【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年12月16日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	Ｏｎｅグローバルバランス
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

Ｏｎｅグローバルバランス

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

基準価額は、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。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- **販売会社へのお問い合わせ**
- **委託会社への照会**

  ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

  コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）
- **計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。**

（５）【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

※償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2022年12月17日から2023年6月16日まで

※ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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、決済機能の停止、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委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、委託会社または販売会社は、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、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

②当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。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 国内外の株式、公社債の4資産に分散投資します。

●上記資産に関しては、マザーファンド(*)を通じて実質的に投資します。

(*)ファンドが投資するマザーファンド(「主要投資対象マザーファンド」といいます。)は以下のとおりです。
・国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
・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
また、「DIAMマネーマザーファンド」および短期金融資産に直接投資する場合もあります。(「主要投資対象マザーファンド」および「DIAMマネーマザーファンド」を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。)

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

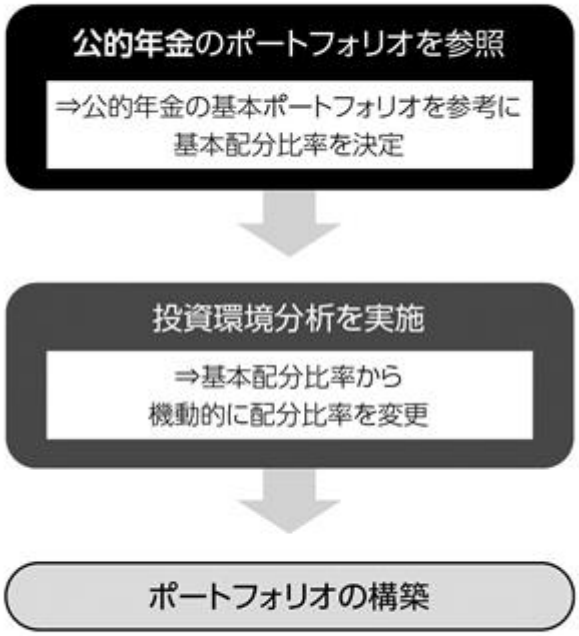
2 主要投資対象マザーファンドへの投資割合については、公的年金の基本ポートフォリオ(*)を考慮しつつ、投資環境分析による各資産の魅力度判定に応じた機動的な変更を行うことで、信託財産の成長をめざします。

(*)国民年金、厚生年金の積立金を運用している、年金積立金管理運用独立行政法人(Government Pension Investment Fund　以下「GPIF」といいます。)の基本ポートフォリオです。

※当ファンドは、アセットマネジメントOneがGPIFの基本ポートフォリオを考慮しつつ、独自に資産配分比率を決定するものであり、GPIFと何ら関係を有するものではありません。
※当ファンドの運用は、GPIFの運用成果に連動することをめざすものではありません。
※GPIFの基本ポートフォリオの資産構成が変更される場合や、GPIFの基本ポートフォリオが参照できなくなる場合などは運用方法を変更することがあります。

3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

運用プロセス



STEP1

「国内株式」、「外国株式」、「国内債券」および「外国債券」の各資産（以下「各資産」といいます。）について、年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）の基本ポートフォリオを参考に、基本配分比率を決定します。

STEP2

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

STEP3

STEP1～2で決定した配分比率に従って、各資産への投資を行います。
※STEP2において各資産の魅力度が低いと判断する場合、各資産への配分比率を引き下げ、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産への投資割合を増加させます。

■分配方針

年1回の決算時（毎年9月16日（休業日の場合は翌営業日））に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※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。

＜商品分類＞

・商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書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う。

＜属性区分＞

・属性区分表

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

（注1）「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2）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）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）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う。
年１回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
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う。
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う。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

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

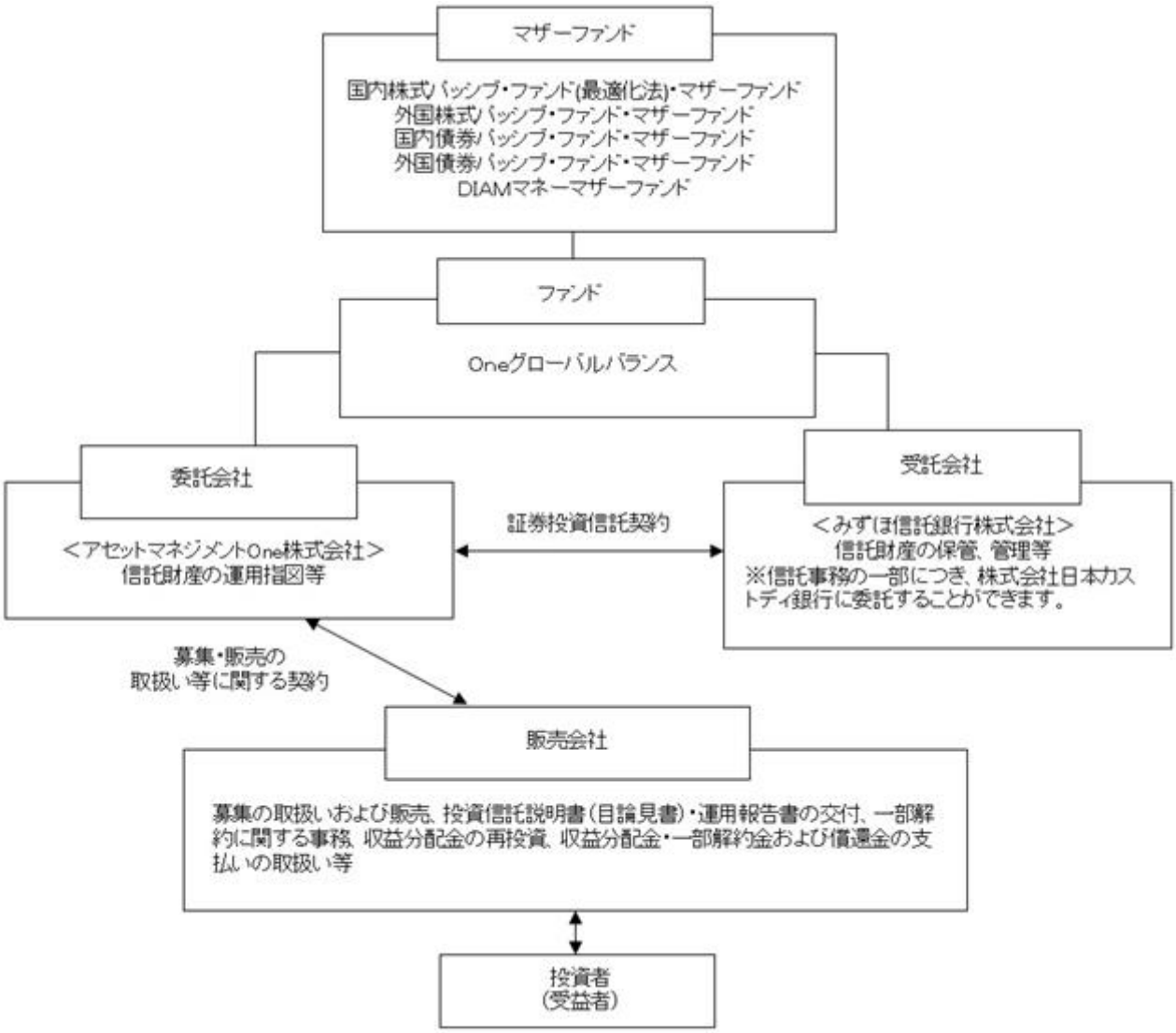
（注2）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

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

（２）【ファンドの沿革】

2021年9月16日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

（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、当ファンドにかかる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、当ファンドの運用の基本方針、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

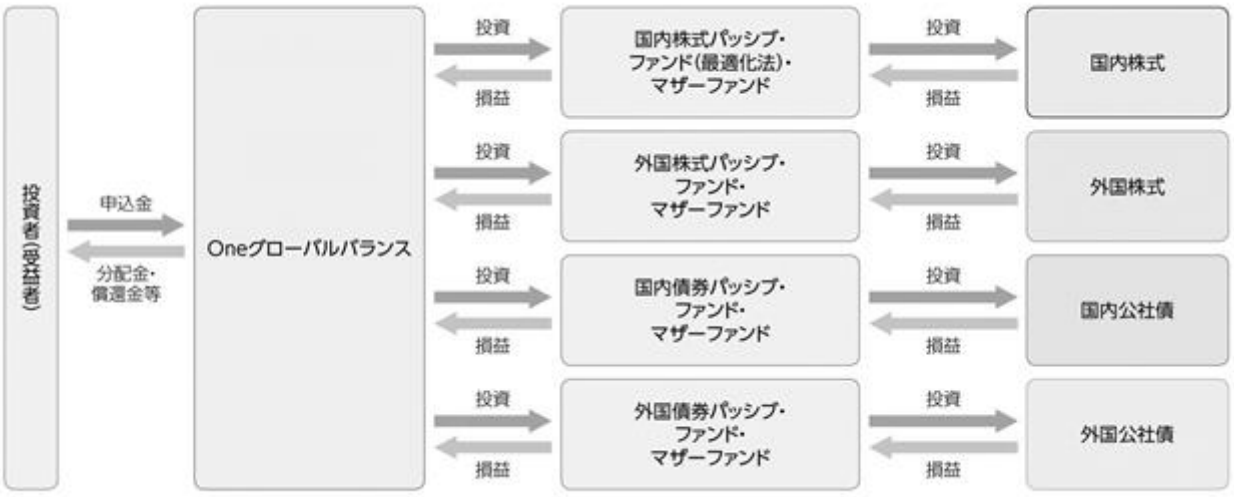
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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、収益分配金の再投資、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。

●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マザーファンドにて行う仕組みです。



※当ファンドは、ＤＩＡＭマネーマザーファンドおよび短期金融資産に直接投資する場合もあります。

○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9月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2022年9月30日現在）

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

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜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を主要投資対象とします。なお、ＤＩＡＭマネーマザーファンド受益証券や短期金融資産にも投資を行います。

＜投資態度＞

①以下のマザーファンド（主要投資対象マザーファンドといいます。）受益証券への投資を通じて、国内外の株式および公社債に実質的に投資を行います。
・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
・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
なお、ＤＩＡＭマネーマザーファンド受益証券や短期金融資産にも投資を行います。
（上記のマザーファンドを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）
②主要投資対象マザーファンド受益証券の投資割合については、公的年金が基本ポートフォリオで定める資産構成割合や、投資環境分析等を勘案のうえ決定します。
③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
④ファンドの資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16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項に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かかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主として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である国内株式パッシブ・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、ＤＩＡＭマネーマザーファンドの各受益証券を含む次の有価証券（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．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

6．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。）

7．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。）

8．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。）

9．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。）

10.コマーシャル・ペーパー

11.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

12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～11.の証券または証書の性質を有するもの

13.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

14.投資証券、新投資口予約権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、次の15.で定めるものを除きます。）

15.投資法人債券（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。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

16.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。）

17.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、有価証券にかかるものに限ります。）

18.預託証券または預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

19.外国法人が発行する譲渡性預金証書

20.指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

21.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。)

22.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

23.外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.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、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③運用の指図範囲等（約款第17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の指図を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

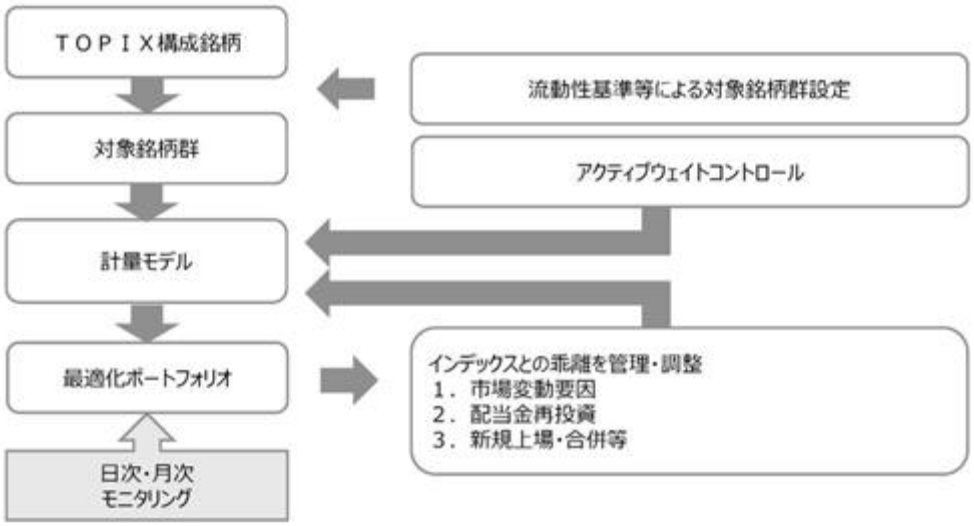
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	**国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。**
主な投資対象	**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したリスク管理を行います。 3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 ※①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。 ②ＪＰＸ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。 ③ＪＰＸ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。 ④ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥ＪＰＸ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。 ⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

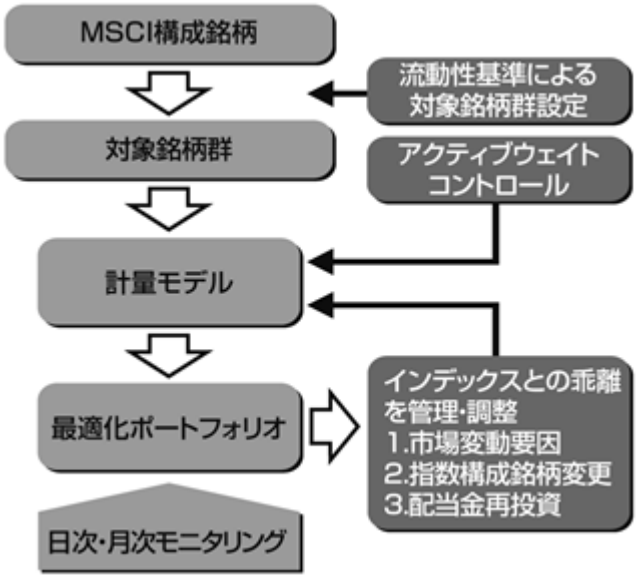
ファンド名	**外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。**
主な投資対象	**海外の株式を主要投資対象とします。**

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

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

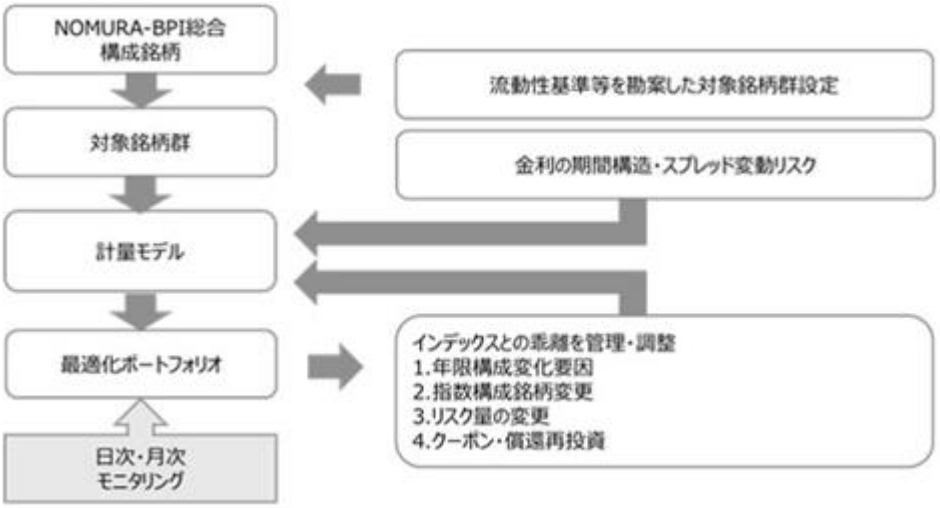
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

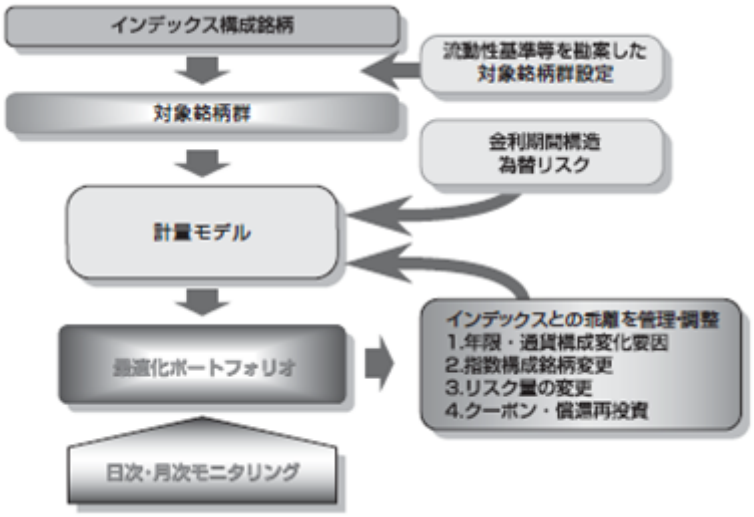
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、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

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 ※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

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

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

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

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

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

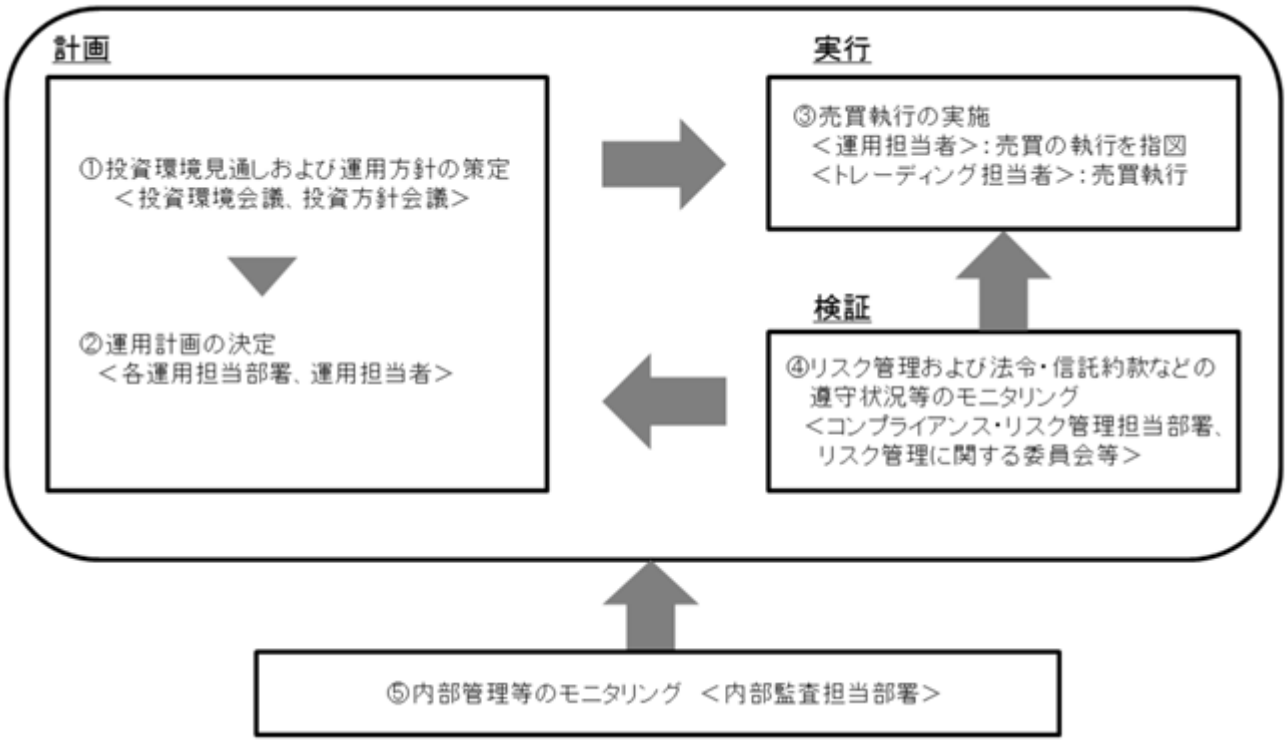
ファンド名	ＤＩＡＭマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにＣＤ、ＣＰ、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	1.国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（＊）の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がＡＡ-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のＣＤ、ＣＰを主要投資対象とします。 （＊）主要格付機関とは、Ｒ＆Ｉ、ＪＣＲ、Ｍｏｏｄｙ’ｓ、Ｓ＆Ｐとします。 2.国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。 3.ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。
運用プロセス	マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。

主な投資制限	1.株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 2.同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 3.同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4.新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 5.投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 6.外貨建て資産への投資は行いません。 7.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。 8.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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

③ 売買執行の実施

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

④ モニタリング

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

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。
※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年9月16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収益の分配を行います。

(1)分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

(2)分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、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場合があります。

(3)留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

②収益の分配方式

(1)信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1)信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料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および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）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を控除し、繰越欠損金のあるとき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。

(2)上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるこの信託の信託財産に属する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。

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

「分配金再投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（５）【投資制限】

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

②株式への実質投資割合には、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）

③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）

④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）

⑤デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑦投資する株式等の範囲（約款第20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。

⑧信用取引の指図範囲（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、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

2)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書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

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

⑨先物取引等の運用指図（約款第23条）

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2)委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品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金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の

外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑩スワップ取引の運用指図（約款第24条）

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

2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として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)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4)上記3）においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額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スワップ取引の想定元本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受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として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)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ

対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3）において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4)上記3）においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額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金利先渡取引の想定元本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受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額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ヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する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。

5)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5）において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産（「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5）において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5）において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

6)上記5）においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額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先渡取引の想定元本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受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額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ヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する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。

7)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。

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

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条）

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。

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（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、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

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

⑭公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引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)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。

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

⑮公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

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

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

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

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑯特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30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。

⑰外国為替予約取引の指図（約款第31条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2)上記1）の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

3)上記2）においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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。

5)委託会社は、外国為替の売買の予約取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑱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に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑲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、複数またはすべ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。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。当ファンドは、国内外の株式および公社債に資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数またはすべての資産の価値が同時に下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

○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。

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式市場や当ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

金利の変動は、公社債等の価格に影響をおよぼします。金利変動は、公社債・株式等の各資産への投資の相対的魅力度を変化させるため、金利変動により各資産の市場の間で資金移動が起こる場合があり、基準価額を下落させる要因となる可能性があります。

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。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、実質保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも基準価額が下落する可能性があります。

○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。

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。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、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、基準価額が下落する要因となります。

○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。

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、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要因となります。

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

○当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。

○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、決済機能の停止、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場合、信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、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も信託を終了（繰上償還）する場合があります。

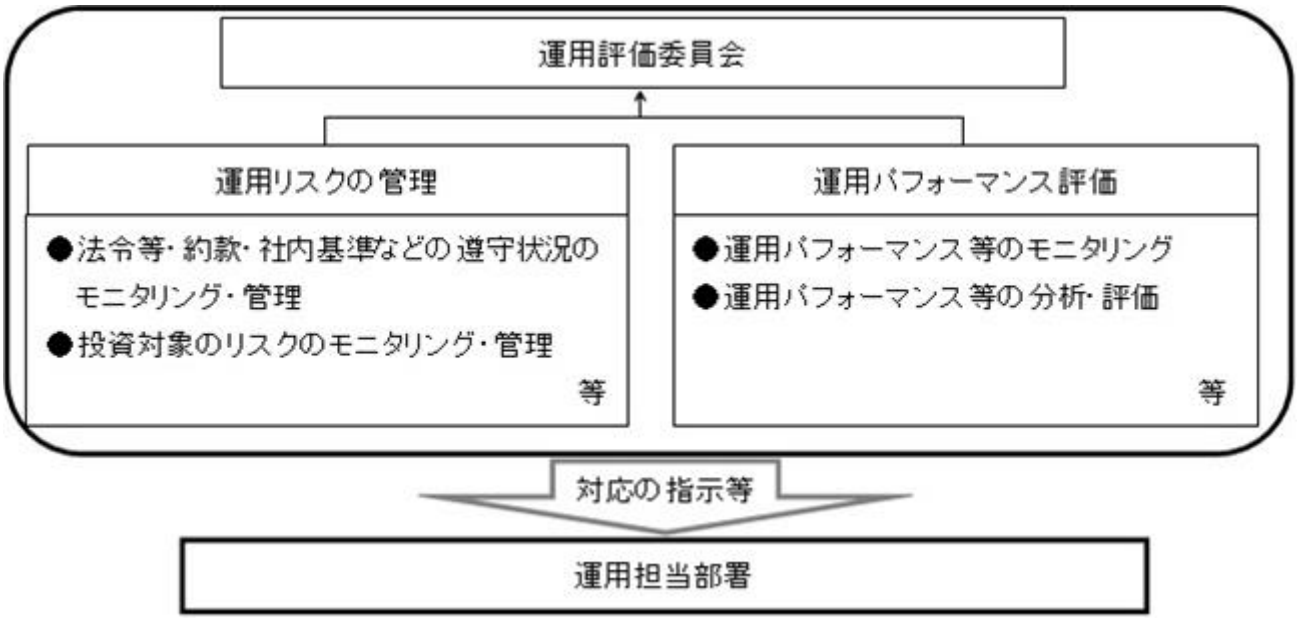
○注意事項

・当ファンドは、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。
・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

＜リスク管理体制＞

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

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



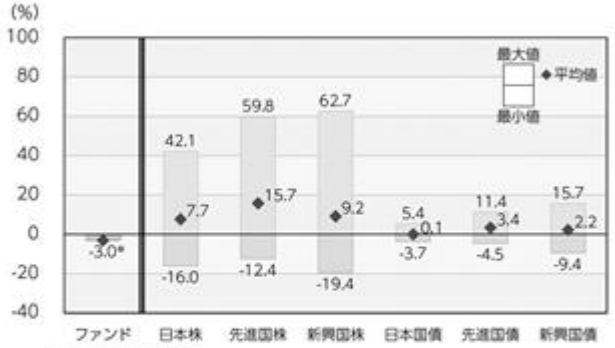
・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※リスク管理体制は2022年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

ファンド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:2022年9月
代表的な資産クラス:2017年10月～2022年9月

*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。
※2022年9月末現在、ファンドの年間騰落率は、1データのみです。

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

※償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

（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1.133%（税抜1.03%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.50%	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0.50%	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0.03%	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、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

※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】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

①信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および

毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での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、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

※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）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

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

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

○法人の受益者に対する課税

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

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は、2022年9月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
※課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

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

＜収益分配金の課税について＞

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2022年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		60,855,286	88.30
	内　日本	60,855,286	88.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,066,593	11.70
純資産総額		68,921,879	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9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		336,234,294,360	96.33
	内　日本	336,234,294,360	96.33
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		12,797,044,795	3.67
純資産総額		349,031,339,155	100.00

その他資産の投資状況

2022年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）		13,072,320,000	3.75
	内　日本	13,072,320,000	3.75

（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9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		683,929,147,033	95.31
	内　アメリカ	490,292,631,756	68.32
	内　イギリス	28,782,198,208	4.01
	内　カナダ	26,673,466,511	3.72
	内　スイス	23,246,025,167	3.24
	内　フランス	20,232,439,039	2.82
	内　オーストラリア	15,065,773,866	2.10
	内　ドイツ	14,589,994,783	2.03
	内　アイルランド	12,239,509,231	1.71
	内　オランダ	11,602,771,797	1.62
	内　スウェーデン	6,111,599,253	0.85
	内　デンマーク	5,180,241,418	0.72
	内　スペイン	4,745,340,137	0.66
	内　香港	4,439,324,194	0.62
	内　イタリア	3,244,619,920	0.45
	内　ジャージィー	2,614,112,838	0.36
	内　フィンランド	2,450,132,629	0.34

	内　シンガポール	2,376,141,363	0.33
	内　イスラエル	1,691,439,152	0.24
	内　ベルギー	1,568,944,018	0.22
	内　ノルウェー	1,556,421,289	0.22
	内　ケイマン諸島	1,414,277,982	0.20
	内　バミューダ	947,069,362	0.13
	内　オランダ領キュラソー	829,759,132	0.12
	内　ニュージーランド	480,408,838	0.07
	内　ルクセンブルグ	428,982,056	0.06
	内　ポルトガル	379,053,171	0.05
	内　オーストリア	328,968,332	0.05
	内　リベリア	173,641,132	0.02
	内　パナマ	134,107,718	0.02
	内　マン島	109,752,741	0.02
投資信託受益証券		1,148,918,913	0.16
	内　オーストラリア	813,069,978	0.11
	内　シンガポール	335,848,935	0.05
投資証券		15,239,605,979	2.12
	内　アメリカ	14,364,392,672	2.00
	内　イギリス	290,013,397	0.04
	内　香港	233,829,174	0.03
	内　フランス	229,467,180	0.03
	内　カナダ	65,175,573	0.01
	内　ベルギー	56,727,983	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		17,283,754,026	2.41
純資産総額		717,601,425,951	100.00

その他資産の投資状況

2022年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		17,973,388,222	2.50
	内　アメリカ	13,705,553,310	1.91
	内　ドイツ	2,441,784,240	0.34
	内　イギリス	778,503,908	0.11
	内　カナダ	662,214,896	0.09
	内　オーストラリア	385,331,868	0.05

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		676,337,809,450	91.06
	内　日本	676,337,809,450	91.06
地方債証券		33,724,899,142	4.54
	内　日本	33,724,899,142	4.54
特殊債券		31,563,874,476	4.25
	内　日本	31,563,874,476	4.25

社債券		26,536,386,560	3.57
	内　日本	25,841,958,560	3.48
	内　フランス	694,428,000	0.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△25,423,767,238	△3.42
純資産総額		742,739,202,390	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9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		176,266,319,352	99.01
	内　アメリカ	93,236,598,197	52.37
	内　フランス	14,944,993,754	8.39
	内　イタリア	13,009,771,654	7.31
	内　ドイツ	11,117,232,733	6.24
	内　スペイン	8,763,678,725	4.92
	内　イギリス	7,382,929,842	4.15
	内　中国	5,187,526,766	2.91
	内　カナダ	3,737,691,916	2.10
	内　ベルギー	3,301,250,313	1.85
	内　オランダ	2,729,090,527	1.53
	内　オーストラリア	2,692,908,180	1.51
	内　オーストリア	2,074,882,420	1.17
	内　メキシコ	1,463,762,349	0.82
	内　アイルランド	1,124,025,849	0.63
	内　フィンランド	931,160,653	0.52
	内　マレーシア	905,368,304	0.51
	内　シンガポール	757,490,983	0.43
	内　ポーランド	743,137,298	0.42
	内　イスラエル	686,931,562	0.39
	内　デンマーク	656,290,024	0.37
	内　スウェーデン	465,871,888	0.26
	内　ノルウェー	353,725,415	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,769,305,080	0.99
純資産総額		178,035,624,432	100.00

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2022年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	18,440,623	1.2662 23,349,517	1.2612 23,257,313	－ －	33.74

