49,799	99.080	4,934,084.920	
AFLAC INC	65,217	57.340	3,739,542.780	
AMERICAN INTL GROUP	85,623	58.690	5,025,213.870	
AMERCO	980	520.960	510,540.800	
ANALOG DEVICES	55,348	155.220	8,591,116.560	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	72,346	51.200	3,704,115.200	
VALERO ENERGY CORP	41,788	120.970	5,055,094.360	
ANSYS INC	8,770	250.640	2,198,112.800	
APPLE INC	1,652,744	154.510	255,365,475.440	
APPLIED MATERIALS INC	89,764	107.180	9,620,905.520	
ALBEMARLE CORP	11,974	221.430	2,651,402.820	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	55,014	84.970	4,674,539.580	
AMEREN CORP	25,790	92.890	2,395,633.100	
ARROW ELECTRONICS INC	6,673	123.800	826,117.400	
AUTODESK INC	22,564	186.410	4,206,155.240	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	42,124	212.340	8,944,610.160	
AUTOZONE INC	2,137	1,950.890	4,169,051.930	
AVERY DENNISON CORP	8,463	171.740	1,453,435.620	
BALL CORP	33,139	69.090	2,289,573.510	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	131,354	312.530	41,052,065.620	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	75,967	42.960	3,263,542.320	
BAXTER INTERNATIONAL INC	48,538	72.460	3,517,063.480	
BECTON DICKINSON & CO	29,321	250.100	7,333,182.100	
AMETEK INC	23,531	120.890	2,844,662.590	
VERIZON COMM INC	415,271	48.130	19,986,993.230	
WR BERKLEY CORP	18,923	66.350	1,255,541.050	
BEST BUY CO INC	22,198	88.740	1,969,850.520	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	490.170	1,205,328.030	

YUM! BRANDS INC	30,146	110.740	3,338,368.040	
FIRSTENERGY CORP	55,710	42.050	2,342,605.500	
BOEING CO	55,521	132.950	7,381,516.950	
ROBERT HALF INTL INC	11,897	96.370	1,146,513.890	
BORGWARNER INC	27,800	36.300	1,009,140.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	140,784	38.650	5,441,301.600	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,979	110.290	1,431,453.910	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,635	103.590	1,308,859.650	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,347	1,219.640	2,862,495.080	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	222,644	76.290	16,985,510.760	
ONEOK INC	42,657	62.480	2,665,209.360	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	142.920	1,127,781.720	
UNITED RENTALS INC	7,341	293.690	2,155,978.290	
SEMPRA ENERGY	33,052	158.540	5,240,064.080	
FEDEX CORP	26,057	208.060	5,421,419.420	
VERISIGN INC	10,834	167.690	1,816,753.460	
AMPHENOL CORP	61,627	69.040	4,254,728.080	
BROWN-FORMAN CORP	31,640	65.140	2,061,029.600	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	6.070	617,713.550	
CSX CORP	220,025	32.780	7,212,419.500	
COTERRA ENERGY INC	74,061	29.620	2,193,686.820	
CAMPBELL SOUP CO	21,404	49.580	1,061,210.320	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,982	246.780	4,190,817.960	
CARDINAL HEALTH INC	25,606	56.050	1,435,216.300	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	80,862	14.190	1,147,431.780	
CATERPILLAR INC	54,196	202.990	11,001,246.040	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,845	120.480	1,306,605.600	
CITRIX SYSTEMS INC	14,230	100.290	1,427,126.700	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	10.700	1,038,681.100	
CERNER CORP	30,462	94.140	2,867,692.680	
JPMORGAN CHASE & CO	297,282	118.890	35,343,856.980	
CHURCH & DWIGHT CO INC	25,740	98.000	2,522,520.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,424	125.000	1,928,000.000	
CINTAS CORP	9,019	378.230	3,411,256.370	
CISCO SYSTEMS INC	424,748	49.550	21,046,263.400	
CLOROX COMPANY	12,349	156.230	1,929,284.270	
COCA-COLA CO/THE	413,753	64.010	26,484,329.530	
COPART INC	21,380	109.560	2,342,392.800	
COGNEX CORP	20,432	48.990	1,000,963.680	
COLGATE-PALMOLIVE CO	82,958	76.670	6,360,389.860	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	28,772	168.090	4,836,285.480	

MOLINA HEALTHCARE INC	5,926	292.500	1,733,355.000	
NRG ENERGY, INC.	23,951	41.690	998,517.190	
COMCAST CORP-CL A	456,955	40.300	18,415,286.500	
CONAGRA BRANDS INC	47,672	35.710	1,702,367.120	
CONSOLIDATED EDISON INC	36,408	92.650	3,373,201.200	
CMS ENERGY CORP	29,634	68.280	2,023,409.520	
COOPER COS INC	4,961	317.030	1,572,785.830	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	17,059	54.840	935,515.560	
CORNING INC	78,991	36.000	2,843,676.000	
SEALED AIR CORP	12,634	63.180	798,216.120	
HEICO CORP-CL A	7,767	110.030	854,603.010	
CUMMINS INC	14,486	197.410	2,859,681.260	
DR HORTON INC	34,127	68.210	2,327,802.670	
DANAHER CORP	64,395	240.450	15,483,777.750	
MOODY'S CORP	17,241	285.040	4,914,374.640	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	53,898	74.440	4,012,167.120	
TARGET CORP	47,935	219.110	10,503,037.850	
DEERE & CO	29,527	364.750	10,769,973.250	
MORGAN STANLEY	134,909	80.260	10,827,796.340	
REPUBLIC SERVICES INC	22,337	129.110	2,883,930.070	
COSTAR GROUP INC	39,774	56.970	2,265,924.780	
THE WALT DISNEY CO	182,053	107.680	19,603,467.040	
DOLLAR TREE INC	22,153	157.890	3,497,737.170	
DOVER CORP	14,180	129.950	1,842,691.000	
OMNICOM GROUP	20,880	75.630	1,579,154.400	
DTE ENERGY CO	19,905	128.410	2,556,001.050	
DUKE ENERGY CORP	77,590	108.910	8,450,326.900	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	126.900	1,768,859.100	
EBAY INC	60,920	48.590	2,960,102.800	
BANK OF AMERICA CORP	740,280	35.760	26,472,412.800	
CITIGROUP INC	198,279	48.750	9,666,101.250	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,111	102.140	1,441,297.540	
EATON CORP PLC	39,800	140.980	5,611,004.000	
CADENCE DESIGN SYS INC	28,289	141.170	3,993,558.130	
DISH NETWORK CORP	24,416	21.750	531,048.000	
ECOLAB INC	26,618	160.360	4,268,462.480	
PERKINELMER INC	12,304	145.020	1,784,326.080	
ELECTRONIC ARTS INC	29,083	111.600	3,245,662.800	
SALESFORCE INC	97,947	167.150	16,371,841.050	
ERIE INDEMNITY CO	2,431	164.420	399,705.020	
EMERSON ELECTRIC CO	61,769	83.610	5,164,506.090	
ATMOS ENERGY CORP	12,557	113.110	1,420,322.270	
ENTERGY CORP	19,156	116.310	2,228,034.360	
EOG RESOURCES INC	60,030	119.560	7,177,186.800	
EQUIFAX INC	12,329	200.400	2,470,731.600	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	23,913	229.680	5,492,337.840	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	17,397	109.030	1,896,794.910	
EXXON MOBIL CORP	425,515	85.020	36,177,285.300	

FMC CORP	12,931	112.670	1,456,935.770	
NEXTERA ENERGY INC	197,013	69.990	13,788,939.870	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,101	367.120	1,505,559.120	
FAIR ISAAC CORP	2,962	358.410	1,061,610.420	
ASSURANT INC	5,823	181.800	1,058,621.400	
FASTENAL CO	58,701	51.900	3,046,581.900	
FIFTH THIRD BANCORP	69,838	36.580	2,554,674.040	
M&T BANK CORP	18,103	165.830	3,002,020.490	
FISERV INC	58,889	92.780	5,463,721.420	
FORD MOTOR CO	403,836	13.350	5,391,210.600	
FRANKLIN RESOURCES INC	29,162	24.530	715,343.860	
FREEPORT-MCMORAN INC	149,515	36.070	5,393,006.050	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	643.050	816,673.500	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,225	158.250	3,358,856.250	
DENTSPLY SIRONA INC	21,462	36.380	780,787.560	
GENERAL DYNAMICS CORP	24,525	229.300	5,623,582.500	
GENERAL MILLS INC	62,284	71.740	4,468,254.160	
GENUINE PARTS CO	13,551	130.950	1,774,503.450	
GILEAD SCIENCES INC	124,270	61.780	7,677,400.600	
GARTNER INC	7,827	246.010	1,925,520.270	
MCKESSON CORP	14,910	329.830	4,917,765.300	
NVIDIA CORP	251,375	175.950	44,229,431.250	
GENERAL ELECTRIC CO	109,526	73.310	8,029,351.060	
VW GRAINGER INC	4,430	469.330	2,079,131.900	
HALLIBURTON CO	88,971	34.300	3,051,705.300	
MONSTER BEVERAGE CORP	40,926	84.140	3,443,513.640	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,773	305.060	10,302,791.380	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	20,078	237.680	4,772,139.040	
HASBRO INC	12,903	88.620	1,143,463.860	
HENRY SCHEIN INC	15,048	84.560	1,272,458.880	
HEICO CORP	5,185	135.440	702,256.400	
HERSHEY FOODS CORP	14,128	223.150	3,152,663.200	
HP INC	117,861	37.540	4,424,501.940	
F5 INC	6,924	170.630	1,181,442.120	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,766	102.040	1,302,642.640	
JUNIPER NETWORKS INC	27,139	31.090	843,751.510	
HOLOGIC INC	25,622	73.320	1,878,605.040	
HOME DEPOT INC	104,985	291.160	30,567,432.600	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,012	79.430	1,589,553.160	
HORMEL FOODS CORP	30,733	52.120	1,601,803.960	
CENTERPOINT ENERGY INC	64,168	30.480	1,955,840.640	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	216.250	778,932.500	
HUMANA INC	13,292	432.800	5,752,777.600	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,171	172.140	1,578,695.940	



HUNTINGTON BANCSHARES INC	145,438	13.100	1,905,237.800	
BIOGEN INC	15,009	195.000	2,926,755.000	
IDEX CORP	7,766	184.790	1,435,079.140	
ILLINOIS TOOL WORKS	32,590	203.560	6,634,020.400	
INTUIT INC	26,814	371.190	9,953,088.660	
IDEXX LABORATORIES INC	8,609	340.180	2,928,609.620	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	24,235	133.310	3,230,767.850	
INTEL CORP	409,073	44.010	18,003,302.730	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	25,983	125.500	3,260,866.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	37,464	47.850	1,792,652.400	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	38,033	31.900	1,213,252.700	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,717	130.160	1,525,084.720	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	178.870	1,458,148.240	
INCYTE CORP	19,005	76.140	1,447,040.700	
JOHNSON & JOHNSON	265,284	177.090	46,979,143.560	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,131	70.020	2,459,872.620	
KLA CORPORATION	14,780	323.220	4,777,191.600	
DEVON ENERGY CORP	65,385	63.760	4,168,947.600	
KELLOGG CO	24,358	72.930	1,776,428.940	
KEYCORP	94,036	18.920	1,779,161.120	
KIMBERLY-CLARK CORP	34,638	138.950	4,812,950.100	
BLACKROCK INC/NEW YORK	15,204	610.230	9,277,936.920	
KROGER CO	72,153	55.190	3,982,124.070	
LAM RESEARCH CORP	14,462	459.120	6,639,793.440	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,688	392.010	1,837,742.880	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,718	160.220	1,396,797.960	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,689	97.230	1,719,901.470	
PLUG POWER INC	56,149	15.710	882,100.790	
LENNAR CORP	27,333	75.760	2,070,748.080	
ELI LILLY & CO	81,699	285.700	23,341,404.300	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	49.880	1,404,421.280	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	55.090	988,149.330	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	73,194	182.010	13,322,039.940	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	30,900	116.640	3,604,176.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,786	439.130	10,884,276.180	
LOEWS CORP	23,530	62.730	1,476,036.900	
LOWE'S COS INC	67,513	192.130	12,971,272.690	
DOMINION ENERGY INC	84,244	81.960	6,904,638.240	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	36.200	1,462,516.200	

MCCORMICK & CO INC	25,192	97.970	2,468,060.240	
MCDONALD'S CORPORATION	75,166	245.680	18,466,782.880	
S&P GLOBAL INC	35,491	327.990	11,640,693.090	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	279.290	1,243,957.660	
MARKEL CORPORATION	1,289	1,287.390	1,659,445.710	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	61,544	94.830	5,836,217.520	
MARSH & MCLENNAN COS	50,348	157.960	7,952,970.080	
MASCO CORP	24,668	53.180	1,311,844.240	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,849	328.140	1,919,290.860	
METLIFE INC	70,818	64.810	4,589,714.580	
MEDTRONIC PLC	135,129	100.310	13,554,789.990	
ACTIVISION BLIZZARD INC	80,415	76.920	6,185,521.800	
CVS HEALTH CORP	132,210	98.160	12,977,733.600	
MERCK & CO. INC.	253,900	87.810	22,294,959.000	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	43,299	53.870	2,332,517.130	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,821	240.640	2,363,325.440	
MICROSOFT CORP	718,385	269.500	193,604,757.500	
MICRON TECH INC	115,516	68.910	7,960,207.560	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	56,461	68.250	3,853,463.250	
3M CO	57,723	149.120	8,607,653.760	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	142.370	898,497.070	
ENTEGRIS INC	14,422	105.970	1,528,299.340	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,578	229.250	1,278,756.500	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	17,201	202.850	3,489,222.850	
ILLUMINA INC	15,251	219.670	3,350,187.170	
XCEL ENERGY INC	52,657	73.490	3,869,762.930	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,061	82.220	827,215.420	
NETAPP INC	24,953	73.020	1,822,068.060	
NEWELL BRANDS INC	41,984	22.620	949,678.080	
NEWMONT CORP	81,722	68.270	5,579,160.940	
NOVAVAX INC	8,342	53.860	449,300.120	
NVR INC	327	4,274.210	1,397,666.670	
NIKE INC-CL B	128,014	109.490	14,016,252.860	
NORDSON CORP	4,856	208.440	1,012,184.640	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,996	245.750	5,897,017.000	
EVERSOURCE ENERGY	33,249	89.130	2,963,483.370	
NISOURCE INC	39,302	29.320	1,152,334.640	
NORTHERN TRUST CORP	19,832	103.750	2,057,570.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,914	449.970	6,710,852.580	
WELLS FARGO & CO	400,273	43.080	17,243,760.840	
NUCOR CORP	29,413	129.530	3,809,865.890	
CHENIERE ENERGY INC	24,273	131.100	3,182,190.300	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,877	121.030	5,310,433.310	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	96,115	59.410	5,710,192.150	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,929	274.160	2,722,134.640	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,551	611.810	4,007,967.310	
ORACLE CORP	164,634	72.530	11,940,904.020	
PACCAR INC	33,498	83.750	2,805,457.500	
PTC INC	11,726	107.510	1,260,662.260	
EXELON CORP	101,204	46.760	4,732,299.040	
PARKER HANNIFIN CORP	13,237	265.740	3,517,600.380	
PAYCHEX INC	31,718	120.130	3,810,283.340	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,559	258.130	1,951,204.670	
PPL CORPORATION	77,299	28.280	2,186,015.720	
PEPSICO INC	139,522	171.490	23,926,627.780	
PENTAIR PLC	17,214	49.170	846,412.380	
PFIZER INC	563,736	49.490	27,899,294.640	
ESSENTIAL UTILITIES INC	23,712	42.260	1,002,069.120	
CONOCOPHILLIPS	131,402	98.000	12,877,396.000	
PG&E CORP	161,265	11.770	1,898,089.050	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,798	250.540	5,962,350.920	
ALTRIA GROUP INC	184,270	51.570	9,502,803.900	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	43,909	161.840	7,106,232.560	
BROWN & BROWN INC	21,748	57.550	1,251,597.400	
GARMIN LTD	15,507	101.240	1,569,928.680	
PPG INDUSTRIES INC	24,618	125.040	3,078,234.720	
IPG PHOTONICS CORP	3,586	98.030	351,535.580	
COSTCO WHOLESALE CORP	44,357	501.460	22,243,261.220	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,282	122.900	2,861,357.800	
QUEST DIAGNOSTICS	13,048	134.090	1,749,606.320	
PROCTER & GAMBLE CO	243,733	154.790	37,727,431.070	
PROGRESSIVE CORP	60,370	108.270	6,536,259.900	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	52,384	68.330	3,579,398.720	
PULTE GROUP INC	24,455	41.900	1,024,664.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	29,707	118.930	3,533,053.510	
QUALCOMM INC	112,504	136.810	15,391,672.240	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,030	93.740	1,596,392.200	
EXACT SCIENCES CORP	18,866	51.420	970,089.720	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,891	615.090	6,698,945.190	
RESMED INC	14,063	195.220	2,745,378.860	
US BANCORP	145,528	49.360	7,183,262.080	
SEAGEN INC	12,591	120.480	1,516,963.680	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	39,388	45.790	1,803,576.520	

ROSS STORES INC	36,116	89.620	3,236,715.920	
ROLLINS INC	25,920	32.880	852,249.600	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,889	430.590	4,688,694.510	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,629	205.120	2,385,340.480	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,415	60.920	1,365,521.800	
RPM INTERNATIONAL INC	13,691	83.770	1,146,895.070	
ACCENTURE PLC-CL A	63,444	287.590	18,245,859.960	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	140,373	65.920	9,253,388.160	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,092	206.350	2,701,534.200	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	25,485	172.990	4,408,650.150	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	62,689	94.740	5,939,155.860	
BOOKING HOLDINGS INC	4,079	2,044.980	8,341,473.420	
SCHLUMBERGER LTD	138,531	37.890	5,248,939.590	
SCHWAB (CHARLES) CORP	144,891	64.580	9,357,060.780	
POOL CORP	3,940	395.940	1,560,003.600	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	21,206	114.170	2,421,089.020	
BUNGE LTD	14,313	110.330	1,579,153.290	
SEI INVESTMENTS CO	9,248	54.670	505,588.160	
ANTHEM INC	24,268	489.320	11,874,817.760	
AMERISOURCEBERGEN CORP	15,652	159.650	2,498,841.800	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,849	69.130	1,717,811.370	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,581	266.370	6,547,640.970	
CENTENE CORP	60,096	79.960	4,805,276.160	
SVB FINANCIAL GROUP	5,691	459.980	2,617,746.180	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	58.960	875,909.760	
SNAP-ON INC	5,270	214.000	1,127,780.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	38,982	104.250	4,063,873.500	
ADVANCE AUTO PARTS	5,512	202.900	1,118,384.800	
EDISON INTERNATIONAL	38,351	67.490	2,588,308.990	
SOUTHERN CO	106,378	73.200	7,786,869.600	
TRUIST FINANCIAL CORP	133,355	47.460	6,329,028.300	
SOUTHWEST AIRLINES	14,171	44.590	631,884.890	
AT&T INC	715,626	19.360	13,854,519.360	
CHEVRON CORP	193,885	160.780	31,172,830.300	
STANLEY BLACK & DECKER INC	16,422	121.490	1,995,108.780	
STATE STREET CORP	35,002	67.710	2,369,985.420	
STARBUCKS CORP	116,404	71.860	8,364,791.440	
STEEL DYNAMICS INC	20,170	77.050	1,554,098.500	
STRYKER CORP	33,787	227.510	7,686,880.370	
NETFLIX INC	43,839	177.660	7,788,436.740	
NORTONLIFELOCK INC	54,706	24.510	1,340,844.060	

KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	49.100	821,443.000	
SYNOPSIS INC	15,559	270.510	4,208,865.090	
SYSCO CORP	52,704	86.050	4,535,179.200	
INTUITIVE SURGICAL INC	35,261	211.390	7,453,822.790	
TELEFLEX INC	4,617	267.760	1,236,247.920	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,349	7.490	834,004.010	
TERADYNE INC	16,283	102.460	1,668,356.180	
TEXAS INSTRUMENTS INC	93,187	168.240	15,677,780.880	
TEXTRON INC	21,583	64.230	1,386,276.090	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	39,486	526.230	20,778,717.780	
GLOBE LIFE INC	9,737	97.350	947,896.950	
DAVITA INC	6,813	105.230	716,931.990	
TRACTOR SUPPLY CO	11,435	198.070	2,264,930.450	
BIO-TECHNE CORP	3,521	351.540	1,237,772.340	
TRIMBLE INC	22,464	61.890	1,390,296.960	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,035	354.660	1,431,053.100	
TYSON FOODS INC	28,520	92.090	2,626,406.800	
UGI CORP	17,365	37.130	644,762.450	
UNION PACIFIC CORP	64,433	222.600	14,342,785.800	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	149,739	91.690	13,729,568.910	
UNITEDHEALTH GROUP INC	94,770	488.010	46,248,707.700	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	125.440	1,015,562.240	
VF CORP	30,339	46.450	1,409,246.550	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	27.420	1,849,945.140	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,172	240.160	6,045,307.520	
VULCAN MATERIALS CO	13,508	161.540	2,182,082.320	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,239	43.310	3,128,671.090	
WALMART INC	154,684	149.180	23,075,759.120	
WASTE MANAGEMENT INC	41,050	156.950	6,442,797.500	
WATERS CORP	6,202	321.430	1,993,508.860	
WEBSTER FINANCIAL CORP	13,870	46.920	650,780.400	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,418	296.260	2,197,656.680	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,806	142.500	1,539,855.000	
VAIL RESORTS INC	4,389	241.180	1,058,539.020	
WESTERN DIGITAL CORP	31,476	57.360	1,805,463.360	
WABTEC CORP	17,222	86.680	1,492,802.960	
WHIRLPOOL CORP	5,887	188.590	1,110,229.330	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,610	102.760	1,706,843.600	
WYNN RESORTS LTD	7,294	61.650	449,675.100	
NASDAQ INC	11,841	145.780	1,726,180.980	