2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	8,229,412	2.1283 17,514,658	2.0830 17,141,865	－ －	24.87
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,775,859	6.1624 10,943,731	5.7818 10,267,661	－ －	14.90
4	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,268,042	3.2572 10,644,993	3.1176 10,188,447	－ －	14.78

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年9月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	88.30
合計	88.30

（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9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	6,534,300	2,196.52 14,352,770,366	1,876.00 12,258,346,800	－ －	3.51
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	897,900	12,220.07 10,972,408,802	9,286.00 8,337,899,400	－ －	2.39
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	129,900	54,582.94 7,090,323,911	47,900.00 6,222,210,000	－ －	1.78
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,576,400	3,620.37 5,707,163,679	3,906.00 6,157,418,400	－ －	1.76
5	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,274,800	748.76 6,195,852,443	651.50 5,391,032,200	－ －	1.54
6	任天堂 日本	株式 その他製品	809,000	5,886.77 4,762,401,505	5,854.00 4,735,886,000	－ －	1.36
7	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,025,300	4,051.70 4,154,214,982	4,243.00 4,350,347,900	－ －	1.25
8	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,126,600	3,589.88 4,044,359,389	3,767.00 4,243,902,200	－ －	1.22
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	689,400	6,184.68 4,263,719,572	6,114.00 4,214,991,600	－ －	1.21

10	第一三共 日本	株式 医薬品	1,039,700	2,746.78 2,855,835,275	4,042.00 4,202,467,400	－ －	1.20
11	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	843,400	5,323.80 4,490,098,241	4,900.00 4,132,660,000	－ －	1.18
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	981,200	5,151.22 5,054,377,361	4,161.00 4,082,773,200	－ －	1.17
13	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	273,100	14,223.11 3,884,332,713	13,880.00 3,790,628,000	－ －	1.09
14	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	917,400	4,207.43 3,859,897,846	4,024.00 3,691,617,600	－ －	1.06
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	925,600	4,124.21 3,817,377,742	3,968.00 3,672,780,800	－ －	1.05
16	ダイキン工業 日本	株式 機械	156,500	22,068.09 3,453,656,161	22,295.00 3,489,167,500	－ －	1.00
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,048,000	3,363.70 3,525,158,942	3,137.00 3,287,576,000	－ －	0.94
18	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	91,000	54,466.10 4,956,415,322	35,700.00 3,248,700,000	－ －	0.93
19	信越化学工業 日本	株式 化学	222,500	18,156.79 4,039,886,788	14,330.00 3,188,425,000	－ －	0.91
20	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,130,300	1,475.99 3,144,320,243	1,446.50 3,081,478,950	－ －	0.88
21	三井物産 日本	株式 卸売業	992,000	3,051.94 3,027,532,979	3,089.00 3,064,288,000	－ －	0.88
22	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,180,200	2,454.72 2,897,064,705	2,565.00 3,027,213,000	－ －	0.87
23	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	846,400	3,780.09 3,199,468,318	3,501.00 2,963,246,400	－ －	0.85
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	145,700	20,681.78 3,013,335,551	19,705.00 2,871,018,500	－ －	0.82
25	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	473,300	5,590.55 2,646,009,396	5,806.00 2,747,979,800	－ －	0.79
26	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,695,000	1,595.12 2,703,730,044	1,562.50 2,648,437,500	－ －	0.76
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	391,000	8,085.52 3,161,438,653	6,632.00 2,593,112,000	－ －	0.74
28	日本電産 日本	株式 電気機器	318,400	9,423.03 3,000,295,083	8,130.00 2,588,592,000	－ －	0.74
29	ファナック 日本	株式 電気機器	125,800	21,848.01 2,748,479,663	20,260.00 2,548,708,000	－ －	0.73
30	ＳＭＣ 日本	株式 機械	42,000	64,363.74 2,703,277,323	58,220.00 2,445,240,000	－ －	0.70

（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9月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.33
合計	96.33

（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。

投資株式の業種別投資比率

2022年9月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	15.96
情報・通信業		8.92
輸送用機器		7.32
化学		5.93
医薬品		5.51
卸売業		5.44
サービス業		5.26
銀行業		5.15
機械		5.02
小売業		4.53
食料品		3.45
陸運業		3.23
精密機器		2.74
その他製品		2.46
保険業		2.19
建設業		2.18
不動産業		1.96
電気・ガス業		1.21
その他金融業		1.10
鉄鋼		0.78
非鉄金属		0.72
証券、商品先物取引業		0.71
ガラス・土石製品		0.70
ゴム製品		0.67
金属製品		0.56
石油・石炭製品		0.49
海運業		0.49
空運業		0.47
繊維製品		0.46
鉱業		0.28
パルプ・紙		0.18
倉庫・運輸関連業		0.16
水産・農林業		0.10
合計		96.33

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	1,801,241	23,940.22 43,122,112,546	20,632.52 37,164,156,808	－ －	5.18
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	790,800	42,111.01 33,301,389,416	34,392.37 27,197,490,150	－ －	3.79
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	1,019,090	21,669.44 22,083,114,805	16,624.18 16,941,543,748	－ －	2.36
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	293,941	41,240.53 12,122,283,897	38,839.49 11,416,518,559	－ －	1.59
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	669,993	19,124.90 12,813,551,540	14,107.39 9,451,852,682	－ －	1.32
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	626,815	19,170.47 12,016,339,082	14,204.41 8,903,539,071	－ －	1.24
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	104,355	69,598.79 7,262,981,739	73,683.67 7,689,259,622	－ －	1.07
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	292,947	24,267.69 7,109,147,553	23,825.58 6,979,634,908	－ －	0.97
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	468,251	11,788.40 5,519,931,735	12,841.75 6,013,162,653	－ －	0.84
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	143,111	45,549.10 6,518,578,017	39,037.87 5,586,750,016	－ －	0.78

11	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	255,086	30,626.40 7,812,368,147	19,753.53 5,038,849,489	－ －	0.70
12	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	326,684	21,256.07 6,944,019,060	15,373.02 5,022,122,801	－ －	0.70
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	267,130	22,357.58 5,972,380,536	18,637.04 4,978,514,365	－ －	0.69
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	313,530	17,405.95 5,457,289,679	15,832.68 4,964,021,665	－ －	0.69
15	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	278,503	33,697.75 9,384,925,033	17,695.78 4,928,328,374	－ －	0.69
16	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	183,289	32,049.35 5,874,293,536	26,074.48 4,779,166,941	－ －	0.67
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	114,289	49,258.15 5,629,664,911	40,304.96 4,606,414,407	－ －	0.64
18	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	207,535	20,733.86 4,303,002,995	20,964.14 4,350,793,562	－ －	0.61
19	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	89,821	36,133.31 3,245,530,552	47,788.74 4,292,433,143	－ －	0.60
20	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	196,559	21,006.46 4,129,010,361	20,667.28 4,062,340,518	－ －	0.57
21	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	96,711	53,007.26 5,126,385,926	41,527.16 4,016,133,528	－ －	0.56
22	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	624,273	7,261.27 4,533,019,548	6,394.80 3,992,106,973	－ －	0.56
23	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	458,358	8,838.23 4,051,074,968	8,191.90 3,754,823,679	－ －	0.52
24	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	78,628	50,717.06 3,987,781,063	47,582.74 3,741,336,073	－ －	0.52
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	154,067	24,081.29 3,710,132,676	24,126.79 3,717,142,786	－ －	0.52
26	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	806,400	6,536.45 5,270,998,546	4,439.87 3,580,314,877	－ －	0.50
27	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	281,510	11,415.65 3,213,621,931	12,546.33 3,531,919,722	－ －	0.49

28	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	49,243	73,142.60 3,601,761,206	69,361.09 3,415,548,341	－ －	0.48
29	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサイエンス・ツール／サービス	43,535	81,075.28 3,529,612,691	74,810.29 3,256,866,153	－ －	0.45
30	WALMART INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	168,308	19,335.29 3,254,284,860	19,151.12 3,223,287,125	－ －	0.45

（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9月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.31
投資信託受益証券	0.16
投資証券	2.12
合計	97.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2022年9月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	6.99
銀行		5.69
医薬品		5.47
コンピュータ・周辺機器		5.39
石油・ガス・消耗燃料		5.09
半導体・半導体製造装置		3.97
情報技術サービス		3.69
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.49
資本市場		3.14
保険		3.10
インターネット販売・通信販売		2.68
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.59
ヘルスケア機器・用品		2.21
自動車		2.20
バイオテクノロジー		2.06
化学		1.98
電力		1.95
飲料		1.89
ホテル・レストラン・レジャー		1.81
食品		1.72
専門小売り		1.64
機械		1.58

食品・生活必需品小売り	1.56
航空宇宙・防衛	1.54
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.52
金属・鉱業	1.44
繊維・アパレル・贅沢品	1.24
家庭用品	1.16
娯楽	1.15
各種電気通信サービス	1.14
陸運・鉄道	1.08
各種金融サービス	1.01
総合公益事業	0.87
コングロマリット	0.84
電気設備	0.74
タバコ	0.72
メディア	0.70
専門サービス	0.68
通信機器	0.66
パーソナル用品	0.61
航空貨物・物流サービス	0.53
電子装置・機器・部品	0.53
建設関連製品	0.53
商業サービス・用品	0.53
複合小売り	0.49
消費者金融	0.39
商社・流通業	0.34
不動産管理・開発	0.34
無線通信サービス	0.30
家庭用耐久財	0.26
容器・包装	0.25
建設・土木	0.24
建設資材	0.23
エネルギー設備・サービス	0.23
自動車部品	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
運送インフラ	0.14
ガス	0.13
販売	0.11
水道	0.11
紙製品・林産品	0.11
海運業	0.07
ヘルスケア・テクノロジー	0.06
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	95.31

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	３３２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	11,310,000,000	100.96 11,419,004,000	100.85 11,406,135,000	0.6 2023/12/20	1.54
2	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	9,090,000,000	100.49 9,134,758,000	100.33 9,120,542,400	0.1 2026/12/20	1.23
3	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	8,660,000,000	100.24 8,680,833,000	99.97 8,657,575,200	0.1 2028/3/20	1.17
4	３５９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	8,400,000,000	99.21 8,334,038,000	98.82 8,301,468,000	0.1 2030/6/20	1.12
5	３３５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,910,000,000	101.25 8,009,085,900	101.08 7,995,507,100	0.5 2024/9/20	1.08
6	３４２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,880,000,000	100.54 7,923,064,000	100.43 7,914,041,600	0.1 2026/3/20	1.07
7	３５６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,940,000,000	99.66 7,913,640,000	99.38 7,890,851,400	0.1 2029/9/20	1.06
8	３４３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,850,000,000	100.54 7,893,039,000	100.40 7,882,028,000	0.1 2026/6/20	1.06
9	３４４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,830,000,000	100.56 7,874,572,000	100.37 7,859,440,800	0.1 2026/9/20	1.06
10	３５４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,860,000,000	99.95 7,856,806,000	99.61 7,829,817,600	0.1 2029/3/20	1.05
11	３５７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,810,000,000	99.48 7,769,783,000	99.18 7,746,192,300	0.1 2029/12/20	1.04
12	３６０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,840,000,000	99.22 7,779,158,000	98.75 7,742,078,400	0.1 2030/9/20	1.04
13	１４９回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	7,650,000,000	100.18 7,664,433,000	100.00 7,650,000,000	0.005 2026/9/20	1.03
14	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,540,000,000	101.47 7,651,469,900	101.30 7,638,397,000	0.4 2025/9/20	1.03
15	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,570,000,000	100.44 7,603,694,100	100.28 7,591,877,300	0.1 2027/3/20	1.02
16	３６１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,600,000,000	99.07 7,529,847,000	98.63 7,496,108,000	0.1 2030/12/20	1.01

17	１４７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	7,480,000,000	100.21 7,496,008,000	100.10 7,487,704,400	0.005 2026/3/20	1.01
18	３５２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	7,490,000,000	100.15 7,501,584,000	99.79 7,474,420,800	0.1 2028/9/20	1.01
19	３６５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	7,540,000,000	99.01 7,465,524,000	98.69 7,441,452,200	0.1 2031/12/20	1.00
20	３５１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	7,400,000,000	100.18 7,413,325,000	99.88 7,391,564,000	0.1 2028/6/20	1.00
21	３６７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	7,390,000,000	99.67 7,365,806,000	99.57 7,358,444,700	0.2 2032/6/20	0.99
22	３４９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	7,230,000,000	100.30 7,251,975,000	100.05 7,233,687,300	0.1 2027/12/20	0.97
23	３５３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	7,240,000,000	100.06 7,244,756,000	99.72 7,219,872,800	0.1 2028/12/20	0.97
24	３４７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	7,110,000,000	100.35 7,134,935,000	100.18 7,123,295,700	0.1 2027/6/20	0.96
25	１４５回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	7,050,000,000	100.54 7,088,264,000	100.41 7,079,257,500	0.1 2025/9/20	0.95
26	３５５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	6,910,000,000	99.80 6,896,358,000	99.50 6,875,588,200	0.1 2029/6/20	0.93
27	３４１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	6,720,000,000	101.23 6,803,178,000	101.07 6,792,374,400	0.3 2025/12/20	0.91
28	１４４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	6,700,000,000	100.45 6,730,396,000	100.39 6,726,331,000	0.1 2025/6/20	0.91
29	４３６回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	6,700,000,000	100.16 6,711,160,000	100.11 6,707,370,000	0.005 2024/5/1	0.90
30	３６４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	6,800,000,000	98.86 6,723,038,000	98.42 6,692,900,000	0.1 2031/9/20	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9月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	91.06
地方債証券	4.54
特殊債券	4.25
社債券	3.57
合計	103.42

（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9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	US T N/B 0.25 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,086,075,000	95.90 1,041,613,917	93.74 1,018,152,878	0.25 2024/5/15	0.57
2	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,177,305,300	93.90 1,105,496,242	81.20 956,054,675	1.25 2031/8/15	0.54
3	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,122,277,500	96.50 1,083,005,882	84.33 946,483,241	1.625 2031/5/15	0.53
4	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,157,031,900	94.94 1,098,528,115	81.62 944,427,288	1.375 2031/11/15	0.53
5	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,142,550,900	93.51 1,068,427,523	81.25 928,411,858	1.125 2031/2/15	0.52
6	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,172,961,000	83.24 976,467,311	78.68 922,927,857	0.625 2030/8/15	0.52
7	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	920,991,600	102.26 941,885,587	98.34 905,773,650	2.75 2023/11/15	0.51
8	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,054,216,800	92.77 978,010,090	85.11 897,278,504	1.875 2032/2/15	0.50
9	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	962,986,500	100.61 968,951,672	92.86 894,260,857	2.875 2032/5/15	0.50
10	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	860,171,400	98.82 850,045,511	89.91 773,415,044	1.5 2027/1/31	0.43
11	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	738,531,000	102.14 754,348,334	97.22 718,048,298	2.5 2024/5/15	0.40
12	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	758,804,400	96.62 733,169,770	92.29 700,352,745	2.25 2027/8/15	0.39
13	US T N/B 2.25 03/31/24 アメリカ	国債証券	687,847,500	99.49 684,357,836	97.06 667,668,846	2.25 2024/3/31	0.38
14	US T N/B 2.0 04/30/24 アメリカ	国債証券	683,503,200	98.14 670,844,720	96.53 659,820,879	2 2024/4/30	0.37
15	US T N/B 1.125 01/15/25 アメリカ	国債証券	706,672,800	95.23 673,008,471	93.29 659,303,638	1.125 2025/1/15	0.37
16	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証券	695,088,000	97.41 677,111,464	94.51 656,993,916	0.125 2024/2/15	0.37
17	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	818,176,500	84.50 691,420,973	79.14 647,541,952	0.625 2030/5/15	0.36
18	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	667,574,100	101.93 680,486,093	96.67 645,356,398	2.375 2024/8/15	0.36
19	US T N/B 2.5 01/31/24 アメリカ	国債証券	658,885,500	101.99 672,007,372	97.70 643,777,458	2.5 2024/1/31	0.36
20	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	663,229,800	102.86 682,210,481	93.92 622,969,673	2.75 2028/2/15	0.35

21	US T N/B 1.0 12/15/24 アメリカ	国債証券	667,574,100	98.31 656,334,315	93.27 622,669,306	1 2024/12/15	0.35
22	US T N/B 1.5 02/15/25 アメリカ	国債証券	658,885,500	99.66 656,697,144	93.86 618,477,283	1.5 2025/2/15	0.35
23	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	655,989,300	106.13 696,229,835	94.21 618,039,287	2.875 2028/8/15	0.35
24	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27 中国	国債証券	612,646,370	99.83 611,649,592	99.79 611,365,939	2.48 2027/4/15	0.34
25	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	634,267,800	107.87 684,240,072	95.52 605,874,400	3.125 2028/11/15	0.34
26	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	641,508,300	97.54 625,774,687	93.00 596,627,774	2.375 2027/5/15	0.34
27	US T N/B 1.5 09/30/24 アメリカ	国債証券	624,131,100	96.81 604,240,041	94.89 592,241,900	1.5 2024/9/30	0.33
28	US T N/B 2.5 05/31/24 アメリカ	国債証券	605,305,800	99.54 602,558,874	97.18 588,281,574	2.5 2024/5/31	0.33
29	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	619,786,800	99.84 618,824,546	94.05 582,938,532	2 2025/8/15	0.33
30	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	627,027,300	103.32 647,862,008	92.50 580,049,234	2.625 2029/2/15	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9月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	99.01
合計	99.01

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年9月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０４１２月	買建	712	13,359,294,960	13,072,320,000	3.75

（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9月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Dec22	買建	518	14,618,905,821	13,705,553,310	1.91
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec22	買建	525	2,602,402,322	2,441,784,240	0.34
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec22	買建	70	819,964,064	778,503,908	0.11
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec22	買建	28	688,619,613	662,214,896	0.09
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec22	買建	25	398,463,875	385,331,868	0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2022年9月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2022年9月16日)	69	69	0.9842	0.9842
2021年9月末日	6	－	0.9910	－
10月末日	17	－	1.0102	－
11月末日	37	－	0.9959	－
12月末日	48	－	1.0154	－
2022年1月末日	55	－	0.9747	－
2月末日	60	－	0.9689	－

3月末日	65	－	0.9966	－
4月末日	65	－	0.9823	－
5月末日	66	－	0.9810	－
6月末日	67	－	0.9654	－
7月末日	70	－	0.9797	－
8月末日	71	－	0.9802	－
9月末日	68	－	0.9611	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	△1.6

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

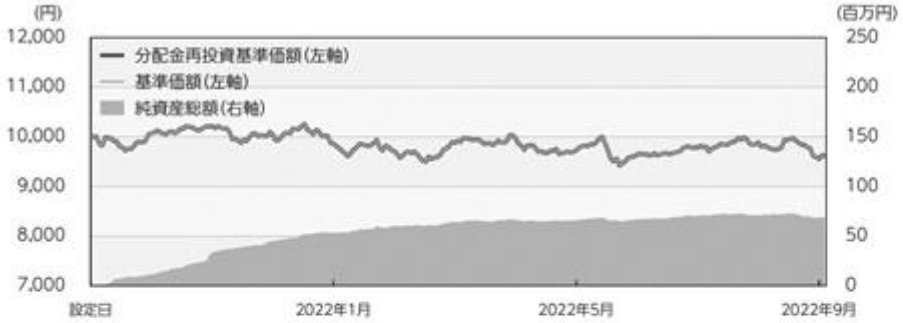
	設定口数	解約口数
第1計算期間	113,391,367	42,328,958

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

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2022年9月30日

基準価額・純資産の推移 《2021年9月16日～2022年9月30日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2021年9月16日)

分配の推移(税引前)

2022年 9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	33.74
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	24.87
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.90
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	14.78

■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	3.51
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.39
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.78
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.76
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.54

■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	5.18
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.79
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.36
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.59
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.32

○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9月30日

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	332回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2023/12/20	1.54
2	345回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	1.23
3	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.17
4	359回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2030/6/20	1.12
5	335回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2024/9/20	1.08

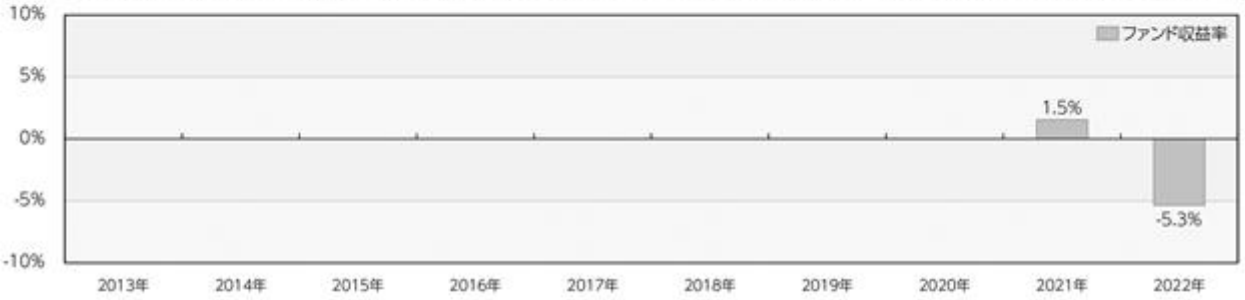
■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	アメリカ	0.25	2024/5/15	0.57
2	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.54
3	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.53
4	US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	アメリカ	1.375	2031/11/15	0.53
5	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.52

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2021年は設定日から年末までの収益率、および2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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、決済機能の停止、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委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、委託会社または販売会社は、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、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

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

基準価額は、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。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）

・お申込手数料
お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。
※償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。
※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。
※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位
各販売会社が定める単位とします。
「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。
※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。
※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。
※当初元本は1口当たり1円です。

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

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し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、信託契約の一部を解約します。
解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の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一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
なお、受益者が解約の請求をするときは、委託会社または販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。
※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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
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。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

信託期間は、2021年9月16日（設定日）から原則として2031年9月12日までです。

※下記(5)その他 イ．償還規定の場合には、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。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年9月17日から翌年9月16日までとします。

b.上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により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。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ.償還規定

a.委託会社は、信託期間中において、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場合、信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、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け出ます。

b.委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

e.上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

f.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。

g.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、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、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き継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

h.受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解

任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

ロ.信託約款の変更等

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、信託約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

b.委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

f.上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

g.上記a.からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

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

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

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。

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、2022年以降の毎年9月16日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。**
- **運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。**

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

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

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

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

再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2021年9月16日から2022年9月16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】

【Ｏｎｅグローバルバランス】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年9月16日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,721,093
親投資信託受益証券	63,563,608
流動資産合計	73,284,701
資産合計	73,284,701
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,957,855
未払受託者報酬	11,275
未払委託者報酬	377,264
その他未払費用	1,257
流動負債合計	3,347,651
負債合計	3,347,651
純資産の部	
元本等	
元本	71,062,409
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,125,359
（分配準備積立金）	120,974
元本等合計	69,937,050
純資産合計	69,937,050
負債純資産合計	73,284,701

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2021年9月16日 至　2022年9月16日
営業収益	
受取利息	28
有価証券売買等損益	△521,392
営業収益合計	△521,364
営業費用	
支払利息	565
受託者報酬	17,311
委託者報酬	580,058
その他費用	1,889
営業費用合計	599,823
営業利益又は営業損失（△）	△1,121,187
経常利益又は経常損失（△）	△1,121,187
当期純利益又は当期純損失（△）	△1,121,187
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（△）	△479,957
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,024
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,024
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	495,153
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	495,153
分配金	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,125,359

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第1期 自　2021年9月16日 至　2022年9月16日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 2022年9月16日現在
１．　期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	112,391,367円
期中一部解約元本額	42,328,958円
２．　受益権の総数	71,062,409口
３．　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,125,359円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　2021年9月16日 至　2022年9月16日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（120,974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（56,623円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は177,597円（1万口当たり24.99円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自　2021年9月16日 至　2022年9月16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	第1期 2022年9月16日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年9月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	665,336
合計	665,336

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年9月16日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9842円 (9,842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9月16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	3,268,042	10,644,993	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,775,859	10,943,731	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19,073,036	24,150,278	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,375,044	17,824,606	
親投資信託受益証券　合計		32,491,981	63,563,608	
合計			63,563,608	

（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」受益証券及び「外国債券パッシブ・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9月16日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,754,008,824
株式	386,534,545,070
派生商品評価勘定	33,891,860
未収入金	471,700
未収配当金	202,162,609
差入委託証拠金	310,200,000
流動資産合計	394,835,280,063
資産合計	394,835,280,063
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,564,290
前受金	89,325,000
未払解約金	980,966,000
流動負債合計	1,071,855,290
負債合計	1,071,855,290
純資産の部	
元本等	
元本	120,884,975,987
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	272,878,448,786
元本等合計	393,763,424,773
純資産合計	393,763,424,773
負債純資産合計	394,835,280,063

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年9月16日 至　2022年9月16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9月16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	127,470,731,813円
同期中追加設定元本額	187,664,056,507円
同期中一部解約元本額	194,249,812,333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	2,642,313,406円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	4,867,639,937円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	22,560,111,258円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	4,844,988,913円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	4,768,719円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	22,092,894円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	75,883,414円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	25,861,666円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	17,483,546円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	23,984,499円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,515,557,538円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,361,394,173円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	47,575,285円
たわらノーロード　バランス（標準型）	313,392,570円
たわらノーロード　バランス（積極型）	492,359,758円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	5,086,753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）	181,093,324円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	438,494,221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）	304,724,177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）	437,972,974円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	641,696円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,720,624円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	42,411,954円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,460,467円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	15,390,163円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,690,532,183円
Ｏｎｅグローバルバランス	3,268,042円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,075,945,849円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,608,291,514円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,962,720,260円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	342,066,840円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,095,725,024円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,130,899,964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＞	1,136,763,668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）	355,134,359円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	578,736,500円
投資のソムリエ	12,976,838,287円
クルーズコントロール	558,149,947円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	865,675,192円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	356,788,123円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	790,693,271円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	799,489,571円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,814,867,727円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	54,122,246円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	26,563,128円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,505,300円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	149,208,843円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	469,486,363円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	442,187,948円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	270,307,269円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	57,025,462円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	27,469,326円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	17,594,669円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	296,304,000円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,289,951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）	5,419,512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）	5,363,560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）	18,924,260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）	3,326,304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）	5,371,694円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	9,644,699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）	31,161,886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）	133,747,900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）	51,450,418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）	35,839,732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）	4,912,412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）	35,964,795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）	51,614,319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）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	87,201,528円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	327,013,099円
ＡＭＯｎｅ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）（適格機関投資家限定）	7,839,821円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,579,316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）	59,142,012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）	9,247,902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）	8,669,539円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	9,696,871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）	49,513,943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）	96,115,489円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,763,131円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,557,072円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,956,382円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	649,685円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,828,328円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,738,873円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	475,393,582円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	564,626,571円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,648,993,131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）	16,833,437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）	24,737,681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）	253,120,233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）	63,421,229円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	403,965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）	300,481,916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）	17,191,479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）	61,395,888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）	136,154,155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）	207,789,080円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,167,248円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,304,396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）	260,091,271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）	922,255,638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）	1,220,307,862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）	48,743,066円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	5,993,725円
コア資産形成ファンド	4,080,157円
ＭＨＡＭトピックスファンド	756,740,421円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	59,769,155円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	794,092,672円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,715,354,019円
計	120,884,975,987円
２．　受益権の総数	120,884,975,987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9月16日 至　2022年9月16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9月16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9月16日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	4,085,876,876
合計	4,085,876,876

（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9月16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9月16日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち１年超		
市場取引 先物取引 買建	7,083,330,000	－	7,115,780,000	32,450,000
合計	7,083,330,000	－	7,115,780,000	32,450,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年9月16日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2573円 (32,573円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年9月16日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	6,800	3,585.00	24,378,000	
日本水産	196,600	545.00	107,147,000	

マルハニチロ	28,000	2,412.00	67,536,000	
雪国まいたけ	15,400	1,009.00	15,538,600	
カネコ種苗	5,900	1,514.00	8,932,600	
サカタのタネ	22,900	4,785.00	109,576,500	
ホクト	16,100	1,906.00	30,686,600	
ホクリヨウ	2,900	606.00	1,757,400	
ショーボンドホールディングス	24,700	6,240.00	154,128,000	
ミライト・ワン	68,200	1,532.00	104,482,400	
タマホーム	12,900	2,352.00	30,340,800	
サンヨーホームズ	2,500	687.00	1,717,500	
日本アクア	8,400	662.00	5,560,800	
ファーストコーポレーション	5,100	736.00	3,753,600	
ベステラ	4,400	1,004.00	4,417,600	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	31,000	181.00	5,611,000	
キャンディル	3,200	594.00	1,900,800	
住石ホールディングス	37,100	240.00	8,904,000	
日鉄鉱業	4,100	5,880.00	24,108,000	
三井松島ホールディングス	8,900	3,360.00	29,904,000	
ＩＮＰＥＸ	671,300	1,508.00	1,012,320,400	
石油資源開発	24,900	3,720.00	92,628,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8,200	1,663.00	13,636,600	
ダイセキ環境ソリューション	4,100	895.00	3,669,500	
第一カッター興業	4,600	1,279.00	5,883,400	
明豊ファシリティワークス	6,700	670.00	4,489,000	
安藤・間	96,400	891.00	85,892,400	
東急建設	56,800	674.00	38,283,200	
コムシスホールディングス	68,200	2,582.00	176,092,400	
ビーアールホールディングス	26,600	344.00	9,150,400	
高松コンストラクショングループ	13,600	1,925.00	26,180,000	
東建コーポレーション	5,800	8,320.00	48,256,000	
ソネック	2,200	1,021.00	2,246,200	
ヤマウラ	9,200	961.00	8,841,200	
オリエンタル白石	71,100	250.00	17,775,000	
大成建設	136,100	4,285.00	583,188,500	
大林組	454,000	976.00	443,104,000	
清水建設	419,900	767.00	322,063,300	
飛島建設	13,100	1,057.00	13,846,700	
長谷工コーポレーション	131,100	1,652.00	216,577,200	
松井建設	16,200	582.00	9,428,400	
錢高組	1,600	3,165.00	5,064,000	
鹿島建設	332,600	1,468.00	488,256,800	
不動テトラ	10,400	1,532.00	15,932,800	
大末建設	5,100	1,535.00	7,828,500	
鉄建建設	9,800	1,784.00	17,483,200	
西松建設	29,600	4,205.00	124,468,000	
三井住友建設	110,200	452.00	49,810,400	
大豊建設	7,100	4,400.00	31,240,000	
佐田建設	10,600	425.00	4,505,000	
ナカノフドー建設	11,700	297.00	3,474,900	
奥村組	24,300	2,976.00	72,316,800	

東鉄工業	19,200	2,352.00	45,158,400	
イチケン	3,600	1,812.00	6,523,200	
富士ピー・エス	6,300	470.00	2,961,000	
淺沼組	11,000	2,737.00	30,107,000	
戸田建設	187,400	770.00	144,298,000	
熊谷組	24,100	2,563.00	61,768,300	
北野建設	3,000	2,338.00	7,014,000	
植木組	4,000	1,241.00	4,964,000	
矢作建設工業	19,400	748.00	14,511,200	
ピーエス三菱	16,000	638.00	10,208,000	
日本ハウスホールディングス	25,200	454.00	11,440,800	
大東建託	50,000	14,880.00	744,000,000	
新日本建設	20,800	711.00	14,788,800	
東亜道路工業	2,600	5,940.00	15,444,000	
日本道路	4,300	6,020.00	25,886,000	
東亜建設工業	10,900	2,398.00	26,138,200	
日本国土開発	38,000	618.00	23,484,000	
若築建設	7,500	2,178.00	16,335,000	
東洋建設	54,800	850.00	46,580,000	
五洋建設	180,000	732.00	131,760,000	
世紀東急工業	22,400	758.00	16,979,200	
福田組	4,700	4,895.00	23,006,500	
日本ドライケミカル	3,600	1,531.00	5,511,600	
住友林業	97,400	2,335.00	227,429,000	
日本基礎技術	12,000	488.00	5,856,000	
巴コーポレーション	17,700	404.00	7,150,800	
大和ハウス工業	387,000	3,112.00	1,204,344,000	
ライト工業	26,900	1,928.00	51,863,200	
積水ハウス	464,000	2,502.00	1,160,928,000	
日特建設	10,100	935.00	9,443,500	
北陸電気工事	8,700	731.00	6,359,700	
ユアテック	27,900	726.00	20,255,400	
日本リーテック	9,300	810.00	7,533,000	
四電工	4,700	1,837.00	8,633,900	
中電工	19,700	2,145.00	42,256,500	
関電工	79,400	860.00	68,284,000	
きんでん	99,300	1,540.00	152,922,000	
東京エネシス	14,400	997.00	14,356,800	
トーエネック	4,900	3,465.00	16,978,500	
住友電設	12,200	2,650.00	32,330,000	
日本電設工業	20,800	1,794.00	37,315,200	
エクシオグループ	67,900	2,171.00	147,410,900	
新日本空調	10,600	1,853.00	19,641,800	
日本工営	9,500	3,645.00	34,627,500	
九電工	31,000	2,883.00	89,373,000	
三機工業	31,800	1,670.00	53,106,000	
日揮ホールディングス	138,100	1,936.00	267,361,600	
中外炉工業	4,500	1,571.00	7,069,500	
ヤマト	11,800	783.00	9,239,400	
太平電業	8,900	3,415.00	30,393,500	

高砂熱学工業	37,400	1,648.00	61,635,200	
三晃金属工業	1,900	2,676.00	5,084,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	50,500	1,620.00	81,810,000	
朝日工業社	5,800	1,828.00	10,602,400	
明星工業	24,600	718.00	17,662,800	
大氣社	20,400	3,265.00	66,606,000	
ダイダン	9,200	2,245.00	20,654,000	
日比谷総合設備	13,400	1,868.00	25,031,200	
ニップン	38,200	1,548.00	59,133,600	
日清製粉グループ本社	147,400	1,446.00	213,140,400	
日東富士製粉	1,600	4,480.00	7,168,000	
昭和産業	12,400	2,489.00	30,863,600	
鳥越製粉	11,400	648.00	7,387,200	
中部飼料	16,100	1,056.00	17,001,600	
フィード・ワン	18,600	685.00	12,741,000	
東洋精糖	1,900	864.00	1,641,600	
日本甜菜製糖	8,200	1,609.00	13,193,800	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	12,700	1,876.00	23,825,200	
塩水港精糖	18,600	202.00	3,757,200	
日新製糖	7,400	1,709.00	12,646,600	
ＬＩＦＵＬＬ	45,500	168.00	7,644,000	
ミクシィ	34,000	2,398.00	81,532,000	
ジェイエイシーリクルートメント	12,100	2,066.00	24,998,600	
日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	244,400	1,733.00	423,545,200	
メンバーズ	3,900	2,580.00	10,062,000	
中広	1,100	399.00	438,900	
ＵＴグループ	21,600	2,672.00	57,715,200	
アイティメディア	7,000	1,678.00	11,746,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	8,500	1,283.00	10,905,500	
夢真ビーネックスグループ	48,600	1,670.00	81,162,000	
コシダカホールディングス	39,900	899.00	35,870,100	
アルトナー	3,600	965.00	3,474,000	
パソナグループ	16,100	1,977.00	31,829,700	
ＣＤＳ	3,700	1,672.00	6,186,400	
リンクアンドモチベーション	38,300	700.00	26,810,000	
エス・エム・エス	50,500	2,953.00	149,126,500	
サニーサイドアップグループ	5,100	601.00	3,065,100	
パーソルホールディングス	149,000	2,747.00	409,303,000	
リニカル	8,300	740.00	6,142,000	
クックパッド	36,400	207.00	7,534,800	
エスクリ	6,600	375.00	2,475,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,300	632.00	4,613,600	
森永製菓	31,500	3,830.00	120,645,000	
中村屋	3,200	3,085.00	9,872,000	
江崎グリコ	36,400	3,465.00	126,126,000	
名糖産業	5,600	1,640.00	9,184,000	
井村屋グループ	7,600	2,240.00	17,024,000	
不二家	8,700	2,370.00	20,619,000	
山崎製パン	85,300	1,611.00	137,418,300	
第一屋製パン	2,800	449.00	1,257,200	

モロゾフ	4,600	3,660.00	16,836,000	
亀田製菓	8,100	4,405.00	35,680,500	
寿スピリッツ	13,600	8,170.00	111,112,000	
カルビー	71,300	2,930.00	208,909,000	
森永乳業	26,500	4,025.00	106,662,500	
六甲バター	9,300	1,409.00	13,103,700	
ヤクルト本社	99,300	8,120.00	806,316,000	
明治ホールディングス	86,200	6,380.00	549,956,000	
雪印メグミルク	34,200	1,661.00	56,806,200	
プリマハム	19,600	2,092.00	41,003,200	
日本ハム	54,800	3,920.00	214,816,000	
林兼産業	4,000	460.00	1,840,000	
丸大食品	14,100	1,480.00	20,868,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	14,000	2,944.00	41,216,000	
柿安本店	5,400	2,286.00	12,344,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	99,000	665.00	65,835,000	
学情	6,000	1,400.00	8,400,000	
スタジオアリス	6,600	2,162.00	14,269,200	
クロスキャット	8,200	1,478.00	12,119,600	
シミックホールディングス	7,300	1,583.00	11,555,900	
エプコ	3,200	633.00	2,025,600	
システナ	218,200	419.00	91,425,800	
ＮＪＳ	2,900	1,965.00	5,698,500	
デジタルアーツ	8,200	6,640.00	54,448,000	
日鉄ソリューションズ	26,600	3,560.00	94,696,000	
綜合警備保障	54,400	3,600.00	195,840,000	
キューブシステム	7,700	1,009.00	7,769,300	
いちご	171,200	311.00	53,243,200	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2,100	864.00	1,814,400	
日本駐車場開発	151,700	189.00	28,671,300	
コア	6,500	1,400.00	9,100,000	
カカクコム	109,300	2,629.00	287,349,700	
アイロムグループ	5,300	2,456.00	13,016,800	
セントケア・ホールディング	9,700	820.00	7,954,000	
サイネックス	2,500	597.00	1,492,500	
ルネサンス	10,400	995.00	10,348,000	
ディップ	26,200	3,870.00	101,394,000	
ＳＢＳホールディングス	11,500	2,919.00	33,568,500	
デジタルホールディングス	10,400	1,284.00	13,353,600	
新日本科学	18,200	2,591.00	47,156,200	
キャリアデザインセンター	3,100	1,492.00	4,625,200	
ベネフィット・ワン	53,900	2,062.00	111,141,800	
エムスリー	262,900	4,434.00	1,165,698,600	
ツカダ・グローバルホールディング	9,500	372.00	3,534,000	
ブラス	2,000	922.00	1,844,000	
アウトソーシング	79,300	1,252.00	99,283,600	
ウェルネット	13,200	601.00	7,933,200	
ワールドホールディングス	5,900	2,676.00	15,788,400	
ディー・エヌ・エー	56,800	1,871.00	106,272,800	
博報堂ＤＹホールディングス	188,500	1,150.00	216,775,000	

ぐるなび	21,800	455.00	9,919,000	
タカミヤ	18,000	405.00	7,290,000	
ジャパンベストレスキューシステム	8,400	741.00	6,224,400	
ファンコミュニケーションズ	26,100	418.00	10,909,800	
ライク	4,900	2,171.00	10,637,900	
ビジネス・ブレークスルー	5,500	402.00	2,211,000	
エスプール	38,300	1,023.00	39,180,900	
ＷＤＢホールディングス	6,700	2,595.00	17,386,500	
手間いらず	2,100	5,340.00	11,214,000	
ティア	8,700	436.00	3,793,200	
ＣＤＧ	1,600	1,259.00	2,014,400	
アドウェイズ	18,300	726.00	13,285,800	
バリューコマース	10,000	2,361.00	23,610,000	
インフォマート	138,200	428.00	59,149,600	
サッポロホールディングス	41,900	3,135.00	131,356,500	
アサヒグループホールディングス	294,600	4,680.00	1,378,728,000	
キリンホールディングス	575,200	2,209.50	1,270,904,400	
宝ホールディングス	87,000	1,068.00	92,916,000	
オエノンホールディングス	38,100	267.00	10,172,700	
養命酒製造	4,300	1,808.00	7,774,400	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	99,800	1,413.00	141,017,400	
サントリー食品インターナショナル	89,700	5,060.00	453,882,000	
ダイドーグループホールディングス	8,000	4,780.00	38,240,000	
伊藤園	47,500	5,820.00	276,450,000	
キーコーヒー	14,300	2,086.00	29,829,800	
ユニカフェ	4,700	918.00	4,314,600	
ジャパンフーズ	1,600	1,100.00	1,760,000	
日清オイリオグループ	17,900	3,170.00	56,743,000	
不二製油グループ本社	33,900	2,408.00	81,631,200	
かどや製油	1,300	3,550.00	4,615,000	
Ｊ－オイルミルズ	14,500	1,549.00	22,460,500	
ローソン	34,000	4,675.00	158,950,000	
サンエー	10,500	4,235.00	44,467,500	
カワチ薬品	12,000	2,092.00	25,104,000	
エービーシー・マート	23,900	6,380.00	152,482,000	
ハードオフコーポレーション	6,700	1,324.00	8,870,800	
高千穂交易	5,400	2,151.00	11,615,400	
アスクル	33,000	1,620.00	53,460,000	
ゲオホールディングス	18,400	1,693.00	31,151,200	
アダストリア	16,500	2,156.00	35,574,000	
ジーフット	9,300	303.00	2,817,900	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	2,200	390.00	858,000	
オルバヘルスケアホールディングス	2,500	1,445.00	3,612,500	
伊藤忠食品	3,100	4,950.00	15,345,000	
くら寿司	16,000	3,130.00	50,080,000	
キャンドゥ	4,800	2,198.00	10,550,400	
エレマテック	12,300	1,364.00	16,777,200	
アイケイ	4,800	421.00	2,020,800	
パルグループホールディングス	13,500	2,401.00	32,413,500	

エディオン	70,500	1,170.00	82,485,000	
あらた	11,400	4,190.00	47,766,000	
サーラコーポレーション	28,800	761.00	21,916,800	
ワッツ	7,400	686.00	5,076,400	
トーメンデバイス	2,200	5,630.00	12,386,000	
ハローズ	7,000	2,907.00	20,349,000	
ＪＰホールディングス	38,300	273.00	10,455,900	
フジオフードグループ本社	11,400	1,333.00	15,196,200	
あみやき亭	3,700	2,922.00	10,811,400	
東京エレクトロン　デバイス	4,500	5,530.00	24,885,000	
ひらまつ	32,500	188.00	6,110,000	
フィールズ	13,500	1,498.00	20,223,000	
双日	157,600	2,334.00	367,838,400	
アルフレッサ　ホールディングス	159,300	1,713.00	272,880,900	
大黒天物産	4,900	5,820.00	28,518,000	
ハニーズホールディングス	12,200	1,213.00	14,798,600	
ファーマライズホールディングス	3,300	649.00	2,141,700	
キッコーマン	93,900	8,310.00	780,309,000	
味の素	312,000	3,978.00	1,241,136,000	
ブルドックソース	5,500	1,818.00	9,999,000	
キユーピー	68,500	2,233.00	152,960,500	
ハウス食品グループ本社	48,800	2,931.00	143,032,800	
カゴメ	59,300	2,987.00	177,129,100	
焼津水産化学工業	6,300	871.00	5,487,300	
アリアケジャパン	14,300	4,720.00	67,496,000	
ピエトロ	2,000	1,771.00	3,542,000	
エバラ食品工業	3,500	3,000.00	10,500,000	
やまみ	1,200	1,428.00	1,713,600	
ニチレイ	58,400	2,368.00	138,291,200	
横浜冷凍	37,300	908.00	33,868,400	
東洋水産	69,800	5,660.00	395,068,000	
イートアンドホールディングス	5,800	2,202.00	12,771,600	
大冷	1,800	1,912.00	3,441,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	477.00	3,863,700	
日清食品ホールディングス	50,400	9,740.00	490,896,000	
永谷園ホールディングス	6,900	1,979.00	13,655,100	
一正蒲鉾	6,000	765.00	4,590,000	
フジッコ	14,500	1,903.00	27,593,500	
ロック・フィールド	15,500	1,504.00	23,312,000	
日本たばこ産業	839,100	2,365.50	1,984,891,050	
ケンコーマヨネーズ	8,000	1,527.00	12,216,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,400	2,234.00	20,999,600	
なとり	8,700	2,000.00	17,400,000	
イフジ産業	2,800	901.00	2,522,800	
ファーマフーズ	19,700	1,302.00	25,649,400	
北の達人コーポレーション	54,600	247.00	13,486,200	
ユーグレナ	81,800	915.00	74,847,000	
紀文食品	12,200	978.00	11,931,600	
ピックルスホールディングス	8,400	1,038.00	8,719,200	
スター・マイカ・ホールディングス	6,500	1,580.00	10,270,000	

ＳＲＥホールディングス	3,900	3,070.00	11,973,000	
ＡＤワークスグループ	27,500	156.00	4,290,000	
片倉工業	12,000	2,001.00	24,012,000	
グンゼ	8,900	3,880.00	34,532,000	
ヒューリック	297,300	1,106.00	328,813,800	
神栄	2,100	873.00	1,833,300	
ラサ商事	6,900	981.00	6,768,900	
アルペン	11,400	2,092.00	23,848,800	
ハブ	5,000	591.00	2,955,000	
ラクーンホールディングス	13,000	1,182.00	15,366,000	
クオールホールディングス	18,800	1,233.00	23,180,400	
アルコニックス	19,500	1,359.00	26,500,500	
神戸物産	106,000	3,570.00	378,420,000	
ソリトンシステムズ	6,600	1,105.00	7,293,000	
ジンズホールディングス	8,200	4,420.00	36,244,000	
ビックカメラ	91,100	1,162.00	105,858,200	
ＤＣＭホールディングス	91,200	1,033.00	94,209,600	
ペッパーフードサービス	28,600	238.00	6,806,800	
ハイパー	2,500	438.00	1,095,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	194,200	2,221.00	431,318,200	
東京一番フーズ	3,500	596.00	2,086,000	
ＤＤホールディングス	8,000	606.00	4,848,000	
あい　ホールディングス	22,000	2,174.00	47,828,000	
ディーブイエックス	5,000	880.00	4,400,000	
きちりホールディングス	4,200	341.00	1,432,200	
アークランドサービスホールディングス	11,300	2,106.00	23,797,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	170,200	1,199.00	204,069,800	
ドトール・日レスホールディングス	24,300	1,703.00	41,382,900	
マツキヨココカラ＆カンパニー	90,000	5,980.00	538,200,000	
ブロンコビリー	7,300	2,398.00	17,505,400	
ＺＯＺＯ	105,600	3,045.00	321,552,000	
トレジャー・ファクトリー	4,500	1,892.00	8,514,000	
物語コーポレーション	7,600	7,120.00	54,112,000	
三越伊勢丹ホールディングス	230,500	1,218.00	280,749,000	
東洋紡	60,300	1,088.00	65,606,400	
ユニチカ	41,900	273.00	11,438,700	
富士紡ホールディングス	6,200	3,410.00	21,142,000	
日清紡ホールディングス	106,400	1,065.00	113,316,000	
倉敷紡績	10,600	2,136.00	22,641,600	
ダイワボウホールディングス	65,400	1,930.00	126,222,000	
シキボウ	8,000	883.00	7,064,000	
日東紡績	19,300	2,459.00	47,458,700	
トヨタ紡織	54,500	1,936.00	105,512,000	
マクニカホールディングス	36,600	2,808.00	102,772,800	
Ｈａｍｅｅ	5,500	995.00	5,472,500	
マーケットエンタープライズ	1,600	909.00	1,454,400	
ラクト・ジャパン	5,200	2,135.00	11,102,000	
ウエルシアホールディングス	81,200	3,005.00	244,006,000	
クリエイトＳＤホールディングス	22,700	3,110.00	70,597,000	

グリムス	6,800	1,678.00	11,410,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,400	656.00	16,006,400	
八洲電機	11,100	999.00	11,088,900	
メディアスホールディングス	8,800	692.00	6,089,600	
レスターホールディングス	14,500	2,009.00	29,130,500	
ジューテックホールディングス	3,000	1,085.00	3,255,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	17,900	340.00	6,086,000	
大光	6,500	700.00	4,550,000	
ＯＣＨＩホールディングス	3,500	1,236.00	4,326,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	74,400	885.00	65,844,000	
黒谷	4,200	563.00	2,364,600	
ミサワ	3,100	592.00	1,835,200	
ティーライフ	2,000	1,243.00	2,486,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,700	717.00	1,935,900	
エー・ピーホールディングス	2,200	448.00	985,600	
三洋貿易	14,000	1,069.00	14,966,000	
チムニー	4,600	1,230.00	5,658,000	
シュッピン	12,700	1,286.00	16,332,200	
ビューティガレージ	2,500	2,885.00	7,212,500	
オイシックス・ラ・大地	22,200	1,771.00	39,316,200	
ウイン・パートナーズ	11,100	950.00	10,545,000	
ネクステージ	31,200	3,225.00	100,620,000	
ジョイフル本田	44,100	1,742.00	76,822,200	
鳥貴族ホールディングス	5,000	2,504.00	12,520,000	
ホットランド	10,500	1,315.00	13,807,500	
すかいらーくホールディングス	187,200	1,541.00	288,475,200	
ＳＦＰホールディングス	7,400	1,724.00	12,757,600	
綿半ホールディングス	10,600	1,383.00	14,659,800	
日本毛織	37,700	1,089.00	41,055,300	
ダイトウボウ	24,800	86.00	2,132,800	
トーア紡コーポレーション	4,400	343.00	1,509,200	
ダイドーリミテッド	20,900	146.00	3,051,400	
ヨシックスホールディングス	3,000	2,246.00	6,738,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,600	1,054.00	47,008,400	
三栄建築設計	6,100	1,645.00	10,034,500	
野村不動産ホールディングス	79,500	3,620.00	287,790,000	
三重交通グループホールディングス	31,200	496.00	15,475,200	
サムティ	20,300	2,289.00	46,466,700	
ディア・ライフ	19,000	649.00	12,331,000	
コーセーアールイー	4,500	628.00	2,826,000	
地主	9,800	2,027.00	19,864,600	
プレサンスコーポレーション	16,800	1,594.00	26,779,200	
フィル・カンパニー	2,200	1,209.00	2,659,800	
ＴＨＥグローバル社	8,200	212.00	1,738,400	
ハウスコム	2,700	943.00	2,546,100	
ＪＰＭＣ	6,400	998.00	6,387,200	
サンセイランディック	4,200	819.00	3,439,800	
エストラスト	1,600	545.00	872,000	

フージャースホールディングス	19,700	804.00	15,838,800	
オープンハウスグループ	49,000	5,350.00	262,150,000	
東急不動産ホールディングス	418,200	795.00	332,469,000	
飯田グループホールディングス	125,600	2,154.00	270,542,400	
イーグランド	2,100	1,640.00	3,444,000	
ムゲンエステート	9,400	475.00	4,465,000	
帝国繊維	14,500	1,609.00	23,330,500	
日本コークス工業	131,800	96.00	12,652,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	1,888.00	11,705,600	
ミタチ産業	3,900	761.00	2,967,900	
ＢＥＥＮＯＳ	7,700	2,459.00	18,934,300	
あさひ	12,800	1,314.00	16,819,200	
日本調剤	9,300	1,260.00	11,718,000	
コスモス薬品	15,400	13,970.00	215,138,000	
シップヘルスケアホールディングス	44,200	2,639.00	116,643,800	
トーエル	6,600	746.00	4,923,600	
ソフトクリエイトホールディングス	6,600	3,470.00	22,902,000	
セブン&アイ・ホールディングス	514,900	5,951.00	3,064,169,900	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	103,000	927.00	95,481,000	
明治電機工業	4,600	1,045.00	4,807,000	
ツルハホールディングス	33,500	8,040.00	269,340,000	
デリカフーズホールディングス	5,900	518.00	3,056,200	
スターティアホールディングス	3,600	944.00	3,398,400	
サンマルクホールディングス	12,200	1,614.00	19,690,800	
フェリシモ	3,500	1,031.00	3,608,500	
トリドールホールディングス	38,200	3,100.00	118,420,000	
帝人	134,200	1,454.00	195,126,800	
東レ	947,700	767.70	727,549,290	
クラレ	206,100	1,058.00	218,053,800	
旭化成	944,600	1,009.50	953,573,700	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	14,000	352.00	4,928,000	
稲葉製作所	7,800	1,357.00	10,584,600	
宮地エンジニアリンググループ	4,400	3,260.00	14,344,000	
トーカロ	39,800	1,232.00	49,033,600	
アルファ	5,400	932.00	5,032,800	
ＳＵＭＣＯ	254,200	1,867.00	474,591,400	
川田テクノロジーズ	2,900	3,750.00	10,875,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4,400	6,490.00	28,556,000	
ジェイテックコーポレーション	2,000	1,607.00	3,214,000	
信和	9,600	804.00	7,718,400	
ビーロット	9,700	558.00	5,412,600	
ファーストブラザーズ	2,800	844.00	2,363,200	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	7,500	880.00	6,600,000	
シーアールイー	5,800	1,444.00	8,375,200	
プロパティエージェント	1,800	1,562.00	2,811,600	
ケイアイスター不動産	6,900	4,870.00	33,603,000	
アグレ都市デザイン	2,500	1,468.00	3,670,000	
グッドコムアセット	5,800	1,406.00	8,154,800	
ジェイ・エス・ビー	3,200	3,765.00	12,048,000	

ロードスターキャピタル	5,400	1,771.00	9,563,400	
テンポイノベーション	4,400	942.00	4,144,800	
グローバル・リンク・マネジメント	2,800	926.00	2,592,800	
フェイスネットワーク	2,000	1,392.00	2,784,000	
住江織物	2,700	1,748.00	4,719,600	
日本フエルト	8,600	412.00	3,543,200	
イチカワ	1,600	1,360.00	2,176,000	
エコナックホールディングス	25,600	91.00	2,329,600	
日東製網	1,700	1,313.00	2,232,100	
芦森工業	2,900	1,015.00	2,943,500	
アツギ	10,900	396.00	4,316,400	
ウイルプラスホールディングス	2,900	1,094.00	3,172,600	
ＪＭホールディングス	11,600	1,652.00	19,163,200	
コメダホールディングス	33,500	2,371.00	79,428,500	
サツドラホールディングス	6,800	689.00	4,685,200	
アレンザホールディングス	10,300	975.00	10,042,500	
串カツ田中ホールディングス	3,600	1,766.00	6,357,600	
バロックジャパンリミテッド	10,600	785.00	8,321,000	
クスリのアオキホールディングス	13,700	6,670.00	91,379,000	
ダイニック	4,900	608.00	2,979,200	
共和レザー	8,300	532.00	4,415,600	
ピーバンドットコム	2,000	506.00	1,012,000	
力の源ホールディングス	7,900	779.00	6,154,100	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	78,600	2,489.00	195,635,400	
アセンテック	5,200	601.00	3,125,200	
セーレン	28,200	2,054.00	57,922,800	
ソトー	5,500	715.00	3,932,500	
東海染工	1,600	1,114.00	1,782,400	
小松マテーレ	23,000	828.00	19,044,000	
ワコールホールディングス	31,300	2,258.00	70,675,400	
ホギメディカル	19,000	3,410.00	64,790,000	
クラウディアホールディングス	2,500	287.00	717,500	
ＴＳＩホールディングス	46,400	416.00	19,302,400	
マツオカコーポレーション	4,400	1,026.00	4,514,400	
ワールド	20,000	1,421.00	28,420,000	
ＴＩＳ	133,700	4,095.00	547,501,500	
ＪＮＳホールディングス	7,000	394.00	2,758,000	
グリー	69,600	870.00	60,552,000	
GMOペパボ	1,700	1,819.00	3,092,300	
コーエーテクモホールディングス	48,900	4,635.00	226,651,500	
三菱総合研究所	6,300	4,370.00	27,531,000	
ボルテージ	4,200	306.00	1,285,200	
電算	900	1,905.00	1,714,500	
ＡＧＳ	6,000	678.00	4,068,000	
ファインデックス	10,300	588.00	6,056,400	
ブレインパッド	13,000	977.00	12,701,000	
ＫＬａｂ	24,300	419.00	10,181,700	
ポールトゥウィンホールディングス	22,200	966.00	21,445,200	
ネクソン	349,300	2,588.00	903,988,400	

アイスタイル	39,600	549.00	21,740,400	
エムアップホールディングス	17,600	1,635.00	28,776,000	
エイチーム	9,600	801.00	7,689,600	
エニグモ	16,500	526.00	8,679,000	
テクノスジャパン	11,900	445.00	5,295,500	
ｅｎｉｓｈ	10,900	424.00	4,621,600	
コロプラ	50,300	689.00	34,656,700	
オルトプラス	11,000	305.00	3,355,000	
ブロードリーフ	75,800	532.00	40,325,600	
クロス・マーケティンググループ	5,800	897.00	5,202,600	
デジタルハーツホールディングス	6,900	1,793.00	12,371,700	
システム情報	11,400	955.00	10,887,000	
メディアドゥ	5,100	1,938.00	9,883,800	
じげん	43,300	331.00	14,332,300	
ブイキューブ	15,500	1,077.00	16,693,500	
エンカレッジ・テクノロジ	3,400	511.00	1,737,400	
サイバーリンクス	4,500	1,134.00	5,103,000	
ディー・エル・イー	10,300	324.00	3,337,200	
フィックスターズ	14,600	1,093.00	15,957,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,200	1,714.00	10,626,800	
オプティム	10,700	876.00	9,373,200	
セレス	5,100	1,014.00	5,171,400	
ＳＨＩＦＴ	9,500	19,840.00	188,480,000	
特種東海製紙	7,900	3,060.00	24,174,000	
ティーガイア	13,600	1,668.00	22,684,800	
セック	2,200	2,186.00	4,809,200	
テクマトリックス	25,800	1,600.00	41,280,000	
プロシップ	5,000	1,420.00	7,100,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,700	2,242.00	89,007,400	
GMOペイメントゲートウェイ	29,700	10,430.00	309,771,000	
ザッパラス	5,200	318.00	1,653,600	
システムリサーチ	4,500	1,879.00	8,455,500	
インターネットイニシアティブ	40,800	4,665.00	190,332,000	
さくらインターネット	16,400	557.00	9,134,800	
ヴィンクス	4,400	1,507.00	6,630,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,000	4,875.00	19,500,000	
ＳＲＡホールディングス	7,400	3,025.00	22,385,000	
システムインテグレータ	4,800	438.00	2,102,400	
朝日ネット	13,900	600.00	8,340,000	
ｅＢＡＳＥ	18,300	552.00	10,101,600	
アバント	16,400	1,363.00	22,353,200	
アドソル日進	5,400	1,470.00	7,938,000	
ＯＤＫソリューションズ	3,200	604.00	1,932,800	
フリービット	7,900	879.00	6,944,100	
コムチュア	17,100	2,334.00	39,911,400	
サイバーコム	2,300	1,336.00	3,072,800	
アステリア	11,000	809.00	8,899,000	
アイル	7,300	1,738.00	12,687,400	

王子ホールディングス	589,200	552.00	325,238,400	
日本製紙	61,900	871.00	53,914,900	
三菱製紙	19,500	293.00	5,713,500	
北越コーポレーション	91,100	752.00	68,507,200	
中越パルプ工業	5,800	945.00	5,481,000	
巴川製紙所	4,500	798.00	3,591,000	
大王製紙	65,400	1,207.00	78,937,800	
阿波製紙	3,500	302.00	1,057,000	
マークラインズ	7,000	2,414.00	16,898,000	
メディカル・データ・ビジョン	19,400	1,001.00	19,419,400	
ｇｕｍｉ	21,200	923.00	19,567,600	
ショーケース	3,400	390.00	1,326,000	
モバイルファクトリー	3,000	905.00	2,715,000	
テラスカイ	5,500	2,025.00	11,137,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,700	1,519.00	10,177,300	
ＰＣＩホールディングス	5,900	936.00	5,522,400	
アイビーシー	2,200	458.00	1,007,600	
ネオジャパン	4,400	964.00	4,241,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,300	2,432.00	8,025,600	
ラクス	70,100	1,491.00	104,519,100	
ランドコンピュータ	3,600	850.00	3,060,000	
ダブルスタンダード	4,500	2,357.00	10,606,500	
オープンドア	9,000	2,319.00	20,871,000	
マイネット	4,600	488.00	2,244,800	
アカツキ	6,800	2,211.00	15,034,800	
ベネフィットジャパン	900	1,570.00	1,413,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,100	2,323.00	9,524,300	
カナミックネットワーク	18,600	534.00	9,932,400	
ノムラシステムコーポレーション	13,500	129.00	1,741,500	
レンゴー	118,100	841.00	99,322,100	
トーモク	7,400	1,516.00	11,218,400	
ザ・パック	9,700	2,279.00	22,106,300	
チェンジ	31,800	1,885.00	59,943,000	
シンクロ・フード	7,800	459.00	3,580,200	
オークネット	6,700	2,217.00	14,853,900	
キャピタル・アセット・プランニング	2,800	701.00	1,962,800	
セグエグループ	4,000	689.00	2,756,000	
エイトレッド	2,100	1,780.00	3,738,000	
マクロミル	29,400	1,125.00	33,075,000	
ビーグリー	2,400	1,367.00	3,280,800	
オロ	4,000	1,619.00	6,476,000	
ユーザーローカル	4,600	1,576.00	7,249,600	
テモナ	2,800	314.00	879,200	
ニーズウェル	4,400	662.00	2,912,800	
マネーフォワード	31,200	3,435.00	107,172,000	
サインポスト	4,900	837.00	4,101,300	
昭和電工	125,300	2,078.00	260,373,400	
住友化学	1,041,600	536.00	558,297,600	
住友精化	6,000	3,320.00	19,920,000	