CME GROUP INC	37,056	200.270	7,421,205.120	
WILLIAMS COS INC	118,034	34.180	4,034,402.120	
LKQ CORP	27,005	49.760	1,343,768.800	
ALLIANT ENERGY CORP	23,323	58.030	1,353,433.690	
WEC ENERGY GROUP INC	32,677	100.660	3,289,266.820	
CARMAX INC	16,069	92.220	1,481,883.180	
TJX COMPANIES INC	123,755	56.200	6,955,031.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,020	325.840	1,635,716.800	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.680	535,153.320	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	21,528	53.590	1,153,685.520	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,928	128.180	1,657,111.040	
SIGNATURE BANK	6,557	218.010	1,429,491.570	
CBRE GROUP INC	34,088	78.540	2,677,271.520	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	21.880	345,244.520	
REGIONS FINANCIAL CORP	95,225	20.190	1,922,592.750	
DOMINO'S PIZZA INC	3,182	335.720	1,068,261.040	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,115	412.790	1,698,630.850	
T-MOBILE US INC	62,167	123.000	7,646,541.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	38,350	31.200	1,196,520.000	
MOSAIC CO/THE	37,470	57.640	2,159,770.800	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	255.520	1,071,395.360	
CELANESE CORP	11,567	140.860	1,629,327.620	
DEXCOM INC	9,864	327.430	3,229,769.520	
EXPEDIA GROUP INC	15,713	132.340	2,079,458.420	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,948	93.350	2,048,845.800	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,432	259.390	2,965,346.480	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	22.850	823,376.900	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	58,093	96.470	5,604,231.710	
LIVE NATION	16,322	88.140	1,438,621.080	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,732	1,321.080	3,609,190.560	
TRANSDIGM GROUP INC	5,375	566.240	3,043,540.000	
MASTERCARD INC	88,264	325.330	28,714,927.120	
WESTERN UNION CO	46,712	16.680	779,156.160	
OWENS CORNING	10,366	91.500	948,489.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,304	101.230	1,346,763.920	
AERCAP HOLDINGS NV	13,522	42.930	580,499.460	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,660	4.580	85,462.800	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	12,312	136.770	1,683,912.240	
DELTA AIR LINES INC	15,786	38.680	610,602.480	

INSULET CORP	6,849	190.240	1,302,953.760	
DISCOVER FINANCIAL	29,877	105.210	3,143,359.170	
TE CONNECTIVITY LTD	33,439	124.820	4,173,855.980	
MASIMO CORP	5,688	127.990	728,007.120	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,135	302.110	3,666,104.850	
VMWARE INC	22,568	97.570	2,201,959.760	
MERCADOLIBRE INC	4,449	774.440	3,445,483.560	
ULTA BEAUTY INC	5,573	380.870	2,122,588.510	
INVESCO LTD	38,530	17.670	680,825.100	
MSCI INC	7,979	388.890	3,102,953.310	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	156,665	98.880	15,491,035.200	
VISA INC	168,006	193.580	32,522,601.480	
KEURIG DR PEPPER INC	73,071	37.000	2,703,627.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	18,607	143.550	2,671,034.850	
MARATHON PETROLEUM CORP	62,915	91.720	5,770,563.800	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,542	69.360	939,273.120	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	206,007	18.520	3,815,249.640	
XYLEM INC	17,109	82.630	1,413,716.670	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	27,183	105.610	2,870,796.630	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,231	209.650	677,379.150	
SPLUNK INC	16,193	94.890	1,536,553.770	
EPAM SYSTEMS INC	5,717	319.620	1,827,267.540	
ZILLOW GROUP INC	8,060	36.090	290,885.400	
HCA HEALTHCARE INC	25,624	224.490	5,752,331.760	
VERISK ANALYTICS INC	15,533	178.870	2,778,387.710	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,554	144.030	943,972.620	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,853	223.600	1,755,930.800	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	18,087	142.670	2,580,472.290	
NXP SEMICONDUCTOR NV	27,308	178.440	4,872,839.520	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	14,445	81.680	1,179,867.600	
LEAR CORP	5,298	128.920	683,018.160	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,131	108.240	1,204,819.440	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	22,959	60.280	1,383,968.520	
DOLLAR GENERAL CORP	23,874	227.500	5,431,335.000	
FORTINET INC	14,199	261.790	3,717,156.210	
HORIZON PHARMA PLC	21,617	89.350	1,931,478.950	
TESLA INC	85,932	800.040	68,749,037.280	
GENERAC HOLDINGS INC	5,950	223.330	1,328,813.500	
ENPHASE ENERGY INC	12,955	151.650	1,964,625.750	

GENERAL MOTORS CO	134,465	38.700	5,203,795.500	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	40.190	1,576,653.700	
APTIV PLC	25,929	95.900	2,486,591.100	
PHILLIPS 66	49,021	89.570	4,390,810.970	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,158	73.010	668,625.580	
META PLATFORMS INC	237,913	197.650	47,023,504.450	
IQVIA HOLDINGS INC	19,593	203.210	3,981,493.530	
DIAMONDBACK ENERGY INC	16,293	129.840	2,115,483.120	
SERVICENOW INC	19,669	432.320	8,503,302.080	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,707	484.040	4,698,576.280	
WORKDAY INC	19,741	183.670	3,625,829.470	
ABBVIE INC	177,342	152.090	26,971,944.780	
ZOETIS INC	46,910	162.650	7,629,911.500	
NEWS CORP/NEW-CL A	40,345	17.570	708,861.650	
CDW CORP	13,687	166.550	2,279,569.850	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	33.980	1,441,193.740	
TWILIO INC	16,047	97.770	1,568,915.190	
COUPA SOFTWARE INC	8,176	67.830	554,578.080	
SNAP INC	109,361	22.890	2,503,273.290	
TRADE DESK INC A	44,139	43.750	1,931,081.250	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,562	56.530	1,049,309.860	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	38.880	343,893.600	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	38.800	770,994.800	
OKTA INC	14,677	91.570	1,343,972.890	
BLACK KNIGHT INC	17,653	69.540	1,227,589.620	
BAKER HUGHES CO	80,009	30.820	2,465,877.380	
BROADCOM INC	41,396	581.390	24,067,220.440	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	5,716	68.490	391,488.840	
MONGODB INC	6,448	250.490	1,615,159.520	
BURLINGTON STORES INC	7,274	183.000	1,331,142.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	42,679	21.900	934,670.100	
VEEVA SYSTEMS INC	14,086	164.740	2,320,527.640	
TWITTER INC	81,609	47.260	3,856,841.340	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	16,816	44.290	744,780.640	
EVERGY INC	23,678	66.450	1,573,403.100	
ALLEGION PLC	9,404	110.710	1,041,116.840	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14,074	52.330	736,492.420	
STERIS PLC	10,112	215.370	2,177,821.440	
DOCUSIGN INC	19,673	70.290	1,382,815.170	
WIX.COM LTD	5,855	64.570	378,057.350	
DROPBOX INC	30,479	20.660	629,696.140	
KKR & CO INC	53,644	51.160	2,744,427.040	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	30.390	153,469.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	21,857	90.680	1,981,992.760	
MODERNA INC	35,350	132.320	4,677,512.000	



HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	27,998	137.790	3,857,844.420	
ARAMARK	22,573	34.620	781,477.260	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	11.840	709,073.920	
CIGNA CORP	33,078	260.650	8,621,780.700	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	45.500	1,491,035.000	
DOW INC	72,010	65.810	4,738,978.100	
AMCOR PLC	155,067	12.560	1,947,641.520	
PINTEREST INC	51,253	20.220	1,036,335.660	
PELTON INTERACTIVE INC	27,064	12.900	349,125.600	
FOX CORP-A	28,163	32.420	913,044.460	
FOX CORP-B	15,511	29.900	463,778.900	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	14.210	605,147.060	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	19,884	151.880	3,019,981.920	
CHEWY INC	9,648	26.940	259,917.120	
AVANTOR INC	57,365	30.120	1,727,833.800	
LYFT INC	26,175	19.000	497,325.000	
DYNATRACE INC	20,512	31.500	646,128.000	
CLOUDFLARE INC	25,638	56.980	1,460,853.240	
TRADEWEB MARKETS INC	10,585	62.350	659,974.750	
CARRIER GLOBAL CORP	79,104	38.090	3,013,071.360	
OTIS WORLDWIDE CORP	39,046	72.770	2,841,377.420	
INMODE LTD	5,754	23.030	132,514.620	
UBER TECHNOLOGIES INC	142,940	23.670	3,383,389.800	
CORTEVA INC	71,366	52.820	3,769,552.120	
MATCH GROUP INC	29,019	70.250	2,038,584.750	
BILL.COM HOLDINGS INC	8,262	107.240	886,016.880	
BLACKSTONE INC	70,716	99.020	7,002,298.320	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	3,343	40.870	136,628.410	
CARLYLE GROUP INC	17,850	36.460	650,811.000	
10X GENOMICS INC	8,136	45.350	368,967.600	
DATADOG INC	22,060	98.310	2,168,718.600	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	80.800	1,802,486.400	
UPSTART HOLDINGS INC	4,442	33.610	149,295.620	
INGERSOLL RAND INC	42,467	42.360	1,798,902.120	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,638	283.980	1,317,099.240	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	18,691	22.790	425,967.890	
DRAFTKINGS INC	35,534	11.360	403,666.240	
ASANA INC	7,477	21.620	161,652.740	
UNITY SOFTWARE INC	5,698	48.130	274,244.740	
AON PLC	22,749	279.180	6,351,065.820	
SOFI TECHNOLOGIES INC	57,384	5.250	301,266.000	
WARNER BROS DISCOVERY INC	226,674	17.350	3,932,793.900	
BENTLEY SYSTEMS INC	17,230	31.250	538,437.500	
COINBASE GLOBAL INC	4,176	72.990	304,806.240	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	18.190	337,024.320	

IAC/INTERACTIVECORP	7,652	79.090	605,196.680	
AIRBNB INC	30,213	116.130	3,508,635.690	
ZENDESK INC	12,612	100.700	1,270,028.400	
CONSTELLATION ENERGY CORP	33,319	57.040	1,900,515.760	
ROYALTY PHARMA PLC	37,502	37.690	1,413,450.380	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	42.070	1,247,627.920	
VIATRIS INC	132,223	10.460	1,383,052.580	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23,146	50.770	1,175,122.420	
SNOWFLAKE INC	21,360	143.760	3,070,713.600	
DOORDASH INC	11,653	68.530	798,580.090	
ARISTA NETWORKS INC	23,160	105.110	2,434,347.600	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	39,016	50.440	1,967,967.040	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	181,564	7.290	1,323,601.560	
FNF GROUP	23,926	39.650	948,665.900	
MARVELL TECHNOLOGY INC	80,895	55.130	4,459,741.350	
ROBINHOOD MARKETS INC	20,748	9.270	192,333.960	
LUCID GROUP INC	44,910	15.950	716,314.500	
GRAB HOLDINGS LTD	113,116	2.750	311,069.000	
CATALENT INC	18,217	94.470	1,720,959.990	
SYNCHRONY FINANCIAL	55,391	36.160	2,002,938.560	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	45,607	39.040	1,780,497.280	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,756	116.620	438,024.720	
WAYFAIR INC	7,350	58.480	429,828.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	18,413	135.090	2,487,412.170	
HUBSPOT INC	4,444	325.160	1,445,011.040	
QORVO INC	11,596	105.250	1,220,479.000	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,603	110.620	287,943.860	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	12,494	114.810	1,434,436.140	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	5,852	233.800	1,368,197.600	
GODADDY INC	17,571	70.740	1,242,972.540	
KORNIT DIGITAL LTD	5,217	56.410	294,290.970	
ETSY INC	13,841	84.060	1,163,474.460	
TRANSUNION	20,148	82.720	1,666,642.560	
BLOCK INC	49,557	84.390	4,182,115.230	
DUPONT DE NEMOURS INC	53,576	63.320	3,392,432.320	
CARVANA CO	8,245	36.680	302,426.600	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,409	49.440	1,107,900.960	
TELADOC HEALTH INC	15,648	29.770	465,840.960	

WESTROCK CO	27,826	51.330	1,428,308.580	
KRAFT HEINZ CO	69,159	43.460	3,005,650.140	
NOVOCURE LTD	10,423	61.430	640,284.890	
FORTIVE CORP	34,812	58.410	2,033,368.920	
WASTE CONNECTIONS INC	26,208	123.360	3,233,018.880	
ALPHABET INC-CL A	30,268	2,287.900	69,250,157.200	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	122,756	16.220	1,991,102.320	
PAYPAL HOLDINGS INC	110,933	78.750	8,735,973.750	
SEA LTD ADR	30,453	64.180	1,954,473.540	
EQUITABLE HOLDINGS INC	34,012	27.680	941,452.160	
SUNRUN INC	17,098	20.460	349,825.080	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	36.450	594,900.450	
ALPHABET INC-CL C	28,814	2,291.690	66,032,755.660	
ZSCALER INC	8,108	150.290	1,218,551.320	
CABLE ONE INC	570	1,102.030	628,157.100	
LINDE PLC	51,319	299.380	15,363,882.220	
ROKU INC	12,563	83.870	1,053,658.810	
AVALARA INC	7,942	74.980	595,491.160	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,367	468.230	5,790,600.410	
VISTRA CORP	42,712	24.440	1,043,881.280	
アメリカ・ドル 小計	32,212,390		3,494,939,846.450 (455,460,560,790)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	45,963	13.590	624,637.170	
ASHTREAD GROUP	45,456	37.650	1,711,418.400	
SEVERN TRENT PLC	24,350	29.870	727,334.500	
BARCLAYS PLC	1,699,313	1.436	2,440,213.460	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.711	585,087.350	
BT GROUP PLC	908,071	1.739	1,579,135.460	
BUNZL PLC	30,228	29.680	897,167.040	
AVIVA PLC	399,688	4.060	1,622,733.280	
CRODA INTERNATIONAL	14,503	67.560	979,822.680	
DIAGEO PLC	233,896	37.140	8,686,897.440	
SCHRODERS PLC	12,178	28.240	343,906.720	
DCC PLC	11,135	60.700	675,894.500	
NATIONAL GRID PLC	374,569	11.875	4,448,006.870	
KINGFISHER PLC	225,392	2.447	551,534.220	
BAE SYSTEMS PLC	323,599	7.458	2,413,401.340	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	218,156	33.065	7,213,328.140	
HALMA PLC	35,487	21.970	779,649.390	
NEXT PLC	13,982	60.520	846,190.640	
IMPERIAL BRANDS PLC	96,595	16.765	1,619,415.170	
JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	23.090	461,245.840	
ANGLO AMERICAN PLC	125,506	32.860	4,124,127.160	
COMPASS GROUP PLC	171,388	15.775	2,703,645.700	
HSBC HOLDINGS PLC	2,032,537	4.957	10,075,285.900	

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	587,598	2.385	1,401,421.230	
UNILEVER PLC	256,459	37.005	9,490,265.290	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,616	10.915	781,688.640	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	27,635	15.805	436,771.170	
PEARSON PLC	86,953	7.568	658,060.300	
PERSIMMON PLC	35,252	20.750	731,479.000	
PRUDENTIAL PLC	283,118	8.830	2,499,931.940	
RIO TINTO PLC	115,215	51.630	5,948,550.450	
VODAFONE GROUP PLC	2,812,508	1.187	3,338,446.990	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	70,178	62.880	4,412,792.640	
RELX PLC	199,428	23.000	4,586,844.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	204,183	5.108	1,042,966.760	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	847,047	0.782	662,390.750	
NATWEST GROUP PLC	606,899	2.036	1,235,646.360	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,675	11.940	581,179.500	
SSE PLC	101,376	18.210	1,846,056.960	
BP PLC	1,968,056	4.049	7,968,658.740	
SAGE GROUP PLC(THE)	99,190	6.668	661,398.920	
SMITHS GROUP PLC	37,796	14.530	549,175.880	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,132	108.450	773,465.400	
STANDARD CHARTERED PLC	260,122	5.544	1,442,116.360	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,220,199	0.425	3,068,584.570	
TAYLOR WIMPLEY PLC	359,514	1.218	437,888.050	
TESCO PLC	733,292	2.772	2,032,685.420	
3I GROUP PLC	107,283	12.470	1,337,819.010	
SMITH & NEPHEW PLC	93,066	12.385	1,152,622.410	
GLAXOSMITHKLINE PLC	501,877	17.454	8,759,761.150	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	33,719	72.520	2,445,301.880	
WPP PLC	120,328	9.504	1,143,597.310	
ASTRAZENECA PLC	155,236	102.460	15,905,480.560	
WHITBREAD PLC	16,795	25.290	424,745.550	
INTERTEK GROUP PLC	17,114	48.690	833,280.660	
BURBERRY GROUP PLC	41,060	14.820	608,509.200	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,297	47.920	828,872.240	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.330	447,586.010	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	22.790	485,996.750	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	39.260	445,993.600	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	17.410	321,301.550	
AVEVA GROUP PLC	10,907	21.170	230,901.190	
ABRDN PLC	213,433	1.815	387,380.890	
EXPERIAN PLC	88,546	26.000	2,302,196.000	

	MONDI PLC	42,399	15.830	671,176.170	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.794	324,867.940	
	OCADO GROUP PLC	46,768	7.914	370,121.950	
	INFORMA PLC	157,970	5.314	839,452.580	
	GLENCORE PLC	1,009,707	4.555	4,599,215.380	
	ENTAIN PLC	61,865	12.340	763,414.100	
	COCA-COLA HBC AG	21,338	15.745	335,966.810	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	60,674	5.906	358,340.640	
	FERGUSON PLC	22,614	91.740	2,074,608.360	
	M&G PLC	270,401	2.067	558,918.860	
	JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.169	294,798.420	
	SHELL PLC	773,588	22.335	17,278,087.980	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.506	610,246.490	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.116	543,723.010	
イギリス・ポンド 小計		29,239,989		180,382,828.340 (28,980,305,201)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	115,189	29.170	3,360,063.130	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	152,152	32.570	4,955,590.640	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,553	697.900	1,781,738.700	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	112,553	18.750	2,110,368.750	
	ICL GROUP LTD	72,257	36.020	2,602,697.140	
	NICE LTD	6,507	652.800	4,247,769.600	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	108.300	1,888,752.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	259.200	1,210,982.400	
イスラエル・シュケル 小計		483,323		22,157,962.360 (835,528,013)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,170	77.200	1,402,724.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	289,874	25.790	7,475,850.460	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	377,160	24.650	9,296,994.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	173,655	19.110	3,318,547.050	
	TELSTRA CORP LTD	415,558	3.930	1,633,142.940	
	ASX LTD	20,036	81.510	1,633,134.360	
	BHP GROUP LTD	505,043	45.020	22,737,035.860	
	AMPOL LTD	22,528	33.010	743,649.280	
	COMPUTERSHARE LT	55,283	23.970	1,325,133.510	
	CSL LIMITED	47,584	270.650	12,878,609.600	
	REA GROUP LTD	6,134	113.160	694,123.440	
	TRANSURBAN GROUP	311,910	13.980	4,360,501.800	
	COCHLEAR LTD	6,285	210.470	1,322,803.950	
	ORIGIN ENERGY LTD	164,274	6.830	1,121,991.420	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	171,040	101.700	17,394,768.000	
RIO TINTO LIMITED	37,037	102.970	3,813,699.890		

APA GROUP	125,299	11.060	1,385,806.940		
ARISTOCRAT LEISU	65,513	31.310	2,051,212.030		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.680	1,318,187.520		
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	49,035	39.330	1,928,546.550		
ORICA LTD	43,659	15.800	689,812.200		
LEND LEASE CORP LTD	65,475	11.210	733,974.750		
BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	18.010	906,353.250		
MACQUARIE GROUP LTD	32,685	180.020	5,883,953.700		
SUNCORP GROUP LTD	127,921	11.580	1,481,325.180		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	336,435	31.780	10,691,904.300		
NEWCREST MINING LTD	86,922	25.070	2,179,134.540		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.350	602,725.650		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	147,246	12.510	1,842,047.460		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	69,215	8.730	604,246.950		
REECE LTD	31,558	16.890	533,014.620		
SANTOS LTD	290,096	7.940	2,303,362.240		
SONIC HEALTHCARE	38,814	34.780	1,349,950.920		
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	26.750	695,098.750		
TABCORP HOLDINGS LTD	227,460	5.020	1,141,849.200		
WESFARMERS LTD	116,188	48.920	5,683,916.960		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,707	30.770	2,791,054.390		
WOOLWORTHS GROUP LTD	125,505	37.750	4,737,813.750		
SEEK LTD	38,405	25.510	979,711.550		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,284	70.040	440,131.360		
MINERAL RESOURCES LTD	16,953	52.710	893,592.630		
BRAMBLES LTD	127,620	10.440	1,332,352.800		
CROWN RESORTS LTD	35,145	12.780	449,153.100		
EVOLUTION MINING LTD	224,674	3.580	804,332.920		
AURIZON HOLDINGS LTD	160,417	3.960	635,251.320		
TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	11.070	877,109.310		
XERO LTD	14,590	87.850	1,281,731.500		
IDP EDUCATION LTD	23,781	25.520	606,891.120		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	7.690	1,234,014.300		
MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.200	955,443.200		
SOUTH32 LTD(AUD)	489,406	4.470	2,187,644.820		
COLES GROUP LTD	120,872	18.590	2,247,010.480		
WISETECH GLOBAL LTD	14,823	40.960	607,150.080		
オーストラリア・ドル 小計	6,973,186		158,219,521.900 (14,323,613,318)		
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	48,157	69.670	3,355,098.190	

BARRICK GOLD CORP	181,943	27.730	5,045,279.390	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	23,190	8.640	200,361.600	
BANK OF MONTREAL	64,241	131.700	8,460,539.700	
BANK OF NOVA SCOTIA	121,569	80.910	9,836,147.790	
NATIONAL BANK OF CANADA	34,547	89.090	3,077,792.230	
BCE INC	7,697	68.970	530,862.090	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	145,719	61.400	8,947,146.600	
BAUSCH HEALTH COS INC	30,250	12.230	369,957.500	
SAPUTO INC	26,668	26.160	697,634.880	
BLACKBERRY LTD	49,855	6.760	337,019.800	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	59,247	17.660	1,046,302.020	
CGI INC	22,260	102.010	2,270,742.600	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	54.200	886,874.600	
CAE INC	32,283	28.380	916,191.540	
CAMECO CORP	45,781	28.020	1,282,783.620	
ROGERS COMM-CL B	34,794	65.010	2,261,957.940	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	46,386	137.780	6,391,063.080	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	120,687	76.080	9,181,866.960	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	171.100	1,047,816.400	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,111	39.210	357,242.310	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	70,533	143.200	10,100,325.600	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	39.260	852,452.380	
OPEN TEXT CORP	25,976	48.230	1,252,822.480	
EMPIRE CO LTD	16,169	41.890	677,319.410	
KINROSS GOLD CORP	123,889	5.900	730,945.100	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	74.410	988,611.260	
FORTIS INC	48,929	63.990	3,130,966.710	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	53,763	31.720	1,705,362.360	
TELUS CORP	31,890	31.360	1,000,070.400	
GREAT WEST LIFECO INC	26,893	33.110	890,427.230	
IMPERIAL OIL LTD	22,210	62.950	1,398,119.500	
ENBRIDGE INC	202,546	55.920	11,326,372.320	
IGM FINANCIAL INC	12,478	36.150	451,079.700	
MANULIFE FINANCIAL CORP	200,997	24.680	4,960,605.960	
LOBLAW CO LTD	16,354	115.490	1,888,723.460	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	87,382	54.920	4,799,019.440	
MAGNA INTERNATIONAL INC	26,536	74.770	1,984,096.720	
SUN LIFE FINANCIAL INC	56,487	63.590	3,592,008.330	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,529	664.470	1,680,444.630	
METRO INC	23,793	69.100	1,644,096.300	

EMERA INC	26,051	63.150	1,645,120.650	
ONEX CORP	7,000	71.120	497,840.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	28.620	553,024.260	
POWER CORP OF CANADA	59,749	35.480	2,119,894.520	
QUEBECOR INC-B	17,195	28.480	489,713.600	
ROYAL BANK OF CANADA	143,856	126.370	18,179,082.720	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	91,896	88.640	8,145,661.440	
SHAW COMM INC-B	45,342	35.410	1,605,560.220	
SUNCOR ENERGY INC	149,974	44.710	6,705,337.540	
LUNDIN MINING CORP	68,762	10.130	696,559.060	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,728	47.390	2,072,269.920	
THOMSON REUTERS CORP	17,791	122.030	2,171,035.730	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	106.470	1,029,032.550	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	183,404	91.960	16,865,831.840	
TC ENERGY CORP	96,178	69.870	6,719,956.860	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,698	113.960	1,105,184.080	
WESTON (GEORGE) LTD	8,379	154.230	1,292,293.170	
INTACT FINANCIAL CORP	18,757	173.400	3,252,463.800	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	44,998	54.230	2,440,241.540	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,038	1,889.130	3,850,046.940	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,864	183.360	3,642,263.040	
TOURMALINE OIL CORP	33,964	68.630	2,330,949.320	
KEYERA CORP	24,571	31.810	781,603.510	
PARKLAND CORP	15,665	33.720	528,223.800	
ALTAGAS LTD	26,009	28.210	733,713.890	
PEMBINA PIPELINE CORP	50,268	48.490	2,437,495.320	
DOLLARAMA INC	26,661	69.740	1,859,338.140	
CENOVUS ENERGY INC W/I	132,303	24.690	3,266,561.070	
NORTHLAND POWER INC	25,030	37.660	942,629.800	
TMX GROUP LTD	4,887	131.790	644,057.730	
IVANHOE MINES LTD	64,027	9.290	594,810.830	
NUTRIEN LTD	58,587	122.810	7,195,069.470	
TFI INTERNATIONAL INC	9,399	104.250	979,845.750	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	12,150	22.630	274,954.500	
WSP GLOBAL INC	10,501	138.620	1,455,648.620	
IA FINANCIAL CORP INC	12,011	66.110	794,047.210	
GFL ENVIRONMENTAL INC	17,254	36.850	635,809.900	
NUVEI CORP	7,929	54.470	431,892.630	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	11,764	45.060	530,085.840	
AIR CANADA	18,814	21.240	399,609.360	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	28,041	66.420	1,862,483.220	
SHOPIFY INC	10,871	436.900	4,749,539.900	



	FIRSTSERVICE CORP	3,286	154.380	507,292.680	
	CANOPY GROWTH CORP	20,287	7.090	143,834.830	
	HYDRO ONE LTD	37,626	35.080	1,319,920.080	
カナダ・ドル 小計		3,956,778		242,032,381.010 (24,220,180,368)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	4.020	579,684.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	186,010	32.450	6,036,024.500	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.930	312,442.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	72,800	9.430	686,504.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.785	597,536.500	
	KEPPEL CORP LTD	144,600	6.580	951,468.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	336,298	11.740	3,948,138.520	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	855,130	2.800	2,394,364.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	88,400	5.230	462,332.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	118,666	28.770	3,414,020.820	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.990	304,764.000	
	VENTURE CORP LTD	22,300	17.200	383,560.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,400	4.180	812,592.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.810	1,168,107.900	
シンガポール・ドル 小計		3,313,587		22,051,538.240 (2,065,567,587)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	263,212	6.264	1,648,759.960	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	57.320	1,088,105.560	
	NESTLE SA-REGISTERED	283,785	119.960	34,042,848.600	
	CIE FINANC RICHEMONT	53,471	102.150	5,462,062.650	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	69,863	352.250	24,609,241.750	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,208	181.800	765,014.400	
	SIKA INHABER	14,507	259.400	3,763,115.800	
	SGS SA-REG	650	2,381.000	1,547,650.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	220,146	83.910	18,472,450.860	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,827	158.900	608,110.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	344	2,188.000	752,672.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	17.010	358,434.720	
	SWISSCOM AG-REG	2,626	580.600	1,524,655.600	
	ABB LTD	161,519	28.190	4,553,220.610	
	ADECCO GROUP AG-REG	11,081	33.880	375,424.280	
	GEBERIT AG	3,639	514.400	1,871,901.600	
	LONZA GROUP AG-REG	7,159	524.000	3,751,316.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	9,730.000	1,138,410.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	103,000.000	1,133,000.000	
	GIVAUDAN-REG	964	3,531.000	3,403,884.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	15,579	442.100	6,887,475.900		

	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,786	381.000	1,442,466.000	
	HOLCIM LTD	53,351	45.900	2,448,810.900	
	TEMENOS GROUP	7,082	95.360	675,339.520	
	BACHEM HOLDING AG	2,630	68.950	181,338.500	
	SONOVA HOLDING AG	5,392	323.700	1,745,390.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,959	246.400	1,468,297.600	
	STRAUMANN HOLDING AG	11,500	107.500	1,236,250.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	232.100	726,473.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,026	44.400	223,154.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,661	180.400	299,644.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,073	538.200	1,653,888.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	808.000	654,480.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	93.500	782,782.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,257	983.800	2,220,436.600	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,730	45.410	941,349.300	
	SWISS RE LTD	28,439	79.840	2,270,569.760	
	ALCON INC	51,012	64.120	3,270,889.440	
	VIFOR PHARMA AG	5,556	175.500	975,078.000	
	UBS GROUP AG	361,146	16.625	6,004,052.250	
	VAT GROUP AG	2,028	265.800	539,042.400	
スイス・フラン	小計	1,739,703		147,517,487.660 (19,312,989,484)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	66,019	429.400	28,348,558.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,042	371.400	15,614,398.800	
	ERICSSON LM-B SHS	295,252	76.760	22,663,543.520	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	285.300	7,347,901.500	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	182.550	10,667,674.350	
	LUNDBERGS B	7,859	438.900	3,449,315.100	
	SKF AB-B SHS	28,236	164.850	4,654,704.600	
	SANDVIK AB	106,357	180.550	19,202,756.350	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	148,909	103.900	15,471,645.100	
	SKANSKA AB-B SHS	33,216	166.950	5,545,411.200	
	SWEDBANK AB	94,382	145.050	13,690,109.100	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,685	175.900	9,267,291.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	94.500	15,312,402.000	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	158.900	3,845,062.200	
	VOLVO AB-B SHS	141,577	154.660	21,896,298.820	
	SWEDISH MATCH AB	167,443	95.000	15,907,085.000	
	TELE2 AB-B SHS	48,914	130.550	6,385,722.700	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	239.100	3,656,317.200	
	INDUSTRIVARDEN C	9,760	236.200	2,305,312.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	152.940	4,115,156.580	
	SECURITAS AB-B SHS	15,716	101.700	1,598,317.200	
	INVESTOR AB-B SHS	177,911	169.640	30,180,822.040	

	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	120.740	9,935,332.380	
	ASSA ABLOY AB-B	94,839	230.600	21,869,873.400	
	TELIA CO AB	283,582	40.110	11,374,474.020	
	LUNDIN ENERGY AB	21,720	411.500	8,937,780.000	
	BOLIDEN AB	29,779	377.000	11,226,683.000	
	ALFA LAVAL AB	27,935	248.800	6,950,228.000	
	KINNEVIK AB-B	22,633	163.750	3,706,153.750	
	FASTIGHETS AB BALDER	12,157	403.200	4,901,702.400	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	88.660	4,235,199.540	
	NIBE INDUSTRIER AB	160,889	81.900	13,176,809.100	
	HEXAGON AB-B SHS	192,267	115.000	22,110,705.000	
	SAGAX AB	19,038	206.000	3,921,828.000	
	EPIROC AB-A	59,226	175.800	10,411,930.800	
	EPIROC AB-B	41,205	152.200	6,271,401.000	
	ESSITY AB-B	58,759	257.100	15,106,938.900	
	EQT AB	31,718	243.200	7,713,817.600	
	EMBRACER GROUP AB	51,636	67.090	3,464,259.240	
	LIFCO AB	26,835	179.000	4,803,465.000	
	EVOLUTION AB	17,322	890.100	15,418,312.200	
	NORDEA BANK ABP	321,689	92.640	29,801,268.960	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	218.800	3,399,933.200	
	SINCH AB	59,403	40.985	2,434,631.950	
	スウェーデン・クローナ 小計	3,427,130		482,298,532.900 (6,250,588,986)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,908	860.000	9,380,880.000	
	A P MOLLER A/S	557	20,040.000	11,162,280.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	19,530.000	7,011,270.000	
	DANSKE BANK A/S	72,887	103.550	7,547,448.850	
	GENMAB A/S	6,511	2,080.000	13,542,880.000	
	NOVOZYMES-B SHS	20,453	432.700	8,850,013.100	
	ROCKWOOL AS	873	1,762.500	1,538,662.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	168,183	760.300	127,869,534.900	
	GN STORE NORD A/S	15,343	221.800	3,403,077.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	102,267	151.700	15,513,903.900	
	COLOPLAST-B	12,609	846.400	10,672,257.600	
	DSV A/S	20,770	1,042.000	21,642,340.000	
	DEMANT A/S	11,367	283.000	3,216,861.000	
	TRYG A/S	37,118	155.500	5,771,849.000	
	PANDORA A/S	9,912	520.200	5,156,222.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,917	525.400	5,210,391.800	
	AMBU A/S B	15,501	85.300	1,322,235.300	
	ORSTED A/S	17,702	709.600	12,561,339.200	
	デンマーク・クローネ 小計	533,237		271,373,446.950 (5,006,840,096)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	112,327	7.330	823,356.910	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	51,768	8.870	459,182.160	

	FISHER & PAYKEL	60,887	21.260	1,294,457.620	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	4.750	1,040,430.500	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.790	363,808.860	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	4.570	603,957.490	
ニュージーランド・ドル 小計		639,011		4,585,193.540 (376,077,574)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	243.600	11,084,774.400	
	NORSK HYDRO ASA	114,939	70.340	8,084,809.260	
	TELENOR ASA	71,764	128.450	9,218,085.800	
	SCHIBSTED ASA	8,211	179.100	1,470,590.100	
	ORKLA ASA	72,906	75.120	5,476,698.720	
	EQUINOR ASA	100,263	321.000	32,184,423.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,042	474.700	7,615,137.400	
	AKER BP ASA	15,719	341.600	5,369,610.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,304	195.200	3,182,540.800	
	ADEVINTA ASA	24,382	58.700	1,431,223.400	
	DNB BANK ASA	94,638	176.850	16,736,730.300	
	SCHIBSTED ASA	8,058	164.200	1,323,123.600	
ノルウェー・クローネ 小計		588,730		103,177,747.180 (1,382,581,812)	
ユーロ	CRH PLC	78,909	35.830	2,827,309.470	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	16,242	95.840	1,556,633.280	
	KERRY GROUP PLC-A	14,597	96.060	1,402,187.820	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	76.100	1,328,021.100	
	UMICORE	18,962	38.760	734,967.120	
	AIR LIQUIDE	47,137	157.640	7,430,676.680	
	AIRBUS SE	57,907	104.600	6,057,072.200	
	AXA SA	189,797	22.470	4,264,738.590	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	65,548	25.560	1,675,406.880	
	ADIDAS AG	19,278	173.360	3,342,034.080	
	ASSICURAZIONI GENERALI	118,133	17.710	2,092,135.430	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	154.100	480,792.000	
	DANONE	66,823	54.840	3,664,573.320	
	SAFRAN SA	34,915	92.660	3,235,223.900	
	INTESA SANPAOLO	1,698,613	1.861	3,161,118.790	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,364	78.210	2,687,608.440	
	ACCOR SA	18,305	29.040	531,577.200	
	BOUYGUES	21,922	30.900	677,389.800	
	BNP PARIBAS	109,100	50.920	5,555,372.000	
	THALES SA	11,069	116.800	1,292,859.200	
	CAPGEMINI SA	16,708	176.700	2,952,303.600	
	UNICREDIT SPA	216,987	8.459	1,835,493.030	
	KONINKLIJKE DSM NV	17,667	142.300	2,514,014.100	
COMMERZBANK AG	112,781	6.142	692,700.900		
EIFFAGE	8,993	90.920	817,643.560		

FRESENIUS SE & CO KGAA	41,425	33.240	1,376,967.000	
UNITED INTERNET	10,010	30.600	306,306.000	
FUCHS PETROLUB SE PEF	5,955	29.000	172,695.000	
PUBLICIS GROUPE	21,947	52.940	1,161,874.180	
FAURECIA	11,287	20.200	227,997.400	
IBERDROLA SA	602,182	10.555	6,356,031.010	
ENI SPA	259,039	13.258	3,434,339.060	
JERONIMO MARTINS	34,644	19.320	669,322.080	
KESKO OYJ-B	23,725	23.490	557,300.250	
KBC GROUPE	23,436	53.960	1,264,606.560	
HANNOVER RUECK SE	5,437	140.600	764,442.200	
WARTSILA OYJ	50,956	7.078	360,666.560	
L'OREAL	25,098	309.000	7,755,282.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	27,806	549.500	15,279,397.000	
GEA GROUP AG	17,490	33.880	592,561.200	
BOLLORE	114,808	4.600	528,116.800	
MEDIOBANCA SPA	60,688	9.778	593,407.260	
MICHELIN(CGDE) -B	16,826	115.350	1,940,879.100	
CONTINENTAL AG	8,829	61.800	545,632.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	96,347	37.335	3,597,115.240	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	12.825	285,882.070	
OMV AG	14,047	45.510	639,278.970	
VERBUND AG	7,320	83.300	609,756.000	
PERNOD-RICARD	21,563	177.950	3,837,135.850	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	16,854	72.340	1,219,218.360	
RENAULT SA	19,671	22.375	440,138.620	
REPSOL SA	138,798	13.645	1,893,898.710	
REMY COINTREAU	1,986	166.600	330,867.600	
MERCK KGAA	12,911	165.100	2,131,606.100	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	52,550	51.900	2,727,345.000	
RWE AG	61,679	39.490	2,435,703.710	
SEB SA	2,596	105.600	274,137.600	
SOCIETE GENERALE-A	81,367	22.005	1,790,480.830	
VINCI S.A.	55,081	88.860	4,894,497.660	
SODEXO	9,822	67.880	666,717.360	
SOFINA	1,449	275.000	398,475.000	
SOLVAY SA	6,845	92.200	631,109.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,592	123.960	6,643,264.320	
VIVENDI SE	65,220	10.845	707,310.900	
SAP SE	104,757	91.660	9,602,026.620	
TELEFONICA S.A	563,665	4.619	2,603,568.630	
TOTALENERGIES SE	251,982	48.145	12,131,673.390	
VALEO	26,570	17.075	453,682.750	
E.ON SE	236,021	9.854	2,325,750.930	
VOEST-ALPINE AG	10,593	23.700	251,054.100	

HENKEL AG & CO KGAA	10,815	62.100	671,611.500	
SIEMENS AG-REG	76,397	114.720	8,764,263.840	
UPM-KYMMENE OYJ	53,122	31.520	1,674,405.440	
ING GROEP NV-CVA	390,337	8.733	3,408,813.020	
PUMA AG	10,980	62.720	688,665.600	
BAYER AG	100,889	61.890	6,244,020.210	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	17.710	1,036,654.850	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,131	63.240	1,083,364.440	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	84,403	61.130	5,159,555.390	
BASF SE	93,645	48.510	4,542,718.950	
BEIERSDORF AG	10,944	90.640	991,964.160	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,634	54.140	792,284.760	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	20,106	58.420	1,174,592.520	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	263.500	1,367,038.000	
ORANGE	204,477	11.722	2,396,879.390	
SAMPO OYJ-A SHS	52,583	43.830	2,304,712.890	
RANDSTAD NV	11,897	48.150	572,840.550	
ALLIANZ SE	42,042	193.720	8,144,376.240	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	281,622	4.409	1,241,671.390	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	106,193	27.685	2,939,953.200	
HERMES INTL	3,086	1,016.500	3,136,919.000	
ENDESA S.A.	30,147	19.045	574,149.610	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	6.675	482,882.850	
ERSTE GROUP BANK AG	32,089	27.440	880,522.160	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	14,042	217.000	3,047,114.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	67,059	25.955	1,740,516.340	
DASSAULT SYSTEMES SA	67,755	38.075	2,579,771.620	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	23.900	563,346.900	
HEINEKEN NV	26,335	92.040	2,423,873.400	
AKZO NOBEL	19,812	79.780	1,580,601.360	
ASML HOLDING NV	41,432	488.750	20,249,890.000	
AEGON NV	196,332	4.816	945,534.910	
VOLKSWAGEN AG	3,315	189.800	629,187.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	18,886	142.800	2,696,920.800	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	650,942	4.640	3,020,370.880	
KERING	7,322	442.900	3,242,913.800	
CNP ASSURANCES	14,608	20.900	305,307.200	
FORTUM OYJ	43,311	15.070	652,696.770	
AGEAS	18,136	43.770	793,812.720	
UCB SA	13,322	99.900	1,330,867.800	
NEMETSCHKE SE	5,104	62.480	318,897.920	
CARREFOUR SA	64,831	20.670	1,340,056.770	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	27.620	488,238.740	