日産化学	68,700	6,760.00	464,412,000	
ラサ工業	5,300	2,341.00	12,407,300	
クレハ	11,100	9,070.00	100,677,000	
多木化学	5,000	4,925.00	24,625,000	
テイカ	8,700	1,253.00	10,901,100	
石原産業	27,400	1,041.00	28,523,400	
片倉コープアグリ	3,500	1,201.00	4,203,500	
日本曹達	16,800	4,480.00	75,264,000	
東ソー	188,800	1,733.00	327,190,400	
トクヤマ	45,400	1,818.00	82,537,200	
セントラル硝子	22,900	3,435.00	78,661,500	
東亞合成	66,700	1,100.00	73,370,000	
大阪ソーダ	11,700	3,865.00	45,220,500	
関東電化工業	27,800	972.00	27,021,600	
デンカ	51,400	3,300.00	169,620,000	
イビデン	75,000	4,425.00	331,875,000	
信越化学工業	242,000	15,895.00	3,846,590,000	
日本カーバイド工業	5,400	1,274.00	6,879,600	
電算システムホールディングス	6,200	2,315.00	14,353,000	
堺化学工業	9,800	1,924.00	18,855,200	
第一稀元素化学工業	13,000	1,318.00	17,134,000	
エア・ウォーター	122,400	1,733.00	212,119,200	
日本酸素ホールディングス	125,700	2,455.00	308,593,500	
日本化学工業	4,400	1,975.00	8,690,000	
東邦アセチレン	3,100	1,129.00	3,499,900	
日本パーカライジング	64,200	955.00	61,311,000	
高圧ガス工業	21,600	651.00	14,061,600	
チタン工業	1,800	1,601.00	2,881,800	
四国化成工業	17,600	1,264.00	22,246,400	
戸田工業	3,300	2,996.00	9,886,800	
ステラ　ケミファ	7,600	2,659.00	20,208,400	
保土谷化学工業	4,100	3,125.00	12,812,500	
日本触媒	21,700	5,580.00	121,086,000	
大日精化工業	10,800	1,755.00	18,954,000	
カネカ	32,900	3,850.00	126,665,000	
協和キリン	156,900	3,250.00	509,925,000	
三菱瓦斯化学	118,300	2,040.00	241,332,000	
三井化学	118,900	3,015.00	358,483,500	
ＪＳＲ	142,200	3,015.00	428,733,000	
東京応化工業	22,700	6,350.00	144,145,000	
大阪有機化学工業	9,800	2,193.00	21,491,400	
三菱ケミカルグループ	947,900	711.30	674,241,270	
ＫＨネオケム	21,600	2,546.00	54,993,600	
ダイセル	205,300	886.00	181,895,800	
住友ベークライト	21,600	4,130.00	89,208,000	
積水化学工業	291,600	1,855.00	540,918,000	
日本ゼオン	111,100	1,365.00	151,651,500	
アイカ工業	36,000	3,185.00	114,660,000	
ＵＢＥ	72,000	2,032.00	146,304,000	
積水樹脂	21,000	1,699.00	35,679,000	

タキロンシーアイ	33,000	531.00	17,523,000	
旭有機材	8,600	2,293.00	19,719,800	
ニチバン	8,000	1,600.00	12,800,000	
リケンテクノス	31,000	519.00	16,089,000	
大倉工業	5,900	1,756.00	10,360,400	
積水化成品工業	18,200	406.00	7,389,200	
群栄化学工業	3,100	2,416.00	7,489,600	
タイガースポリマー	7,300	423.00	3,087,900	
ミライアル	4,900	1,753.00	8,589,700	
ダイキアクシス	5,200	666.00	3,463,200	
ダイキョーニシカワ	32,200	577.00	18,579,400	
竹本容器	4,800	755.00	3,624,000	
森六ホールディングス	7,400	1,763.00	13,046,200	
恵和	4,300	3,795.00	16,318,500	
日本化薬	107,300	1,197.00	128,438,100	
カーリットホールディングス	12,900	656.00	8,462,400	
ソルクシーズ	11,700	364.00	4,258,800	
ＣＬホールディングス	3,200	885.00	2,832,000	
プレステージ・インターナショナル	55,900	683.00	38,179,700	
フェイス	4,100	565.00	2,316,500	
プロトコーポレーション	16,200	1,080.00	17,496,000	
ハイマックス	4,100	1,318.00	5,403,800	
アミューズ	8,100	1,871.00	15,155,100	
野村総合研究所	266,100	3,570.00	949,977,000	
ドリームインキュベータ	4,500	1,937.00	8,716,500	
サイバネットシステム	10,900	958.00	10,442,200	
クイック	9,200	1,800.00	16,560,000	
ＴＡＣ	8,100	205.00	1,660,500	
ＣＥホールディングス	7,400	491.00	3,633,400	
日本システム技術	2,800	2,521.00	7,058,800	
電通グループ	139,700	4,255.00	594,423,500	
インテージホールディングス	17,600	1,644.00	28,934,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,900	1,607.00	11,088,300	
東邦システムサイエンス	4,100	1,014.00	4,157,400	
ぴあ	4,500	3,380.00	15,210,000	
イオンファンタジー	5,700	3,790.00	21,603,000	
ソースネクスト	66,000	279.00	18,414,000	
シーティーエス	16,800	713.00	11,978,400	
ネクシィーズグループ	4,500	688.00	3,096,000	
インフォコム	16,800	1,944.00	32,659,200	
メディカルシステムネットワーク	13,400	410.00	5,494,000	
日本精化	9,800	1,935.00	18,963,000	
扶桑化学工業	12,100	3,380.00	40,898,000	
トリケミカル研究所	15,700	2,134.00	33,503,800	
シンプレクス・ホールディングス	24,200	2,016.00	48,787,200	
ＨＥＲＯＺ	4,400	1,172.00	5,156,800	
ラクスル	18,300	2,862.00	52,374,600	
メルカリ	58,400	2,185.00	127,604,000	
ＩＰＳ	4,300	2,999.00	12,895,700	
ＦＩＧ	16,700	403.00	6,730,100	

システムサポート	5,500	1,440.00	7,920,000	
ＡＤＥＫＡ	60,200	2,251.00	135,510,200	
日油	44,100	5,090.00	224,469,000	
ミヨシ油脂	5,000	994.00	4,970,000	
新日本理化	21,700	235.00	5,099,500	
ハリマ化成グループ	10,100	915.00	9,241,500	
イーソル	8,300	587.00	4,872,100	
アルテリア・ネットワークス	14,400	1,278.00	18,403,200	
東海ソフト	2,300	914.00	2,102,200	
ウイングアーク１ｓｔ	11,700	1,890.00	22,113,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,500	1,684.00	5,894,000	
サーバーワークス	2,700	2,435.00	6,574,500	
東名	1,100	1,081.00	1,189,100	
ヴィッツ	1,300	1,042.00	1,354,600	
トビラシステムズ	3,100	1,009.00	3,127,900	
Ｓａｎｓａｎ	48,400	1,392.00	67,372,800	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,800	727.00	2,035,600	
ギフティ	12,700	2,345.00	29,781,500	
花王	322,000	6,102.00	1,964,844,000	
第一工業製薬	5,100	2,092.00	10,669,200	
石原ケミカル	7,100	1,290.00	9,159,000	
日華化学	5,100	838.00	4,273,800	
ニイタカ	2,900	2,319.00	6,725,100	
三洋化成工業	9,100	4,545.00	41,359,500	
ベース	2,200	6,790.00	14,938,000	
ＪＭＤＣ	19,200	5,400.00	103,680,000	
武田薬品工業	1,225,500	3,882.00	4,757,391,000	
アステラス製薬	1,333,000	1,970.00	2,626,010,000	
住友ファーマ	96,300	1,041.00	100,248,300	
塩野義製薬	181,000	7,016.00	1,269,896,000	
わかもと製薬	15,200	235.00	3,572,000	
日本新薬	34,000	7,550.00	256,700,000	
中外製薬	406,400	3,534.00	1,436,217,600	
科研製薬	22,300	3,840.00	85,632,000	
エーザイ	172,300	6,008.00	1,035,178,400	
理研ビタミン	11,000	1,716.00	18,876,000	
ロート製薬	74,300	4,360.00	323,948,000	
小野薬品工業	300,600	3,361.00	1,010,316,600	
久光製薬	33,000	3,425.00	113,025,000	
有機合成薬品工業	10,600	306.00	3,243,600	
持田製薬	17,500	3,370.00	58,975,000	
参天製薬	271,500	982.00	266,613,000	
扶桑薬品工業	5,000	1,982.00	9,910,000	
日本ケミファ	1,700	1,855.00	3,153,500	
ツムラ	44,600	3,040.00	135,584,000	
日医工	45,000	469.00	21,105,000	
テルモ	441,100	4,380.00	1,932,018,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	38,900	2,722.00	105,885,800	
キッセイ薬品工業	22,600	2,497.00	56,432,200	

生化学工業	27,500	876.00	24,090,000	
栄研化学	23,100	1,803.00	41,649,300	
鳥居薬品	6,900	2,797.00	19,299,300	
ＪＣＲファーマ	43,900	2,148.00	94,297,200	
東和薬品	22,500	2,147.00	48,307,500	
富士製薬工業	8,400	1,040.00	8,736,000	
ゼリア新薬工業	23,100	2,033.00	46,962,300	
第一三共	1,131,000	4,236.00	4,790,916,000	
キョーリン製薬ホールディングス	28,200	1,743.00	49,152,600	
大幸薬品	23,500	603.00	14,170,500	
ダイト	9,800	2,629.00	25,764,200	
大塚ホールディングス	297,000	4,530.00	1,345,410,000	
大正製薬ホールディングス	28,900	5,200.00	150,280,000	
ペプチドリーム	63,000	1,684.00	106,092,000	
大日本塗料	17,300	720.00	12,456,000	
日本ペイントホールディングス	573,800	1,088.00	624,294,400	
関西ペイント	131,900	2,159.00	284,772,100	
神東塗料	10,400	139.00	1,445,600	
中国塗料	33,000	875.00	28,875,000	
日本特殊塗料	9,100	956.00	8,699,600	
藤倉化成	19,000	445.00	8,455,000	
太陽ホールディングス	22,500	2,612.00	58,770,000	
ＤＩＣ	50,600	2,480.00	125,488,000	
サカタインクス	28,800	966.00	27,820,800	
東洋インキＳＣホールディングス	25,400	1,897.00	48,183,800	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	12,300	962.00	11,832,600	
アルプス技研	11,600	1,811.00	21,007,600	
サニックス	26,100	258.00	6,733,800	
ダイオーズ	2,900	1,499.00	4,347,100	
日本空調サービス	15,600	740.00	11,544,000	
オリエンタルランド	158,500	20,390.00	3,231,815,000	
フォーカスシステムズ	9,500	981.00	9,319,500	
ダスキン	32,000	2,819.00	90,208,000	
パーク２４	99,300	2,116.00	210,118,800	
明光ネットワークジャパン	17,500	607.00	10,622,500	
ファルコホールディングス	6,600	1,724.00	11,378,400	
クレスコ	11,200	1,727.00	19,342,400	
フジ・メディア・ホールディングス	136,000	1,096.00	149,056,000	
秀英予備校	3,300	444.00	1,465,200	
田谷	1,900	549.00	1,043,100	
ラウンドワン	41,600	2,092.00	87,027,200	
リゾートトラスト	63,000	2,403.00	151,389,000	
オービック	48,200	19,830.00	955,806,000	
ジャストシステム	21,800	3,305.00	72,049,000	
ＴＤＣソフト	12,200	1,212.00	14,786,400	
Ｚホールディングス	2,206,200	410.10	904,762,620	
ビー・エム・エル	19,000	3,390.00	64,410,000	
トレンドマイクロ	75,000	8,010.00	600,750,000	
りらいあコミュニケーションズ	22,000	984.00	21,648,000	
ＩＤホールディングス	9,700	879.00	8,526,300	

リソー教育	68,100	325.00	22,132,500	
日本オラクル	24,800	7,940.00	196,912,000	
早稲田アカデミー	8,200	1,085.00	8,897,000	
アルファシステムズ	4,100	4,265.00	17,486,500	
フューチャー	32,300	1,621.00	52,358,300	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,000	1,419.00	11,352,000	
ＳＢテクノロジー	6,600	2,401.00	15,846,600	
トーセ	3,800	776.00	2,948,800	
ユー・エス・エス	166,800	2,416.00	402,988,800	
オービックビジネスコンサルタント	14,500	4,815.00	69,817,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	69,700	3,360.00	234,192,000	
アイティフォー	18,500	771.00	14,263,500	
東京個別指導学院	13,200	562.00	7,418,400	
東計電算	1,800	6,000.00	10,800,000	
サイバーエージェント	318,200	1,306.00	415,569,200	
楽天グループ	614,800	642.00	394,701,600	
エックスネット	2,400	999.00	2,397,600	
クリーク・アンド・リバー社	7,800	2,453.00	19,133,400	
モーニングスター	26,100	470.00	12,267,000	
テー・オー・ダブリュー	28,500	311.00	8,863,500	
大塚商会	73,600	4,405.00	324,208,000	
サイボウズ	17,900	1,454.00	26,026,600	
山田コンサルティンググループ	7,700	1,232.00	9,486,400	
セントラルスポーツ	5,500	2,523.00	13,876,500	
パラカ	4,500	1,938.00	8,721,000	
電通国際情報サービス	15,800	4,455.00	70,389,000	
ＡＣＣＥＳＳ	17,300	722.00	12,490,600	
デジタルガレージ	25,400	3,705.00	94,107,000	
イーエムシステムズ	21,600	844.00	18,230,400	
ウェザーニューズ	4,500	7,680.00	34,560,000	
ＣＩＪ	11,900	728.00	8,663,200	
ビジネスエンジニアリング	3,600	2,147.00	7,729,200	
日本エンタープライズ	14,900	153.00	2,279,700	
WOWOW	6,300	1,353.00	8,523,900	
スカラ	12,900	708.00	9,133,200	
インテリジェント　ウェイブ	7,600	700.00	5,320,000	
フルキャストホールディングス	12,800	2,600.00	33,280,000	
エン・ジャパン	26,400	2,337.00	61,696,800	
あすか製薬ホールディングス	14,700	1,121.00	16,478,700	
サワイグループホールディングス	30,000	4,010.00	120,300,000	
富士フイルムホールディングス	274,000	6,860.00	1,879,640,000	
コニカミノルタ	316,300	493.00	155,935,900	
資生堂	271,100	5,184.00	1,405,382,400	
ライオン	155,800	1,617.00	251,928,600	
高砂香料工業	8,800	2,695.00	23,716,000	
マンダム	30,400	1,524.00	46,329,600	
ミルボン	19,200	6,330.00	121,536,000	
ファンケル	63,100	2,841.00	179,267,100	
コーセー	26,400	14,540.00	383,856,000	
コタ	10,900	1,522.00	16,589,800	

シーボン	1,600	1,662.00	2,659,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	66,600	1,638.00	109,090,800	
ノエビアホールディングス	11,600	5,790.00	67,164,000	
アジュバンホールディングス	3,600	959.00	3,452,400	
新日本製薬	7,400	1,603.00	11,862,200	
エステー	10,000	1,532.00	15,320,000	
アグロ　カネショウ	5,100	1,311.00	6,686,100	
コニシ	23,600	1,572.00	37,099,200	
長谷川香料	26,900	3,150.00	84,735,000	
星光ＰＭＣ	7,400	544.00	4,025,600	
小林製薬	39,700	8,360.00	331,892,000	
荒川化学工業	11,000	1,013.00	11,143,000	
メック	10,700	2,305.00	24,663,500	
日本高純度化学	3,700	2,359.00	8,728,300	
タカラバイオ	40,900	1,806.00	73,865,400	
ＪＣＵ	16,000	3,075.00	49,200,000	
新田ゼラチン	8,900	907.00	8,072,300	
ＯＡＴアグリオ	5,800	1,798.00	10,428,400	
デクセリアルズ	40,600	3,920.00	159,152,000	
アース製薬	11,800	5,290.00	62,422,000	
北興化学工業	13,100	950.00	12,445,000	
大成ラミック	4,200	2,856.00	11,995,200	
クミアイ化学工業	51,500	994.00	51,191,000	
日本農薬	27,800	825.00	22,935,000	
富士興産	3,800	1,199.00	4,556,200	
ニチレキ	16,800	1,291.00	21,688,800	
ユシロ化学工業	7,400	865.00	6,401,000	
ビーピー・カストロール	5,500	1,091.00	6,000,500	
富士石油	34,000	330.00	11,220,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,100	1,096.00	5,589,600	
出光興産	158,600	3,445.00	546,377,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,345,600	505.30	1,185,231,680	
コスモエネルギーホールディングス	61,500	4,010.00	246,615,000	
テスホールディングス	13,600	1,063.00	14,456,800	
インフロニア・ホールディングス	170,200	1,001.00	170,370,200	
横浜ゴム	73,900	2,316.00	171,152,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	74,700	1,666.00	124,450,200	
ブリヂストン	414,500	5,029.00	2,084,520,500	
住友ゴム工業	127,300	1,210.00	154,033,000	
藤倉コンポジット	12,500	918.00	11,475,000	
オカモト	7,200	3,800.00	27,360,000	
アキレス	10,000	1,318.00	13,180,000	
フコク	6,800	986.00	6,704,800	
ニッタ	14,600	2,889.00	42,179,400	
クリエートメディック	4,600	910.00	4,186,000	
住友理工	30,200	583.00	17,606,600	
三ツ星ベルト	19,000	3,230.00	61,370,000	
バンドー化学	25,100	1,032.00	25,903,200	
ＡＧＣ	132,000	4,780.00	630,960,000	
日本板硝子	70,500	578.00	40,749,000	

石塚硝子	2,500	1,573.00	3,932,500	
有沢製作所	21,200	1,306.00	27,687,200	
日本山村硝子	5,300	605.00	3,206,500	
日本電気硝子	52,900	2,614.00	138,280,600	
オハラ	6,100	1,372.00	8,369,200	
住友大阪セメント	23,200	3,505.00	81,316,000	
太平洋セメント	88,600	2,155.00	190,933,000	
リソルホールディングス	1,600	4,515.00	7,224,000	
日本ヒューム	12,900	653.00	8,423,700	
日本コンクリート工業	27,900	268.00	7,477,200	
三谷セキサン	6,300	3,740.00	23,562,000	
アジアパイルホールディングス	22,200	501.00	11,122,200	
東海カーボン	108,900	1,005.00	109,444,500	
日本カーボン	7,400	4,025.00	29,785,000	
東洋炭素	8,200	3,380.00	27,716,000	
ノリタケカンパニーリミテド	7,900	4,075.00	32,192,500	
ＴＯＴＯ	94,300	4,865.00	458,769,500	
日本碍子	153,600	1,979.00	303,974,400	
日本特殊陶業	108,700	2,900.00	315,230,000	
ダントーホールディングス	10,200	327.00	3,335,400	
ＭＡＲＵＷＡ	5,300	17,400.00	92,220,000	
品川リフラクトリーズ	3,700	3,940.00	14,578,000	
黒崎播磨	2,700	4,940.00	13,338,000	
ヨータイ	9,900	1,390.00	13,761,000	
東京窯業	15,300	267.00	4,085,100	
ニッカトー	6,500	446.00	2,899,000	
フジミインコーポレーテッド	12,500	6,210.00	77,625,000	
クニミネ工業	4,900	825.00	4,042,500	
エーアンドエーマテリアル	2,700	864.00	2,332,800	
ニチアス	32,800	2,358.00	77,342,400	
日本製鉄	644,000	2,226.00	1,433,544,000	
神戸製鋼所	268,600	638.00	171,366,800	
中山製鋼所	21,400	595.00	12,733,000	
合同製鐵	7,400	1,797.00	13,297,800	
ＪＦＥホールディングス	356,900	1,459.00	520,717,100	
東京製鐵	45,000	1,267.00	57,015,000	
共英製鋼	15,200	1,488.00	22,617,600	
大和工業	25,200	4,480.00	112,896,000	
東京鐵鋼	6,300	1,348.00	8,492,400	
大阪製鐵	8,200	1,190.00	9,758,000	
淀川製鋼所	16,800	2,465.00	41,412,000	
丸一鋼管	44,700	2,929.00	130,926,300	
モリ工業	3,800	2,649.00	10,066,200	
大同特殊鋼	21,100	3,775.00	79,652,500	
日本高周波鋼業	4,400	327.00	1,438,800	
日本冶金工業	10,600	2,793.00	29,605,800	
山陽特殊製鋼	13,200	1,986.00	26,215,200	
愛知製鋼	8,700	2,139.00	18,609,300	
日立金属	166,100	2,174.00	361,101,400	
日本金属	3,900	1,000.00	3,900,000	

大平洋金属	9,500	2,318.00	22,021,000	
新日本電工	85,400	350.00	29,890,000	
栗本鐵工所	6,300	1,620.00	10,206,000	
虹　技	2,000	925.00	1,850,000	
日本鋳鉄管	1,600	969.00	1,550,400	
日本製鋼所	39,600	3,005.00	118,998,000	
三菱製鋼	9,900	977.00	9,672,300	
日亜鋼業	17,600	243.00	4,276,800	
日本精線	2,500	4,570.00	11,425,000	
エンビプロ・ホールディングス	10,200	870.00	8,874,000	
大紀アルミニウム工業所	19,000	1,327.00	25,213,000	
日本軽金属ホールディングス	39,000	1,600.00	62,400,000	
三井金属鉱業	41,600	3,125.00	130,000,000	
東邦亜鉛	7,900	2,359.00	18,636,100	
三菱マテリアル	89,100	2,009.00	179,001,900	
住友金属鉱山	168,900	4,390.00	741,471,000	
ＤＯＷＡホールディングス	36,000	5,370.00	193,320,000	
古河機械金属	23,500	1,246.00	29,281,000	
エス・サイエンス	68,500	25.00	1,712,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,800	3,210.00	57,138,000	
東邦チタニウム	27,600	2,504.00	69,110,400	
ＵＡＣＪ	21,100	2,383.00	50,281,300	
ＣＫサンエツ	2,900	3,950.00	11,455,000	
古河電気工業	44,400	2,473.00	109,801,200	
住友電気工業	538,100	1,605.00	863,650,500	
フジクラ	171,800	944.00	162,179,200	
昭和電線ホールディングス	13,500	1,846.00	24,921,000	
東京特殊電線	2,000	2,231.00	4,462,000	
タツタ電線	27,100	455.00	12,330,500	
カナレ電気	2,300	1,453.00	3,341,900	
平河ヒューテック	8,500	1,088.00	9,248,000	
リョービ	14,200	1,291.00	18,332,200	
アーレスティ	16,400	403.00	6,609,200	
アサヒホールディングス	61,700	2,089.00	128,891,300	
東洋製罐グループホールディングス	78,600	1,791.00	140,772,600	
ホッカンホールディングス	7,200	1,321.00	9,511,200	
コロナ	7,400	838.00	6,201,200	
横河ブリッジホールディングス	22,100	1,948.00	43,050,800	
駒井ハルテック	2,400	1,671.00	4,010,400	
高田機工	600	2,403.00	1,441,800	
三和ホールディングス	145,300	1,344.00	195,283,200	
文化シヤッター	45,400	1,054.00	47,851,600	
三協立山	18,400	601.00	11,058,400	
アルインコ	10,200	881.00	8,986,200	
東洋シヤッター	2,500	538.00	1,345,000	
ＬＩＸＩＬ	242,600	2,307.00	559,678,200	
日本フイルコン	9,700	469.00	4,549,300	
ノーリツ	19,700	1,553.00	30,594,100	
長府製作所	13,900	1,996.00	27,744,400	
リンナイ	26,600	10,430.00	277,438,000	

ユニプレス	25,500	923.00	23,536,500	
ダイニチ工業	7,400	635.00	4,699,000	
日東精工	17,500	521.00	9,117,500	
三洋工業	1,600	1,703.00	2,724,800	
岡部	21,600	662.00	14,299,200	
ジーテクト	17,000	1,366.00	23,222,000	
東プレ	23,500	1,212.00	28,482,000	
高周波熱錬	23,800	678.00	16,136,400	
東京製綱	9,500	945.00	8,977,500	
サンコール	13,200	737.00	9,728,400	
モリテックスチール	12,100	271.00	3,279,100	
パイオラックス	20,300	1,944.00	39,463,200	
エイチワン	13,700	593.00	8,124,100	
日本発条	130,000	944.00	122,720,000	
中央発條	7,400	691.00	5,113,400	
アドバネクス	2,000	1,230.00	2,460,000	
三浦工業	60,600	2,810.00	170,286,000	
タクマ	44,200	1,306.00	57,725,200	
テクノプロ・ホールディングス	89,200	2,925.00	260,910,000	
アトラグループ	3,400	189.00	642,600	
インターワークス	4,400	384.00	1,689,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	2,074.00	14,310,600	
ＫｅｅＰｅｒ技研	9,600	4,030.00	38,688,000	
ファーストロジック	2,300	852.00	1,959,600	
三機サービス	2,600	919.00	2,389,400	
Ｇｕｎｏｓｙ	8,200	770.00	6,314,000	
デザインワン・ジャパン	3,900	173.00	674,700	
イー・ガーディアン	5,000	2,899.00	14,495,000	
リブセンス	6,800	263.00	1,788,400	
ジャパンマテリアル	45,800	1,901.00	87,065,800	
ベクトル	20,900	1,111.00	23,219,900	
ウチヤマホールディングス	7,300	299.00	2,182,700	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,100	1,106.00	12,276,600	
キャリアリンク	5,400	2,218.00	11,977,200	
ＩＢＪ	8,200	922.00	7,560,400	
アサンテ	6,600	1,600.00	10,560,000	
バリューＨＲ	11,600	1,450.00	16,820,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	12,300	4,095.00	50,368,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,800	1,113.00	6,455,400	
ＥＲＩホールディングス	4,200	1,067.00	4,481,400	
アビスト	2,200	2,966.00	6,525,200	
シグマクシス・ホールディングス	17,900	1,172.00	20,978,800	
ウィルグループ	11,100	1,417.00	15,728,700	
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,400	164.00	2,525,600	
メドピア	10,500	1,433.00	15,046,500	
レアジョブ	2,800	770.00	2,156,000	
リクルートホールディングス	1,067,300	4,398.00	4,693,985,400	
エラン	17,600	1,100.00	19,360,000	

ツガミ	31,500	1,184.00	37,296,000	
オークマ	14,600	5,090.00	74,314,000	
芝浦機械	17,400	2,878.00	50,077,200	
アマダ	243,300	1,084.00	263,737,200	
アイダエンジニアリング	33,600	822.00	27,619,200	
滝澤鉄工所	4,500	1,130.00	5,085,000	
ＦＵＪＩ	61,500	1,979.00	121,708,500	
牧野フライス製作所	15,600	4,410.00	68,796,000	
オーエスジー	62,400	1,875.00	117,000,000	
ダイジェット工業	1,600	865.00	1,384,000	
旭ダイヤモンド工業	37,800	750.00	28,350,000	
ＤＭＧ森精機	79,300	1,736.00	137,664,800	
ソディック	36,400	777.00	28,282,800	
ディスコ	22,700	33,950.00	770,665,000	
日東工器	7,400	1,600.00	11,840,000	
日進工具	12,200	1,098.00	13,395,600	
パンチ工業	13,100	430.00	5,633,000	
冨士ダイス	7,700	601.00	4,627,700	
土木管理総合試験所	6,200	308.00	1,909,600	
ネットマーケティング	7,300	899.00	6,562,700	
日本郵政	1,627,800	991.70	1,614,289,260	
ベルシステム２４ホールディングス	21,500	1,407.00	30,250,500	
鎌倉新書	16,900	870.00	14,703,000	
ＳＭＮ	3,400	531.00	1,805,400	
一蔵	1,900	457.00	868,300	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,200	665.00	1,463,000	
エアトリ	8,600	3,065.00	26,359,000	
アトラエ	10,500	1,497.00	15,718,500	
ストライク	6,600	4,190.00	27,654,000	
ソラスト	36,600	898.00	32,866,800	
セラク	4,700	1,108.00	5,207,600	
インソース	16,500	2,797.00	46,150,500	
豊田自動織機	110,400	7,370.00	813,648,000	
豊和工業	7,900	804.00	6,351,600	
ニデックオーケーケー	5,800	1,120.00	6,496,000	
石川製作所	4,100	1,360.00	5,576,000	
東洋機械金属	10,000	573.00	5,730,000	
津田駒工業	2,700	488.00	1,317,600	
エンシュウ	3,500	766.00	2,681,000	
島精機製作所	22,600	2,100.00	47,460,000	
オプトラン	19,300	2,370.00	45,741,000	
ＮＣホールディングス	4,400	1,801.00	7,924,400	
イワキ	9,800	1,357.00	13,298,600	
フリュー	13,700	1,020.00	13,974,000	
ヤマシンフィルタ	24,200	323.00	7,816,600	
日阪製作所	15,800	835.00	13,193,000	
やまびこ	21,400	1,149.00	24,588,600	
野村マイクロ・サイエンス	4,900	3,555.00	17,419,500	
平田機工	6,700	4,400.00	29,480,000	
ペガサスミシン製造	15,600	936.00	14,601,600	

マルマエ	6,300	1,985.00	12,505,500	
タツモ	7,200	1,394.00	10,036,800	
ナブテスコ	82,000	3,135.00	257,070,000	
三井海洋開発	16,400	1,473.00	24,157,200	
レオン自動機	16,500	1,176.00	19,404,000	
ＳＭＣ	45,700	63,800.00	2,915,660,000	
ホソカワミクロン	10,000	2,533.00	25,330,000	
ユニオンツール	5,700	3,470.00	19,779,000	
オイレス工業	20,000	1,498.00	29,960,000	
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,045.00	23,865,500	
サトーホールディングス	20,300	1,896.00	38,488,800	
技研製作所	13,600	3,380.00	45,968,000	
日本エアーテック	6,600	1,057.00	6,976,200	
カワタ	4,500	885.00	3,982,500	
日精樹脂工業	9,700	941.00	9,127,700	
オカダアイヨン	4,800	1,449.00	6,955,200	
ワイエイシイホールディングス	6,100	1,339.00	8,167,900	
小松製作所	706,500	2,807.00	1,983,145,500	
住友重機械工業	83,300	2,881.00	239,987,300	
日立建機	62,400	2,884.00	179,961,600	
日工	19,300	632.00	12,197,600	
巴工業	5,600	2,468.00	13,820,800	
井関農機	12,200	1,233.00	15,042,600	
ＴＯＷＡ	13,400	1,758.00	23,557,200	
丸山製作所	2,500	1,555.00	3,887,500	
北川鉄工所	6,000	1,288.00	7,728,000	
シンニッタン	18,600	217.00	4,036,200	
ローツェ	7,700	8,130.00	62,601,000	
タカキタ	4,700	530.00	2,491,000	
クボタ	697,100	2,161.00	1,506,433,100	
荏原実業	6,500	2,157.00	14,020,500	
東洋エンジニアリング	20,600	625.00	12,875,000	
三菱化工機	4,500	2,150.00	9,675,000	
月島機械	24,300	898.00	21,821,400	
帝国電機製作所	9,900	1,926.00	19,067,400	
東京機械製作所	6,300	684.00	4,309,200	
新東工業	29,100	704.00	20,486,400	
澁谷工業	12,300	2,413.00	29,679,900	
アイチコーポレーション	22,300	806.00	17,973,800	
小森コーポレーション	35,800	732.00	26,205,600	
鶴見製作所	11,000	2,211.00	24,321,000	
住友精密工業	2,300	2,551.00	5,867,300	
日本ギア工業	5,500	378.00	2,079,000	
酒井重工業	2,600	2,992.00	7,779,200	
荏原製作所	53,500	5,020.00	268,570,000	
石井鐵工所	1,100	2,785.00	3,063,500	
西島製作所	12,700	1,318.00	16,738,600	
北越工業	13,200	998.00	13,173,600	
ダイキン工業	170,200	24,095.00	4,100,969,000	
オルガノ	4,500	8,790.00	39,555,000	