NOKIA OYJ	527,868	4.531	2,391,769.900	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	92,210	23.475	2,164,629.750	
WOLTERS KLUWER-CVA	26,126	92.700	2,421,880.200	
SANOFI	113,545	97.790	11,103,565.550	
STMICROELECTRONICS NV	65,537	33.430	2,190,901.910	
ELISA OYJ	14,618	54.180	792,003.240	
BANCO SANTANDER SA	1,710,741	2.633	4,504,381.050	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	18.980	930,228.780	
QIAGEN N.V.	22,039	42.100	927,841.900	
DEUTSCHE BANK AG-REG	195,467	9.101	1,778,945.160	
BMW VORZUG	3,437	71.150	244,542.550	
ENEL SPA	839,071	5.842	4,901,852.780	
COLRUYT NV	5,030	34.790	174,993.700	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	317,373	17.280	5,484,205.440	
SARTORIUS AG	2,847	317.500	903,922.500	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	43.850	483,753.200	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	126,222	25.760	3,251,478.720	
RATIONAL AG	516	518.000	267,288.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	106.700	519,202.200	
BECHTLE AG	8,139	39.860	324,420.540	
KONINKLIJKE KPN NV	358,749	3.325	1,192,840.420	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	83.380	1,232,273.020	
TELEPERFORMANCE	5,991	307.100	1,839,836.100	
DEUTSCHE BOERSE AG	19,242	161.300	3,103,734.600	
EURAZEO	3,311	67.800	224,485.800	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	82.560	934,414.080	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	72.000	781,416.000	
INDITEX	109,459	19.710	2,157,436.890	
ESSILORLUXOTTICA	29,399	144.100	4,236,395.900	
SNAM SPA	210,122	5.210	1,094,735.620	
CREDIT AGRICOLE SA	118,106	9.950	1,175,154.700	
ORPEA	5,291	32.520	172,063.320	
ENAGAS	24,864	20.660	513,690.240	
WENDEL	2,354	87.750	206,563.500	
TENARIS SA	55,855	14.120	788,672.600	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.260	236,154.360	
ATLANTIA SPA	48,155	22.890	1,102,267.950	
PROXIMUS	14,640	16.470	241,120.800	
TERNA SPA	122,204	7.648	934,616.190	
BIOMERIEUX	4,870	89.100	433,917.000	
GRIFOLS SA	31,982	18.445	589,907.990	
FERROVIAL SA	46,452	23.150	1,075,363.800	
LANXESS AG	7,376	35.260	260,077.760	
NESTE OYJ	45,715	39.000	1,782,885.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	20,487	11.300	231,503.100	
RECORDATI SPA	10,908	42.410	462,608.280	

DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.818	567,234.950	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	174.450	1,048,095.600	
KONE OYJ	33,662	42.680	1,436,694.160	
ELIA GROUP	2,918	148.500	433,323.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	287.700	894,459.300	
ENGIE	186,382	10.990	2,048,338.180	
ALSTOM	30,164	23.040	694,978.560	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	8.244	535,958.920	
IPSEN SA	3,873	93.900	363,674.700	
ARKEMA SA	6,392	115.050	735,399.600	
LEGRAND SA	27,117	79.360	2,152,005.120	
AMPLIFON SPA	12,300	34.330	422,259.000	
ADP	3,975	129.200	513,570.000	
ORION OYJ	13,559	35.840	485,954.560	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.455	621,089.730	
SYMRISE AG	11,861	99.940	1,185,388.340	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,552	38.320	979,152.640	
PRYSMIAN SPA	21,062	28.350	597,107.700	
DIASORIN SPA	2,429	111.350	270,469.150	
CAIXABANK	405,557	2.953	1,197,609.820	
BUREAU VERITAS SA	31,295	25.200	788,634.000	
GETLINK	44,292	17.075	756,285.900	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	20.560	607,774.160	
AMADEUS IT GROUP SA	45,939	57.080	2,622,198.120	
BRENTAG SE	13,372	67.160	898,063.520	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	25.320	625,074.840	
EDENRED	26,160	44.560	1,165,689.600	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.878	303,554.170	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	94.660	777,063.940	
KION GROUP AG	7,874	46.590	366,849.660	
VONOVIA SE	70,094	32.840	2,301,886.960	
KNORR-BREMSE AG	7,195	66.100	475,589.500	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	30,120	50.840	1,531,300.800	
FERRARI NV	12,640	179.450	2,268,248.000	
CNH INDUSTRIAL NV	112,387	12.895	1,449,230.360	
AROUNDTOWN SA	113,225	4.500	509,512.500	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,858	32.410	287,087.780	
MONCLER SPA	16,554	42.860	709,504.440	
NEXI SPA	58,847	9.184	540,450.840	
PROSUS NV	90,992	40.390	3,675,166.880	
JDE PEET'S BV	7,893	27.920	220,372.560	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	16.685	775,985.980	
INPOST SA	22,392	5.608	125,574.330	
EURONEXT NV	10,081	72.520	731,074.120	
IMCD NV	5,720	127.400	728,728.000	



WORLDLINE SA	24,912	35.250	878,148.000	
NN GROUP NV	22,329	45.660	1,019,542.140	
FINECOBANK SPA	53,601	11.775	631,151.770	
ARGENX SE	4,531	284.400	1,288,616.400	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	70,972	19.502	1,384,095.940	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	47,088	25.785	1,214,164.080	
EUROAPI SASU	5,320	14.500	77,140.000	
ZALANDO SE	19,788	32.530	643,703.640	
STELLANTIS NV	204,449	12.848	2,626,760.750	
AENA SME SA	7,394	128.900	953,086.600	
CELLNEX TELECOM SAU	51,290	40.160	2,059,806.400	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	17.838	404,387.460	
ABN AMRO BANK NV	52,835	10.990	580,656.650	
EXOR NV	10,514	61.860	650,396.040	
SCOUT24 SE	10,048	58.840	591,224.320	
COVESTRO AG	20,258	38.430	778,514.940	
HELLOFRESH SE	17,856	33.720	602,104.320	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	87,033	51.860	4,513,531.380	
POSTE ITALIANE SPA	58,889	8.976	528,587.660	
AMUNDI SA	6,292	54.750	344,487.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.275	430,306.720	
ADYEN NV	1,913	1,378.400	2,636,879.200	
UNIPER SE	11,072	21.500	238,048.000	
DELIVERY HERO SE	17,246	25.220	434,944.120	
ユーロ 小計	18,585,013		419,144,039.170 (57,535,902,257)	
香港・ドル				
HANG LUNG PROPERTIES LTD	172,000	14.340	2,466,480.000	
CLP HOLDINGS LTD	171,296	75.950	13,009,931.200	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	57,314	53.000	3,037,642.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	123,491	325.600	40,208,669.600	
MTR CORP	192,441	42.450	8,169,120.450	
HANG SENG BANK LTD	79,896	139.800	11,169,460.800	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	129,972	31.350	4,074,622.200	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	54.300	8,216,676.000	
HONG KONG & CHINA GAS	1,245,406	8.410	10,473,864.460	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	213,904	41.500	8,877,016.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	372,495	29.300	10,914,103.500	
NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	28.550	4,941,034.300	
SINO LAND CO	217,200	10.480	2,276,256.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	146,065	90.250	13,182,366.250	
SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	43.850	2,324,927.000	

TECHTRONIC INDUSTRIES CO	137,656	99.600	13,710,537.600	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	17.080	3,040,240.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	233,000	12.300	2,865,900.000	
AIA GROUP LTD	1,205,716	73.300	88,378,982.800	
HKT TRUST / HKT LTD	463,136	11.240	5,205,648.640	
SANDS CHINA LTD	260,600	15.360	4,002,816.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	26.250	3,675,000.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	114,400	18.580	2,125,552.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	160,135	36.200	5,796,887.000	
ESR CAYMAN LTD	216,400	23.650	5,117,860.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	7.820	1,927,630.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	161,300	19.300	3,113,090.000	
WH GROUP LTD	931,500	5.260	4,899,690.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	249,445	54.500	13,594,752.500	
CK ASSET HOLDINGS LTD	195,195	52.750	10,296,536.250	
香港・ドル 小計	8,391,869		311,093,292.550 (5,164,148,656)	
合計	110,083,946		620,914,884,142 (620,914,884,142)	

## (2) 株式以外の有価証券

2022年5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	108,264.000	1,148,681.040	
		GOODMAN GROUP	168,343.000	3,235,552.460	
		GPT GROUP	219,223.000	1,028,155.870	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	943,508.360	
		SCENTRE GROUP	499,267.000	1,372,984.250	
		STOCKLAND	259,328.000	995,819.520	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	684,218.280	
	オーストラリア・ドル 小計		2,073,791.000	9,408,919.780 (851,789,508)	
シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	309,478.000	854,159.280	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	568,831.000	1,268,493.130	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	6,264.000	8,017.920	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	206,400.000	377,712.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	235,000.000	390,100.000	

	シンガポール・ドル 小計		1,325,973.000	2,898,482.330 (271,500,840)	
投資信託受益証券 合計			3,399,764	1,123,290,348 (1,123,290,348)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	38,456.000	470,316.880	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,696.000	2,397,799.360	
		AMERICAN TOWER CORP	45,676.000	10,265,681.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	157,479.000	1,042,510.980	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,446.000	2,690,410.140	
		BOSTON PROPERTIES INC	15,660.000	1,726,828.200	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	9,000.000	1,274,040.000	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	44,561.000	7,588,292.690	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	28,895.000	3,658,107.000	
		DUKE REALTY TRUST	35,256.000	1,747,992.480	
		EQUINIX INC	9,248.000	5,826,702.400	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,531.000	1,135,514.390	
		EQUITY RESIDENTIAL	35,964.000	2,617,819.560	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,099.000	1,747,241.520	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,528.000	2,195,907.840	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	53,250.000	1,561,822.500	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,534,942.500	
		INVITATION HOMES INC	63,432.000	2,274,037.200	
		IRON MOUNTAIN INC	30,120.000	1,551,180.000	
		KIMCO REALTY	59,720.000	1,357,435.600	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	57,601.000	1,011,473.560	
		MID AMERICA	12,263.000	2,137,195.640	
		PROLOGIS INC	74,013.000	9,281,970.330	
		PUBLIC STORAGE	15,589.000	4,869,535.930	
		REALTY INCOME CORP	55,895.000	3,549,332.500	
		REGENCY CENTERS CORP	15,613.000	1,030,926.390	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	11,090.000	3,497,120.600	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	33,617.000	4,002,776.190	
		SUN COMMUNITIES INC	11,536.000	1,802,846.080	
		UDR INC	29,919.000	1,392,430.260	
		VENTAS INC	42,297.000	2,224,822.200	
		VICI PROPERTIES INC	93,540.000	2,495,647.200	
		VORNADO REALTY TRUST	16,223.000	548,499.630	
WELLTOWER INC	44,395.000	3,809,091.000			
WEYERHAEUSER CO	76,481.000	2,961,344.320			
WP CAREY INC	16,611.000	1,262,436.000			
	アメリカ・ドル 小計		1,375,415.000	100,542,030.070 (13,102,637,359)	

イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	78,577.000	377,169.600	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	538,873.080	
	SEGRO PLC	126,044.000	1,380,181.800	
イギリス・ポンド 小計		281,713.000	2,296,224.480 (368,911,425)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	403,741.380	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	302,759.760	
カナダ・ドル 小計		23,146.000	706,501.140 (70,699,569)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	327,516.900	
	GECINA SA	5,045.000	515,094.500	
	KLEPIERRE	17,716.000	386,740.280	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	930,260.550	
ユーロ 小計		41,362.000	2,159,612.230 (296,449,971)	
香港・ドル	LINK REIT	211,516.000	14,044,662.400	
香港・ドル 小計		211,516.000	14,044,662.400 (233,141,396)	
投資証券 合計		1,933,152	14,071,839,720 (14,071,839,720)	
合計			15,195,130,068 (15,195,130,068)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 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	68.29	-	-	73.66
	投資証券 36銘柄	-	-	1.96	
イギリス・ポンド	株式 78銘柄	4.35	-	-	4.61
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.13	-	-	0.13
オーストラリア・ドル	株式 53銘柄	2.15	-	-	2.39
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.63	-	-	3.82
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.31	-	-	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	2.90	-	-	3.04
スウェーデン・クローナ	株式 44銘柄	0.94	-	-	0.98
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.75	-	-	0.79

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	0.21	-	-	0.22
ユーロ	株式	228銘柄	8.63	-	-	9.09
	投資証券	4銘柄	-	-	0.04	-
香港・ドル	株式	30銘柄	0.77	-	-	0.85
	投資証券	1銘柄	-	-	0.03	-

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2022年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,487,786,438
国債証券	587,673,211,350
地方債証券	30,670,760,306
特殊債券	28,116,519,411
社債券	27,893,723,560
未収利息	701,777,060
前払費用	306,916,204
流動資産合計	677,850,694,329
資産合計	
677,850,694,329	
負債の部	
流動負債	
未払金	16,674,054,000
未払解約金	1,694,179,000
流動負債合計	18,368,233,000
負債合計	
18,368,233,000	
純資産の部	
元本等	
元本	515,463,932,533
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	144,018,528,796
元本等合計	659,482,461,329
純資産合計	659,482,461,329
負債純資産合計	677,850,694,329

## 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11月12日 至 2022年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	386,492,682,761円
同期中追加設定元本額	548,688,811,628円
同期中一部解約元本額	419,717,561,856円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	25,032,273,206円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	147,584,576円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	176,881,974円
M I T O 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	16,150,703,546円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,782,640,084円
たわらノーロード バランス(堅実型)	955,403,702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)	211,005,244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)	78,254,123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)	1,342,675,364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)	1,285,840,371円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	346,346,006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)	24,088,288円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	18,237,847円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	14,168,059円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	106,597,142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
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,171,326,738円
O n eグローバルバランス	12,283,551円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	9,132,808,208円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	12,736,994,476円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	5,278,074,227円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,237,491,074円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,355,077,472円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	387,965,709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
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,359,227,595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>	2,454,388,893円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,925,143,614円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,284,098,876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>	392,919,537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 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)	1,881,058,075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(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(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(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



しあわせの一步・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)	3,472,544,539円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,286,663,916円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,374,317,140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)	98,163,768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)	2,089,972,693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)	170,811,608円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	7,689,090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)	2,177,388,425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)	49,621,482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)	539,512,398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)	918,663,467円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	285,106,829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)	40,713,425,251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]	13,552,019,925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	515,463,932,533円
2. 受益権の総数	515,463,932,533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11月12日 至 2022年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年5月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,298,259,300
地方債証券	143,185,538
特殊債券	160,278,044
社債券	137,990,480
合計	3,739,713,362

(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11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

2022年5月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2794円 (12,794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11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 2 6 回 利付国庫債券(2年)	2,100,000,000	2,101,911,000	
	4 2 7 回 利付国庫債券(2年)	2,400,000,000	2,402,184,000	
	4 2 8 回 利付国庫債券(2年)	2,800,000,000	2,802,744,000	
	4 2 9 回 利付国庫債券(2年)	2,830,000,000	2,832,943,200	
	4 3 0 回 利付国庫債券(2年)	3,340,000,000	3,343,674,000	
	4 3 1 回 利付国庫債券(2年)	4,300,000,000	4,304,988,000	
	4 3 2 回 利付国庫債券(2年)	3,400,000,000	3,403,876,000	
	4 3 3 回 利付国庫債券(2年)	2,800,000,000	2,803,136,000	
	4 3 4 回 利付国庫債券(2年)	4,600,000,000	4,605,382,000	
	4 3 5 回 利付国庫債券(2年)	3,720,000,000	3,724,538,400	
	1 3 7 回 利付国庫債券(5年)	5,700,000,000	5,713,167,000	
	1 3 8 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,013,250,000	
	1 3 9 回 利付国庫債券(5年)	4,050,000,000	4,061,623,500	
	1 4 0 回 利付国庫債券(5年)	3,490,000,000	3,500,644,500	
	1 4 1 回 利付国庫債券(5年)	6,610,000,000	6,631,813,000	
	1 4 2 回 利付国庫債券(5年)	7,730,000,000	7,758,214,500	
	1 4 3 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,518,000,000	
1 4 4 回 利付国庫債券(5年)	5,200,000,000	5,221,788,000		
1 4 5 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	3,817,138,000	
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)	6,250,000,000	6,251,312,500	
150回 利付国庫債券(5年)	5,540,000,000	5,540,000,000	
151回 利付国庫債券(5年)	2,640,000,000	2,638,706,400	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	146,918,200	
2回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	813,285,900	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	701,028,000	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	936,547,200	
5回 利付国庫債券(40年)	1,010,000,000	1,265,479,500	
6回 利付国庫債券(40年)	1,420,000,000	1,748,133,600	
7回 利付国庫債券(40年)	1,390,000,000	1,642,924,400	
8回 利付国庫債券(40年)	1,650,000,000	1,817,706,000	
9回 利付国庫債券(40年)	2,730,000,000	2,233,767,900	
10回 利付国庫債券(40年)	2,280,000,000	2,184,354,000	
11回 利付国庫債券(40年)	1,880,000,000	1,741,688,400	
12回 利付国庫債券(40年)	1,960,000,000	1,630,230,000	
13回 利付国庫債券(40年)	2,130,000,000	1,762,532,400	
14回 利付国庫債券(40年)	2,400,000,000	2,121,336,000	
329回 利付国庫債券(10年)	2,050,000,000	2,069,864,500	
330回 利付国庫債券(10年)	3,860,000,000	3,905,663,800	
331回 利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	1,967,764,500	
332回 利付国庫債券(10年)	8,110,000,000	8,196,777,000	
333回 利付国庫債券(10年)	6,630,000,000	6,710,620,800	
334回 利付国庫債券(10年)	7,720,000,000	7,824,992,000	
335回 利付国庫債券(10年)	5,510,000,000	5,580,252,500	
336回 利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,129,589,000	
337回 利付国庫債券(10年)	6,900,000,000	6,961,203,000	
338回 利付国庫債券(10年)	4,330,000,000	4,384,428,100	

339回 利付国庫債券(10年)	6,780,000,000	6,871,665,600	
340回 利付国庫債券(10年)	6,540,000,000	6,634,503,000	
341回 利付国庫債券(10年)	7,120,000,000	7,203,517,600	
342回 利付国庫債券(10年)	4,480,000,000	4,499,846,400	
343回 利付国庫債券(10年)	6,550,000,000	6,579,540,500	
344回 利付国庫債券(10年)	6,630,000,000	6,658,840,500	
345回 利付国庫債券(10年)	6,690,000,000	6,719,235,300	
346回 利付国庫債券(10年)	5,970,000,000	5,994,596,400	
347回 利付国庫債券(10年)	6,410,000,000	6,432,819,600	
348回 利付国庫債券(10年)	5,690,000,000	5,706,728,600	
349回 利付国庫債券(10年)	5,530,000,000	5,542,331,900	
350回 利付国庫債券(10年)	7,260,000,000	7,270,527,000	
351回 利付国庫債券(10年)	6,100,000,000	6,103,660,000	
352回 利付国庫債券(10年)	5,340,000,000	5,338,291,200	
353回 利付国庫債券(10年)	4,740,000,000	4,733,743,200	
354回 利付国庫債券(10年)	5,660,000,000	5,646,529,200	
355回 利付国庫債券(10年)	5,210,000,000	5,189,837,300	
356回 利付国庫債券(10年)	5,040,000,000	5,012,532,000	
357回 利付国庫債券(10年)	5,110,000,000	5,075,507,500	
358回 利付国庫債券(10年)	5,050,000,000	5,010,913,000	
359回 利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,451,765,000	
360回 利付国庫債券(10年)	6,040,000,000	5,980,506,000	
361回 利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,439,610,000	
362回 利付国庫債券(10年)	5,840,000,000	5,771,555,200	
363回 利付国庫債券(10年)	5,700,000,000	5,628,864,000	

364回 利付国庫債券(10年)	6,000,000,000	5,920,380,000	
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	131,121,100	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	117,028,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	245,164,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	240,568,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	231,098,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	287,155,000	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	274,721,200	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	177,805,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	419,573,600	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	324,737,400	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	300,592,800	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	335,620,800	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	493,520,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	346,253,600	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	417,351,000	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	385,020,000	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	368,491,400	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	445,763,500	
24回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	344,420,100	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	412,549,500	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	785,056,400	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	797,431,600	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	992,583,900	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,098,779,000	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,112,390,400	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	900,403,200	

32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,230,968,800	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,440,095,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,508,604,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,788,149,600	
36回 利付国庫債券(30年)	1,770,000,000	2,169,205,800	
37回 利付国庫債券(30年)	2,760,000,000	3,335,294,400	
38回 利付国庫債券(30年)	1,850,000,000	2,202,295,500	
39回 利付国庫債券(30年)	1,680,000,000	2,032,044,000	
40回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,810,487,200	
41回 利付国庫債券(30年)	1,680,000,000	1,969,447,200	
42回 利付国庫債券(30年)	1,760,000,000	2,064,251,200	
43回 利付国庫債券(30年)	1,820,000,000	2,135,715,400	
44回 利付国庫債券(30年)	1,850,000,000	2,171,955,500	
45回 利付国庫債券(30年)	2,040,000,000	2,311,177,200	
46回 利付国庫債券(30年)	2,090,000,000	2,368,095,400	
47回 利付国庫債券(30年)	1,860,000,000	2,145,993,600	
48回 利付国庫債券(30年)	2,040,000,000	2,267,500,800	
49回 利付国庫債券(30年)	1,860,000,000	2,067,241,200	
50回 利付国庫債券(30年)	1,860,000,000	1,827,059,400	
51回 利付国庫債券(30年)	1,550,000,000	1,352,375,000	
52回 利付国庫債券(30年)	1,510,000,000	1,379,671,900	
53回 利付国庫債券(30年)	1,760,000,000	1,643,681,600	
54回 利付国庫債券(30年)	1,750,000,000	1,707,510,000	
55回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	1,578,738,600	
56回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,294,515,600	

57回 利付国庫債券(30年)	1,670,000,000	1,621,737,000	
58回 利付国庫債券(30年)	2,170,000,000	2,102,426,200	
59回 利付国庫債券(30年)	1,930,000,000	1,821,437,500	
60回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,451,433,900	
61回 利付国庫債券(30年)	1,440,000,000	1,352,044,800	
62回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,307,476,800	
63回 利付国庫債券(30年)	1,710,000,000	1,477,012,500	
64回 利付国庫債券(30年)	1,670,000,000	1,439,289,500	
65回 利付国庫債券(30年)	1,610,000,000	1,387,481,900	
66回 利付国庫債券(30年)	1,530,000,000	1,315,662,300	
67回 利付国庫債券(30年)	1,950,000,000	1,765,296,000	
68回 利付国庫債券(30年)	1,890,000,000	1,709,750,700	
69回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	1,735,547,000	
70回 利付国庫債券(30年)	1,810,000,000	1,675,263,600	
71回 利付国庫債券(30年)	1,940,000,000	1,794,616,400	
72回 利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,662,336,000	
73回 利付国庫債券(30年)	1,910,000,000	1,760,981,800	
74回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	706,748,200	
64回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,803,700	
65回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	61,897,800	
67回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,814,500	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,578,000	
71回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,893,600	
72回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	483,239,200	
73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	400,238,800	