トーヨーカネツ	5,400	2,452.00	13,240,800	
栗田工業	78,700	5,410.00	425,767,000	
椿本チエイン	20,400	3,265.00	66,606,000	
大同工業	6,300	715.00	4,504,500	
日機装	32,400	1,014.00	32,853,600	
木村化工機	12,000	715.00	8,580,000	
レイズネクスト	21,000	1,176.00	24,696,000	
アネスト岩田	24,200	899.00	21,755,800	
ダイフク	73,500	7,320.00	538,020,000	
サムコ	4,400	3,210.00	14,124,000	
加藤製作所	7,400	746.00	5,520,400	
油研工業	1,900	1,784.00	3,389,600	
タダノ	75,300	898.00	67,619,400	
フジテック	47,900	2,873.00	137,616,700	
ＣＫＤ	39,500	1,835.00	72,482,500	
キトー	12,200	2,661.00	32,464,200	
平和	43,400	2,163.00	93,874,200	
理想科学工業	13,100	2,427.00	31,793,700	
ＳＡＮＫＹＯ	32,100	4,025.00	129,202,500	
日本金銭機械	15,800	652.00	10,301,600	
マースグループホールディングス	9,900	1,648.00	16,315,200	
フクシマガリレイ	9,600	3,605.00	34,608,000	
オーイズミ	5,400	393.00	2,122,200	
ダイコク電機	7,100	1,310.00	9,301,000	
竹内製作所	23,700	2,663.00	63,113,100	
アマノ	40,900	2,511.00	102,699,900	
ＪＵＫＩ	20,300	690.00	14,007,000	
サンデン	21,600	259.00	5,594,400	
ジャノメ	13,300	680.00	9,044,000	
ブラザー工業	177,700	2,588.00	459,887,600	
マックス	18,400	1,967.00	36,192,800	
モリタホールディングス	24,900	1,294.00	32,220,600	
グローリー	37,000	2,233.00	82,621,000	
新晃工業	14,400	1,540.00	22,176,000	
大和冷機工業	20,000	1,077.00	21,540,000	
セガサミーホールディングス	140,200	1,960.00	274,792,000	
日本ピストンリング	5,700	1,259.00	7,176,300	
リケン	5,700	2,433.00	13,868,100	
ＴＰＲ	16,900	1,275.00	21,547,500	
ツバキ・ナカシマ	32,200	1,192.00	38,382,400	
ホシザキ	84,200	3,870.00	325,854,000	
大豊工業	12,800	706.00	9,036,800	
日本精工	266,900	768.00	204,979,200	
ＮＴＮ	283,600	278.00	78,840,800	
ジェイテクト	132,900	995.00	132,235,500	
不二越	9,700	3,650.00	35,405,000	
ミネベアミツミ	248,100	2,384.00	591,470,400	
日本トムソン	35,600	566.00	20,149,600	
ＴＨＫ	75,500	2,619.00	197,734,500	
ユーシン精機	12,200	707.00	8,625,400	

前澤給装工業	10,000	890.00	8,900,000	
イーグル工業	16,800	1,186.00	19,924,800	
前澤工業	9,300	612.00	5,691,600	
日本ピラー工業	13,400	2,489.00	33,352,600	
キッツ	48,200	798.00	38,463,600	
日立製作所	749,900	6,724.00	5,042,327,600	
東芝	272,600	5,052.00	1,377,175,200	
三菱電機	1,455,100	1,368.00	1,990,576,800	
富士電機	86,700	5,760.00	499,392,000	
東洋電機製造	5,100	886.00	4,518,600	
安川電機	154,900	4,505.00	697,824,500	
シンフォニア　テクノロジー	15,900	1,435.00	22,816,500	
明電舎	22,100	1,983.00	43,824,300	
オリジン	3,600	1,380.00	4,968,000	
山洋電気	5,600	5,110.00	28,616,000	
デンヨー	11,100	1,521.00	16,883,100	
ＰＨＣホールディングス	24,000	1,553.00	37,272,000	
ベイカレント・コンサルティング	10,600	39,750.00	421,350,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,800	2,560.00	7,168,000	
アイモバイル	7,400	1,258.00	9,309,200	
キャリアインデックス	5,000	401.00	2,005,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	6,000	884.00	5,304,000	
船場	1,600	730.00	1,168,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,300	1,902.00	89,964,600	
フルテック	2,000	1,170.00	2,340,000	
グリーンズ	5,600	878.00	4,916,800	
ツナググループ・ホールディングス	4,200	325.00	1,365,000	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	4,400	378.00	1,663,200	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,100	616.00	1,293,600	
ウェルビー	9,800	743.00	7,281,400	
エル・ティー・エス	1,700	3,080.00	5,236,000	
ミダックホールディングス	6,700	3,470.00	23,249,000	
日総工産	11,500	574.00	6,601,000	
キュービーネットホールディングス	6,800	1,429.00	9,717,200	
ＲＰＡホールディングス	21,000	300.00	6,300,000	
三櫻工業	21,600	722.00	15,595,200	
マキタ	176,300	3,036.00	535,246,800	
東芝テック	16,800	3,950.00	66,360,000	
芝浦メカトロニクス	2,800	10,250.00	28,700,000	
マブチモーター	32,400	3,965.00	128,466,000	
日本電産	346,400	9,153.00	3,170,599,200	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,400	473.00	2,554,200	
トレックス・セミコンダクター	6,600	2,763.00	18,235,800	
東光高岳	8,700	1,868.00	16,251,600	
ダブル・スコープ	42,600	2,479.00	105,605,400	
宮越ホールディングス	5,800	904.00	5,243,200	
ダイヘン	14,400	3,975.00	57,240,000	
ヤーマン	25,400	1,229.00	31,216,600	

ＪＶＣケンウッド	127,000	201.00	25,527,000	
ミマキエンジニアリング	13,900	687.00	9,549,300	
Ｉ－ＰＥＸ	7,300	1,329.00	9,701,700	
日新電機	36,500	1,364.00	49,786,000	
大崎電気工業	26,200	522.00	13,676,400	
オムロン	129,800	6,895.00	894,971,000	
日東工業	19,600	2,612.00	51,195,200	
ＩＤＥＣ	19,300	2,921.00	56,375,300	
正興電機製作所	4,400	1,026.00	4,514,400	
不二電機工業	2,900	1,098.00	3,184,200	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	46,800	2,456.00	114,940,800	
サクサホールディングス	3,000	1,263.00	3,789,000	
メルコホールディングス	4,400	3,190.00	14,036,000	
テクノメディカ	3,600	1,613.00	5,806,800	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,400	1,283.00	5,645,200	
日本電気	185,000	4,865.00	900,025,000	
富士通	140,300	15,900.00	2,230,770,000	
沖電気工業	59,100	726.00	42,906,600	
岩崎通信機	6,300	747.00	4,706,100	
電気興業	7,400	2,350.00	17,390,000	
サンケン電気	13,400	4,790.00	64,186,000	
ナカヨ	2,200	1,061.00	2,334,200	
アイホン	7,000	2,026.00	14,182,000	
ルネサスエレクトロニクス	850,800	1,299.00	1,105,189,200	
セイコーエプソン	174,200	2,131.00	371,220,200	
ワコム	119,500	761.00	90,939,500	
アルバック	31,100	5,640.00	175,404,000	
アクセル	5,900	948.00	5,593,200	
ＥＩＺＯ	10,600	3,815.00	40,439,000	
ジャパンディスプレイ	532,400	51.00	27,152,400	
日本信号	33,100	934.00	30,915,400	
京三製作所	30,400	419.00	12,737,600	
能美防災	17,600	1,594.00	28,054,400	
ホーチキ	9,800	1,324.00	12,975,200	
星和電機	5,800	445.00	2,581,000	
エレコム	35,700	1,581.00	56,441,700	
パナソニック　ホールディングス	1,662,900	1,125.00	1,870,762,500	
シャープ	148,100	943.00	139,658,300	
アンリツ	98,600	1,621.00	159,830,600	
富士通ゼネラル	42,300	2,917.00	123,389,100	
ソニーグループ	976,700	10,410.00	10,167,447,000	
ＴＤＫ	225,800	4,965.00	1,121,097,000	
帝国通信工業	6,800	1,427.00	9,703,600	
タムラ製作所	56,100	665.00	37,306,500	
アルプスアルパイン	127,300	1,211.00	154,160,300	
池上通信機	4,500	591.00	2,659,500	
日本電波工業	15,600	1,450.00	22,620,000	
鈴木	7,600	866.00	6,581,600	
メイコー	16,800	2,834.00	47,611,200	

日本トリム	2,900	2,329.00	6,754,100	
ローランド　ディー．ジー．	7,400	3,195.00	23,643,000	
フォスター電機	14,400	783.00	11,275,200	
ＳＭＫ	3,600	2,408.00	8,668,800	
ヨコオ	10,400	2,164.00	22,505,600	
ティアック	23,800	115.00	2,737,000	
ホシデン	34,400	1,614.00	55,521,600	
ヒロセ電機	21,600	20,010.00	432,216,000	
日本航空電子工業	31,300	2,338.00	73,179,400	
ＴＯＡ	16,700	795.00	13,276,500	
マクセル	28,400	1,463.00	41,549,200	
古野電気	18,500	1,116.00	20,646,000	
スミダコーポレーション	12,000	1,062.00	12,744,000	
アイコム	5,000	2,609.00	13,045,000	
リオン	5,300	2,051.00	10,870,300	
横河電機	143,000	2,347.00	335,621,000	
新電元工業	5,500	3,830.00	21,065,000	
アズビル	90,400	3,940.00	356,176,000	
東亜ディーケーケー	7,700	848.00	6,529,600	
日本光電工業	59,800	2,992.00	178,921,600	
チノー	4,900	1,630.00	7,987,000	
共和電業	13,600	329.00	4,474,400	
日本電子材料	7,300	1,473.00	10,752,900	
堀場製作所	28,800	6,100.00	175,680,000	
アドバンテスト	115,900	7,360.00	853,024,000	
小野測器	5,300	406.00	2,151,800	
エスペック	11,500	1,782.00	20,493,000	
キーエンス	141,300	50,110.00	7,080,543,000	
日置電機	6,700	6,660.00	44,622,000	
シスメックス	111,600	8,115.00	905,634,000	
日本マイクロニクス	21,400	1,346.00	28,804,400	
メガチップス	13,700	2,590.00	35,483,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,000	3,310.00	19,860,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	10,800	915.00	9,882,000	
澤藤電機	1,900	1,177.00	2,236,300	
デンソー	305,100	7,300.00	2,227,230,000	
原田工業	7,400	777.00	5,749,800	
コーセル	17,300	929.00	16,071,700	
イリソ電子工業	13,100	4,085.00	53,513,500	
オプテックスグループ	23,700	2,129.00	50,457,300	
千代田インテグレ	5,200	2,190.00	11,388,000	
レーザーテック	63,900	17,515.00	1,119,208,500	
スタンレー電気	100,500	2,522.00	253,461,000	
岩崎電気	4,900	2,503.00	12,264,700	
ウシオ電機	73,800	1,613.00	119,039,400	
岡谷電機産業	11,100	244.00	2,708,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	13,300	378.00	5,027,400	
エノモト	4,400	1,510.00	6,644,000	
日本セラミック	13,200	2,622.00	34,610,400	
遠藤照明	7,100	775.00	5,502,500	

古河電池	11,200	1,152.00	12,902,400	
双信電機	7,400	412.00	3,048,800	
山一電機	10,200	1,978.00	20,175,600	
図研	10,100	3,485.00	35,198,500	
日本電子	30,000	5,380.00	161,400,000	
カシオ計算機	96,400	1,309.00	126,187,600	
ファナック	136,800	21,620.00	2,957,616,000	
日本シイエムケイ	27,500	462.00	12,705,000	
エンプラス	3,900	4,505.00	17,569,500	
大真空	19,200	934.00	17,932,800	
ローム	64,800	10,400.00	673,920,000	
浜松ホトニクス	103,900	6,220.00	646,258,000	
三井ハイテック	13,400	7,630.00	102,242,000	
新光電気工業	45,800	3,640.00	166,712,000	
京セラ	219,400	7,964.00	1,747,301,600	
協栄産業	1,600	1,461.00	2,337,600	
太陽誘電	69,300	4,155.00	287,941,500	
村田製作所	425,300	7,362.00	3,131,058,600	
双葉電子工業	26,700	648.00	17,301,600	
日東電工	94,300	8,630.00	813,809,000	
北陸電気工業	5,800	1,087.00	6,304,600	
東海理化電機製作所	41,100	1,497.00	61,526,700	
ニチコン	41,500	1,451.00	60,216,500	
日本ケミコン	14,700	1,920.00	28,224,000	
ＫＯＡ	21,600	2,334.00	50,414,400	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	57,900	409.00	23,681,100	
日立造船	123,500	867.00	107,074,500	
三菱重工業	228,700	5,096.00	1,165,455,200	
川崎重工業	105,600	2,497.00	263,683,200	
ＩＨＩ	97,300	3,470.00	337,631,000	
名村造船所	40,300	638.00	25,711,400	
サノヤスホールディングス	17,600	123.00	2,164,800	
スプリックス	5,000	985.00	4,925,000	
マネジメントソリューションズ	7,300	2,555.00	18,651,500	
プロレド・パートナーズ	3,200	612.00	1,958,400	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	4,300	363.00	1,560,900	
テノ．ホールディングス	1,800	550.00	990,000	
フロンティア・マネジメント	4,000	1,221.00	4,884,000	
ピアラ	2,300	727.00	1,672,100	
コプロ・ホールディングス	2,900	887.00	2,572,300	
ギークス	2,600	854.00	2,220,400	
カーブスホールディングス	40,900	836.00	34,192,400	
フォーラムエンジニアリング	9,000	913.00	8,217,000	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	2,800	1,560.00	4,368,000	
日本車輌製造	5,000	2,100.00	10,500,000	
三菱ロジスネクスト	20,700	787.00	16,290,900	
近畿車輌	1,600	985.00	1,576,000	
一家ホールディングス	2,800	709.00	1,985,200	
フルサト・マルカホールディングス	13,600	3,185.00	43,316,000	

ヤマエグループホールディングス	8,600	1,592.00	13,691,200	
藤久ホールディングス	4,700	647.00	3,040,900	
ＦＰＧ	51,700	1,323.00	68,399,100	
島根銀行	4,600	460.00	2,116,000	
じもとホールディングス	10,200	498.00	5,079,600	
全国保証	36,700	4,725.00	173,407,500	
めぶきフィナンシャルグループ	632,600	281.00	177,760,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,500	1,368.00	14,364,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,800	2,248.00	40,014,400	
九州フィナンシャルグループ	269,100	381.00	102,527,100	
かんぽ生命保険	154,800	2,260.00	349,848,000	
ゆうちょ銀行	363,000	1,046.00	379,698,000	
あんしん保証	6,000	260.00	1,560,000	
富山第一銀行	34,200	425.00	14,535,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	761,200	465.00	353,958,000	
ジェイリース	5,100	2,651.00	13,520,100	
西日本フィナンシャルホールディングス	80,700	757.00	61,089,900	
イントラスト	6,500	609.00	3,958,500	
日本モーゲージサービス	8,500	892.00	7,582,000	
ＣＡＳＡ	5,400	831.00	4,487,400	
アルヒ	22,700	1,407.00	31,938,900	
プレミアグループ	23,400	1,891.00	44,249,400	
日産自動車	1,838,800	539.20	991,480,960	
いすゞ自動車	451,600	1,778.00	802,944,800	
トヨタ自動車	7,107,900	2,030.50	14,432,590,950	
日野自動車	194,700	645.00	125,581,500	
三菱自動車工業	577,200	608.00	350,937,600	
エフテック	9,900	518.00	5,128,200	
レシップホールディングス	5,700	518.00	2,952,600	
ＧＭＢ	2,800	714.00	1,999,200	
ファルテック	2,800	600.00	1,680,000	
武蔵精密工業	34,800	1,662.00	57,837,600	
日産車体	22,800	801.00	18,262,800	
新明和工業	40,700	1,037.00	42,205,900	
極東開発工業	24,800	1,384.00	34,323,200	
トピー工業	11,700	1,386.00	16,216,200	
ティラド	4,300	2,712.00	11,661,600	
曙ブレーキ工業	85,700	173.00	14,826,100	
タチエス	25,500	1,213.00	30,931,500	
ＮＯＫ	58,700	1,229.00	72,142,300	
フタバ産業	34,700	342.00	11,867,400	
ＫＹＢ	13,700	3,400.00	46,580,000	
市光工業	18,600	390.00	7,254,000	
大同メタル工業	30,000	512.00	15,360,000	
プレス工業	69,900	429.00	29,987,100	
ミクニ	18,100	321.00	5,810,100	
太平洋工業	29,700	1,071.00	31,808,700	

河西工業	19,200	208.00	3,993,600	
アイシン	114,000	3,995.00	455,430,000	
マツダ	458,800	1,192.00	546,889,600	
今仙電機製作所	10,200	559.00	5,701,800	
本田技研工業	1,140,000	3,525.00	4,018,500,000	
スズキ	309,100	4,959.00	1,532,826,900	
ＳＵＢＡＲＵ	409,600	2,525.50	1,034,444,800	
安永	6,200	710.00	4,402,000	
ヤマハ発動機	203,500	2,892.00	588,522,000	
小糸製作所	77,800	4,565.00	355,157,000	
ＴＢＫ	15,600	303.00	4,726,800	
エクセディ	23,500	1,790.00	42,065,000	
ミツバ	24,200	418.00	10,115,600	
豊田合成	44,100	2,345.00	103,414,500	
愛三工業	24,400	729.00	17,787,600	
盟和産業	1,600	978.00	1,564,800	
日本プラスト	11,300	449.00	5,073,700	
ヨロズ	12,200	866.00	10,565,200	
エフ・シー・シー	25,400	1,426.00	36,220,400	
新家工業	3,300	1,654.00	5,458,200	
シマノ	52,900	23,920.00	1,265,368,000	
テイ・エス　テック	65,900	1,530.00	100,827,000	
三十三フィナンシャルグループ	12,400	1,474.00	18,277,600	
第四北越フィナンシャルグループ	21,700	2,701.00	58,611,700	
ひろぎんホールディングス	196,500	620.00	121,830,000	
マーキュリアホールディングス	8,300	635.00	5,270,500	
おきなわフィナンシャルグループ	13,000	2,189.00	28,457,000	
ダイレクトマーケティングミックス	15,100	1,602.00	24,190,200	
ポピンズ	2,000	1,707.00	3,414,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	12,100	2,801.00	33,892,100	
十六フィナンシャルグループ	17,900	2,474.00	44,284,600	
北國フィナンシャルホールディングス	12,800	4,780.00	61,184,000	
ネットプロテクションズホールディングス	46,700	466.00	21,762,200	
プロクレアホールディングス	15,600	2,146.00	33,477,600	
ジャムコ	9,100	1,412.00	12,849,200	
小野建	13,700	1,477.00	20,234,900	
はるやまホールディングス	7,200	407.00	2,930,400	
南陽	2,900	1,869.00	5,420,100	
ノジマ	24,800	2,676.00	66,364,800	
佐鳥電機	9,600	1,239.00	11,894,400	
カッパ・クリエイト	21,600	1,437.00	31,039,200	
エコートレーディング	3,000	537.00	1,611,000	
伯東	9,000	3,490.00	31,410,000	
コンドーテック	11,500	1,006.00	11,569,000	
中山福	8,100	309.00	2,502,900	
ライトオン	11,500	690.00	7,935,000	
ナガイレーベン	18,500	1,952.00	36,112,000	
三菱食品	14,700	3,285.00	48,289,500	
良品計画	176,700	1,300.00	229,710,000	

パリミキホールディングス	19,000	249.00	4,731,000	
松田産業	11,200	2,296.00	25,715,200	
第一興商	29,200	4,050.00	118,260,000	
メディパルホールディングス	142,000	1,887.00	267,954,000	
アドヴァングループ	13,000	854.00	11,102,000	
ＳＰＫ	6,000	1,385.00	8,310,000	
萩原電気ホールディングス	5,200	2,188.00	11,377,600	
アルビス	4,500	2,316.00	10,422,000	
アズワン	22,100	6,000.00	132,600,000	
スズデン	4,800	2,002.00	9,609,600	
尾家産業	3,200	846.00	2,707,200	
シモジマ	9,400	1,092.00	10,264,800	
ドウシシャ	14,400	1,488.00	21,427,200	
小津産業	3,400	1,737.00	5,905,800	
コナカ	16,600	345.00	5,727,000	
高速	8,100	1,515.00	12,271,500	
ハウス　オブ　ローゼ	1,900	1,618.00	3,074,200	
Ｇ－７ホールディングス	17,000	1,441.00	24,497,000	
たけびし	5,100	1,488.00	7,588,800	
イオン北海道	20,300	1,149.00	23,324,700	
コジマ	26,400	638.00	16,843,200	
ヒマラヤ	4,700	954.00	4,483,800	
コーナン商事	21,900	3,300.00	72,270,000	
ネットワンシステムズ	56,500	2,937.00	165,940,500	
エコス	5,000	1,825.00	9,125,000	
ワタミ	18,600	919.00	17,093,400	
マルシェ	5,000	453.00	2,265,000	
リックス	3,200	2,076.00	6,643,200	
システムソフト	45,100	105.00	4,735,500	
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	307,100	2,714.00	833,469,400	
丸文	12,200	833.00	10,162,600	
西松屋チェーン	30,300	1,518.00	45,995,400	
ゼンショーホールディングス	75,000	3,605.00	270,375,000	
ハピネット	11,700	1,585.00	18,544,500	
幸楽苑ホールディングス	9,000	1,058.00	9,522,000	
ハークスレイ	6,400	497.00	3,180,800	
橋本総業ホールディングス	2,800	1,997.00	5,591,600	
日本ライフライン	45,500	997.00	45,363,500	
サイゼリヤ	22,700	2,676.00	60,745,200	
タカショー	12,000	684.00	8,208,000	
ＶＴホールディングス	57,800	482.00	27,859,600	
アルゴグラフィックス	12,000	3,855.00	46,260,000	
魚力	4,300	2,179.00	9,369,700	
ＩＤＯＭ	46,600	877.00	40,868,200	
日本エム・ディ・エム	9,000	1,258.00	11,322,000	
ポプラ	3,500	148.00	518,000	
フジ・コーポレーション	8,100	1,235.00	10,003,500	
ユナイテッドアローズ	16,000	1,904.00	30,464,000	
進和	9,000	2,173.00	19,557,000	

エスケイジャパン	3,700	545.00	2,016,500	
ダイトロン	5,300	2,071.00	10,976,300	
ハイデイ日高	22,200	2,079.00	46,153,800	
シークス	19,500	1,122.00	21,879,000	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	9,000	206.00	1,854,000	
コロワイド	63,100	1,904.00	120,142,400	
ピーシーデポコーポレーション	17,800	267.00	4,752,600	
田中商事	3,700	567.00	2,097,900	
オーハシテクニカ	7,500	1,400.00	10,500,000	
壱番屋	10,800	4,480.00	48,384,000	
白銅	4,900	2,566.00	12,573,400	
トップカルチャー	4,900	210.00	1,029,000	
ＰＬＡＮＴ	3,600	650.00	2,340,000	
スギホールディングス	30,700	6,070.00	186,349,000	
ダイコー通産	1,600	1,111.00	1,777,600	
薬王堂ホールディングス	7,600	2,364.00	17,966,400	
島津製作所	186,400	3,910.00	728,824,000	
ＪＭＳ	12,000	550.00	6,600,000	
クボテック	3,400	240.00	816,000	
長野計器	10,400	1,049.00	10,909,600	
ブイ・テクノロジー	6,800	2,833.00	19,264,400	
スター精密	25,300	1,738.00	43,971,400	
東京計器	9,900	1,224.00	12,117,600	
愛知時計電機	5,600	1,411.00	7,901,600	
インターアクション	7,800	1,646.00	12,838,800	
オーバル	13,900	440.00	6,116,000	
東京精密	24,300	4,585.00	111,415,500	
マニー	56,900	1,811.00	103,045,900	
ニコン	219,800	1,461.00	321,127,800	
トプコン	73,300	1,811.00	132,746,300	
オリンパス	747,000	3,001.00	2,241,747,000	
理研計器	10,300	4,300.00	44,290,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	24,600	8,850.00	217,710,000	
キヤノン電子	14,300	1,608.00	22,994,400	
タムロン	9,700	3,030.00	29,391,000	
ＨＯＹＡ	301,000	14,650.00	4,409,650,000	
シード	7,300	540.00	3,942,000	
ノーリツ鋼機	12,300	2,551.00	31,377,300	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	17,600	898.00	15,804,800	
朝日インテック	171,000	2,409.00	411,939,000	
キヤノン	710,200	3,304.00	2,346,500,800	
リコー	370,900	1,139.00	422,455,100	
シチズン時計	142,200	610.00	86,742,000	
リズム	4,800	1,434.00	6,883,200	
大研医器	12,300	475.00	5,842,500	
メニコン	48,200	3,005.00	144,841,000	
シンシア	1,300	444.00	577,200	
中本パックス	4,400	1,565.00	6,886,000	
スノーピーク	22,200	2,213.00	49,128,600	

パラマウントベッドホールディングス	29,900	2,607.00	77,949,300	
トランザクション	9,900	1,066.00	10,553,400	
粧美堂	3,900	421.00	1,641,900	
ニホンフラッシュ	12,200	959.00	11,699,800	
前田工繊	14,000	3,275.00	45,850,000	
永大産業	16,900	246.00	4,157,400	
アートネイチャー	13,400	728.00	9,755,200	
バンダイナムコホールディングス	128,900	9,951.00	1,282,683,900	
アイフィスジャパン	4,000	597.00	2,388,000	
共立印刷	21,400	134.00	2,867,600	
ＳＨＯＥＩ	13,600	5,330.00	72,488,000	
フランスベッドホールディングス	20,000	896.00	17,920,000	
マーベラス	24,000	663.00	15,912,000	
パイロットコーポレーション	20,200	5,390.00	108,878,000	
萩原工業	8,700	1,052.00	9,152,400	
エイベックス	26,400	1,569.00	41,421,600	
フジシールインターナショナル	32,000	1,512.00	48,384,000	
タカラトミー	64,400	1,293.00	83,269,200	
広済堂ホールディングス	9,700	1,221.00	11,843,700	
エステールホールディングス	3,400	624.00	2,121,600	
レック	18,400	791.00	14,554,400	
タカノ	5,300	741.00	3,927,300	
三光合成	17,800	473.00	8,419,400	
プロネクサス	12,200	968.00	11,809,600	
ホクシン	10,800	145.00	1,566,000	
ウッドワン	4,700	1,142.00	5,367,400	
大建工業	7,900	1,916.00	15,136,400	
きもと	23,800	251.00	5,973,800	
凸版印刷	203,200	2,235.00	454,152,000	
大日本印刷	168,900	3,030.00	511,767,000	
共同印刷	4,100	2,481.00	10,172,100	
ＮＩＳＳＨＡ	24,600	1,824.00	44,870,400	
光村印刷	600	1,232.00	739,200	
藤森工業	12,200	3,380.00	41,236,000	
ヴィア・ホールディングス	20,000	139.00	2,780,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	9,000	2,079.00	18,711,000	
前澤化成工業	9,100	1,313.00	11,948,300	
未来工業	5,600	1,481.00	8,293,600	
アシックス	119,500	2,582.00	308,549,000	
ツツミ	3,900	1,984.00	7,737,600	
ウェーブロックホールディングス	5,800	613.00	3,555,400	
ＪＳＰ	9,100	1,439.00	13,094,900	
ニチハ	19,900	2,831.00	56,336,900	
ローランド	9,500	4,300.00	40,850,000	
エフピコ	28,600	3,330.00	95,238,000	
小松ウオール工業	4,700	1,902.00	8,939,400	
ヤマハ	90,600	5,150.00	466,590,000	
河合楽器製作所	4,000	2,771.00	11,084,000	
クリナップ	14,400	602.00	8,668,800	
ピジョン	82,500	2,106.00	173,745,000	

天馬	12,300	2,085.00	25,645,500	
兼松サステック	600	1,612.00	967,200	
キングジム	11,400	910.00	10,374,000	
象印マホービン	38,700	1,610.00	62,307,000	
リンテック	29,700	2,313.00	68,696,100	
信越ポリマー	28,000	1,261.00	35,308,000	
東リ	35,600	201.00	7,155,600	
イトーキ	26,500	420.00	11,130,000	
任天堂	88,000	61,090.00	5,375,920,000	
三菱鉛筆	18,700	1,415.00	26,460,500	
松風	5,100	2,212.00	11,281,200	
タカラスタンダード	25,000	1,318.00	32,950,000	
コクヨ	62,300	1,820.00	113,386,000	
ナカバヤシ	12,600	507.00	6,388,200	
ニフコ	52,000	3,035.00	157,820,000	
立川ブラインド工業	6,000	1,024.00	6,144,000	
グローブライド	11,600	2,499.00	28,988,400	
オカムラ	43,800	1,341.00	58,735,800	
バルカー	12,700	2,628.00	33,375,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,100	1,925.00	2,117,500	
伊藤忠商事	920,700	3,773.00	3,473,801,100	
丸紅	1,330,300	1,389.50	1,848,451,850	
スクロール	23,600	738.00	17,416,800	
高島	2,100	2,581.00	5,420,100	
ヨンドシーホールディングス	13,000	1,782.00	23,166,000	
三陽商会	6,700	969.00	6,492,300	
長瀬産業	70,200	2,008.00	140,961,600	
ナイガイ	4,300	262.00	1,126,600	
蝶理	8,600	2,038.00	17,526,800	
豊田通商	137,100	4,905.00	672,475,500	
オンワードホールディングス	84,200	294.00	24,754,800	
三共生興	19,700	466.00	9,180,200	
兼松	53,200	1,491.00	79,321,200	
美津濃	13,000	2,704.00	35,152,000	
ツカモトコーポレーション	1,900	1,060.00	2,014,000	
ルックホールディングス	4,200	2,199.00	9,235,800	
三井物産	1,113,100	3,281.00	3,652,081,100	
日本紙パルプ商事	7,300	4,450.00	32,485,000	
東京エレクトロン	99,000	40,910.00	4,050,090,000	
カメイ	16,300	1,107.00	18,044,100	
東都水産	600	4,960.00	2,976,000	
ＯＵＧホールディングス	2,100	2,846.00	5,976,600	
スターゼン	10,400	2,029.00	21,101,600	
セイコーホールディングス	22,100	2,925.00	64,642,500	
山善	55,300	920.00	50,876,000	
椿本興業	2,600	3,720.00	9,672,000	
住友商事	908,600	1,952.00	1,773,587,200	
ＢＩＰＲＯＧＹ	47,800	3,250.00	155,350,000	
内田洋行	6,000	4,335.00	26,010,000	
三菱商事	1,006,900	4,338.00	4,367,932,200	