74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,234,800	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	191,008,800	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	73,880,800	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,332,000	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	265,045,000	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,164,500	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	95,976,000	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	427,300,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	150,025,400	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	75,371,800	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	182,432,100	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	638,126,300	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	130,714,800	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	130,251,600	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	645,991,000	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,907,900	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	515,068,300	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	121,027,500	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,271,951,600	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	405,627,300	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	737,763,800	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	613,657,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	132,666,000	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	736,032,000	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	177,577,600	

99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	835,515,000	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	933,077,700	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	261,245,500	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	570,320,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	181,529,600	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	123,465,100	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	720,876,800	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	566,345,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	678,108,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	770,771,400	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	392,220,500	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	499,061,200	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	526,493,000	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	841,764,800	
113回 利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,334,595,600	
114回 利付国庫債券(20年)	820,000,000	938,162,000	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	414,576,000	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	612,680,000	
117回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,228,638,200	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	634,692,450	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	529,990,800	
120回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	744,825,600	
121回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	900,039,100	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	644,709,900	
123回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,217,275,500	

124回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	690,516,000	
125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	703,182,000	
126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	588,846,000	
127回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	618,791,400	
128回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,574,773,900	
129回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	866,818,000	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,040,885,300	
131回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	896,389,300	
132回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	944,249,500	
133回 利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,181,451,200	
134回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,035,162,000	
135回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	844,007,000	
136回 利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,651,143,200	
137回 利付国庫債券(20年)	1,480,000,000	1,690,707,600	
138回 利付国庫債券(20年)	1,420,000,000	1,594,177,200	
139回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,812,032,000	
140回 利付国庫債券(20年)	2,590,000,000	2,961,716,800	
141回 利付国庫債券(20年)	1,880,000,000	2,152,806,800	
142回 利付国庫債券(20年)	1,610,000,000	1,860,194,000	
143回 利付国庫債券(20年)	2,320,000,000	2,635,659,200	
144回 利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,744,602,500	
145回 利付国庫債券(20年)	2,850,000,000	3,273,567,000	
146回 利付国庫債券(20年)	3,080,000,000	3,541,969,200	
147回 利付国庫債券(20年)	3,190,000,000	3,636,823,300	
148回 利付国庫債券(20年)	3,100,000,000	3,501,791,000	

149回 利付国庫債券(20年)	3,160,000,000	3,573,770,400	
150回 利付国庫債券(20年)	3,450,000,000	3,863,103,000	
151回 利付国庫債券(20年)	3,160,000,000	3,463,423,200	
152回 利付国庫債券(20年)	3,040,000,000	3,333,238,400	
153回 利付国庫債券(20年)	3,220,000,000	3,572,010,400	
154回 利付国庫債券(20年)	3,090,000,000	3,388,432,200	
155回 利付国庫債券(20年)	2,860,000,000	3,061,687,200	
156回 利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,671,920,000	
157回 利付国庫債券(20年)	2,630,000,000	2,526,009,800	
158回 利付国庫債券(20年)	2,990,000,000	2,987,996,700	
159回 利付国庫債券(20年)	2,680,000,000	2,710,927,200	
160回 利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,355,453,000	
161回 利付国庫債券(20年)	2,790,000,000	2,813,380,200	
162回 利付国庫債券(20年)	2,630,000,000	2,646,726,800	
163回 利付国庫債券(20年)	2,670,000,000	2,681,454,300	
164回 利付国庫債券(20年)	3,230,000,000	3,187,848,500	
165回 利付国庫債券(20年)	3,090,000,000	3,042,352,200	
166回 利付国庫債券(20年)	2,640,000,000	2,675,323,200	
167回 利付国庫債券(20年)	2,970,000,000	2,909,738,700	
168回 利付国庫債券(20年)	2,370,000,000	2,278,257,300	
169回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,356,225,000	
170回 利付国庫債券(20年)	2,520,000,000	2,367,640,800	
171回 利付国庫債券(20年)	2,440,000,000	2,285,206,400	
172回 利付国庫債券(20年)	2,110,000,000	2,006,335,700	
173回 利付国庫債券(20年)	2,720,000,000	2,580,572,800	

	174回 利付国庫債券(20年)	3,010,000,000	2,846,858,000	
	175回 利付国庫債券(20年)	2,630,000,000	2,526,746,200	
	176回 利付国庫債券(20年)	2,520,000,000	2,413,933,200	
	177回 利付国庫債券(20年)	2,580,000,000	2,420,994,600	
	178回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,290,824,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	2,660,000,000	2,533,330,800	
	180回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	804,128,000	
	<b>国債証券 合計</b>	<b>573,445,000,000</b>	<b>587,673,211,350</b>	
<b>地方債証券</b>	720回 東京都公募公債	300,000,000	302,862,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	404,604,000	
	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,891,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	110,265,100	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	196,682,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	394,936,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	296,331,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	239,132,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	122,348,000	
	1回 東京都公募公債 20年	100,000,000	101,697,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	105,905,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,075,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	219,500,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	329,445,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	113,463,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	114,272,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	100,000,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	399,060,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	98,335,000	
	29回1号 宮城県公募公債 10年	100,000,000	100,975,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	246,247,500	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	303,267,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,411,000	
	237回 神奈川県公募公債	200,000,000	198,944,000	
	251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	197,746,000	
	3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	128,596,000	

11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	112,924,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	345,117,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	114,233,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	303,375,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,781,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,484,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	195,628,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	197,024,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	196,240,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	195,632,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	227,306,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	108,613,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	99,471,000	
190回 大阪府公募公債 5年	300,000,000	298,974,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	353,969,000	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	109,550,846	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	395,048,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	198,094,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	202,350,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	196,716,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	98,695,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	126,724,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	213,412,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	306,792,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	320,229,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	105,387,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	102,958,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	196,826,000	

令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	98,535,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	196,730,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	106,601,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	106,973,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	208,404,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	107,124,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	340,044,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	344,616,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	123,647,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	169,650,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	101,473,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	198,442,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	100,333,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	198,004,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	94,717,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	94,845,000	
25年度8回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,117,000	
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	197,660,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	199,064,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	114,601,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	112,896,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	338,190,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	108,327,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	202,406,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	100,763,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	199,792,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	196,912,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	98,504,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	106,551,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	111,987,000	
21年度2回 福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,854,000	

24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	338,874,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	202,140,000	
25年度6回 千葉県公募公債	100,000,000	101,085,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	100,135,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	195,818,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	107,885,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	107,950,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	97,991,000	
25年度2回 新潟県公募公債	100,000,000	101,163,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	197,658,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	112,572,000	
127回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,968,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,976,000	
132回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,180,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,055,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,940,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	609,222,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,035,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,479,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,093,600	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,040,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,460,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,053,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,424,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,295,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,961,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,198,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,514,000	



30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	99,766,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	101,228,000	
25年度2回 島根県公募公債	106,000,000	107,082,260	
令和元年度1回 島根県公募公債	200,000,000	190,952,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	196,944,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	101,206,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	100,797,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	200,158,000	
令和2年 2回 大阪市公募公債	300,000,000	296,028,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	226,060,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	455,931,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	196,614,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	112,451,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	108,812,000	
5回 京都市公募公債 30年 定時償還	200,000,000	188,062,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	110,596,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	230,716,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	227,600,000	
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	301,092,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	182,510,000	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	404,128,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	393,448,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	124,576,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	112,117,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	112,571,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	123,081,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	201,752,000	
26年度4回 札幌市公募公債 10年	100,000,000	101,066,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	299,040,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	199,798,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	227,340,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	123,064,000	

6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	111,784,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	112,453,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	125,780,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	200,776,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	93,073,000	
26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	101,087,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	200,032,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	301,203,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	100,802,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	197,390,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	196,862,000	
26年度1回 相模原市公募公債	100,000,000	101,156,000	
26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	101,089,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	198,916,000	
地方債証券 合計	29,745,330,000	30,670,760,306	
特殊債券			
9回 新関西国際空港社債	200,000,000	212,812,000	
12回 新関西国際空港社債	200,000,000	210,970,000	
78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	301,782,000	
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	90,628,000	
33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,883,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	205,483,500	
26回 高速道路機構債	200,000,000	258,560,000	
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,642,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	100,948,000	
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,132,000	
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,063,000	
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,437,000	
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,240,000	
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	118,635,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	103,729,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	191,764,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	99,520,000	
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,894,000	

116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,736,000	
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	563,020,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,142,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,851,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	505,125,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	434,889,100	
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	106,111,950	
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,209,000	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,348,000	
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,728,000	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	325,221,000	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	506,290,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,926,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,384,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	218,366,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,809,000	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,823,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,282,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	802,856,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	200,842,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,437,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	174,102,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	179,150,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	181,484,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	632,675,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	223,942,000	

1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	341,763,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	342,480,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	115,267,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	319,152,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	228,284,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	113,173,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	226,634,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,610,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	505,470,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	549,040,580	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	112,611,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,723,000	
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	219,124,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	332,472,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	400,392,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,160,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	100,604,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,360,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,222,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,305,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	226,096,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,959,830	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	107,308,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	105,728,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	209,286,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	181,638,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	109,660,000	

2 1 回 政保中部国際空港債券	100,000,000	101,256,000	
3 9 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	226,804,000	
6 1 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,372,000	
7 5 回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	403,259,500	
8 0 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,573,000	
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,242,000	
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,080,000	
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	299,150,000	
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,250,000	
1 7 2 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,552,000	
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,098,000	
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,984,000	
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,284,000	
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,467,000	
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	498,480,000	
3 2 5 回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	498,480,000	
8 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	19,974,000	20,111,620	
9 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,582,000	30,795,156	
2 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	32,226,000	32,706,811	
4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,680,000	49,900,407	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,921,000	11,092,678	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,390,000	53,232,430	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,230,000	31,636,926	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,225,000	51,597,405	
4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,702,000	10,847,654	
2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,865,000	18,815,953	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,090,000	115,707,399	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,936,000	176,675,389	

3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,428,000	24,590,965	
4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,176,000	21,152,518	
5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,955,000	25,025,788	
5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,963,000	26,077,348	
6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,188,000	33,559,530	
6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,840,000	79,716,121	
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,841,000	35,156,399	
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,035,000	41,244,057	
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,575,000	41,829,173	
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,523,000	45,882,287	
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,395,000	47,504,768	
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,651,000	52,103,979	
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,033,000	59,006,793	
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,246,000	61,701,543	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	224,241,000	222,148,831	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,026,000	75,831,373	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,750,000	75,647,737	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,822,000	75,662,015	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,520,000	235,353,956	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	237,309,000	235,968,204	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,284,000	159,357,558	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	241,362,000	239,513,167	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	241,149,000	239,381,377	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	417,040,000	415,697,130	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,051,000	82,712,982	

142回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	85,617,000	84,426,067	
154回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	272,385,000	267,770,798	
156回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	364,552,000	359,557,637	
160回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	279,408,000	275,865,106	
168回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	287,736,000	284,993,875	
170回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	871,317,000	859,833,041	
21回 沖縄振興開発金融公庫 債券	100,000,000	101,769,000	
い第828号 利付商工債	100,000,000	100,093,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	99,966,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	299,232,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	298,995,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	199,274,000	
369回 利附信金中金債(5 年)	400,000,000	399,468,000	
377回 利附信金中金債(5 年)	300,000,000	299,112,000	
7回 広島県・広島市折半保証 広島高速道路債券	100,000,000	100,979,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	113,386,000	
18回 国際協力機構債券	100,000,000	100,940,000	
72回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,644,000	
77回 東日本高速道路社債	300,000,000	298,665,000	
85回 中日本高速道路債券	300,000,000	299,946,000	
87回 中日本高速道路債券	400,000,000	399,692,000	
71回 鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,208,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	103,691,000	
90回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	197,282,000	
特殊債券 合計	27,119,239,000	28,116,519,411	
社債券			
25回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2 017)	300,000,000	297,222,000	
26回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2 018)	100,000,000	100,193,000	
2回 BPCESA円貨社債 (ソーシャルボンド)	100,000,000	99,677,000	
6回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債	200,000,000	201,140,000	
11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債(2 016)	100,000,000	98,584,000	
25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,931,000	

27回	首都高速道路社債	400,000,000	399,780,000	
16回	成田国際空港社債	100,000,000	101,244,000	
37回	成田国際空港社債	100,000,000	93,155,000	
57回	東日本高速道路社債	100,000,000	100,061,000	
67回	東日本高速道路社債	200,000,000	198,344,000	
79回	東日本高速道路社債	300,000,000	299,385,000	
83回	東日本高速道路社債	200,000,000	199,590,000	
56回	中日本高速道路社債	100,000,000	101,165,000	
90回	中日本高速道路債券	200,000,000	199,580,000	
91回	中日本高速道路債券	500,000,000	498,590,000	
25回	西日本高速道路社債	200,000,000	202,390,000	
26回	西日本高速道路社債	100,000,000	101,627,000	
33回	西日本高速道路債券	300,000,000	302,193,000	
34回	西日本高速道路債券	200,000,000	202,038,000	
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	199,280,000	
10回	麒麟ホールディングス社債	100,000,000	101,224,000	
9回	野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	99,055,000	
12回	セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,892,000	
14回	セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	200,006,000	
30回	東レ社債	300,000,000	300,228,000	
42回	王子ホールディングス社債	200,000,000	199,162,000	
49回	住友化学社債	100,000,000	101,479,000	
23回	三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	201,204,000	
40回	三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,600,000	
17回	ダイセル社債	300,000,000	299,001,000	
16回	武田薬品工業社債	500,000,000	489,955,000	
4回	住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,828,000	
6回	JXホールディングス社債	100,000,000	101,189,000	
14回	ブリヂストン社債	300,000,000	298,677,000	
35回	三菱マテリアル社債	300,000,000	298,560,000	
17回	パナソニック社債	100,000,000	100,907,000	
19回	パナソニック社債	100,000,000	98,349,000	
23回	パナソニック社債	200,000,000	196,308,000	
29回	三菱重工業社債	100,000,000	101,066,000	
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	99,526,000	
16回	トヨタ自動車社債	200,000,000	202,076,000	
26回	トヨタ自動車社債	200,000,000	199,424,000	
26回	豊田通商社債	100,000,000	99,495,000	
73回	三井物産社債	400,000,000	395,560,000	



47回	住友商事社債	100,000,000	101,031,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	101,314,000	
12回	新生銀行社債	400,000,000	399,324,000	
13回	新生銀行社債	200,000,000	199,486,000	
88回	三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	110,374,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,545,000	
20回	三井住友信託銀行社債	300,000,000	298,695,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	201,916,000	
11回	セブン銀行社債	200,000,000	202,036,000	
28回	芙蓉総合リース社債	300,000,000	298,080,000	
17回	NTTファイナンス社債	300,000,000	299,754,000	
18回	NTTファイナンス社債	400,000,000	398,200,000	
69回	ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,728,000	
81回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,812,000	
96回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,706,000	
80回	日立キャピタル社債	200,000,000	196,060,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	295,317,000	
23回	三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	99,029,000	
27回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,306,000	
29回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,882,000	
31回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	196,686,000	
56回	三菱UFJリース社債	300,000,000	300,837,000	
3回	野村ホールディングス社債	300,000,000	298,482,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	104,951,000	
106回	住友不動産社債	100,000,000	100,523,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	200,542,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	105,204,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	96,580,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	317,682,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	213,064,000	
65回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	113,086,000	
71回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,379,000	
73回	東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	228,550,000	
107回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	107,687,000	
125回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	101,152,000	
127回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,941,000	
147回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,999,000	

160回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	89,032,000	
163回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,476,000	
165回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	189,722,000	
171回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	182,644,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	308,016,000	
21回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,856,000	
60回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	197,746,000	
70回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	91,957,000	
71回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	89,307,000	
74回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,447,000	
75回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	189,108,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	206,092,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,822,000	
32回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,881,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	130,789,200	
47回	東京地下鉄社債	100,000,000	87,452,000	
6回	横浜高速鉄道社債	200,000,000	197,680,000	
12回	ソフトバンク社債	400,000,000	394,752,000	
30回	光通信社債	200,000,000	198,006,000	
527回	中部電力社債	100,000,000	99,875,000	
532回	中部電力社債	200,000,000	196,300,000	
497回	関西電力社債	100,000,000	102,380,000	
508回	関西電力社債	300,000,000	301,266,000	
530回	関西電力社債	400,000,000	396,576,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	190,428,000	
541回	関西電力社債	300,000,000	293,235,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	405,076,000	
396回	中国電力社債	200,000,000	199,980,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	98,794,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	103,264,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	102,566,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	406,664,000	
488回	東北電力社債	100,000,000	100,000,000	
521回	東北電力社債	400,000,000	396,620,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	198,182,000	
536回	東北電力社債	300,000,000	291,615,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	201,942,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	203,342,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	406,452,000	
428回	九州電力社債	100,000,000	101,651,000	
463回	九州電力社債	100,000,000	98,147,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	96,912,000	
491回	九州電力社債	300,000,000	293,250,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	93,243,000	
493回	九州電力社債	200,000,000	198,880,000	
321回	北海道電力社債	261,000,000	265,635,360	
340回	北海道電力社債	300,000,000	301,629,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	195,682,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	211,376,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	304,158,000	

54回	電源開発社債	100,000,000	100,218,000	
75回	電源開発社債	200,000,000	195,608,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	302,991,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	197,092,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	94,802,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	91,117,000	
27回	NTTデータ社債	200,000,000	201,772,000	
5回	ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,024,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	200,476,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	198,358,000	
社債券 合計		27,881,000,000	27,893,723,560	
合計			674,354,214,627	

## 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11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,986,294,495
国債証券	167,454,135,650
未収入金	9,088,494,213
未収利息	1,034,787,789
前払費用	182,930,353
流動資産合計	186,746,642,500
資産合計	186,746,642,500
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,415
前受金	7,878,859,771
未払金	7,597,946
未払解約金	8,681,756,000
流動負債合計	16,568,220,132
負債合計	16,568,220,132
純資産の部	
元本等	
元本	82,363,858,493
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,814,563,875
元本等合計	170,178,422,368
純資産合計	170,178,422,368
負債純資産合計	186,746,642,500

## 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11月12日 至 2022年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	73,208,120,285円
同期中追加設定元本額	25,586,778,569円
同期中一部解約元本額	16,431,040,361円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,779,239,180円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	11,836,308円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	42,032,157円
M I T O 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	13,872,505,006円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	238,685,272円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,800,416,311円
たわらノーロード バランス（堅実型）	49,785,694円
たわらノーロード バランス（標準型）	248,817,987円
たわらノーロード バランス（積極型）	52,394,768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）	6,584,449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）	320,806,832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）	385,937,803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）	75,672,101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）	378,278円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	3,109,272円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	29,802,653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
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,296,202,027円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	617,422,124円

Oneグローバルバランス	7,893,024円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	702,184,001円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,226,085,720円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,403,413,563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>	378,312,029円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	439,172,740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>	98,404,268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 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)	5,298,257,686円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	2,634,779,056円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,560,403,726円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,289,812,212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)	1,880,861,037円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,533,545,508円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,707,889,829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)	101,188,348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)	1,709,722,335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)	382,827,007円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,378,524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)	336,845,341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)	333,982,115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)	454,910,215円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	53,694,217円
動的パッケージファンド<DC年金>	42,704,062円
コア資産形成ファンド	28,144,439円
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ)	2,646,284,836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)	244,044,000円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5,887,490,810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	82,363,858,493円
2. 受益権の総数	82,363,858,493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11月12日 至 2022年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11日現在
----	--------------

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年5月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	11,655,669,128	
合計	11,655,669,128	

(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11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2022年5月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建					
アメリカ・ドル	169,834,401	-	169,840,816	6,415	
イギリス・ポンド	64,633,760	-	64,634,801	1,041	
ユーロ	39,997,866	-	40,001,625	3,759	
ユーロ	65,202,775	-	65,204,390	1,615	
合計	169,834,401	-	169,840,816	6,415	

## (注)時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場の



うち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0662円 (20,662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11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	6,260,000.000	6,014,001.530	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,800,000.000	4,598,624.970	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,550,000.000	3,480,283.430	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,560,250.000	
		US T N/B 0.125 07/31/23	2,640,000.000	2,570,906.230	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,900,000.000	2,821,382.790	
		US T N/B 0.125 08/31/23	530,000.000	514,741.790	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,940,937.500	
		US T N/B 0.125 10/15/23	230,000.000	222,632.810	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,160,000.000	2,080,265.600	
		US T N/B 0.25 03/15/24	5,510,000.000	5,277,762.090	
		US T N/B 0.25 05/15/24	2,500,000.000	2,383,398.420	
		US T N/B 0.25 05/31/25	890,000.000	822,763.270	
		US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,742,687.500	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,594,248.410	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,227,929.670	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	920,000.000	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,590,000.000	1,459,073.430	
		US T N/B 0.25 09/30/23	2,500,000.000	2,427,148.420	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,408,159.350	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,826,562.500	
		US T N/B 0.25 11/15/23	800,000.000	773,750.000	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,371,625.000	
US T N/B 0.375 04/15/24	2,110,000.000	2,021,149.200			
US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,381,299.990			
US T N/B 0.375 07/15/24	500,000.000	475,527.340			

US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,310,748.410	
US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,889,234.370	
US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,892,187.500	
US T N/B 0.375 09/30/27	1,870,000.000	1,629,383.570	
US T N/B 0.375 10/31/23	890,000.000	863,439.060	
US T N/B 0.375 11/30/25	3,190,000.000	2,919,597.630	
US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,740,546.860	
US T N/B 0.5 02/28/26	3,370,000.000	3,078,810.930	
US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,677,116.400	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,105,874.610	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,753,382.790	
US T N/B 0.5 06/30/27	1,050,000.000	927,855.460	
US T N/B 0.5 08/31/27	4,370,000.000	3,843,210.130	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,203,929.660	
US T N/B 0.5 11/30/23	3,000,000.000	2,908,242.180	
US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,970,890.630	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,290,000.000	4,406,817.990	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,548,695.270	
US T N/B 0.625 08/15/30	4,960,000.000	4,110,212.460	
US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,800,000.000	
US T N/B 0.625 11/30/27	2,700,000.000	2,377,687.500	
US T N/B 0.625 12/31/27	3,320,000.000	2,916,931.240	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,864,323.410	
US T N/B 0.75 03/31/26	3,220,000.000	2,965,670.290	
US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,401,687.500	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,230,000.000	2,963,525.000	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,750,000.000	4,334,375.000	
US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,481,539.060	
US T N/B 0.75 12/31/23	1,990,000.000	1,932,787.500	
US T N/B 0.875 01/31/24	200,000.000	194,289.060	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	3,049,078.880	
US T N/B 0.875 09/30/26	3,110,000.000	2,848,322.630	
US T N/B 0.875 11/15/30	7,000,000.000	5,902,968.740	
US T N/B 1.0 07/31/28	3,770,000.000	3,342,487.880	
US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,404,890.990	
US T N/B 1.125 01/15/25	4,910,000.000	4,698,256.250	
US T N/B 1.125 02/15/31	7,760,000.000	6,662,081.200	
US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,845,667.170	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,011,914.060	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,860,000.000	3,478,825.000	
US T N/B 1.125 05/15/40	2,600,000.000	1,829,140.600	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	2,208,543.740	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,327,567.950	
US T N/B 1.125 10/31/26	2,390,000.000	2,210,189.830	
US T N/B 1.25 03/31/28	3,610,000.000	3,272,126.550	
US T N/B 1.25 04/30/28	4,010,000.000	3,629,833.190	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,370,000.000	2,800,214.050	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,900,000.000	4,428,375.000	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,346,970.670	

US T N/B 1.25 07/31/23	350,000.000	345,707.020	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,630,000.000	7,427,530.820	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,774,482.810	
US T N/B 1.25 09/30/28	3,980,000.000	3,573,604.660	
US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,436,953.120	
US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,607,367.180	
US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	721,845.690	
US T N/B 1.375 06/30/23	3,830,000.000	3,794,692.180	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	3,233,603.850	
US T N/B 1.375 08/31/23	370,000.000	365,418.350	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,031,335.930	
US T N/B 1.375 09/30/23	1,830,000.000	1,804,908.970	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,258,686.290	
US T N/B 1.375 11/15/31	6,990,000.000	6,060,275.330	
US T N/B 1.375 11/15/40	3,190,000.000	2,326,207.800	
US T N/B 1.375 12/31/28	1,500,000.000	1,354,218.750	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,940,000.000	5,567,821.860	
US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,390,216.780	
US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,352,483.180	
US T N/B 1.5 02/29/24	4,000,000.000	3,923,593.720	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,516,982.000	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,676,121.850	
US T N/B 1.5 11/30/24	2,300,000.000	2,227,046.870	
US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,641,718.720	
US T N/B 1.625 02/15/26	2,890,000.000	2,759,046.870	
US T N/B 1.625 04/30/23	3,320,000.000	3,305,215.600	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,494,814.810	
US T N/B 1.625 05/15/31	7,640,000.000	6,827,056.250	
US T N/B 1.625 05/31/23	3,100,000.000	3,083,652.330	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,612,571.840	
US T N/B 1.625 09/30/26	2,150,000.000	2,035,949.200	
US T N/B 1.625 10/31/23	2,800,000.000	2,767,406.230	
US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,618,087.500	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	3,390,439.010	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,710,308.580	
US T N/B 1.75 01/31/29	3,000,000.000	2,772,539.040	
US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,883,906.240	
US T N/B 1.75 05/15/23	3,510,000.000	3,498,208.570	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,314,246.870	
US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,949,267.180	
US T N/B 1.75 08/15/41	4,430,000.000	3,418,714.050	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,883,277.320	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,937,140.620	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	2,001,203.120	
US T N/B 1.875 02/15/32	4,350,000.000	3,941,847.620	
US T N/B 1.875 02/15/41	4,650,000.000	3,702,925.730	
US T N/B 1.875 02/15/51	4,720,000.000	3,571,712.490	
US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,440,499.190	
US T N/B 1.875 02/28/29	2,000,000.000	1,862,890.620	

US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,804,506.240	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,780,000.000	2,668,148.410	
US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	804,112.500	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,070,000.000	3,843,693.750	
US T N/B 2.0 02/15/25	1,010,000.000	988,142.950	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,894,625.000	
US T N/B 2.0 04/30/24	360,000.000	355,753.120	
US T N/B 2.0 05/31/24	3,970,000.000	3,918,979.260	
US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	285,967.180	
US T N/B 2.0 08/15/25	3,380,000.000	3,288,634.370	
US T N/B 2.0 08/15/51	5,890,000.000	4,599,261.660	
US T N/B 2.0 11/15/26	2,830,000.000	2,716,800.000	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,429,882.810	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,650,000.000	1,636,980.450	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,840,000.000	4,798,217.140	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,868,068.340	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,350,000.000	2,279,867.180	
US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	375,279.680	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	2,888,796.870	
US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	1,989,531.240	
US T N/B 2.125 11/30/24	280,000.000	275,395.310	
US T N/B 2.25 01/31/24	710,000.000	706,339.060	
US T N/B 2.25 02/15/27	1,490,000.000	1,444,717.950	
US T N/B 2.25 02/15/52	2,500,000.000	2,077,539.050	
US T N/B 2.25 03/31/26	2,690,000.000	2,624,641.390	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,276,539.040	
US T N/B 2.25 05/15/41	2,760,000.000	2,333,709.350	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,190,000.000	2,115,060.930	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,070,000.000	1,690,446.070	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,040,000.000	2,510,137.470	
US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,321,359.370	
US T N/B 2.25 11/15/24	5,390,000.000	5,319,256.250	
US T N/B 2.25 11/15/25	2,920,000.000	2,859,090.600	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,153,506.250	
US T N/B 2.25 12/31/23	280,000.000	278,753.120	
US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,956,640.610	
US T N/B 2.375 02/15/42	2,000,000.000	1,722,812.500	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	2,018,960.920	
US T N/B 2.375 05/15/27	4,700,000.000	4,577,726.530	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,470,000.000	3,333,910.930	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,060,000.000	4,305,743.750	
US T N/B 2.375 08/15/24	4,610,000.000	4,574,344.500	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,180,000.000	1,853,851.530	
US T N/B 2.5 01/31/24	4,550,000.000	4,545,023.430	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,985,697.630	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,520,264.050	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,920,000.000	2,877,568.740	
US T N/B 2.5 05/15/24	5,100,000.000	5,087,250.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,130,000.000	1,828,971.100	

US T N/B 2.5 08/15/23	4,080,000.000	4,093,068.720	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,436,168.750	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,830,000.000	4,718,306.250	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,390,000.000	2,377,023.030	
US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,983,886.700	
US T N/B 2.625 06/30/23	2,350,000.000	2,360,648.430	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,530,000.000	3,536,480.820	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,270,141.390	
US T N/B 2.75 02/15/24	6,030,000.000	6,046,723.770	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,580,000.000	4,525,254.650	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,956,478.100	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,720,000.000	2,737,318.720	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,800,000.000	3,824,046.850	
US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,036,912.490	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,288,393.750	
US T N/B 2.75 08/15/42	240,000.000	218,193.740	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,240,000.000	2,025,449.990	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,181,273.820	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,822,494.120	
US T N/B 2.75 11/15/23	6,360,000.000	6,388,321.840	
US T N/B 2.75 11/15/42	2,476,000.000	2,248,324.030	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,360,000.000	2,135,246.840	
US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	2,002,578.120	
US T N/B 2.875 05/15/28	5,240,000.000	5,208,068.740	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	2,116,103.120	
US T N/B 2.875 05/15/49	2,890,000.000	2,709,600.750	
US T N/B 2.875 05/31/25	570,000.000	570,556.630	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,201,375.000	
US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,496,025.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,050,000.000	965,835.930	
US T N/B 2.875 09/30/23	1,220,000.000	1,228,768.750	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,990,000.000	4,014,314.050	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	995,793.740	
US T N/B 2.875 11/30/25	360,000.000	360,000.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,960,000.000	1,848,678.090	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,522,054.670	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,460,000.000	3,319,437.500	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	1,026,675.000	
US T N/B 3.0 05/15/45	720,000.000	676,181.240	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,530,393.740	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,250,000.000	3,098,037.050	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,756,562.500	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,279,931.250	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,462,743.740	
US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	809,139.050	
US T N/B 3.125 02/15/42	860,000.000	834,233.590	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,690,000.000	1,628,209.370	
US T N/B 3.125 05/15/48	1,830,000.000	1,786,680.450	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	2,004,440.620	

US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,408,572.610	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	989,519.510	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,429,106.250	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,200,000.000	3,281,499.990	
US T N/B 3.5 02/15/39	100,000.000	104,781.250	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,693,035.140	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,527,421.870	
US T N/B 3.75 08/15/41	820,000.000	869,328.110	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,439,475.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,399,650.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	1,088,195.300	
US T N/B 4.25 11/15/40	700,000.000	794,007.800	
US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	698,906.240	
US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	1,054,462.500	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,150,000.000	1,323,398.430	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,190,000.000	1,380,771.870	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,140,000.000	1,343,151.550	
US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	707,859.360	
US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,155,940.610	
US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	1,063,897.630	
US T N/B 4.75 02/15/41	30,000.000	36,264.840	
US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	686,899.210	
US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	963,621.080	
US T N/B 5.375 02/15/31	860,000.000	1,018,965.620	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,100,000.000	1,222,289.050	
US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,043,367.180	
US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	936,119.750	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,050,000.000	
アメリカ・ドル 小計	686,500,000.000 (89,464,680,000)	639,406,895.520 (83,327,506,622)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	950,000.000	906,110.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,762,650.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	500,000.000	460,990.000
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	800,000.000	774,609.710
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	540,000.000	468,328.380
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,150,000.000	1,093,404.350
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	790,000.000	707,174.180
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	680,000.000	630,047.040
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,130,000.000	692,529.300
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	860,000.000	841,258.810

UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,050,000.000	876,382.500	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	450,000.000	313,908.470	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	960,000.000	954,697.150	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	870,000.000	672,858.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	850,000.000	761,047.500	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,140,000.000	1,078,458.240	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	660,000.000	609,093.420	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,750,000.000	1,739,125.830	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	390,000.000	336,423.670	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	350,000.000	272,758.500	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,000,000.000	988,473.470	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	430,000.000	354,392.580	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,500,000.000	1,295,784.880	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	800,000.000	802,333.840	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,180,000.000	1,044,144.700	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	350,000.000	309,120.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	934,578.560	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	680,000.000	618,753.480	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	630,000.000	588,794.470	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	588,917.940	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,310,000.000	1,237,055.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	1,326,964.050	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	890,000.000	907,468.920	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,380,000.000	1,397,179.620	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,210,000.000	1,426,919.120	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	495,110.590	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,250,000.000	1,496,580.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,250,000.000	1,560,976.990	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	840,000.000	1,255,984.800	

	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,000,000.000	1,384,120.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	1,394,771.400	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,100,000.000	1,391,005.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,170,000.000	1,427,528.700	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	800,000.000	1,051,248.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	892,322.490	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,422,445.160	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,200,000.000	1,691,957.040	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	917,000.000	1,333,509.650	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,879,702.920	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	300,000.000	382,287.710	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,195,000.000	1,672,483.990	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,095,000.000	1,360,081.980	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,080,000.000	1,487,095.200	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	965,000.000	1,059,805.070	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	866,762.000	
	イギリス・ポンド 小計	51,264,000.000 (8,236,074,240)	55,278,514.370 (8,881,046,119)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	200,000.000	193,205.000	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	260,000.000	245,414.000	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	320,000.000	307,370.240	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,564,616.340	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	800,000.000	656,776.800	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	160,000.000	160,401.760	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,300,000.000	2,285,422.600	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,500,000.000	2,483,172.500	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,460,000.000	1,453,126.320	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,702,609.000	



	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,700,000.000	1,837,181.500	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,530,000.000	2,065,501.530	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	220,000.000	258,782.040	
イスラエル・シケル 小計		16,910,000.000 (637,638,898)	17,213,579.630 (649,086,218)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,390,000.000	1,301,185.680	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,313,248.940	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,310,000.000	1,168,030.880	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,700,000.000	1,351,762.030	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,359,537.640	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,717,583.500	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,610,000.000	1,355,968.350	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	920,000.000	585,948.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,140,000.000	958,034.920	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	800,000.000	755,840.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,686,829.600	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,160,000.000	1,161,018.480	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	900,000.000	763,589.700	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	587,182.930	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,650,000.000	1,610,895.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	270,000.000	260,132.790	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,550,000.000	1,487,225.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,380,000.000	1,180,079.950	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	490,000.000	493,550.390	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,200,000.000	1,188,590.730	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	575,646.710		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	930,000.000	930,142.000		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,160,000.000	2,249,309.080		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,030,000.000	1,115,064.090		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	530,000.000	566,837.910		
オーストラリア・ドル 小計		30,450,000.000 (2,756,638,500)	27,723,234.300 (2,509,784,401)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	17,500,000.000	17,439,712.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	12,000,000.000	12,002,060.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,344,729.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	17,000,000.000	17,086,280.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,511,230.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,740,908.180	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	11,000,000.000	10,946,733.270	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	9,000,000.000	8,992,665.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,118,942.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	15,600,000.000	15,713,022.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	1,000,000.000	1,012,360.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,613,038.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	14,150,000.000	14,682,252.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,237,205.810	
	オフショア・人民元 小計	155,450,000.000 (2,999,345,570)	156,441,139.860 (3,018,469,217)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,010,000.000	919,765.590	
	CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,434,678.000	
	CANADA 0.25 05/01/23	1,000,000.000	978,879.000	
	CANADA 0.25 08/01/23	700,000.000	681,015.300	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,910,000.000	1,777,064.000	
	CANADA 0.5 11/01/23	620,000.000	601,781.300	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,462,316.400	
	CANADA 0.75 02/01/24	1,200,000.000	1,162,454.400	
	CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	642,281.500	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,179,772.850	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	672,769.300	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,180,000.000	1,099,148.760	
	CANADA 1.25 06/01/30	2,250,000.000	1,974,694.500	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,410,000.000	1,395,464.310	
	CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	667,433.200	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,480,000.000	2,186,301.040	
	CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	428,593.440	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,110,000.000	972,314.490	
	CANADA 1.75 12/01/53	1,440,000.000	1,081,752.480	
	CANADA 2.0 06/01/28	100,000.000	95,479.500	
	CANADA 2.0 06/01/32	500,000.000	455,743.000	
	CANADA 2.0 09/01/23	880,000.000	874,060.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,500,000.000	2,023,897.500	
	CANADA 2.25 03/01/24	900,000.000	894,406.500	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,130,000.000	1,115,286.270	
	CANADA 2.25 06/01/29	730,000.000	700,275.860	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,270,000.000	1,265,928.380	
	CANADA 2.75 12/01/48	680,000.000	649,312.960	
	CANADA 2.75 12/01/64	490,000.000	458,561.600	
	CANADA 3.5 12/01/45	720,000.000	774,539.280	
	CANADA 4.0 06/01/41	630,000.000	711,974.340	

	CANADA 5.0 06/01/37	450,000.000	552,197.250	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,090,000.000	1,287,177.730	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	763,220.410	
カナダ・ドル 小計		36,100,000.000 (3,612,527,000)	33,940,540.440 (3,396,429,882)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	350,000.000	326,900.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	350,000.000	315,705.070	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	401,310.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	290,000.000	237,022.800	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	279,017.200	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	370,000.000	363,340.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	541,640.650	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	440,000.000	439,032.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	180,000.000	164,880.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	420,000.000	417,690.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	500,000.000	483,750.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	460,000.000	444,205.900	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	705,740.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	550,000.000	552,750.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	490,000.000	490,980.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	260,000.000	263,640.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	380,000.000	397,100.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	829,384.000		
シンガポール・ドル 小計		7,900,000.000 (739,993,000)	7,654,087.620 (716,958,387)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	3,040,000.000	2,608,274.400	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	2,890,000.000	2,718,501.620	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,170,000.000	2,929,045.130	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	3,920,000.000	3,796,833.600	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	5,780,000.000	5,802,061.100	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,200,000.000	3,309,680.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	8,540,000.000	8,760,938.340	
SWEDEN 3.5 03/30/39	3,900,000.000	4,739,276.480		
スウェーデン・クローナ 小計		34,440,000.000 (446,342,400)	34,664,610.670 (449,253,354)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	1,010,000.000	996,546.800	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,080,000.000	3,597,044.060	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,370,000.000	1,690,840.950	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,030,000.000	6,830,291.760	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,750,000.000	5,462,672.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,540,000.000	5,728,302.930	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,950,000.000	11,679,130.350	
デンマーク・クローネ 小計		33,730,000.000 (622,318,500)	35,984,829.350 (663,920,102)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,650,000.000	1,427,213.700	

	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,837,886.910	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,400,000.000	4,212,036.400	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,294,302.320	
	NORWAY 1.75 03/13/25	6,790,000.000	6,627,053.580	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,420,000.000	3,172,022.640	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,972,089.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,800,000.000	1,803,187.800	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,700,000.000	1,584,400.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,290,000.000	6,362,649.500	
	ノルウェー・クローネ 小計	34,830,000.000 (466,722,000)	33,292,841.850 (446,124,081)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,397,874.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	1,970,000.000	1,652,633.000	
	POLAND 07/25/24	810,000.000	700,979.910	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,980,000.000	1,941,172.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	1,400,000.000	888,650.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,620,000.000	2,349,616.000	
	POLAND 2.5 04/25/24	690,000.000	638,319.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,327,766.750	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	1,892,543.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,390,000.000	2,688,270.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	710,000.000	540,239.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,780,000.000	2,481,011.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,740,000.000	2,644,565.800	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,351,224.000	
	ポーランド・ズロチ 小計	28,560,000.000 (837,896,136)	23,494,863.460 (689,294,654)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	855,090.840	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	996,544.500	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,932,142.120	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,300,000.000	1,111,774.710	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,000,000.000	1,807,058.480	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,542,423.720	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	300,000.000	301,127.310	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	400,000.000	383,444.260	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	600,000.000	592,227.120	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,430,000.000	1,404,184.800	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	740,000.000	733,287.460	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,700,000.000	2,705,340.060	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	906,749.370	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,730,000.000	1,745,731.230	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	300,000.000	291,056.450	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,113,084.070	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,000,000.000	1,985,953.300	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	492,649.190	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	283,618.420		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,681,510.300		

	MALAYSIA 4.893 06/08/38	120,000.000	119,200.050	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	3,150,000.000	3,027,242.840	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,571,792.220	
マレーシア・リンギット 小計		30,500,000.000 (906,737,550)	29,583,232.820 (879,482,887)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,085,000.000	5,406,987.280	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	21,822,000.000	22,362,384.720	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	26,132,000.000	23,495,371.070	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	21,546,000.000	20,320,270.890	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	18,748,000.000	17,203,633.500	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	16,487,000.000	14,113,696.350	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,315,000.000	6,532,221.850	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	20,670,000.000	20,289,258.600	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	15,371,000.000	13,386,555.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	15,151,000.000	14,968,454.690	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	19,637,913.020	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,677,480.320	
	メキシコ・ペソ 小計		204,128,000.000 (1,306,092,595)	192,394,227.290 (1,231,015,224)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	850,000.000	767,656.250	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	610,000.000	539,869.670	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	330,000.000	324,360.300	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	250,000.000	231,650.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	420,000.000	305,508.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	170,000.000	138,924.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	570,000.000	544,425.810	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	690,000.000	677,822.880	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	250,000.000	161,852.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	822,500.880	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	530,000.000	419,366.210	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	850,000.000	845,835.000	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	300,000.000	164,742.000	
	AUSTRIA 07/15/23	750,000.000	750,795.000	
	AUSTRIA 07/15/24	850,000.000	845,350.500	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	820,000.000	833,962.960	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	490,000.000	478,585.450	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	180,000.000	152,856.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	740,000.000	763,489.080		