第一実業	5,800	3,840.00	22,272,000	
キヤノンマーケティングジャパン	31,800	3,175.00	100,965,000	
西華産業	6,600	1,621.00	10,698,600	
佐藤商事	10,600	1,148.00	12,168,800	
菱洋エレクトロ	9,000	2,233.00	20,097,000	
東京産業	12,500	767.00	9,587,500	
ユアサ商事	12,300	3,580.00	44,034,000	
神鋼商事	3,500	4,085.00	14,297,500	
トルク	6,000	224.00	1,344,000	
阪和興業	26,600	3,635.00	96,691,000	
正栄食品工業	9,100	4,265.00	38,811,500	
カナデン	12,500	1,060.00	13,250,000	
菱電商事	12,200	1,605.00	19,581,000	
ニプロ	107,900	1,105.00	119,229,500	
岩谷産業	34,000	5,440.00	184,960,000	
ナイス	4,700	1,541.00	7,242,700	
ニチモウ	1,900	2,573.00	4,888,700	
極東貿易	8,800	1,331.00	11,712,800	
アステナホールディングス	20,000	438.00	8,760,000	
兼松エレクトロニクス	8,300	4,045.00	33,573,500	
三愛オブリ	34,300	1,119.00	38,381,700	
稲畑産業	30,800	2,475.00	76,230,000	
ＧＳＩクレオス	7,400	1,490.00	11,026,000	
明和産業	14,100	784.00	11,054,400	
クワザワホールディングス	5,400	425.00	2,295,000	
キムラタン	85,000	21.00	1,785,000	
ゴールドウイン	25,300	8,010.00	202,653,000	
ユニ・チャーム	270,500	4,744.00	1,283,252,000	
デサント	26,100	3,530.00	92,133,000	
キング	7,200	411.00	2,959,200	
ワキタ	27,700	1,105.00	30,608,500	
ヤマトインターナショナル	11,400	263.00	2,998,200	
東邦ホールディングス	41,700	1,872.00	78,062,400	
サンゲツ	37,200	1,625.00	60,450,000	
ミツウロコグループホールディングス	17,600	997.00	17,547,200	
シナネンホールディングス	5,000	3,720.00	18,600,000	
伊藤忠エネクス	34,000	1,061.00	36,074,000	
サンリオ	43,100	3,635.00	156,668,500	
サンワ　テクノス	7,700	1,342.00	10,333,400	
リョーサン	15,700	2,301.00	36,125,700	
新光商事	20,200	965.00	19,493,000	
トーホー	5,800	1,560.00	9,048,000	
三信電気	6,300	1,741.00	10,968,300	
東陽テクニカ	15,200	1,302.00	19,790,400	
モスフードサービス	20,100	3,135.00	63,013,500	
加賀電子	12,500	4,160.00	52,000,000	
三益半導体工業	12,100	2,024.00	24,490,400	
都築電気	6,800	1,302.00	8,853,600	
ソーダニッカ	12,200	602.00	7,344,400	
立花エレテック	10,000	1,601.00	16,010,000	

木曽路	20,700	2,160.00	44,712,000	
ＳＲＳホールディングス	22,400	878.00	19,667,200	
千趣会	25,200	389.00	9,802,800	
タカキュー	10,600	82.00	869,200	
リテールパートナーズ	20,300	1,084.00	22,005,200	
ケーヨー	28,400	883.00	25,077,200	
上新電機	14,900	1,916.00	28,548,400	
日本瓦斯	73,400	2,256.00	165,590,400	
ロイヤルホールディングス	26,100	2,164.00	56,480,400	
東天紅	600	830.00	498,000	
いなげや	15,200	1,196.00	18,179,200	
チヨダ	13,100	782.00	10,244,200	
ライフコーポレーション	12,000	2,674.00	32,088,000	
リンガーハット	17,600	2,190.00	38,544,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	19,200	622.00	11,942,400	
テンアライド	15,200	288.00	4,377,600	
ＡＯＫＩホールディングス	29,700	711.00	21,116,700	
オークワ	21,900	936.00	20,498,400	
コメリ	23,700	2,609.00	61,833,300	
青山商事	29,300	953.00	27,922,900	
しまむら	17,800	12,550.00	223,390,000	
はせがわ	7,900	369.00	2,915,100	
高島屋	103,300	1,679.00	173,440,700	
松屋	25,800	1,043.00	26,909,400	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	66,700	1,128.00	75,237,600	
近鉄百貨店	4,400	2,382.00	10,480,800	
丸井グループ	111,100	2,476.00	275,083,600	
クレディセゾン	89,700	1,763.00	158,141,100	
アクシアル　リテイリング	10,200	3,345.00	34,119,000	
井筒屋	7,200	376.00	2,707,200	
イオン	506,500	2,687.50	1,361,218,750	
イズミ	24,300	3,045.00	73,993,500	
フォーバル	5,300	984.00	5,215,200	
平和堂	22,900	2,019.00	46,235,100	
フジ	33,600	1,869.00	62,798,400	
ヤオコー	17,500	6,540.00	114,450,000	
ゼビオホールディングス	20,900	992.00	20,732,800	
ケーズホールディングス	130,700	1,220.00	159,454,000	
ＰＡＬＴＡＣ	21,600	4,175.00	90,180,000	
三谷産業	23,800	303.00	7,211,400	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6,700	578.00	3,872,600	
日産東京販売ホールディングス	22,600	282.00	6,373,200	
新生銀行	100,300	1,983.00	198,894,900	
あおぞら銀行	85,900	2,741.00	235,451,900	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,001,200	731.30	6,582,577,560	
りそなホールディングス	1,627,200	551.40	897,238,080	
三井住友トラスト・ホールディングス	254,300	4,343.00	1,104,424,900	
三井住友フィナンシャルグループ	997,900	4,350.00	4,340,865,000	
千葉銀行	434,200	786.00	341,281,200	
群馬銀行	247,400	404.00	99,949,600	

武蔵野銀行	19,700	1,720.00	33,884,000	
千葉興業銀行	33,100	275.00	9,102,500	
筑波銀行	59,900	190.00	11,381,000	
七十七銀行	40,900	1,852.00	75,746,800	
秋田銀行	9,200	1,659.00	15,262,800	
山形銀行	14,100	968.00	13,648,800	
岩手銀行	9,400	1,851.00	17,399,400	
東邦銀行	110,000	208.00	22,880,000	
東北銀行	6,900	971.00	6,699,900	
ふくおかフィナンシャルグループ	111,000	2,650.00	294,150,000	
静岡銀行	316,900	852.00	269,998,800	
スルガ銀行	134,900	387.00	52,206,300	
八十二銀行	285,400	496.00	141,558,400	
山梨中央銀行	15,400	1,150.00	17,710,000	
大垣共立銀行	26,300	1,744.00	45,867,200	
福井銀行	12,300	1,410.00	17,343,000	
清水銀行	5,500	1,447.00	7,958,500	
富山銀行	2,300	1,712.00	3,937,600	
滋賀銀行	25,000	2,619.00	65,475,000	
南都銀行	20,800	1,980.00	41,184,000	
百五銀行	129,200	322.00	41,602,400	
京都銀行	47,700	5,470.00	260,919,000	
紀陽銀行	45,600	1,501.00	68,445,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	87,200	857.00	74,730,400	
山陰合同銀行	85,500	706.00	60,363,000	
中国銀行	108,200	951.00	102,898,200	
鳥取銀行	4,900	1,118.00	5,478,200	
伊予銀行	172,400	711.00	122,576,400	
百十四銀行	14,100	1,657.00	23,363,700	
四国銀行	20,300	848.00	17,214,400	
阿波銀行	20,400	1,884.00	38,433,600	
大分銀行	8,200	1,878.00	15,399,600	
宮崎銀行	8,300	2,206.00	18,309,800	
佐賀銀行	8,100	1,538.00	12,457,800	
琉球銀行	33,300	781.00	26,007,300	
セブン銀行	456,800	265.00	121,052,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,843,800	1,665.00	3,069,927,000	
高知銀行	4,800	653.00	3,134,400	
山口フィナンシャルグループ	153,600	795.00	122,112,000	
芙蓉総合リース	13,200	8,240.00	108,768,000	
みずほリース	19,000	3,275.00	62,225,000	
東京センチュリー	23,800	4,930.00	117,334,000	
ＳＢＩホールディングス	189,900	2,699.00	512,540,100	
日本証券金融	60,400	821.00	49,588,400	
アイフル	258,100	390.00	100,659,000	
日本アジア投資	12,200	229.00	2,793,800	
長野銀行	4,700	1,213.00	5,701,100	
名古屋銀行	9,400	3,105.00	29,187,000	
北洋銀行	193,200	231.00	44,629,200	
愛知銀行	4,700	5,790.00	27,213,000	

中京銀行	4,700	1,901.00	8,934,700	
大光銀行	4,500	1,317.00	5,926,500	
愛媛銀行	20,000	877.00	17,540,000	
トマト銀行	4,600	1,022.00	4,701,200	
京葉銀行	64,200	500.00	32,100,000	
栃木銀行	68,900	275.00	18,947,500	
北日本銀行	4,500	1,720.00	7,740,000	
東和銀行	25,200	520.00	13,104,000	
福島銀行	16,200	211.00	3,418,200	
大東銀行	6,700	626.00	4,194,200	
リコーリース	13,600	3,600.00	48,960,000	
イオンフィナンシャルサービス	83,700	1,490.00	124,713,000	
アコム	303,400	326.00	98,908,400	
ジャックス	15,200	3,770.00	57,304,000	
オリエントコーポレーション	416,000	119.00	49,504,000	
オリックス	913,700	2,276.00	2,079,581,200	
三菱ＨＣキャピタル	497,000	686.00	340,942,000	
ジャフコ　グループ	53,200	2,207.00	117,412,400	
九州リースサービス	6,600	600.00	3,960,000	
トモニホールディングス	111,000	315.00	34,965,000	
大和証券グループ本社	987,500	615.50	607,806,250	
野村ホールディングス	2,348,000	504.70	1,185,035,600	
岡三証券グループ	110,900	332.00	36,818,800	
丸三証券	45,700	461.00	21,067,700	
東洋証券	46,600	261.00	12,162,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	151,400	373.00	56,472,200	
光世証券	3,000	422.00	1,266,000	
水戸証券	37,700	256.00	9,651,200	
いちよし証券	25,400	643.00	16,332,200	
松井証券	75,300	799.00	60,164,700	
ＳＯＭＰＯホールディングス	218,800	6,089.00	1,332,273,200	
日本取引所グループ	358,200	2,020.50	723,743,100	
マネックスグループ	129,500	476.00	61,642,000	
極東証券	17,500	686.00	12,005,000	
岩井コスモホールディングス	14,400	1,234.00	17,769,600	
アイザワ証券グループ	20,800	646.00	13,436,800	
フィデアホールディングス	14,000	1,318.00	18,452,000	
池田泉州ホールディングス	163,200	217.00	35,414,400	
アニコム　ホールディングス	47,300	623.00	29,467,900	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	316,100	4,179.00	1,320,981,900	
マネーパートナーズグループ	16,300	274.00	4,466,200	
スパークス・グループ	71,000	302.00	21,442,000	
小林洋行	3,200	216.00	691,200	
第一生命ホールディングス	748,900	2,433.50	1,822,448,150	
東京海上ホールディングス	427,900	7,851.00	3,359,442,900	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,400	468.00	3,463,200	
イー・ギャランティ	22,800	2,354.00	53,671,200	
アサックス	8,000	585.00	4,680,000	

ＮＥＣキャピタルソリューション	6,200	2,097.00	13,001,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	342,100	1,523.00	521,018,300	
アドバンスクリエイト	7,400	1,090.00	8,066,000	
三井不動産	600,100	2,981.00	1,788,898,100	
三菱地所	875,700	1,974.50	1,729,069,650	
平和不動産	24,400	4,050.00	98,820,000	
東京建物	121,600	2,176.00	264,601,600	
京阪神ビルディング	20,100	1,289.00	25,908,900	
住友不動産	276,600	3,579.00	989,951,400	
太平洋興発	5,600	677.00	3,791,200	
テーオーシー	23,000	738.00	16,974,000	
東京楽天地	2,200	4,045.00	8,899,000	
レオパレス２１	159,400	345.00	54,993,000	
スターツコーポレーション	20,900	2,750.00	57,475,000	
フジ住宅	17,800	647.00	11,516,600	
空港施設	15,300	550.00	8,415,000	
明和地所	7,200	615.00	4,428,000	
ゴールドクレスト	12,200	1,804.00	22,008,800	
リログループ	81,500	2,268.00	184,842,000	
エスリード	5,900	1,739.00	10,260,100	
日神グループホールディングス	25,000	438.00	10,950,000	
日本エスコン	28,600	810.00	23,166,000	
タカラレーベン	64,500	390.00	25,155,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	7,200	802.00	5,774,400	
イオンモール	77,200	1,690.00	130,468,000	
毎日コムネット	5,200	626.00	3,255,200	
ファースト住建	5,700	1,098.00	6,258,600	
ランド	837,100	10.00	8,371,000	
カチタス	38,100	3,490.00	132,969,000	
東祥	11,200	1,259.00	14,100,800	
トーセイ	21,300	1,444.00	30,757,200	
穴吹興産	3,400	2,045.00	6,953,000	
サンフロンティア不動産	21,300	1,191.00	25,368,300	
ＦＪネクストホールディングス	15,100	1,036.00	15,643,600	
インテリックス	3,500	557.00	1,949,500	
ランドビジネス	5,100	231.00	1,178,100	
サンネクスタグループ	4,600	929.00	4,273,400	
グランディハウス	10,500	551.00	5,785,500	
東武鉄道	142,100	3,430.00	487,403,000	
相鉄ホールディングス	46,300	2,425.00	112,277,500	
東急	362,900	1,725.00	626,002,500	
京浜急行電鉄	173,500	1,497.00	259,729,500	
小田急電鉄	196,100	1,916.00	375,727,600	
京王電鉄	68,400	5,520.00	377,568,000	
京成電鉄	94,700	4,075.00	385,902,500	
富士急行	16,000	4,520.00	72,320,000	
東日本旅客鉄道	237,800	7,683.00	1,827,017,400	
西日本旅客鉄道	165,400	5,725.00	946,915,000	
東海旅客鉄道	109,700	16,970.00	1,861,609,000	
西武ホールディングス	187,900	1,547.00	290,681,300	

鴻池運輸	22,100	1,427.00	31,536,700	
西日本鉄道	37,500	2,984.00	111,900,000	
ハマキョウレックス	10,100	3,225.00	32,572,500	
サカイ引越センター	7,200	4,955.00	35,676,000	
近鉄グループホールディングス	138,400	4,905.00	678,852,000	
阪急阪神ホールディングス	172,300	4,380.00	754,674,000	
南海電気鉄道	61,700	2,904.00	179,176,800	
京阪ホールディングス	57,600	3,690.00	212,544,000	
神戸電鉄	3,600	3,385.00	12,186,000	
名古屋鉄道	142,800	2,273.00	324,584,400	
山陽電気鉄道	10,600	2,172.00	23,023,200	
アルプス物流	10,300	1,122.00	11,556,600	
トランコム	4,200	8,220.00	34,524,000	
ヤマトホールディングス	202,300	2,156.00	436,158,800	
山九	35,900	4,255.00	152,754,500	
日新	10,800	1,885.00	20,358,000	
丸運	7,000	221.00	1,547,000	
丸全昭和運輸	10,000	3,150.00	31,500,000	
センコーグループホールディングス	68,400	989.00	67,647,600	
トナミホールディングス	2,800	3,650.00	10,220,000	
ニッコンホールディングス	44,500	2,417.00	107,556,500	
日本石油輸送	900	2,391.00	2,151,900	
福山通運	18,900	3,330.00	62,937,000	
セイノーホールディングス	80,400	1,172.00	94,228,800	
エスライン	4,100	798.00	3,271,800	
神奈川中央交通	3,700	3,455.00	12,783,500	
日立物流	28,600	8,790.00	251,394,000	
丸和運輸機関	24,900	1,562.00	38,893,800	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	12,500	1,150.00	14,375,000	
日本郵船	123,400	9,790.00	1,208,086,000	
商船三井	227,700	3,315.00	754,825,500	
川崎汽船	45,500	7,630.00	347,165,000	
ＮＳユナイテッド海運	6,900	4,365.00	30,118,500	
明治海運	13,900	738.00	10,258,200	
飯野海運	58,000	729.00	42,282,000	
共栄タンカー	2,700	876.00	2,365,200	
九州旅客鉄道	99,000	3,140.00	310,860,000	
ＳＧホールディングス	248,000	2,136.00	529,728,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	48,200	7,240.00	348,968,000	
日本航空	317,400	2,677.00	849,679,800	
ＡＮＡホールディングス	351,600	2,782.00	978,151,200	
ビーウィズ	4,000	1,348.00	5,392,000	
パスコ	2,800	1,295.00	3,626,000	
ＴＲＥホールディングス	28,000	1,716.00	48,048,000	
人・夢・技術グループ	5,800	2,518.00	14,604,400	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,600	3,690.00	13,284,000	
シルバーライフ	3,200	1,199.00	3,836,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,520.00	1,976,000	

Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,700	3,645.00	24,421,500	
コーア商事ホールディングス	9,600	633.00	6,076,800	
国際紙パルプ商事	28,400	675.00	19,170,000	
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	861.00	3,099,600	
ブックオフグループホールディングス	9,000	1,032.00	9,288,000	
ギフトホールディングス	2,300	3,940.00	9,062,000	
三菱倉庫	35,700	3,565.00	127,270,500	
三井倉庫ホールディングス	14,400	3,340.00	48,096,000	
住友倉庫	43,400	2,144.00	93,049,600	
澁澤倉庫	7,400	2,064.00	15,273,600	
ヤマタネ	6,600	1,601.00	10,566,600	
東陽倉庫	20,900	272.00	5,684,800	
乾汽船	8,900	1,760.00	15,664,000	
日本トランスシティ	26,000	503.00	13,078,000	
ケイヒン	2,600	1,404.00	3,650,400	
中央倉庫	7,600	941.00	7,151,600	
川西倉庫	2,800	1,034.00	2,895,200	
安田倉庫	9,900	920.00	9,108,000	
ファイズホールディングス	3,200	949.00	3,036,800	
東洋埠頭	4,200	1,219.00	5,119,800	
上組	70,100	2,776.00	194,597,600	
サンリツ	3,800	674.00	2,561,200	
キムラユニティー	7,600	811.00	6,163,600	
キユーソー流通システム	7,400	1,345.00	9,953,000	
東海運	8,400	270.00	2,268,000	
エーアイテイー	9,200	1,526.00	14,039,200	
内外トランスライン	4,600	2,237.00	10,290,200	
ショーエイコーポレーション	4,300	578.00	2,485,400	
日本コンセプト	4,100	1,765.00	7,236,500	
ＴＢＳホールディングス	74,800	1,614.00	120,727,200	
日本テレビホールディングス	127,700	1,174.00	149,919,800	
朝日放送グループホールディングス	12,200	639.00	7,795,800	
テレビ朝日ホールディングス	36,800	1,431.00	52,660,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	129,600	539.00	69,854,400	
テレビ東京ホールディングス	9,400	1,946.00	18,292,400	
日本ＢＳ放送	5,100	934.00	4,763,400	
ビジョン	17,000	1,460.00	24,820,000	
スマートバリュー	3,600	462.00	1,663,200	
ＵＳＥＮ−ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	11,600	2,029.00	23,536,400	
ワイヤレスゲート	6,200	288.00	1,785,600	
コネクシオ	10,800	1,252.00	13,521,600	
日本通信	127,200	222.00	28,238,400	
クロップス	2,800	904.00	2,531,200	
日本電信電話	1,714,800	3,845.00	6,593,406,000	
ＫＤＤＩ	1,115,300	4,296.00	4,791,328,800	
ソフトバンク	2,317,300	1,492.00	3,457,411,600	
光通信	17,600	17,880.00	314,688,000	
エムティーアイ	11,900	495.00	5,890,500	
GMOインターネットグループ	48,200	2,681.00	129,224,200	

ファイバーゲート	6,900	961.00	6,630,900	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,300	290.00	957,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	82,400	2,698.00	222,315,200	
学研ホールディングス	21,600	964.00	20,822,400	
ゼンリン	24,900	918.00	22,858,200	
昭文社ホールディングス	6,100	304.00	1,854,400	
インプレスホールディングス	12,700	208.00	2,641,600	
東京電力ホールディングス	1,166,900	484.00	564,779,600	
中部電力	440,400	1,402.00	617,440,800	
関西電力	545,300	1,315.00	717,069,500	
中国電力	224,900	772.00	173,622,800	
北陸電力	132,300	493.00	65,223,900	
東北電力	340,900	696.00	237,266,400	
四国電力	129,600	783.00	101,476,800	
九州電力	298,400	803.00	239,615,200	
北海道電力	135,500	508.00	68,834,000	
沖縄電力	33,100	1,097.00	36,310,700	
電源開発	115,200	2,127.00	245,030,400	
エフオン	9,400	668.00	6,279,200	
イーレックス	20,100	2,879.00	57,867,900	
レノバ	30,600	3,665.00	112,149,000	
東京瓦斯	277,500	2,585.00	717,337,500	
大阪瓦斯	262,200	2,294.00	601,486,800	
東邦瓦斯	61,100	2,988.00	182,566,800	
北海道瓦斯	7,700	1,652.00	12,720,400	
広島ガス	27,200	326.00	8,867,200	
西部ガスホールディングス	14,800	1,786.00	26,432,800	
静岡ガス	29,500	1,038.00	30,621,000	
メタウォーター	16,100	1,990.00	32,039,000	
アイネット	7,100	1,298.00	9,215,800	
松竹	8,800	12,010.00	105,688,000	
東宝	90,300	5,170.00	466,851,000	
エイチ・アイ・エス	34,800	2,397.00	83,415,600	
東映	4,400	17,610.00	77,484,000	
ラックランド	4,200	2,809.00	11,797,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	407,400	1,936.00	788,726,400	
共立メンテナンス	26,600	6,140.00	163,324,000	
イチネンホールディングス	15,200	1,259.00	19,136,800	
建設技術研究所	6,800	2,956.00	20,100,800	
スペース	9,700	864.00	8,380,800	
アインホールディングス	18,900	6,410.00	121,149,000	
燦ホールディングス	6,500	1,806.00	11,739,000	
ピー・シー・エー	9,000	1,081.00	9,729,000	
スバル興業	600	9,000.00	5,400,000	
東京テアトル	5,400	1,210.00	6,534,000	
タナベ経営	4,800	650.00	3,120,000	
ビジネスブレイン太田昭和	5,000	1,474.00	7,370,000	
ナガワ	4,200	7,480.00	31,416,000	
東京都競馬	11,200	4,190.00	46,928,000	

常磐興産	5,000	1,257.00	6,285,000	
カナモト	24,400	2,055.00	50,142,000	
ＤＴＳ	28,600	3,555.00	101,673,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	71,200	6,190.00	440,728,000	
シーイーシー	16,400	1,442.00	23,648,800	
カプコン	141,900	3,665.00	520,063,500	
西尾レントオール	12,400	2,895.00	35,898,000	
アイ・エス・ビー	6,600	1,251.00	8,256,600	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	81,800	24.00	1,963,200	
日本空港ビルデング	49,700	6,130.00	304,661,000	
トランス・コスモス	18,900	3,730.00	70,497,000	
乃村工藝社	63,800	947.00	60,418,600	
ジャステック	8,000	1,222.00	9,776,000	
ＳＣＳＫ	105,900	2,246.00	237,851,400	
藤田観光	5,800	2,948.00	17,098,400	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	9,200	2,006.00	18,455,200	
日本管財	16,000	2,606.00	41,696,000	
トーカイ	11,800	1,834.00	21,641,200	
白洋舎	1,400	1,430.00	2,002,000	
セコム	146,800	8,441.00	1,239,138,800	
ＮＳＷ	5,800	2,221.00	12,881,800	
セントラル警備保障	7,200	2,337.00	16,826,400	
アイネス	13,200	1,506.00	19,879,200	
丹青社	28,100	793.00	22,283,300	
メイテック	52,600	2,331.00	122,610,600	
ＴＫＣ	23,200	3,460.00	80,272,000	
富士ソフト	14,600	8,120.00	118,552,000	
応用地質	13,000	1,844.00	23,972,000	
船井総研ホールディングス	27,900	2,417.00	67,434,300	
ＮＳＤ	48,000	2,502.00	120,096,000	
進学会ホールディングス	4,800	314.00	1,507,200	
丸紅建材リース	900	1,812.00	1,630,800	
オオバ	9,300	702.00	6,528,600	
コナミグループ	55,600	6,930.00	385,308,000	
いであ	3,300	1,672.00	5,517,600	
学究社	4,700	1,640.00	7,708,000	
ベネッセホールディングス	49,700	2,167.00	107,699,900	
イオンディライト	17,200	2,833.00	48,727,600	
ナック	7,000	931.00	6,517,000	
福井コンピュータホールディングス	7,000	3,500.00	24,500,000	
ダイセキ	27,100	4,410.00	119,511,000	
ステップ	5,400	1,795.00	9,693,000	
日鉄物産	9,400	5,340.00	50,196,000	
泉州電業	3,500	5,630.00	19,705,000	
元気寿司	4,400	2,990.00	13,156,000	
トラスコ中山	28,700	1,961.00	56,280,700	
ヤマダホールディングス	543,200	481.00	261,279,200	
オートバックスセブン	47,700	1,422.00	67,829,400	

モリト	10,100	714.00	7,211,400	
アークランズ	24,000	1,470.00	35,280,000	
ニトリホールディングス	60,900	12,955.00	788,959,500	
グルメ杵屋	12,200	1,014.00	12,370,800	
愛眼	8,100	178.00	1,441,800	
ケーユーホールディングス	8,000	1,154.00	9,232,000	
吉野家ホールディングス	53,600	2,319.00	124,298,400	
加藤産業	16,600	3,395.00	56,357,000	
北恵	3,500	731.00	2,558,500	
イノテック	9,300	1,338.00	12,443,400	
イエローハット	24,100	1,819.00	43,837,900	
松屋フーズホールディングス	7,400	3,810.00	28,194,000	
ＪＢＣＣホールディングス	10,400	1,819.00	18,917,600	
ＪＫホールディングス	10,800	1,020.00	11,016,000	
サガミホールディングス	22,100	1,230.00	27,183,000	
日伝	10,500	1,771.00	18,595,500	
関西フードマーケット	12,400	1,136.00	14,086,400	
ミロク情報サービス	13,500	1,522.00	20,547,000	
北沢産業	7,600	215.00	1,634,000	
杉本商事	7,200	1,850.00	13,320,000	
因幡電機産業	38,200	2,704.00	103,292,800	
王将フードサービス	10,200	6,470.00	65,994,000	
プレナス	17,200	1,910.00	32,852,000	
ミニストップ	11,400	1,421.00	16,199,400	
アークス	27,200	2,032.00	55,270,400	
バローホールディングス	31,400	1,803.00	56,614,200	
東テク	4,500	3,360.00	15,120,000	
ミスミグループ本社	192,900	3,290.00	634,641,000	
アルテック	8,400	322.00	2,704,800	
ベルク	6,800	5,430.00	36,924,000	
大　庄	8,200	1,141.00	9,356,200	
タキヒヨー	4,200	810.00	3,402,000	
ファーストリテイリング	20,600	81,370.00	1,676,222,000	
ソフトバンクグループ	917,400	5,458.00	5,007,169,200	
蔵王産業	2,200	1,799.00	3,957,800	
スズケン	55,100	3,350.00	184,585,000	
サンドラッグ	57,800	3,560.00	205,768,000	
サックスバー　ホールディングス	14,400	705.00	10,152,000	
ジェコス	10,600	803.00	8,511,800	
ヤマザワ	3,000	1,257.00	3,771,000	
やまや	3,200	2,592.00	8,294,400	
グローセル	16,600	413.00	6,855,800	
ベルーナ	32,900	716.00	23,556,400	
合計	159,903,300		386,534,545,070	

（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9月16日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,994,225,846
コール・ローン	2,171,880,002
株式	750,270,963,911
投資信託受益証券	1,310,632,490
投資証券	17,526,695,767
派生商品評価勘定	551,292
未収入金	49,162,801
未収配当金	1,417,952,568
差入委託証拠金	5,337,547,086
流動資産合計	780,079,611,763
資産合計	780,079,611,763
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	325,387,586
未払解約金	197,533,000
流動負債合計	522,920,586
負債合計	522,920,586
純資産の部	
元本等	
元本	126,499,195,964
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	653,057,495,213
元本等合計	779,556,691,177
純資産合計	779,556,691,177
負債純資産合計	780,079,611,763

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9月16日 至　2022年9月16日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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9月16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	117,772,327,909円
同期中追加設定元本額	89,927,581,447円
同期中一部解約元本額	81,200,713,392円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,381,824,343円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	4,013,847円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	14,934,293円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	62,308,984円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	21,763,404円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	11,488,467円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	19,358,496円
たわらノーロード　先進国株式	36,619,880,427円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	431,692,295円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,693,968,172円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	713,141,118円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	76,646,674円
たわらノーロード　バランス（標準型）	639,167,717円
たわらノーロード　バランス（積極型）	811,343,414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）	456,933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）	138,709,542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）	413,797,919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）	333,202,392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）	499,224,703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）	1,180,284円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	24,784,587円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,785,895円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,765,292円
たわらノーロード　全世界株式	408,690,558円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	54,120,800,979円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	2,555,953,285円
Ｏｎｅグローバルバランス	1,775,859円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	149,946,759円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	776,878,131円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,008,488,915円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	90,850,329円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	250,018,488円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	243,167,364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＞	617,942,926円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	123,721,570円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	164,962,425円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	190,050,304円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	309,753,705円
投資のソムリエ	4,839,890,597円
クルーズコントロール	152,934,069円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	317,448,124円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	190,353,659円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	199,272,081円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	203,512,293円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	969,338,158円
ワールドアセットバランス（基本コース）	154,815,210円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	135,960,336円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	15,461,260円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	7,781,346円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,351,797円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	38,582,357円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	124,815,038円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	110,355,678円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	139,772,197円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	18,311,563円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	8,047,021円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	5,106,308円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	77,132,491円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	964,702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）	76,865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）	57,046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）	42,234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）	50,879円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	126,341円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	1,447,832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）	101,992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）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	2,027,331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）	445,001,824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）	40,569,742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）	1,171,916,262円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	201,507,928円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,082,874,331円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	120,705,282円
ＡＭＯｎｅ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）（適格機関投資家限定）	1,102,339円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,344,385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）	191,354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）	3,033,196円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	2,413,213円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,909,110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）	52,161,436円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,040,109円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,021,931円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,345,988円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	234,920円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,707,821円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,581,382円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	172,155,872円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	268,484,252円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	895,520,710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）	45,422,514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）	40,046,656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）	274,550,315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）	11,472,477円

ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	976,291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）	108,795,104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）	9,342,929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）	33,334,116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）	49,326,716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）	112,925,049円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	2,468,146円
コア資産形成ファンド	1,617,716円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,508,746,882円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	141,211,797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）	11,796,201円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	333,355,393円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,597,745,830円
計	126,499,195,964円
２．　受益権の総数	126,499,195,964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9月16日 至　2022年9月16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9月16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9月16日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△83,639,981,650
投資信託受益証券	△145,283,949
投資証券	△2,033,327,236
合計	△85,818,592,835

（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9月16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9月16日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,957,185,872	－	1,954,842,201	△2,343,671
アメリカ・ドル	1,604,552,000	－	1,602,214,160	△2,337,840
カナダ・ドル	68,533,290	－	68,101,362	△431,928
ユーロ	284,100,582	－	284,526,679	426,097
合計	1,957,185,872	－	1,954,842,201	△2,343,671

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年9月16日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	10,705,241,143	－	10,382,748,520	△322,492,623
合計	10,705,241,143	－	10,382,748,520	△322,492,623

（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9月16日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	6.1625円 (61,625円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年9月16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	1,050,271	126.280	132,628,221.880	
	ABBOTT LABORATORIES	199,092	105.060	20,916,605.520	
	AES CORP	79,505	26.690	2,121,988.450	
	ABIOMED INC	5,283	263.720	1,393,232.760	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	103,277	125.490	12,960,230.730	
	ADVANCED MICRO DEVICES	185,626	76.660	14,230,089.160	
	ADOBE INC	54,397	309.130	16,815,744.610	
	CHUBB LTD	48,192	192.160	9,260,574.720	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	25,641	248.470	6,371,019.270	
	ALLEGHANY CORP	1,594	842.500	1,342,945.000	
	ALLSTATE CORP	31,078	129.020	4,009,683.560	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	77,733	176.860	13,747,858.380	

AMGEN INC	61,279	227.660	13,950,777.140	
HESS CORP	31,366	124.950	3,919,181.700	
AMERICAN EXPRESS CO	72,215	156.130	11,274,927.950	
AMERICAN ELECTRIC POWER	59,622	100.190	5,973,528.180	
AFLAC INC	68,561	59.560	4,083,493.160	
AMERICAN INTL GROUP	91,731	54.180	4,969,985.580	
AMERCO	980	523.320	512,853.600	
ANALOG DEVICES	60,071	147.870	8,882,698.770	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	79,236	55.890	4,428,500.040	
VALERO ENERGY CORP	46,059	105.160	4,843,564.440	
ANSYS INC	9,857	241.450	2,379,972.650	
APPLE INC	1,855,642	152.370	282,744,171.540	
APPLIED MATERIALS INC	98,906	88.920	8,794,721.520	
ALBEMARLE CORP	13,133	286.750	3,765,887.750	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	63,215	85.260	5,389,710.900	
AMEREN CORP	28,729	91.180	2,619,510.220	
ARROW ELECTRONICS INC	6,673	99.810	666,032.130	
AUTODESK INC	24,822	201.300	4,996,668.600	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	48,278	230.710	11,138,217.380	
AUTOZONE INC	2,306	2,144.940	4,946,231.640	
AVERY DENNISON CORP	9,514	179.360	1,706,431.040	
BALL CORP	36,411	57.660	2,099,458.260	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	147,275	276.700	40,750,992.500	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	90,312	44.440	4,013,465.280	
BAXTER INTERNATIONAL INC	58,170	58.970	3,430,284.900	
BECTON DICKINSON & CO	32,817	256.700	8,424,123.900	
AMETEK INC	27,388	121.440	3,325,998.720	
VERIZON COMM INC	482,392	41.030	19,792,543.760	
WR BERKLEY CORP	24,066	67.750	1,630,471.500	
BEST BUY CO INC	24,645	72.420	1,784,790.900	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	472.750	1,162,492.250	
YUM! BRANDS INC	32,015	115.160	3,686,847.400	
FIRSTENERGY CORP	61,472	40.420	2,484,698.240	
BOEING CO	64,968	149.780	9,730,907.040	
ROBERT HALF INTL INC	11,897	78.300	931,535.100	
BORGWARNER INC	27,800	37.080	1,030,824.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	165,305	42.200	6,975,871.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	107.730	1,561,438.620	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	17,656	128.430	2,267,560.080	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,582	1,243.790	3,211,465.780	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	246,659	71.780	17,705,183.020	
ONEOK INC	51,956	62.460	3,245,171.760	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	130.930	1,033,168.630	
UNITED RENTALS INC	8,287	288.710	2,392,539.770	
SEMPRA ENERGY	35,320	170.880	6,035,481.600	
FEDEX CORP	28,131	204.870	5,763,197.970	
VERISIGN INC	10,834	174.620	1,891,833.080	
AMPHENOL CORP	70,392	72.890	5,130,872.880	
BROWN-FORMAN CORP	35,058	70.330	2,465,629.140	
QUANTA SERVICES INC	15,516	138.880	2,154,862.080	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	5.940	604,484.100	
CSX CORP	251,396	30.170	7,584,617.320	
COTERRA ENERGY INC	91,495	30.770	2,815,301.150	
CAMPBELL SOUP CO	26,900	47.090	1,266,721.000	
CONSTELLATION BRANDS INC	18,254	240.520	4,390,452.080	
CARDINAL HEALTH INC	31,857	66.390	2,114,986.230	
CARLISLE COS INC	6,250	301.230	1,882,687.500	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	127,302	10.920	1,390,137.840	
CATERPILLAR INC	61,435	182.490	11,211,273.150	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,845	119.500	1,295,977.500	
CITRIX SYSTEMS INC	14,230	103.610	1,474,370.300	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	8.960	869,774.080	
JPMORGAN CHASE & CO	337,151	117.870	39,739,988.370	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,423	77.040	2,112,667.920	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,259	99.800	1,722,448.200	
CINTAS CORP	10,710	398.570	4,268,684.700	
CISCO SYSTEMS INC	477,480	43.290	20,670,109.200	
CLEVELAND-CLIFFS INC	56,364	15.230	858,423.720	
CLOROX COMPANY	14,322	140.490	2,012,097.780	
COCA-COLA CO/THE	472,160	59.530	28,107,684.800	
COPART INC	25,044	110.610	2,770,116.840	
COGNEX CORP	20,432	41.930	856,713.760	
COLGATE-PALMOLIVE CO	92,146	75.230	6,932,143.580	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	31,293	162.510	5,085,425.430	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,695	341.730	2,287,882.350	
NRG ENERGY, INC.	23,951	44.860	1,074,441.860	
COMCAST CORP-CL A	512,963	34.000	17,440,742.000	
CONAGRA BRANDS INC	55,843	33.620	1,877,441.660	
CONSOLIDATED EDISON INC	41,660	97.640	4,067,682.400	
CMS ENERGY CORP	32,591	66.640	2,171,864.240	
COOPER COS INC	5,638	299.960	1,691,174.480	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	21,281	50.940	1,084,054.140	
CORNING INC	94,551	32.610	3,083,308.110	
SEALED AIR CORP	17,610	50.760	893,883.600	

HEICO CORP-CL A	7,767	121.430	943,146.810	
CUMMINS INC	15,824	211.510	3,346,934.240	
DR HORTON INC	39,849	69.620	2,774,287.380	
DANAHER CORP	79,452	281.910	22,398,313.320	
MOODY'S CORP	18,678	282.310	5,272,986.180	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	58,780	62.040	3,646,711.200	
TARGET CORP	53,706	165.010	8,862,027.060	
DEERE & CO	33,393	358.770	11,980,406.610	
MORGAN STANLEY	149,133	88.260	13,162,478.580	
REPUBLIC SERVICES INC	24,966	145.670	3,636,797.220	
COSTAR GROUP INC	46,656	72.490	3,382,093.440	
THE WALT DISNEY CO	209,580	110.770	23,215,176.600	
DOLLAR TREE INC	25,247	137.940	3,482,571.180	
DOVER CORP	16,217	122.500	1,986,582.500	
OMNICOM GROUP	23,275	68.950	1,604,811.250	
DTE ENERGY CO	21,579	130.600	2,818,217.400	
DUKE ENERGY CORP	87,541	106.280	9,303,857.480	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	130.430	1,818,063.770	
EBAY INC	66,344	42.660	2,830,235.040	
BANK OF AMERICA CORP	833,387	34.510	28,760,185.370	
CITIGROUP INC	221,607	48.440	10,734,643.080	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,111	81.300	1,147,224.300	
EATON CORP PLC	46,295	141.110	6,532,687.450	
CADENCE DESIGN SYS INC	31,336	163.050	5,109,334.800	
DISH NETWORK CORP	24,416	17.290	422,152.640	
ECOLAB INC	28,945	161.810	4,683,590.450	
PERKINELMER INC	13,622	132.190	1,800,692.180	
ELECTRONIC ARTS INC	31,306	124.410	3,894,779.460	
SALESFORCE INC	114,597	154.780	17,737,323.660	
ERIE INDEMNITY CO	2,431	222.190	540,143.890	
EMERSON ELECTRIC CO	68,902	80.520	5,547,989.040	
ATMOS ENERGY CORP	15,146	114.120	1,728,461.520	
ENTERGY CORP	24,061	115.300	2,774,233.300	
EOG RESOURCES INC	68,416	122.560	8,385,064.960	
EQUIFAX INC	13,970	186.720	2,608,478.400	
EQT CORP	36,492	48.090	1,754,900.280	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	26,040	244.780	6,374,071.200	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,678	96.990	1,908,569.220	
EXXON MOBIL CORP	483,973	94.830	45,895,159.590	
FMC CORP	15,205	108.250	1,645,941.250	
NEXTERA ENERGY INC	225,769	86.010	19,418,391.690	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,101	446.670	1,831,793.670	
FAIR ISAAC CORP	2,962	458.000	1,356,596.000	
ASSURANT INC	5,823	155.760	906,990.480	
FASTENAL CO	67,700	47.230	3,197,471.000	
FIFTH THIRD BANCORP	77,462	35.780	2,771,590.360	
M&T BANK CORP	21,099	186.500	3,934,963.500	

FISERV INC	69,266	104.580	7,243,838.280	
FORD MOTOR CO	455,691	14.890	6,785,238.990	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	24.530	930,079.480	
FREEPORT-MCMORAN INC	163,569	29.780	4,871,084.820	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	850.130	1,079,665.100	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	23,283	184.520	4,296,179.160	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	32.980	844,255.020	
GENERAL DYNAMICS CORP	27,257	228.460	6,227,134.220	
GENERAL MILLS INC	70,309	75.070	5,278,096.630	
GENUINE PARTS CO	16,139	154.410	2,492,022.990	
GILEAD SCIENCES INC	144,529	65.000	9,394,385.000	
GARTNER INC	9,036	302.550	2,733,841.800	
MCKESSON CORP	16,468	341.020	5,615,917.360	
NVIDIA CORP	287,665	129.290	37,192,207.850	
GENERAL ELECTRIC CO	127,250	68.910	8,768,797.500	
WW GRAINGER INC	5,411	532.830	2,883,143.130	
HALLIBURTON CO	104,397	29.400	3,069,271.800	
MONSTER BEVERAGE CORP	44,230	87.370	3,864,375.100	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	39,464	331.620	13,087,051.680	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,738	228.430	4,965,611.340	
HASBRO INC	15,437	77.990	1,203,931.630	
HENRY SCHEIN INC	15,048	71.930	1,082,402.640	
HEICO CORP	5,185	152.110	788,690.350	
HERSHEY FOODS CORP	16,042	219.620	3,523,144.040	
HP INC	118,420	26.940	3,190,234.800	
F5 INC	6,924	150.630	1,042,962.120	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,279	97.440	1,488,785.760	
JUNIPER NETWORKS INC	34,097	27.980	954,034.060	
HOLOGIC INC	28,090	67.660	1,900,569.400	
HOME DEPOT INC	117,817	271.540	31,992,028.180	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,012	88.090	1,762,857.080	
HORMEL FOODS CORP	34,578	45.950	1,588,859.100	
CENTERPOINT ENERGY INC	71,052	32.180	2,286,453.360	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	250.040	900,644.080	
HUMANA INC	14,663	497.240	7,291,030.120	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,171	174.030	1,596,029.130	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	163,228	14.260	2,327,631.280	
BIOGEN INC	16,547	206.720	3,420,595.840	
IDEX CORP	9,361	205.840	1,926,868.240	
ILLINOIS TOOL WORKS	35,993	194.790	7,011,076.470	
INTUIT INC	30,950	422.120	13,064,614.000	
IDEXX LABORATORIES INC	9,829	349.840	3,438,577.360	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26,475	159.220	4,215,349.500	
INTEL CORP	470,457	28.840	13,567,979.880	

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	29,611	105.410	3,121,295.510	
INTERNATIONAL PAPER CO	37,464	39.680	1,486,571.520	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	27.820	1,270,789.780	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	192.860	1,572,194.720	
INCYTE CORP	21,658	68.980	1,493,968.840	
JOHNSON & JOHNSON	301,541	165.080	49,778,388.280	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,131	65.700	2,308,106.700	
KLA CORPORATION	16,870	337.360	5,691,263.200	
DEVON ENERGY CORP	70,979	69.480	4,931,620.920	
KELLOGG CO	29,514	70.340	2,076,014.760	
KEYCORP	106,247	18.070	1,919,883.290	
KIMBERLY-CLARK CORP	37,556	121.420	4,560,049.520	
BLACKROCK INC/NEW YORK	17,481	632.340	11,053,935.540	
KROGER CO	77,870	47.880	3,728,415.600	
LAM RESEARCH CORP	16,232	413.440	6,710,958.080	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,380	372.300	2,002,974.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	132.680	1,463,327.720	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,689	88.240	1,560,877.360	
PLUG POWER INC	56,149	29.300	1,645,165.700	
LENNAR CORP	29,937	73.820	2,209,949.340	
ELI LILLY & CO	92,766	309.470	28,708,294.020	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	37.380	1,052,471.280	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	49.320	884,652.840	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	84,328	185.000	15,600,680.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	33,941	133.160	4,519,583.560	
LOCKHEED MARTIN CORP	27,367	413.590	11,318,717.530	
LOEWS CORP	23,530	55.420	1,304,032.600	
LOWE'S COS INC	73,521	191.040	14,045,451.840	
DOMINION ENERGY INC	93,452	80.920	7,562,135.840	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	34.430	1,391,006.430	
MCCORMICK & CO INC	29,917	78.510	2,348,783.670	
MCDONALD'S CORPORATION	83,911	253.470	21,268,921.170	
S&P GLOBAL INC	40,163	347.060	13,938,970.780	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	285.020	1,269,479.080	
MARKEL CORPORATION	1,512	1,191.420	1,801,427.040	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	69,970	94.880	6,638,753.600	
MARSH & MCLENNAN COS	57,542	156.890	9,027,764.380	
MASCO CORP	28,937	48.990	1,417,623.630	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,058	337.440	2,381,651.520	

METLIFE INC	76,607	65.690	5,032,313.830	
MEDTRONIC PLC	152,891	90.620	13,854,982.420	
ACTIVISION BLIZZARD INC	90,094	76.830	6,921,922.020	
CVS HEALTH CORP	150,756	102.310	15,423,846.360	
MERCK & CO.INC.	290,486	86.750	25,199,660.500	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	51,019	68.150	3,476,944.850	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,593	224.120	2,374,103.160	
MICROSOFT CORP	814,668	245.380	199,903,233.840	
MICRON TECH INC	129,374	52.690	6,816,716.060	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	62,574	64.600	4,042,280.400	
3M CO	65,484	116.420	7,623,647.280	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	101.120	638,168.320	
ENTEGRIS INC	17,709	93.170	1,649,947.530	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,578	203.610	1,135,736.580	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,762	238.160	4,468,357.920	
ILLUMINA INC	17,754	201.970	3,585,775.380	
XCEL ENERGY INC	60,629	73.380	4,448,956.020	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,061	106.930	1,075,822.730	
NETAPP INC	24,953	69.080	1,723,753.240	
NEWELL BRANDS INC	41,984	16.720	701,972.480	
NEWMONT CORP	95,125	42.400	4,033,300.000	
NVR INC	365	4,007.500	1,462,737.500	
NIKE INC-CL B	144,409	105.500	15,235,149.500	
NORDSON CORP	5,664	223.020	1,263,185.280	
NORFOLK SOUTHERN CORP	27,565	238.860	6,584,175.900	
EVERSOURCE ENERGY	40,545	88.190	3,575,663.550	
NISOURCE INC	44,573	28.960	1,290,834.080	
NORTHERN TRUST CORP	22,556	95.460	2,153,195.760	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,043	485.080	8,267,218.440	
WELLS FARGO & CO	431,845	44.140	19,061,638.300	
NUCOR CORP	31,536	117.270	3,698,226.720	
CHENIERE ENERGY INC	25,946	172.100	4,465,306.600	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,937	102.770	4,823,715.490	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	108,336	65.090	7,051,590.240	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,008	256.360	2,822,010.880	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,729	688.870	5,324,276.230	
ORACLE CORP	183,937	70.240	12,919,734.880	
PACCAR INC	38,135	85.640	3,265,881.400	
PTC INC	11,726	114.990	1,348,372.740	
EXELON CORP	109,446	43.240	4,732,445.040	
PARKER HANNIFIN CORP	15,112	267.540	4,043,064.480	
PAYCHEX INC	36,225	118.960	4,309,326.000	

ALIGN TECHNOLOGY INC	8,596	252.000	2,166,192.000	
PPL CORPORATION	86,817	28.880	2,507,274.960	
PEPSICO INC	158,327	165.880	26,263,282.760	
PENTAIR PLC	17,214	43.600	750,530.400	
PFIZER INC	644,659	45.940	29,615,634.460	
ESSENTIAL UTILITIES INC	27,796	45.680	1,269,721.280	
CONOCOPHILLIPS	148,227	115.560	17,129,112.120	
PG&E CORP	161,265	13.110	2,114,184.150	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,796	244.280	6,545,726.880	
ALTRIA GROUP INC	208,508	42.010	8,759,421.080	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	46,237	165.050	7,631,416.850	
BROWN & BROWN INC	27,138	61.490	1,668,715.620	
GARMIN LTD	17,835	86.950	1,550,753.250	
PPG INDUSTRIES INC	26,678	120.440	3,213,098.320	
COSTCO WHOLESALE CORP	50,906	503.500	25,631,171.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	25,937	112.080	2,907,018.960	
QUEST DIAGNOSTICS	13,048	124.280	1,621,605.440	
PROCTER & GAMBLE CO	275,473	137.440	37,861,009.120	
PROGRESSIVE CORP	67,362	127.090	8,561,036.580	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56,485	66.470	3,754,557.950	
PULTE GROUP INC	29,050	38.860	1,128,883.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	31,571	131.430	4,149,376.530	
QUALCOMM INC	127,397	124.980	15,922,077.060	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,036	107.930	2,270,415.480	
EXACT SCIENCES CORP	18,866	40.890	771,430.740	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,471	705.850	8,802,655.350	
RESMED INC	16,883	225.950	3,814,713.850	
US BANCORP	162,921	45.870	7,473,186.270	
SEAGEN INC	16,376	141.310	2,314,092.560	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	44,799	47.280	2,118,096.720	
ROSS STORES INC	40,011	89.560	3,583,385.160	
ROLLINS INC	25,920	35.800	927,936.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,800	384.000	4,531,200.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,975	245.170	3,181,080.750	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	50.830	1,396,655.910	
RPM INTERNATIONAL INC	13,691	91.040	1,246,428.640	
ACCENTURE PLC-CL A	72,739	273.860	19,920,302.540	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	159,217	59.570	9,484,556.690	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,092	206.750	2,706,771.000	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	26,823	164.160	4,403,263.680	

FIDELITY NATIONAL INFORMATION	70,733	85.690	6,061,110.770	
BOOKING HOLDINGS INC	4,693	1,956.770	9,183,121.610	
SCHLUMBERGER LTD	159,299	39.630	6,313,019.370	
SCHWAB (CHARLES) CORP	167,564	72.580	12,161,795.120	
POOL CORP	4,660	328.430	1,530,483.800	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24,880	115.770	2,880,357.600	
BUNGE LTD	16,302	91.200	1,486,742.400	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	54.740	792,470.980	
ELEVANCE HEALTH INC	27,342	485.330	13,269,892.860	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,525	139.810	2,450,170.250	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	29,468	77.470	2,282,885.960	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	28,677	223.870	6,419,919.990	
CENTENE CORP	68,055	86.000	5,852,730.000	
SVB FINANCIAL GROUP	7,000	379.030	2,653,210.000	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	52.920	786,179.520	
SNAP-ON INC	6,118	214.830	1,314,329.940	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,080	92.540	3,894,083.200	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	167.620	1,200,997.300	
EDISON INTERNATIONAL	45,114	68.300	3,081,286.200	
SOUTHERN CO	121,963	77.290	9,426,520.270	
TRUIST FINANCIAL CORP	154,110	48.120	7,415,773.200	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	36.900	726,930.000	
AT&T INC	822,177	16.760	13,779,686.520	
CHEVRON CORP	214,383	160.620	34,434,197.460	
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,672	85.620	1,598,696.640	
STATE STREET CORP	43,562	71.400	3,110,326.800	
STARBUCKS CORP	132,186	92.220	12,190,192.920	
STEEL DYNAMICS INC	20,170	76.230	1,537,559.100	
STRYKER CORP	39,272	226.720	8,903,747.840	
NETFLIX INC	51,377	235.380	12,093,118.260	
NORTONLIFELOCK INC	62,570	21.580	1,350,260.600	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	48.600	813,078.000	
SYNOPSYS INC	17,236	315.940	5,445,541.840	
SYSCO CORP	59,300	79.660	4,723,838.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	41,719	209.620	8,745,136.780	
TELEFLEX INC	5,532	232.670	1,287,130.440	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,349	8.890	989,892.610	
TERADYNE INC	18,512	82.350	1,524,463.200	
TEXAS INSTRUMENTS INC	105,890	162.670	17,225,126.300	
TEXTRON INC	24,814	64.070	1,589,832.980	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	45,030	551.980	24,855,659.400	

GLOBE LIFE INC	9,737	101.780	991,031.860	
DAVITA INC	6,813	92.780	632,110.140	
TRACTOR SUPPLY CO	12,713	187.960	2,389,535.480	
BIO-TECHNE CORP	4,403	316.370	1,392,977.110	
TRIMBLE INC	28,676	59.420	1,703,927.920	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,516	362.760	1,638,224.160	
TYSON FOODS INC	32,395	72.100	2,335,679.500	
UGI CORP	24,160	37.610	908,657.600	
MARATHON OIL CORP	88,213	26.800	2,364,108.400	
UNION PACIFIC CORP	72,179	218.360	15,761,006.440	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	170,608	85.610	14,605,750.880	
UNITEDHEALTH GROUP INC	107,659	522.910	56,295,967.690	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	98.990	801,423.040	
VF CORP	37,887	40.580	1,537,454.460	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	23.050	1,555,114.350	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	29,576	287.670	8,508,127.920	
VULCAN MATERIALS CO	15,328	162.220	2,486,508.160	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86,056	34.230	2,945,696.880	
WALMART INC	172,367	133.470	23,005,823.490	
WASTE MANAGEMENT INC	47,925	171.030	8,196,612.750	
WATERS CORP	6,836	295.760	2,021,815.360	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	47.720	1,063,440.200	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,901	273.730	2,436,470.730	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	139.150	1,764,282.850	
VAIL RESORTS INC	4,389	229.980	1,009,382.220	
WESTERN DIGITAL CORP	35,421	37.770	1,337,851.170	
WABTEC CORP	20,273	87.850	1,780,983.050	
WHIRLPOOL CORP	6,832	145.890	996,720.480	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	100.200	1,887,066.600	
WYNN RESORTS LTD	12,757	65.230	832,139.110	
NASDAQ INC	40,053	61.110	2,447,638.830	
CME GROUP INC	41,498	190.770	7,916,573.460	
WILLIAMS COS INC	135,860	32.830	4,460,283.800	
LKQ CORP	31,863	48.880	1,557,463.440	
ALLIANT ENERGY CORP	29,066	60.230	1,750,645.180	
WEC ENERGY GROUP INC	35,483	101.060	3,585,911.980	
CARMAX INC	18,673	84.980	1,586,831.540	
TJX COMPANIES INC	133,163	64.880	8,639,615.440	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,958	296.200	1,764,759.600	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.870	556,879.630	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	21,528	56.810	1,223,005.680	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,331	208.480	2,987,726.880	
SIGNATURE BANK	6,557	178.800	1,172,391.600	
CBRE GROUP INC	37,573	78.230	2,939,335.790	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	18.550	292,700.450	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,099	22.440	2,403,301.560	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	349.510	1,438,233.650	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,852	418.880	2,032,405.760	
WESTLAKE CORP	4,187	93.890	393,117.430	
T-MOBILE US INC	72,278	141.020	10,192,643.560	
LAS VEGAS SANDS CORP	38,350	39.690	1,522,111.500	
MOSAIC CO/THE	42,561	53.610	2,281,695.210	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	256.810	1,076,804.330	
CELANESE CORP	13,491	107.200	1,446,235.200	
DEXCOM INC	44,066	90.980	4,009,124.680	
EXPEDIA GROUP INC	18,196	107.790	1,961,346.840	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	101.120	2,429,610.240	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,462	277.350	3,456,335.700	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	19.640	707,707.760	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	62,831	98.390	6,181,942.090	
LIVE NATION	20,505	92.090	1,888,305.450	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,157	1,710.650	5,400,522.050	
TRANSDIGM GROUP INC	6,205	587.100	3,642,955.500	
MASTERCARD INC	99,621	316.960	31,575,872.160	
WESTERN UNION CO	46,712	13.950	651,632.400	
OWENS CORNING	10,366	83.610	866,701.260	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	92.400	1,395,979.200	
AERCAP HOLDINGS NV	13,522	46.380	627,150.360	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	14,212	163.610	2,325,225.320	
DELTA AIR LINES INC	15,786	33.280	525,358.080	
INSULET CORP	8,015	259.140	2,077,007.100	
DISCOVER FINANCIAL	32,568	100.910	3,286,436.880	
TE CONNECTIVITY LTD	36,520	124.280	4,538,705.600	
MASIMO CORP	5,688	155.250	883,062.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,211	338.600	4,473,244.600	
VMWARE INC	24,654	113.670	2,802,420.180	
MERCADOLIBRE INC	5,154	965.780	4,977,630.120	
ULTA BEAUTY INC	6,073	422.670	2,566,874.910	
INVESCO LTD	38,530	16.380	631,121.400	
MSCI INC	9,505	456.190	4,336,085.950	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	177,919	94.040	16,731,502.760	
VISA INC	188,795	195.370	36,884,879.150	

KEURIG DR PEPPER INC	91,408	37.230	3,403,119.840	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,499	147.860	3,178,842.140	
MARATHON PETROLEUM CORP	63,587	96.140	6,113,254.180	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	16,182	60.120	972,861.840	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	229,919	18.330	4,214,415.270	
XYLEM INC	20,869	94.280	1,967,529.320	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,975	78.690	2,358,732.750	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	232.300	1,094,829.900	
SPLUNK INC	18,478	93.480	1,727,323.440	
EPAM SYSTEMS INC	6,493	413.010	2,681,673.930	
HCA HEALTHCARE INC	27,031	208.970	5,648,668.070	
VERISK ANALYTICS INC	18,597	183.980	3,421,476.060	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,554	152.180	997,387.720	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	205.420	1,816,734.480	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	19,974	146.610	2,928,388.140	
NXP SEMICONDUCTOR NV	29,467	159.680	4,705,290.560	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	14,445	92.490	1,336,018.050	
TARGA RESOURCES CORP	26,352	72.150	1,901,296.800	
LEAR CORP	6,911	137.940	953,303.340	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,911	119.140	1,538,216.540	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,335	53.570	1,410,765.950	
DOLLAR GENERAL CORP	25,915	240.850	6,241,627.750	
FORTINET INC	77,005	50.820	3,913,394.100	
HORIZON PHARMA PLC	24,711	63.540	1,570,136.940	
TESLA INC	303,055	303.750	92,052,956.250	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	208.670	1,442,744.380	
ENPHASE ENERGY INC	15,506	312.180	4,840,663.080	
GENERAL MOTORS CO	160,651	40.660	6,532,069.660	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	32.650	1,280,859.500	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,608	233.200	2,007,385.600	
APTIV PLC	32,363	96.750	3,131,120.250	
PHILLIPS 66	53,977	81.870	4,419,096.990	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,158	65.900	603,512.200	
META PLATFORMS INC	263,151	149.550	39,354,232.050	
IQVIA HOLDINGS INC	21,481	207.370	4,454,514.970	
DIAMONDBACK ENERGY INC	18,801	134.630	2,531,178.630	
SERVICENOW INC	23,284	435.550	10,141,346.200	
PALO ALTO NETWORKS INC	34,716	179.620	6,235,687.920	
WORKDAY INC	22,324	154.330	3,445,262.920	