AUSTRIA 1.75 10/20/23	900,000.000	923,581.800	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	440,000.000	455,123.680	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	720,000.000	789,258.240	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	490,000.000	633,442.600	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	280,000.000	443,742.320	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	840,000.000	1,125,516.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	710,000.000	823,977.010	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	755,000.000	959,076.500	
BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	550,235.560	
BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	816,042.200	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,000,000.000	905,700.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	810,000.000	812,511.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	480,000.000	367,002.720	
BELGIUM 0.5 10/22/24	1,090,000.000	1,092,706.470	
BELGIUM 0.65 06/22/71	390,000.000	219,780.430	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,270,000.000	1,279,155.430	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,210,000.000	1,201,626.800	
BELGIUM 0.8 06/22/28	560,000.000	549,276.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,070,000.000	1,048,974.500	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,030,000.000	1,040,678.010	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,270,000.000	1,224,127.600	
BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	787,971.240	
BELGIUM 1.4 06/22/53	320,000.000	271,293.120	
BELGIUM 1.45 06/22/37	530,000.000	500,778.980	
BELGIUM 1.6 06/22/47	800,000.000	736,734.400	
BELGIUM 1.7 06/22/50	800,000.000	745,616.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	760,000.000	763,049.120	
BELGIUM 2.15 06/22/66	500,000.000	499,700.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	852,523.040	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	410,484.750	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,020,000.000	1,070,095.260	
BELGIUM 3.0 06/22/34	730,000.000	833,945.430	
BELGIUM 3.75 06/22/45	740,000.000	979,593.500	
BELGIUM 4.0 03/28/32	730,000.000	896,332.690	
BELGIUM 4.25 03/28/41	820,000.000	1,111,153.300	
BELGIUM 4.5 03/28/26	610,000.000	700,152.510	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,120,000.000	1,534,557.920	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,050,000.000	1,323,868.870	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,800,000.000	1,761,534.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,571,722.670	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	660,000.000	638,202.180	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,260,000.000	1,225,148.400	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,750,000.000	1,721,020.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	670,000.000	660,043.800	
BUNDESOBL 04/05/24	1,860,000.000	1,854,585.540	
BUNDESOBL 10/13/23	1,540,000.000	1,541,955.800	
BUNDESOBL 10/18/24	1,920,000.000	1,905,667.200	
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,500,000.000	1,495,425.000	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	60,000.000	59,990.940	

DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,020,000.000	1,888,518.200	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,940,000.000	1,789,708.200	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	910,000.000	825,435.520	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,560,000.000	1,348,916.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,310,000.000	1,970,453.100	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,130,000.000	1,979,068.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	590,000.000	549,266.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,290,000.000	1,180,259.700	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	500,000.000	458,416.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,120,000.000	1,547,260.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	480,000.000	353,044.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	990,000.000	701,672.400	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,320,000.000	1,268,322.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,000,000.000	950,245.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,330,000.000	2,287,337.700	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,780,000.000	1,714,864.460	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,810,000.000	1,751,518.900	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,907,068.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,010,000.000	2,007,125.700	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,640,000.000	1,616,892.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,210,000.000	1,197,580.560	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,980,000.000	1,931,256.360	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,890,000.000	1,778,215.950	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,540,000.000	1,565,246.760	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	640,000.000	651,136.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,450,000.000	1,499,692.950	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,220,000.000	1,240,847.360	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,230,000.000	2,288,044.670	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,150,000.000	2,212,350.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,290,000.000	3,378,948.440	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,900,000.000	2,429,226.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,190,000.000	2,859,036.240	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,650,000.000	2,288,847.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,830,000.000	2,547,546.660	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,130,000.000	1,681,643.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	160,000.000	198,432.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,330,000.000	1,895,875.100	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	2,248,724.400	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,520,000.000	2,101,719.200	

DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,666,162.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	910,000.000	1,003,293.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	1,092,382.200	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	1,098,540.000	
FINLAND 0.0 09/15/24	220,000.000	218,191.160	
FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	188,301.540	
FINLAND 0.125 04/15/36	290,000.000	236,654.630	
FINLAND 0.125 04/15/52	250,000.000	163,671.000	
FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	266,166.000	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	226,133.880	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	455,762.020	
FINLAND 0.5 04/15/43	150,000.000	119,415.450	
FINLAND 0.5 09/15/27	580,000.000	566,757.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	231,208.560	
FINLAND 0.5 09/15/29	450,000.000	428,296.500	
FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	190,203.400	
FINLAND 0.875 09/15/25	330,000.000	332,825.460	
FINLAND 09/15/23	300,000.000	300,198.600	
FINLAND 1.125 04/15/34	490,000.000	467,098.870	
FINLAND 1.375 04/15/47	310,000.000	300,355.900	
FINLAND 2.0 04/15/24	430,000.000	444,988.510	
FINLAND 2.625 07/04/42	320,000.000	374,552.320	
FINLAND 2.75 07/04/28	490,000.000	540,947.260	
FINLAND 4.0 07/04/25	480,000.000	532,249.920	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,620,000.000	1,614,861.360	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,000,000.000	984,123.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	1,750,000.000	1,701,101.500	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,450,000.000	2,343,873.350	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	800,000.000	686,160.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,090,000.000	2,813,330.670	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,680,000.000	3,274,574.400	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,842,120.500	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,620,000.000	2,546,996.320	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,990,000.000	2,982,124.340	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,260,000.000	3,221,789.540	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,427,635.070	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,550,000.000	1,228,009.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	660,000.000	353,520.420	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	900,000.000	677,136.600	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	850,000.000	835,131.800	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,160,000.000	1,572,512.400	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	800,000.000	571,338.400	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,370,000.000	3,295,496.040	
FRANCE OAT 03/25/24	3,020,000.000	3,006,271.080	
FRANCE OAT 03/25/25	3,320,000.000	3,267,095.800	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,870,000.000	2,879,184.000	



FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,769,191.960	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,760,000.000	2,630,746.440	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,310,000.000	2,159,619.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,680,000.000	3,717,344.640	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,130,000.000	1,936,915.500	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	2,430,000.000	2,477,496.780	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,070,000.000	1,005,800.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,270,000.000	2,269,909.200	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,850,000.000	2,942,297.250	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,050,000.000	2,090,403.450	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,598,412.500	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,930,000.000	4,303,750.860	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,900,000.000	4,268,784.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,860,000.000	2,332,782.240	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,080,000.000	3,406,634.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	900,000.000	1,343,700.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,440,000.000	2,222,359.200	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,557,494.240	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,695,000.000	3,922,039.270	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,744,148.320	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,980,000.000	2,689,533.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,282,772.200	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,537,167.300	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,566,159.540	
IRISH 0.0 10/18/31	770,000.000	662,725.910	
IRISH 0.2 05/15/27	500,000.000	482,273.500	
IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	495,573.100	
IRISH 0.4 05/15/35	390,000.000	326,810.640	
IRISH 0.55 04/22/41	270,000.000	211,441.860	
IRISH 0.9 05/15/28	510,000.000	503,005.350	
IRISH 1.0 05/15/26	790,000.000	797,422.050	
IRISH 1.1 05/15/29	530,000.000	524,594.000	
IRISH 1.3 05/15/33	390,000.000	373,163.700	
IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	357,526.800	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.000	444,951.000	
IRISH 1.7 05/15/37	560,000.000	550,043.200	
IRISH 2.0 02/18/45	560,000.000	566,781.600	
IRISH 2.4 05/15/30	740,000.000	800,040.640	
IRISH 3.4 03/18/24	420,000.000	444,210.810	
IRISH 5.4 03/13/25	860,000.000	976,342.860	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	985,310.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	990,000.000	919,017.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,400,000.000	1,370,600.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,250,000.000	1,150,250.000	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,307,844.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,295,750.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,300,000.000	1,298,583.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,460,000.000	1,416,243.800	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,200,000.000	1,044,600.000	

ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,534,571.500	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	500,000.000	445,500.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	500,000.000	502,250.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,810,000.000	1,472,141.960	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,380,000.000	1,381,211.640	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,510,000.000	1,429,819.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,400,000.000	1,182,214.600	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,080,000.000	804,168.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,380,000.000	1,136,982.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,170,315.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,576,344.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	1,084,159.700	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	500,000.000	475,325.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,530,000.000	1,480,657.500	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,750,000.000	1,583,648.500	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	916,496.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,370,000.000	1,362,697.900	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,039,805.520	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	585,225.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,760,000.000	1,755,353.600	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,350,000.000	1,335,285.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,490,000.000	1,331,392.480	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,585,183.500	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,020,000.000	728,127.000	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,212,826.800	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,360,000.000	1,089,496.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	1,005,147.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,140,000.000	1,145,814.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,750,000.000	1,726,215.750	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,200,000.000	1,209,852.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,040,000.000	1,033,300.320	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	890,000.000	896,288.740	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	263,412.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	440,000.000	343,200.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	690,000.000	692,829.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	860,000.000	775,892.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,259,770.680	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	980,720.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	954,267.420	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,350,000.000	1,383,991.650	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,682,361.270	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,330,000.000	1,220,142.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	619,430.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,240,000.000	1,268,924.240	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,100,000.000	1,054,790.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,655,703.070	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,000,000.000	987,981.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	1,192,211.820	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,230,000.000	1,265,312.070	

ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,235,117.660	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,870,000.000	1,988,890.860	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,711,988.460	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	100,000.000	110,482.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,980,000.000	2,187,900.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,710,000.000	1,819,012.500	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,910,000.000	2,102,910.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,990,000.000	2,073,983.970	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	2,290,000.000	2,412,515.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,911,804.720	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,382,742.540	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	60,000.000	65,828.880	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,999,968.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,600,000.000	1,986,880.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,550,000.000	1,937,190.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,440,000.000	2,899,940.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,530,000.000	1,918,314.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,780,000.000	2,235,146.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,210,000.000	1,481,524.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	430,325.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,270,000.000	1,424,609.800	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	920,000.000	887,029.040	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	220,000.000	205,266.600	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	450,000.000	359,532.400	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	740,000.000	504,971.560	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	900,000.000	821,349.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	700,000.000	628,738.600	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,360,000.000	1,347,357.980	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	910,000.000	859,982.760	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	760,000.000	652,509.690	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,360,000.000	1,348,848.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,154,580.480	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,140,000.000	1,126,867.200	
NETHERLANDS 01/15/24	1,440,000.000	1,437,664.320	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	560,000.000	572,691.280	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,770,000.000	1,835,350.170	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,020,000.000	1,140,683.340	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,580,000.000	2,068,893.080	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,290,000.000	1,807,466.730	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,190,000.000	1,594,243.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,020,000.000	1,271,022.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,590,000.000	1,554,384.000	

SPAIN 0.0 01/31/26	1,370,000.000	1,313,262.820	
SPAIN 0.0 01/31/27	230,000.000	215,970.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,160,000.000	1,060,530.000	
SPAIN 0.0 04/30/23	1,000,000.000	1,000,960.000	
SPAIN 0.0 05/31/24	1,260,000.000	1,244,937.960	
SPAIN 0.0 05/31/25	620,000.000	601,520.210	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,640,000.000	1,382,520.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,270,000.000	1,259,282.470	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,690,000.000	1,696,004.570	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,900,000.000	1,724,884.980	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,425,604.440	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,415,086.290	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,240,000.000	1,084,008.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,550,000.000	1,505,437.500	
SPAIN 0.85 07/30/37	730,000.000	584,343.100	
SPAIN 1.0 07/30/42	130,000.000	100,074.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,380,000.000	948,129.000	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	1,021,324.500	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,671,250.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,730,000.000	1,737,650.060	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,640,000.000	1,632,726.050	
SPAIN 1.4 07/30/28	970,000.000	963,452.500	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,500,000.000	1,483,902.000	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,760,000.000	1,763,560.480	
SPAIN 1.45 10/31/71	360,000.000	228,666.240	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,510,000.000	1,521,023.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,510,000.000	1,541,574.100	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,330,000.000	1,262,854.950	
SPAIN 1.9 10/31/52	730,000.000	611,503.480	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,577,195.910	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,791,160.350	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,710,000.000	1,776,648.100	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,470,000.000	1,490,580.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,070,000.000	1,106,212.010	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,617,973.280	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,290,000.000	1,386,544.890	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,070,000.000	1,221,173.880	
SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,563,605.190	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,300,000.000	1,612,230.100	
SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,178,634.630	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,635,000.000	1,824,679.620	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,480,000.000	2,006,510.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	1,300,000.000	1,399,409.700	
SPAIN 4.9 07/30/40	1,290,000.000	1,767,300.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	380,000.000	461,586.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	660,000.000	968,899.800	
SPAIN 5.75 07/30/32	1,515,000.000	2,036,509.960	
SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,948,054.390	
SPAIN 6.0 01/31/29	1,680,000.000	2,159,357.760	

	ユーロ 小計	430,552,000.000 (59,101,873,040)	441,434,869.250 (60,595,764,502)	
国債証券	合計	172,134,879,429.200 (172,134,879,429)	167,454,135,650 (167,454,135,650)	
合計			167,454,135,650 (167,454,135,650)	

(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	48.96	49.76
イギリス・ポンド	国債証券 55銘柄	5.22	5.30
イスラエル・シュケル	国債証券 13銘柄	0.38	0.39
オーストラリア・ドル	国債証券 25銘柄	1.47	1.50
オフショア・人民元	国債証券 14銘柄	1.77	1.80
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	2.00	2.03
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.42	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.26	0.27
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.39	0.40
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	0.41	0.41
マレーシア・リングgit	国債証券 23銘柄	0.52	0.53
メキシコ・ペソ	国債証券 12銘柄	0.72	0.74
ユーロ	国債証券 342銘柄	35.61	36.19

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2022年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,848,973,391
投資証券	155,737,287,200
派生商品評価勘定	172,447,230
未収入金	14,664,139,592
未収配当金	1,717,809,548
差入委託証拠金	272,260,500
流動資産合計	180,412,917,461
資産合計	180,412,917,461
負債の部	
流動負債	
前受金	211,264,800
未払金	369,228,387
未払解約金	4,738,998,000
流動負債合計	5,319,491,187
負債合計	5,319,491,187
純資産の部	
元本等	
元本	74,422,264,176
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	100,671,162,098
元本等合計	175,093,426,274
純資産合計	175,093,426,274
負債純資産合計	180,412,917,461

## 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11月12日 至 2022年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	88,358,860,745円
同期中追加設定元本額	51,342,264,463円
同期中一部解約元本額	65,278,861,032円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	484,095円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,739,109円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,349,239円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	2,267,895円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	1,248,266円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,199,505円
たわらノーロード 国内リート	4,827,203,556円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	784,975,128円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,547,070,936円
たわらノーロード バランス(堅実型)	28,575,950円
たわらノーロード バランス(標準型)	536,962,296円
たわらノーロード バランス(積極型)	585,077,788円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	75,783,783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)	376,041,816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)	218,465,645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)	284,138,461円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,354,896円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	33,193,937円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,607,376円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	13,253,071円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,475,526円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	427,865,080円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,803円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	127,599,856円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	168,835,185円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	343,149,449円
投資のソムリエ	5,039,656,374円
投資のソムリエ<DC年金>	310,468,228円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	138,640,897円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	232,576,513円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,273,155,642円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	19,274,190円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,755,229円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,604,950円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	60,007,907円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	266,684,420円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	120,157,037円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	19,616,706円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	8,473,126円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,422,953円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	896,889円
Jリートインデックスファンド(DC)	49,970,891円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	79,699,997円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	720,675,852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)	760,808円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	217,707,759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)	708,067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)	26,730,366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)	551,421円
固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)	190,209,302円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	59,683,551円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	140,219,304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)	527,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	2,869,206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)	148,330,752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)	244,308,833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)	170,659,574円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	60,842,765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)	588,327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)	170,407,397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)	245,929,724円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	4,387,362,910円 129,252,449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)	614,705,854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)	1,014,158円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4,656,418円
日米資産配分戦略ファンド(TIPS活用型)(為替ヘッジ比率調整型)(適格機関投資家限定)	143,047,028円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	18,239,088円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,014,220,269円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	7,674,466,108円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	37,291,605,350円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,576,121,062円
MHAM J-REITインデックスファンド(ファンドラップ)	111,576,634円
計	74,422,264,176円
2. 受益権の総数	74,422,264,176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11月12日 至 2022年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11日現在
----	--------------

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年5月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	10,743,353,022	
合計	10,743,353,022	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年6月8日から2022年5月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	2022年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	4,354,064,700	-		4,526,769,000
合計	4,354,064,700	-		4,526,769,000

## (注)時価の算定方法

## 不動産投信指数先物取引

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年5月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3527円 (23,527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11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	5,610	1,091,706,000	
	GLP投資法人	46,917	7,905,514,500	
	NTT都市開発リート投資法人	13,885	2,023,044,500	
	Oneリート投資法人	2,514	676,014,600	
	SOSILA物流リート投資法人	6,739	1,032,414,800	
	いちごオフィスリート投資法人	11,870	985,210,000	
	いちごホテルリート投資法人	2,400	213,120,000	
	アクティブ・プロパティーズ 投資法人	7,720	3,165,200,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	14,484	4,982,496,000	
	イオンリート投資法人	17,036	2,514,513,600	
	インヴィンシブル投資法人	63,759	2,639,622,600	
	エスコンジャパンリート投資法人	2,917	384,168,900	
	オリックス不動産投資法人	28,863	5,264,611,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	9,924	1,079,731,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人	4,481	2,970,903,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ ネクスト投資法人	10,365	2,164,212,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	5,784	1,561,101,600	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	6,739	2,223,870,000	
	サムティ・レジデンシャル投資 法人	3,281	434,076,300	
	サンケイリアルエステート投資 法人	4,588	428,519,200	
	ザイマックス・リート投資法人	2,338	284,768,400	
ジャパン・ホテル・リート投資 法人	44,379	2,826,942,300		
ジャパンエクセレント投資法人	13,442	1,649,333,400		

ジャパンリアルエステイト投資法人	14,486	9,053,750,000	
スターアジア不動産投資法人	14,970	869,757,000	
スターツプロシード投資法人	2,256	530,836,800	
タカラレーベン不動産投資法人	5,713	683,846,100	
トーセイ・リート投資法人	3,027	396,537,000	
ヒューリックリート投資法人	13,514	2,104,129,800	
フロンティア不動産投資法人	5,078	2,536,461,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	3,549	561,451,800	
マリモ地方創生リート投資法人	1,696	226,924,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	32,611	4,565,540,000	
ラサールロジポート投資法人	17,734	3,060,888,400	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,648	868,662,400	
阪急阪神リート投資法人	6,543	954,623,700	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	5,706	3,018,474,000	
三菱地所物流リート投資法人	4,208	1,880,976,000	
産業ファンド投資法人	20,565	3,781,903,500	
森トラスト・ホテルリート投資法人	3,399	428,274,000	
森トラスト総合リート投資法人	10,353	1,422,502,200	
森ヒルズリート投資法人	17,034	2,498,887,800	
星野リゾート・リート投資法人	2,428	1,607,336,000	
積水ハウス・リート投資法人	43,972	3,381,446,800	
大江戸温泉リート投資法人	2,338	161,789,600	
大和ハウスリート投資法人	21,751	6,742,810,000	
大和証券オフィス投資法人	3,063	2,196,171,000	
大和証券リビング投資法人	19,574	2,237,308,200	
投資法人みらい	17,547	863,312,400	
東海道リート投資法人	1,109	125,982,400	
東急リアル・エステート投資法人	9,712	1,778,267,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	5,002	3,201,280,000	
日本ビルファンド投資法人	16,888	11,264,296,000	
日本プライムリアルティ投資法人	9,898	3,815,679,000	
日本プロロジスリート投資法人	23,701	8,070,190,500	
日本リート投資法人	4,470	1,618,140,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	9,768	3,032,964,000	
日本都市ファンド投資法人	73,090	7,477,107,000	
福岡リート投資法人	7,492	1,194,974,000	
平和不動産リート投資法人	9,384	1,401,031,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	46,845	7,621,681,500	
投資証券 合計	846,157	155,737,287,200	
合計		155,737,287,200	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2022年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,910,580,644
投資信託受益証券	4,918,168,442
投資証券	42,817,677,908
派生商品評価勘定	227,880
未収入金	8,818,227,848
未収配当金	83,993,113
流動資産合計	59,548,875,835
資産合計	59,548,875,835
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	282,398
前受金	152,136,506
未払金	72,822,900
未払解約金	2,877,972,000
流動負債合計	3,103,213,804
負債合計	3,103,213,804
純資産の部	
元本等	
元本	33,426,474,476
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	23,019,187,555
元本等合計	56,445,662,031
純資産合計	56,445,662,031
負債純資産合計	59,548,875,835

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2022年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	49,033,840,425円
同期中追加設定元本額	65,923,010,457円
同期中一部解約元本額	81,530,376,406円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	90,175,514円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	50,800,784円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,720,407円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	24,191,939円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	129,033,757円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	31,753,977円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	16,976,717円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,793,514円
たわらノーロード 先進国リート	12,026,941,487円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,081,948,134円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	309,146,757円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,066,666,863円
たわらノーロード バランス(堅実型)	18,576,796円

たわらノーロード バランス(標準型)	353,390,489円
たわらノーロード バランス(積極型)	714,522,322円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	2,849,915円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	5,559,853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)	82,507,729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)	195,108,070円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,645,189円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,917,519円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,712,041円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,053,355,582円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,409,019円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	494,358,281円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	42,883,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	180,881,613円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	232,426,715円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	461,095,501円
投資のソムリエ	6,658,677,593円
投資のソムリエ<DC年金>	410,087,217円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	192,368,902円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	306,716,032円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,677,377,987円
ワールドアセットバランス(基本コース)	355,965,633円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	404,966,031円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	24,298,659円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,434,044円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,116,594円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	79,303,088円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	620,599,670円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	159,578,489円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	24,710,427円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	10,695,989円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,237,668円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,132,991円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	282,642,227円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	240,098,810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)	983,915円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	91,764,215円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	656,048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)	39,117,042円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	459,027円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	50,771,390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)	583,400円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	826,526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)	692,408円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	170,770,932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)	1,380,735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)	6,155,616円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	24,224,451円
D I A M世界アセットバランスファンドV A(適格機関投資家向け)	76,247,712円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A(適格機関投資家限定)	183,504,280円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,149,314,230円
D I A M海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	436,537,261円
計	33,426,474,476円
2. 受益権の総数	33,426,474,476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11月12日 至 2022年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年5月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	475,071,955	
投資証券	5,617,289,529	
合計	6,092,361,484	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年6月23日から2022年5月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2022年5月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建					
アメリカ・ドル	8,364,795,145	-	8,364,908,883	113,738	
イギリス・ポンド	6,385,190,000	-	6,385,292,900	102,900	
イスラエル・シケル	444,148,615	-	444,194,842	46,227	
オーストラリア・ドル	13,252,500	-	13,198,810	53,690	
カナダ・ドル	550,469,340	-	550,411,483	57,857	
シンガポール・ドル	152,078,400	-	152,094,472	16,072	
ユーロ	299,756,800	-	299,724,480	32,320	
韓国・ウォン	333,563,490	-	333,571,896	8,406	
香港・ドル	20,410,000	-	20,420,000	10,000	
買建					
アメリカ・ドル	165,926,000	-	166,000,000	74,000	
アメリカ・ドル	26,004,000	-	26,063,220	59,220	
アメリカ・ドル	26,004,000	-	26,063,220	59,220	
合計	8,390,799,145	-	8,390,972,103	54,518	

(注)時価の算定方法  
為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年5月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6887円 (16,887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11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	234,200.000	167,453.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	444,700.000	266,820.000		
		PRIME US REIT	187,500.000	133,125.000		
		アメリカ・ドル	小計	939,100.000	567,398.000 (73,943,307)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	112,986.000	331,048.980		
		ARENA REIT	87,709.000	365,746.530		
		BWP TRUST	123,132.000	493,759.320		
		CENTURIA CAPITAL GROUP	160,650.000	372,708.000		
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	137,552.000	466,301.280		
CENTURIA OFFICE REIT		134,024.000	268,048.000			
CHARTER HALL GROUP		123,089.000	1,626,005.690			
CHARTER HALL LONG WALE REIT	157,436.000	758,841.520				
CHARTER HALL RETAIL REIT	133,314.000	537,255.420				

	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	98,242.000	339,917.320	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	354,475.000	285,352.370	
	DEXUS	280,924.000	2,980,603.640	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	66,614.000	205,837.260	
	GDI PROPERTY GROUP	120,130.000	121,931.950	
	GOODMAN GROUP	445,302.000	8,558,704.440	
	GPT GROUP	499,716.000	2,343,668.040	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	86,526.000	325,337.760	
	HEALTHCO REIT	82,879.000	136,750.350	
	HOME CONSORTIUM LTD	53,921.000	308,967.330	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	370,828.000	472,805.700	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	57,562.000	198,588.900	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	92,600.000	362,992.000	
	IRONGATE GROUP	167,333.000	320,777.360	
	MIRVAC GROUP	1,028,153.000	2,241,373.540	
	NATIONAL STORAGE REIT	277,992.000	625,482.000	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	81,543.000	75,019.560	
	RURAL FUNDS GROUP	95,654.000	277,396.600	
	SCENTRE GROUP	1,356,742.000	3,731,040.500	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	288,128.000	815,402.240	
	STOCKLAND	622,791.000	2,391,517.440	
	VICINITY CENTRES	1,007,669.000	1,783,574.130	
	WAYPOINT REIT LTD	183,821.000	443,008.610	
	オーストラリア・ドル 小計	8,889,437.000	34,565,763.780 (3,129,238,595)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	110,195.000	149,865.200	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	876,360.000	2,418,753.600	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	496,116.000	565,572.240	
	CAPITALAND CHINA TRUST	292,980.000	328,137.600	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,329,209.000	2,964,136.070	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	190,500.000	243,840.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	129,700.000	81,062.500	
	ESR LOGOS REIT	1,311,540.000	491,827.500	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	255,500.000	164,797.500	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	335,700.000	100,710.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	275,700.000	628,596.000	

		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	756,064.000	1,058,489.600	
		IREIT GLOBAL	137,400.000	84,501.000	
		KEPPEL DC REIT	340,500.000	681,000.000	
		KEPPEL REIT	505,400.000	581,210.000	
		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	433,400.000	335,885.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	568,300.000	1,039,989.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	504,420.000	1,250,961.600	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	832,220.000	1,381,485.200	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	556,700.000	668,040.000	
		QUE COMMERCIAL REIT	728,555.000	298,707.550	
		PARKWAY LIFE REIT	98,900.000	469,775.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	142,400.000	116,056.000	
		SPH REIT	277,100.000	261,859.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	423,200.000	249,688.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	564,390.000	965,106.900	
		シンガポール・ドル 小計	12,472,449.000	17,580,052.560 (1,646,723,523)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	90,340.000	194,231.000	
	ユーロ 小計		90,340.000	194,231.000 (26,662,089)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	368,000.000	2,506,080.000	
	香港・ドル 小計		368,000.000	2,506,080.000 (41,600,928)	
		投資信託受益証券 合計	22,759,326	4,918,168,442 (4,918,168,442)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	22,725.000	430,638.750	
		AGREE REALTY CORP	18,562.000	1,221,936.460	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	18,574.000	373,151.660	
		ALEXANDER'S INC.	640.000	149,280.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	38,127.000	6,220,801.320	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,685.000	48,464.250	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	13,534.000	437,689.560	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	36,362.000	2,347,167.100	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	77,203.000	2,755,375.070	
		AMERICOLD REALTY TRUST	69,614.000	1,733,388.600	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	40,968.000	1,737,452.880	

APARTMENT INVT & MGMT CO-A	47,057.000	255,519.510	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	55,129.000	912,384.950	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	16,931.000	210,960.260	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,836.000	49,393.240	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	36,618.000	7,326,895.620	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,559.000	222,534.000	
BOSTON PROPERTIES INC	37,209.000	4,103,036.430	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	15,584.000	89,919.680	
BRANDYWINE REALTY TRUST	44,056.000	473,161.440	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	77,739.000	1,791,883.950	
BROADSTONE NET LEASE INC	41,832.000	803,592.720	
BRT APARTMENTS CORP	5,193.000	98,199.630	
CAMDEN PROPERTY TRUST	26,745.000	3,786,022.200	
CARETRUST REIT INC	24,897.000	407,812.860	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	7,793.000	170,666.700	
CEDAR REALTY TRUST INC	3,383.000	92,592.710	
CENTERSPACE	3,821.000	307,781.550	
CHATHAM LODGING TRUST	14,827.000	178,220.540	
CITY OFFICE REIT INC	12,631.000	168,876.470	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	42,315.520	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	5,911.000	218,707.000	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	29,106.000	730,851.660	
COUSINS PROPERTIES INC	38,734.000	1,289,842.200	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	4,068.000	25,709.760	
CTO REALTY GROUTH INC	1,652.000	98,921.760	
CUBESMART	57,179.000	2,440,399.720	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	54,281.000	534,667.850	
DIGITAL REALTY TRUST INC	74,378.000	9,416,254.800	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	133,108.000	726,769.680	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	71,346.000	148,399.680	
DOUGLAS EMMETT INC	45,705.000	1,250,945.850	
DUKE REALTY TRUST	99,717.000	4,943,968.860	
EAST GROUP	10,616.000	1,764,803.840	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	22,100.000	401,778.000	

EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	42,294.000	330,739.080	
EPR PROPERTIES	19,440.000	981,331.200	
EQUINIX INC	23,607.000	14,873,590.350	
EQUITY COMMONWEALTH	29,315.000	751,636.600	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	45,158.000	3,101,903.020	
EQUITY RESIDENTIAL	89,522.000	6,516,306.380	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	31,473.000	690,832.350	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	17,086.000	4,894,797.280	
EXTRA SPACE STORAGE INC	35,070.000	6,147,069.600	
FARMLAND PARTNERS INC	8,004.000	117,658.800	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	18,479.000	2,024,928.820	
FIRST INDUSTRIAL RT	33,996.000	1,741,615.080	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	19,932.000	505,475.520	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	28,147.000	126,942.970	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	61,391.000	2,610,345.320	
GETTY REALTY CORP	11,730.000	292,194.300	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,399.000	214,187.210	
GLADSTONE LAND CORP	9,276.000	288,019.800	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	18,571.000	232,694.630	
GLOBAL NET LEASE INC	26,481.000	340,810.470	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	38,403.000	1,157,466.420	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	57,613.000	1,628,143.380	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	141,170.000	4,140,516.100	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,024.000	90,420.480	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	27,275.000	1,024,176.250	
HOST HOTELS & RESORTS INC	186,832.000	3,643,224.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	39,564.000	816,205.320	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	57,473.000	1,275,325.870	
INDUS REALTY TRUST INC	1,952.000	129,651.840	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	19,417.000	284,459.050	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	7,065.000	908,629.650	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	17,317.000	471,715.080	
INVITATION HOMES INC	156,296.000	5,603,211.600	

IRON MOUNTAIN INC	75,785.000	3,902,927.500	
JBG SMITH PROPERTIES	29,565.000	711,333.900	
KILROY REALTY CORP	27,408.000	1,649,413.440	
KIMCO REALTY	161,375.000	3,668,053.750	
KITE REALTY GROUP TRUST	57,011.000	1,176,136.930	
LIFE STORAGE INC	21,434.000	2,444,333.360	
LTC PROPERTIES INC	10,066.000	346,874.360	
LXP INDUSTRIAL TRUST	73,368.000	820,987.920	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	156,048.000	2,740,202.880	
MID AMERICA	30,205.000	5,264,127.400	
NATIONAL HEALTH INVS INC	11,856.000	616,512.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	45,856.000	1,915,863.680	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	21,310.000	1,099,809.100	
NETSTREIT CORP	9,938.000	198,660.620	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,833.000	434,266.850	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	14,378.000	284,971.960	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	62,361.000	1,692,477.540	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,539.000	116,334.570	
ORION OFFICE REIT INC	17,284.000	209,827.760	
PARAMOUNT GROUP INC	42,030.000	357,675.300	
PARK HOTELS & RESORTS INC	61,521.000	1,131,371.190	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	34,044.000	763,947.360	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,075.000	10,874.050	
PHILLIPS EDISON & CO INC	29,473.000	938,125.590	
PHYSICIANS REALTY TRUST	57,266.000	1,002,727.660	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	31,951.000	473,194.310	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,629.000	218,744.820	
POSTAL REALTY TRUST INC	5,420.000	86,665.800	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	15,866.000	393,476.800	
PROLOGIS INC	194,060.000	24,337,064.600	
PS BUSINESS PARKS	5,226.000	976,478.100	
PUBLIC STORAGE	39,992.000	12,492,301.040	
REALTY INCOME CORP	148,276.000	9,415,526.000	
REGENCY CENTERS CORP	40,285.000	2,660,018.550	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	31,319.000	536,494.470	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	41,905.000	2,817,692.200	



	RLJ LODGING TRUST	42,947.000	551,010.010	
	RPT REALTY	25,106.000	303,029.420	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	14,336.000	1,242,357.760	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	59,277.000	747,482.970	
	SAFEHOLD INC	4,102.000	171,340.540	
	SAUL CENTERS INC	3,954.000	187,300.980	
	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	10,015.000	94,741.900	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	49,250.000	304,857.500	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	86,129.000	10,255,380.030	
	SITE CENTERS CORP	46,469.000	683,094.300	
	SL GREEN	16,676.000	1,059,593.040	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	33,267.000	1,304,066.400	
	STAG INDUSTRIAL INC	45,957.000	1,574,027.250	
	STORE CAPITAL CORP	64,030.000	1,677,586.000	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	31,568.000	280,008.160	
	SUN COMMUNITIES INC	30,364.000	4,745,285.920	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	56,705.000	651,540.450	
	TANGER FACTORY OUTLET	26,757.000	483,766.560	
	TERRENO REALTY CORP	19,661.000	1,271,673.480	
	THE MACERICH COMPANY	55,181.000	717,904.810	
	THE NECESSITY RETAIL REIT INC	36,537.000	255,393.630	
	UDR INC	78,260.000	3,642,220.400	
	UMH PROPERTIES INC	13,520.000	264,451.200	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,718.000	179,058.880	
	URBAN EDGE PROPERTIES	28,370.000	499,595.700	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	8,987.000	150,622.120	
	VENTAS INC	104,552.000	5,499,435.200	
	VERIS RESIDENTIAL INC	23,898.000	335,288.940	
	VICI PROPERTIES INC	220,827.000	5,891,664.360	
	VORNADO REALTY TRUST	41,449.000	1,401,390.690	
	WASHINGTON REIT	21,793.000	490,996.290	
	WELLTOWER INC	114,082.000	9,788,235.600	
	WHITESTONE REIT	13,270.000	149,951.000	
	WP CAREY INC	49,882.000	3,791,032.000	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	29,431.000	543,296.260	
アメリカ・ドル	小計	5,984,878.000	279,989,533.220 (36,488,235,969)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	35,387.000	42,393.620	
	ASSURA PLC	761,594.000	488,943.340	

BIG YELLOW GROUP PLC	44,742.000	536,904.000	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	202,992.000	223,291.200	
BRITISH LAND CO PLC	244,491.000	1,173,556.800	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	218,422.000	336,588.300	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	154,314.000	129,160.810	
CUSTODIAN REIT PLC	131,826.000	132,089.650	
DERWENT LONDON PLC	29,166.000	812,564.760	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	182,998.000	154,999.300	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	65,438.000	424,038.240	
HAMMERSON PLC	887,134.000	234,203.370	
HOME REIT PLC	165,476.000	199,233.100	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	116,154.000	142,404.800	
INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
LAND SECURITIES GROUP PLC	196,019.000	1,370,172.810	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	253,468.000	595,649.800	
LXI REIT PLC	233,750.000	332,392.500	
NEWRIVER REIT PLC	85,108.000	74,043.960	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	166,228.000	158,581.510	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	344,188.000	476,700.380	
PRS REIT PLC/THE	160,752.000	170,397.120	
REGIONAL REIT LTD	127,500.000	104,295.000	
SAFESTORE HOLDINGS LTD	54,595.000	573,793.450	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	157,850.000	87,764.600	
SEGRO PLC	314,743.000	3,446,435.850	
SHAFTESBURY PLC	74,248.000	415,046.320	
STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	118,767.000	97,388.940	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	252,333.000	312,892.920	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	107,890.000	96,129.990	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	486,148.000	968,406.810	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	228,862.000	197,965.630	
UNITE GROUP PLC	103,957.000	1,045,807.420	
WORKSPACE GROUP PLC	35,485.000	220,716.700	
イギリス・ボンド 小計	6,973,065.000	15,774,953.000 (2,534,403,949)	

イスラエル・シケル	REIT 1 LTD	48,544.000	1,004,860.800	
イスラエル・シケル 小計		48,544.000	1,004,860.800 (37,891,090)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	16,136.000	603,647.760	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,685.000	175,926.300	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,790.000	63,323.800	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,725.000	269,304.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,592.000	68,960.640	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	22,031.000	1,019,814.990	
	CHOICE PROPERTIES REIT	41,281.000	588,254.250	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	14,862.000	243,142.320	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,232.000	257,116.160	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	30,744.000	414,736.560	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	5,638.000	127,418.800	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,129.000	64,004.370	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,417.000	401,384.880	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,303.000	702,267.740	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	36,059.000	424,414.430	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	33,986.760	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	20,035.000	251,839.950	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,149.000	261,049.050	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,486.000	96,608.460	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5,297.000	90,207.910	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	7,791.000	87,415.020	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,847.000	346,695.150	
	PLAZA RETAIL REIT	19,764.000	88,542.720	
PRIMARIS REIT	14,325.000	193,101.000		
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	39,207.000	822,954.930		
SLATE GROCERY REIT	8,168.000	113,453.520		

	SLATE OFFICE REIT	8,950.000	43,497.000	
	SMARTCENTRES REIT	18,170.000	510,758.700	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	23,242.000	428,582.480	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	11,141.000	68,739.970	
カナダ・ドル 小計		502,839.000	8,861,149.620 (886,735,242)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	246,979.000	306,253.960	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	268,144.000	577,850.320	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	397,607.000	399,595.030	
	PRECINCT PROPERTIES	330,506.000	446,183.100	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	129,172.000	382,349.120	
ニュージーランド・ドル 小計		1,372,408.000	2,112,231.530 (173,245,230)	
ユーロ	AEDIFICA	9,443.000	1,006,623.800	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,621.000	62,291.080	
	ALTAREA	1,186.000	162,719.200	
	BEFIMMO	6,230.000	292,187.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	8,178.000	191,774.100	
	CARMILA SA	13,743.000	192,402.000	
	COFINIMMO SA	7,661.000	942,303.000	
	COIMA RES SPA	4,972.000	48,974.200	
	COVIVIO	12,269.000	793,190.850	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	9,943.000	207,212.120	
	GECINA SA	14,175.000	1,447,267.500	
	HAMBORNER REIT AG	17,478.000	144,543.060	
	HIBERNIA REIT PLC	168,162.000	271,749.790	
	ICADE	8,239.000	451,497.200	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	16,006.000	61,463.040	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	70,984.000	531,315.240	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,205.000	180,125.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	118,628.000	168,451.760	
	KLEPIERRE	50,765.000	1,108,199.950	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	16,845.000	81,866.700	
	MERCIALYS	14,017.000	113,747.950	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	86,598.000	849,093.390	
	MONTEA SCA	2,589.000	248,802.900	
NSI NV	4,758.000	166,530.000		
RETAIL ESTATES	3,014.000	205,253.400		

	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	30,410.000	2,090,079.300	
	VASTNED RETAIL	5,338.000	122,507.100	
	WAREHOUSES DE PAUW	36,554.000	1,149,257.760	
	WERELDHAVE NV	9,961.000	146,825.140	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,282.000	250,366.800	
ユーロ 小計		765,254.000	13,688,620.330 (1,879,036,913)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,571.000	88,489,140.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	36,837.000	243,860,940.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	6,134.000	36,313,280.000	
	JR REIT XXVII	28,338.000	160,959,840.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	12,106.000	79,173,240.000	
	LOTTE REIT CO LTD	34,943.000	201,271,680.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	21,920.000	105,764,000.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	16,189.000	124,979,080.000	
韓国・ウォン 小計		189,091.000	1,148,366,300.000 (117,248,199)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	477,070.000	1,622,038.000	
	LINK REIT	552,520.000	36,687,328.000	
	PROSPERITY REIT	360,000.000	972,000.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	287,000.000	1,064,770.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	607,000.000	1,875,630.000	
香港・ドル 小計		2,283,590.000	42,221,766.000 (700,881,316)	
投資証券 合計		18,119,669	42,817,677,908 (42,817,677,908)	
合計			47,735,846,350 (47,735,846,350)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 4銘柄	0.13	-	76.59
	投資証券 149銘柄	-	64.64	
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-	4.49	5.31

イスラエル・シケル	投資証券	1銘柄	-	0.07	0.08
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	32銘柄	5.54	-	6.56
カナダ・ドル	投資証券	30銘柄	-	1.57	1.86
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	26銘柄	2.92	-	3.45
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	-	0.31	0.36
ユーロ	投資信託受益証券	1銘柄	0.05	-	3.99
	投資証券	30銘柄	-	3.33	
韓国・ウォン	投資証券	9銘柄	-	0.21	0.25
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.07	-	1.56
	投資証券	5銘柄	-	1.24	

(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

資産総額	427,644,735円
負債総額	127,225円
純資産総額( - )	427,517,510円
発行済数量	332,390,608口
1口当たり純資産額( / )	1.2862円

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2022年5月31日現在

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

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

## 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

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

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2022年5月31日現在

資産総額	193,625,642,173円
負債総額	11,578,719,654円
純資産総額( - )	182,046,922,519円
発行済数量	74,722,883,144口
1口当たり純資産額( / )	2.4363円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年5月31日現在

資産総額	70,523,460,002円
負債総額	9,459,880,249円
純資産総額( - )	61,063,579,753円
発行済数量	34,754,670,489口
1口当たり純資産額( / )	1.7570円



## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2)受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5)受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6)受益権の再分割

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

### (7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第二部【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)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

##### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

##### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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
ソフトウェア	2,878	3,107
ソフトウェア仮勘定	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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 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。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬</p> <p>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。</p> <p>(2) 運用受託報酬</p> <p>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。</p> <p>(3) 投資助言報酬</p> <p>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。</p> <p>(4) 成功報酬</p> <p>成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## （会計上の見積りの変更）

## 第37期

（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	12,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

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

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	利益 剰余金	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

## 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

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。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

## 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 其他有価証券	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 其他有価証券	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 其他有価証券(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 其他有価証券(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			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1	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			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1	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	第37期
	(2021年3月31日現在)	(2022年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
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

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（\*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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



## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

## (3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

	第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

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

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

#### (2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

#### (3) 投資顧問会社

名称	イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社
資本金の額	9,557.5万円（2022年3月末日現在）
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (6) その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【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11月26日	臨時報告書
2022年1月25日	臨時報告書
2022年2月10日	有価証券報告書
2022年2月10日	有価証券届出書
2022年3月28日	臨時報告書



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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2022年7月15日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の2021年11月12日から2022年5月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の2022年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 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、継続企業的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、継続企業的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。継続企業的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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。