ABBVIE INC	202,895	142.510	28,914,566.450	
ZOETIS INC	54,758	159.180	8,716,378.440	
NEWS CORP/NEW-CL A	40,345	17.140	691,513.300	
CDW CORP	15,145	169.680	2,569,803.600	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	34.290	1,454,341.770	
TWILIO INC	21,268	77.690	1,652,310.920	
COUPA SOFTWARE INC	8,176	70.600	577,225.600	
SNAP INC	127,318	11.900	1,515,084.200	
TRADE DESK INC A	51,978	62.780	3,263,178.840	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,466	63.780	1,432,881.480	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	41.260	364,944.700	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	40.990	814,512.290	
OKTA INC	17,828	62.540	1,114,963.120	
BLACK KNIGHT INC	17,653	67.580	1,192,989.740	
BAKER HUGHES CO	108,170	24.330	2,631,776.100	
BROADCOM INC	46,304	500.140	23,158,482.560	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9,939	44.750	444,770.250	
MONGODB INC	7,891	233.520	1,842,706.320	
BURLINGTON STORES INC	7,274	139.210	1,012,613.540	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	42,679	15.090	644,026.110	
VEEVA SYSTEMS INC	15,824	174.830	2,766,509.920	
TWITTER INC	75,611	42.140	3,186,247.540	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	16,816	40.470	680,543.520	
EVERGY INC	27,756	67.560	1,875,195.360	
ALLEGION PLC	9,404	93.150	875,982.600	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	19,542	60.210	1,176,623.820	
STERIS PLC	10,912	199.360	2,175,416.320	
DOCUSIGN INC	21,673	60.280	1,306,448.440	
WIX.COM LTD	5,855	76.360	447,087.800	
DROPBOX INC	30,479	21.820	665,051.780	
KKR & CO INC	63,201	49.640	3,137,297.640	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	44.170	223,058.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,527	80.210	2,207,940.670	
MODERNA INC	38,522	135.860	5,233,598.920	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	32,925	135.240	4,452,777.000	
ARAMARK	30,212	37.930	1,145,941.160	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	9.880	591,693.440	
CIGNA CORP	35,933	289.960	10,419,132.680	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	37.650	1,233,790.500	
DOW INC	84,832	46.910	3,979,469.120	
AMCOR PLC	172,505	11.790	2,033,833.950	
PINTEREST INC	62,041	25.630	1,590,110.830	
FOX CORP-A	36,501	34.560	1,261,474.560	
FOX CORP-B	15,511	32.030	496,817.330	

CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	10.910	464,613.260	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	23,809	178.860	4,258,477.740	
CHEWY INC	9,648	36.450	351,669.600	
AVANTOR INC	65,960	23.180	1,528,952.800	
LYFT INC	36,887	16.990	626,710.130	
DYNATRACE INC	20,512	38.640	792,583.680	
CLOUDFLARE INC	29,770	60.950	1,814,481.500	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	63.910	881,958.000	
CARRIER GLOBAL CORP	96,568	40.400	3,901,347.200	
OTIS WORLDWIDE CORP	47,395	68.930	3,266,937.350	
UBER TECHNOLOGIES INC	165,469	33.130	5,481,987.970	
CORTEVA INC	84,012	62.120	5,218,825.440	
MATCH GROUP INC	31,784	57.860	1,839,022.240	
BILL.COM HOLDINGS INC	10,180	158.840	1,616,991.200	
BLACKSTONE INC	80,890	94.700	7,660,283.000	
CARLYLE GROUP INC	24,530	31.420	770,732.600	
DATADOG INC	26,832	95.360	2,558,699.520	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	62.580	1,396,034.640	
INGERSOLL RAND INC	46,398	49.310	2,287,885.380	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,733	351.580	2,015,608.140	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	39.690	1,521,793.980	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	30.830	285,701.610	
UNITY SOFTWARE INC	21,046	38.040	800,589.840	
AON PLC	24,432	280.130	6,844,136.160	
WARNER BROS DISCOVERY INC	270,225	13.170	3,558,863.250	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	736	1,767.140	1,300,615.040	
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	34.710	783,265.860	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	77.230	1,011,249.620	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	23.990	444,486.720	
IAC INC	9,152	62.560	572,549.120	
AIRBNB INC	43,816	125.040	5,478,752.640	
ZENDESK INC	12,612	76.590	965,953.080	
CONSTELLATION ENERGY CORP	37,045	86.800	3,215,506.000	
APPLOVIN CORP	13,206	24.390	322,094.340	
ROYALTY PHARMA PLC	37,502	42.170	1,581,459.340	
ROBLOX CORP	38,445	43.500	1,672,357.500	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	43.830	1,299,822.480	
VIATRIS INC	132,223	9.550	1,262,729.650	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23,146	46.650	1,079,760.900	
SNOWFLAKE INC	25,880	196.490	5,085,161.200	
DOORDASH INC	20,697	64.410	1,333,093.770	
ARISTA NETWORKS INC	27,865	116.940	3,258,533.100	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	47,354	57.150	2,706,281.100	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	181,564	8.010	1,454,327.640	
FNF GROUP	31,004	39.800	1,233,959.200	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	5.400	323,395.200	
JACOBS SOLUTIONS INC	14,561	119.430	1,739,020.230	
MARVELL TECHNOLOGY INC	99,859	46.670	4,660,419.530	
APA CORP	37,156	41.490	1,541,602.440	
LUCID GROUP INC	44,910	16.490	740,565.900	
GRAB HOLDINGS LTD	113,116	2.950	333,692.200	
CATALENT INC	20,564	89.240	1,835,131.360	
SYNCHRONY FINANCIAL	63,139	32.600	2,058,331.400	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	56,943	37.710	2,147,320.530	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	153.200	802,308.400	
WAYFAIR INC	7,350	48.340	355,299.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	20,584	165.660	3,409,945.440	
HUBSPOT INC	5,613	302.840	1,699,840.920	
QORVO INC	11,596	85.430	990,646.280	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	91.710	1,406,372.850	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5,852	313.250	1,833,139.000	
GODADDY INC	19,722	76.160	1,502,027.520	
ETSY INC	13,841	112.350	1,555,036.350	
TRANSUNION	22,126	68.470	1,514,967.220	
ALCOA CORP	19,669	43.140	848,520.660	
BLOCK INC	59,110	69.180	4,089,229.800	
DUPONT DE NEMOURS INC	57,674	55.130	3,179,567.620	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,409	47.390	1,061,962.510	
TELADOC HEALTH INC	20,256	31.890	645,963.840	
WESTROCK CO	27,826	38.580	1,073,527.080	
KRAFT HEINZ CO	86,262	34.610	2,985,527.820	
NOVOCURE LTD	10,423	88.950	927,125.850	
FORTIVE CORP	38,946	64.280	2,503,448.880	
WASTE CONNECTIONS INC	28,997	145.830	4,228,632.510	
ALPHABET INC-CL A	689,988	102.910	71,006,665.080	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	144,397	13.070	1,887,268.790	
PAYPAL HOLDINGS INC	127,274	96.400	12,269,213.600	
SEA LTD ADR	40,917	60.770	2,486,526.090	
EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	29.510	1,325,707.240	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	35.930	586,413.530	
ALPHABET INC-CL C	646,017	103.900	67,121,166.300	
ZSCALER INC	10,662	175.990	1,876,405.380	

	CABLE ONE INC	570	1,063.400	606,138.000	
	LINDE PLC	58,050	282.900	16,422,345.000	
	ROKU INC	12,563	73.810	927,275.030	
	AVALARA INC	11,113	92.590	1,028,952.670	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,495	376.000	5,074,120.000	
	VISTRA CORP	50,407	25.370	1,278,825.590	
アメリカ・ドル　小計		39,093,024		3,884,734,611.300 (555,944,370,224)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	11.515	529,263.940	
	ASHTEAD GROUP	50,699	43.020	2,181,070.980	
	SEVERN TRENT PLC	29,397	26.450	777,550.650	
	BARCLAYS PLC	1,890,510	1.722	3,255,458.220	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.242	526,839.430	
	BT GROUP PLC	756,852	1.411	1,067,918.170	
	BUNZL PLC	38,593	27.510	1,061,693.430	
	AVIVA PLC	358,631	4.425	1,586,942.170	
	CRODA INTERNATIONAL	17,375	65.680	1,141,190.000	
	DIAGEO PLC	263,728	37.635	9,925,403.280	
	SCHRODERS PLC	12,178	25.860	314,923.080	
	DCC PLC	11,135	48.350	538,377.250	
	NATIONAL GRID PLC	409,380	10.345	4,235,036.100	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.487	560,549.900	
	BAE SYSTEMS PLC	350,927	7.748	2,718,982.390	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	243,703	34.350	8,371,198.050	
	HALMA PLC	41,997	20.380	855,898.860	
	NEXT PLC	13,982	58.480	817,667.360	
	IMPERIAL BRANDS PLC	108,090	19.125	2,067,221.250	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	19.880	397,122.880	
	ANGLO AMERICAN PLC	142,815	28.155	4,020,956.320	
	COMPASS GROUP PLC	200,991	19.255	3,870,081.700	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,310,615	5.297	12,239,327.650	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	736,620	2.629	1,936,573.980	
	UNILEVER PLC	291,354	39.695	11,565,297.030	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,616	10.285	736,570.560	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	13.325	564,327.070	
	PEARSON PLC	86,953	9.040	786,055.120	
	PERSIMMON PLC	35,252	14.520	511,859.040	
	PRUDENTIAL PLC	309,558	9.508	2,943,277.460	
	RIO TINTO PLC	131,074	47.700	6,252,229.800	
	VODAFONE GROUP PLC	3,044,329	1.092	3,324,407.260	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	83,554	63.720	5,324,060.880	
	RELX PLC	216,002	22.420	4,842,764.840	

RENTOKIL INITIAL PLC	204,183	5.222	1,066,243.620	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	847,047	0.768	650,532.090	
NATWEST GROUP PLC	563,549	2.742	1,545,251.350	
ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	10.935	737,543.880	
SSE PLC	128,201	17.355	2,224,928.350	
BP PLC	2,175,067	4.565	9,929,180.850	
SAGE GROUP PLC(THE)	129,688	7.180	931,159.840	
SMITHS GROUP PLC	50,866	15.200	773,163.200	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	103.800	927,556.800	
STANDARD CHARTERED PLC	294,895	6.092	1,796,500.340	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,991,045	0.476	3,803,737.420	
TAYLOR WIMPLEY PLC	359,514	1.078	387,556.090	
TESCO PLC	846,543	2.320	1,963,979.760	
3I GROUP PLC	107,283	11.320	1,214,443.560	
SMITH & NEPHEW PLC	93,066	10.600	986,499.600	
GSK PLC	474,174	13.376	6,342,551.420	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	36,657	78.020	2,859,979.140	
WPP PLC	120,328	7.692	925,562.970	
ASTRAZENECA PLC	178,526	101.300	18,084,683.800	
WHITBREAD PLC	25,470	26.880	684,633.600	
INTERTEK GROUP PLC	17,114	39.460	675,318.440	
BURBERRY GROUP PLC	41,060	17.295	710,132.700	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	48.990	1,065,630.480	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.017	387,459.640	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	22.620	482,371.500	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	35.920	408,051.200	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	12.315	227,273.320	
AVEVA GROUP PLC	17,427	30.250	527,166.750	
ABRDN PLC	213,433	1.445	308,410.680	
EXPERIAN PLC	106,747	26.870	2,868,291.890	
MONDI PLC	58,887	14.735	867,699.940	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.504	314,154.760	
OCADO GROUP PLC	69,766	6.500	453,479.000	
INFORMA PLC	157,970	5.524	872,626.280	
GLENCORE PLC	1,157,199	5.020	5,809,138.980	
ENTAIN PLC	61,865	12.335	763,104.770	
COCA-COLA HBC AG	21,338	19.380	413,530.440	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	6.098	525,787.850	
FERGUSON PLC	24,704	99.140	2,449,154.560	
M&G PLC	270,401	1.972	533,230.770	
JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.282	323,294.760	
HALEON PLC	567,403	2.644	1,500,213.530	
SHELL PLC	861,789	23.145	19,946,106.400	
AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	6.208	688,051.260	

	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.117	544,210.210	
イギリス・ポンド　小計		32,303,751		203,347,673.890 (33,395,788,483)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	33.120	4,858,803.360	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	33.830	6,101,003.690	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	5.968	1,717,429.260	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,553	681.200	1,739,103.600	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	155.100	1,950,227.400	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	19.470	3,172,519.680	
	ICL GROUP LTD	72,257	29.140	2,105,568.980	
	NICE LTD	7,640	699.500	5,344,180.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	132.500	2,310,800.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	264.000	1,233,408.000	
イスラエル・シュケル　小計		894,899		30,533,043.970 (1,268,898,348)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	63.000	1,370,502.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	347,282	23.740	8,244,474.680	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	392,465	21.540	8,453,696.100	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	194,047	17.930	3,479,262.710	
	TELSTRA CORP LTD	482,855	3.860	1,863,820.300	
	ASX LTD	23,956	74.020	1,773,223.120	
	BHP GROUP LTD	583,711	38.740	22,612,964.140	
	AMPOL LTD	32,715	32.600	1,066,509.000	
	COMPUTERSHARE LT	68,135	24.910	1,697,242.850	
	CSL LIMITED	55,619	287.610	15,996,580.590	
	REA GROUP LTD	6,134	124.130	761,413.420	
	TRANSURBAN GROUP	364,824	13.370	4,877,696.880	
	COCHLEAR LTD	7,836	212.720	1,666,873.920	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	5.870	1,251,654.230	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	196,239	95.060	18,654,479.340	
	RIO TINTO LIMITED	42,295	94.640	4,002,798.800	
	APA GROUP	125,299	10.570	1,324,410.430	
	ARISTOCRAT LEISU	65,513	34.210	2,241,199.730	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.560	1,284,387.840	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	49,035	33.510	1,643,162.850	
	ORICA LTD	43,659	14.510	633,492.090	
	LEND LEASE CORP LTD	65,475	9.870	646,238.250	
	BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	16.120	811,239.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	41,229	176.540	7,278,567.660	
	SUNCORP GROUP LTD	154,162	10.510	1,620,242.620	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	362,624	29.820	10,813,447.680	
	NEWCREST MINING LTD	98,073	17.100	1,677,048.300	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.350	602,725.650	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	12.290	2,119,865.230	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	7.720	1,046,662.160	
	REECE LTD	31,558	14.850	468,636.300	
	SANTOS LTD	359,516	7.960	2,861,747.360	
	SONIC HEALTHCARE	52,774	31.740	1,675,046.760	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	25.960	674,570.600	
	WESFARMERS LTD	131,656	46.140	6,074,607.840	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	221,231	33.730	7,462,121.630	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	136,728	35.000	4,785,480.000	
	SEEK LTD	38,405	20.930	803,816.650	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,284	62.700	394,006.800	
	MINERAL RESOURCES LTD	16,953	70.010	1,186,879.530	
	BRAMBLES LTD	170,929	12.170	2,080,205.930	
	EVOLUTION MINING LTD	224,674	2.140	480,802.360	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.740	833,455.260	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	13.260	1,050,629.580	
	XERO LTD	14,590	85.080	1,241,317.200	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	27.850	662,300.850	
	LOTTERY CORP LTD	227,460	4.350	989,451.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	7.330	1,176,245.100	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.600	1,074,873.600	
	SOUTH32 LTD(AUD)	619,251	4.000	2,477,004.000	
	COLES GROUP LTD	151,233	16.660	2,519,541.780	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	58.700	870,110.100	
オーストラリア・ドル　小計		8,019,837		173,358,731.800 (16,632,036,729)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	52,200	54.320	2,835,504.000	
	BARRICK GOLD CORP	200,288	20.010	4,007,762.880	
	BANK OF MONTREAL	77,765	127.850	9,942,255.250	
	BANK OF NOVA SCOTIA	139,067	71.350	9,922,430.450	
	NATIONAL BANK OF CANADA	38,087	92.050	3,505,908.350	
	BCE INC	7,697	61.580	473,981.260	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	161,474	64.550	10,423,146.700	
	BAUSCH HEALTH COS INC	30,250	10.110	305,827.500	
	SAPUTO INC	26,668	34.960	932,313.280	
	BLACKBERRY LTD	49,855	7.980	397,842.900	

ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	83,181	17.740	1,475,630.940	
CGI INC	25,261	103.010	2,602,135.610	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	67.050	1,097,139.150	
CAE INC	32,283	23.250	750,579.750	
CAMECO CORP	45,781	38.220	1,749,749.820	
ROGERS COMM-CL B	40,412	55.500	2,242,866.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	106,140	64.130	6,806,758.200	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	132,635	71.570	9,492,686.950	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	156.580	958,895.920	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	40.290	657,935.700	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,497	156.870	10,431,384.390	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	42.240	917,157.120	
OPEN TEXT CORP	33,217	38.660	1,284,169.220	
EMPIRE CO LTD	16,169	35.940	581,113.860	
KINROSS GOLD CORP	123,889	4.360	540,156.040	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	86.680	1,151,630.480	
FORTIS INC	54,416	56.580	3,078,857.280	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	64,491	23.340	1,505,219.940	
TELUS CORP	31,890	28.640	913,329.600	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	31.490	1,077,209.920	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	61.440	1,673,994.240	
ENBRIDGE INC	235,594	55.390	13,049,551.660	
IGM FINANCIAL INC	12,478	36.690	457,817.820	
MANULIFE FINANCIAL CORP	219,912	22.860	5,027,188.320	
LOBLAW CO LTD	18,620	112.790	2,100,149.800	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	95,432	58.670	5,598,995.440	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,328	73.480	2,375,461.440	
SUN LIFE FINANCIAL INC	69,945	58.210	4,071,498.450	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,914	640.750	1,867,145.500	
METRO INC	28,316	70.600	1,999,109.600	
EMERA INC	30,947	60.180	1,862,390.460	
ONEX CORP	10,157	67.950	690,168.150	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	20.710	400,179.330	
POWER CORP OF CANADA	65,500	34.140	2,236,170.000	
QUEBECOR INC-B	17,195	27.000	464,265.000	
ROYAL BANK OF CANADA	160,700	127.910	20,555,137.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	107,880	100.280	10,818,206.400	
SHAW COMM INC-B	52,487	33.690	1,768,287.030	
SUNCOR ENERGY INC	167,689	41.230	6,913,817.470	
LUNDIN MINING CORP	68,762	7.060	485,459.720	
TECK RESOURCES LTD-CL B	58,616	42.830	2,510,523.280	

	THOMSON REUTERS CORP	19,979	147.850	2,953,895.150	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	102.820	993,755.300	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	207,201	88.010	18,235,760.010	
	TC ENERGY CORP	110,440	63.180	6,977,599.200	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,862	108.200	634,268.400	
	WESTON (GEORGE) LTD	8,379	148.690	1,245,873.510	
	INTACT FINANCIAL CORP	20,070	204.040	4,095,082.800	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	53,414	41.900	2,238,046.600	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,393	1,958.230	4,686,044.390	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	21,662	155.710	3,372,990.020	
	TOURMALINE OIL CORP	38,177	81.980	3,129,750.460	
	KEYERA CORP	24,571	31.240	767,598.040	
	PARKLAND CORP	15,665	31.480	493,134.200	
	ALTAGAS LTD	33,833	28.900	977,773.700	
	PEMBINA PIPELINE CORP	60,655	47.240	2,865,342.200	
	DOLLARAMA INC	32,535	76.220	2,479,817.700	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	158,757	24.920	3,956,224.440	
	ARC RESOURCES LTD	74,961	19.020	1,425,758.220	
	NORTHLAND POWER INC	25,030	45.030	1,127,100.900	
	TMX GROUP LTD	7,040	130.870	921,324.800	
	BRP INC	4,307	93.840	404,168.880	
	IVANHOE MINES LTD	64,027	8.920	571,120.840	
	NUTRIEN LTD	62,480	117.560	7,345,148.800	
	TFI INTERNATIONAL INC	9,399	132.300	1,243,487.700	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	12,150	25.340	307,881.000	
	WSP GLOBAL INC	15,095	163.710	2,471,202.450	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,011	73.090	877,883.990	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	17,254	38.810	669,627.740	
	NUVEI CORP	7,929	42.190	334,524.510	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	53.440	860,544.320	
	AIR CANADA	18,814	19.110	359,535.540	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,443	78.180	2,536,393.740	
	SHOPIFY INC	134,677	44.800	6,033,529.600	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	163.620	856,877.940	
	HYDRO ONE LTD	37,626	34.760	1,307,879.760	
カナダ・ドル　小計		4,629,519		268,744,041.420 (29,061,980,639)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	3.700	533,540.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	203,210	33.390	6,785,181.900	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	8.350	328,990.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.550	953,090.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.795	605,148.430	

	KEPPEL CORP LTD	144,600	7.320	1,058,472.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	368,898	12.350	4,555,890.300	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.700	2,546,991.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.340	868,818.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,766	27.300	3,542,611.800	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	7.070	308,252.000	
	VENTURE CORP LTD	44,900	17.370	779,913.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,400	3.990	775,656.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.660	1,122,119.400	
シンガポール・ドル　小計		3,586,587		24,764,673.830 (2,517,329,095)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	335,436	5.124	1,718,774.060	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	47.470	901,123.010	
	NESTLE SA-REGISTERED	322,578	108.740	35,077,131.720	
	CIE FINANC RICHEMONT	60,472	103.650	6,267,922.800	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	81,148	327.800	26,600,314.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,208	160.550	675,594.400	
	SIKA INHABER	16,475	207.700	3,421,857.500	
	SGS SA-REG	769	2,295.000	1,764,855.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	246,748	77.770	19,189,591.960	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	139.600	792,230.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	449	1,940.000	871,060.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	16.910	356,327.520	
	SWISSCOM AG-REG	2,942	495.700	1,458,349.400	
	ABB LTD	192,456	26.970	5,190,538.320	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	29.840	592,085.280	
	GEBERIT AG	4,146	434.800	1,802,680.800	
	LONZA GROUP AG-REG	8,438	484.800	4,090,742.400	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	9,930.000	1,161,810.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	100,900.000	1,311,700.000	
	GIVAUDAN-REG	1,043	2,964.000	3,091,452.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,214	430.600	7,412,348.400	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	2,595	393.800	1,021,911.000	
	HOLCIM LTD	64,992	45.210	2,938,288.320	
	TEMENOS GROUP	7,082	77.260	547,155.320	
	BACHEM HOLDING AG	2,630	54.450	143,203.500	
	SONOVA HOLDING AG	6,135	234.300	1,437,430.500	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,959	220.000	1,310,980.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,969	96.480	1,251,249.120	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	223.300	698,929.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,026	41.760	209,885.760	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	155.400	422,688.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,610	517.800	1,869,258.000	

	EMS-CHEMIE HOLDING	810	630.000	510,300.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	83.400	698,224.800	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,623	920.000	2,413,160.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	48.570	1,264,325.670	
	SWISS RE LTD	35,664	82.660	2,947,986.240	
	SIG GROUP AG	38,322	22.880	876,807.360	
	ALCON INC	57,507	65.600	3,772,459.200	
	UBS GROUP AG	408,211	16.210	6,617,100.310	
	VAT GROUP AG	3,325	223.000	741,475.000	
スイス・フラン　小計		2,057,937		155,441,306.070 (23,152,982,539)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	313,452	108.760	34,091,039.520	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	168,168	97.560	16,406,470.080	
	ERICSSON LM-B SHS	330,309	72.980	24,105,950.820	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	187.050	4,817,472.750	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	181.050	10,580,018.850	
	LUNDBERGS B	7,859	426.500	3,351,863.500	
	SKF AB-B SHS	46,594	149.700	6,975,121.800	
	SANDVIK AB	114,819	157.750	18,112,697.250	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	179,371	111.250	19,955,023.750	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	157.750	6,931,061.750	
	SWEDBANK AB	94,382	153.450	14,482,917.900	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,211	150.650	10,577,287.150	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	93.480	15,147,125.280	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	177.600	4,297,564.800	
	VOLVO AB-B SHS	168,857	170.680	28,820,512.760	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	444.800	4,511,161.600	
	SWEDISH MATCH AB	190,761	109.700	20,926,481.700	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	103.200	6,647,731.200	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	233.200	3,566,094.400	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	230.800	4,921,810.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	122.000	3,282,654.000	
	SECURITAS AB-B SHS	44,038	85.660	3,772,295.080	
	INVESTOR AB-B SHS	204,473	172.460	35,263,413.580	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	107.940	8,882,058.780	
	ASSA ABLOY AB-B	121,506	221.300	26,889,277.800	
	TELIA CO AB	344,810	35.120	12,109,727.200	
	BOLIDEN AB	29,779	347.450	10,346,713.550	
	ALFA LAVAL AB	35,313	284.400	10,043,017.200	
	KINNEVIK AB-B	22,633	150.200	3,399,476.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	54.550	3,978,986.100	
	INDUTRADE AB	29,769	191.400	5,697,786.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	66.460	3,174,727.740	
	NIBE INDUSTRIER AB	185,385	111.400	20,651,889.000	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	225.000	4,135,500.000	
	HEXAGON AB-B SHS	223,124	112.200	25,034,512.800	
	SAGAX AB	19,038	216.200	4,116,015.600	
	EPIROC AB-A	87,125	161.500	14,070,687.500	
	EPIROC AB-B	41,205	144.350	5,947,941.750	
	ESSITY AB-B	66,425	232.000	15,410,600.000	
	EQT AB	31,718	253.700	8,046,856.600	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	65.340	5,213,543.940	
	VOLVO CAR AB	63,710	59.310	3,778,640.100	
	LIFCO AB	26,835	168.650	4,525,722.750	
	EVOLUTION AB	19,664	859.000	16,891,376.000	
	NORDEA BANK ABP	403,176	103.180	41,599,699.680	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	197.700	3,072,060.300	
スウェーデン・クローナ　小計		4,453,662		558,560,587.110 (7,451,198,232)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,908	931.200	10,157,529.600	
	A P MOLLER A/S	557	15,455.000	8,608,435.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	14,860.000	5,334,740.000	
	DANSKE BANK A/S	72,887	107.250	7,817,130.750	
	GENMAB A/S	7,409	2,699.000	19,996,891.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	396.000	9,448,164.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,314.000	1,147,122.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	190,848	768.500	146,666,688.000	
	GN STORE NORD A/S	15,343	205.300	3,149,917.900	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	114,856	168.480	19,350,938.880	
	COLOPLAST-B	14,743	868.000	12,796,924.000	
	DSV A/S	21,906	1,032.500	22,617,945.000	
	DEMANT A/S	11,367	220.500	2,506,423.500	
	TRYG A/S	46,469	168.750	7,841,643.750	
	PANDORA A/S	9,912	417.500	4,138,260.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	390.000	4,889,820.000	
	ORSTED A/S	20,956	707.100	14,817,987.600	
デンマーク・クローネ　小計		575,790		301,286,560.980 (5,802,779,164)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.675	1,261,317.170	
	FISHER & PAYKEL	60,887	20.050	1,220,784.350	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.130	1,123,664.940	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.010	377,632.340	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	5.050	667,392.850	
ニュージーランド・ドル　小計		639,257		4,650,791.650 (397,224,115)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	188.900	8,595,705.600	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	65.860	10,733,270.060	
	TELENOR ASA	93,511	105.600	9,874,761.600	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	316.600	3,541,171.000	
	ORKLA ASA	72,906	82.940	6,046,823.640	
	EQUINOR ASA	110,053	363.000	39,949,239.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	419.600	8,322,346.400	
	AKER BP ASA	33,719	338.800	11,423,997.200	
	SALMAR ASA	7,248	620.500	4,497,384.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	203.400	5,231,651.400	
	ADEVINTA ASA	24,382	80.200	1,955,436.400	
	DNB BANK ASA	105,251	183.750	19,339,871.250	
ノルウェー・クローネ　小計		712,285		129,511,657.550 (1,826,114,371)	
ユーロ	CRH PLC	85,408	35.615	3,041,805.920	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19,953	119.700	2,388,374.100	
	KERRY GROUP PLC-A	18,268	96.320	1,759,573.760	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	56.600	987,726.600	
	UMICORE	24,290	31.170	757,119.300	
	AIR LIQUIDE	60,479	122.300	7,396,581.700	
	AIRBUS SE	68,898	94.900	6,538,420.200	
	AXA SA	216,226	25.375	5,486,734.750	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	72,439	22.250	1,611,767.750	
	ADIDAS AG	20,853	136.600	2,848,519.800	
	ASSICURAZIONI GENERALI	137,318	15.270	2,096,845.860	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	128.500	400,920.000	
	DANONE	76,193	50.100	3,817,269.300	
	SAFRAN SA	38,630	101.680	3,927,898.400	
	INTESA SANPAOLO	1,851,944	1.920	3,555,732.480	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	39,096	74.680	2,919,689.280	
	ACCOR SA	18,305	25.030	458,174.150	
	BOUYGUES	30,492	30.370	926,042.040	
	BNP PARIBAS	130,359	50.360	6,564,879.240	
	THALES SA	12,886	115.450	1,487,688.700	
	CAPGEMINI SA	18,395	171.200	3,149,224.000	
	UNICREDIT SPA	241,149	10.964	2,643,957.630	
	D'IETEREN TRDG	2,736	153.100	418,881.600	
	KONINKLIJKE DSM NV	20,593	120.550	2,482,486.150	
	COMMERZBANK AG	112,781	7.984	900,443.500	
	EIFFAGE	8,993	90.960	818,003.280	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	25.500	1,248,174.000	
	UNITED INTERNET	10,010	22.200	222,222.000	
	PUBLICIS GROUPE	26,472	52.840	1,398,780.480	
	IBERDROLA SA	698,810	10.525	7,354,975.250	
	ENI SPA	278,442	11.540	3,213,220.680	
	JERONIMO MARTINS	34,644	22.600	782,954.400	
	KESKO OYJ-B	35,252	20.770	732,184.040	
	KBC GROUPE	28,279	55.200	1,561,000.800	
	HANNOVER RUECK SE	7,105	161.550	1,147,812.750	

WARTSILA OYJ	50,956	7.724	393,584.140	
L'OREAL	27,890	342.750	9,559,297.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	31,922	641.400	20,474,770.800	
GEA GROUP AG	17,490	32.900	575,421.000	
BOLLORE	114,808	4.780	548,782.240	
MEDIOBANCA SPA	60,688	8.528	517,547.260	
MICHELIN(CGDE)-B	77,776	24.200	1,882,179.200	
CONTINENTAL AG	12,921	55.840	721,508.640	
DEUTSCHE POST AG-REG	111,656	35.770	3,993,935.120	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	17.940	399,900.540	
OMV AG	17,258	39.130	675,305.540	
VERBUND AG	7,320	92.050	673,806.000	
PERNOD-RICARD	23,542	187.100	4,404,708.200	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	16,854	67.000	1,129,218.000	
RENAULT SA	19,671	31.450	618,652.950	
REPSOL SA	161,783	12.330	1,994,784.390	
REMY COINTREAU	2,866	173.100	496,104.600	
MERCK KGAA	15,234	173.000	2,635,482.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	56,977	40.815	2,325,516.250	
RWE AG	76,569	40.770	3,121,718.130	
SEB SA	2,596	69.350	180,032.600	
SOCIETE GENERALE-A	90,814	24.510	2,225,851.140	
VINCI S.A.	62,039	94.860	5,885,019.540	
SODEXO	9,822	82.620	811,493.640	
SOFINA	1,449	184.000	266,616.000	
SOLVAY SA	9,070	81.060	735,214.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	63,417	124.680	7,906,831.560	
VIVENDI SE	76,073	8.512	647,533.370	
SAP SE	120,929	84.990	10,277,755.710	
TELEFONICA S.A	614,947	3.901	2,398,908.240	
TOTALENERGIES SE	285,560	50.030	14,286,566.800	
VALEO	26,570	19.005	504,962.850	
E.ON SE	256,515	8.708	2,233,732.620	
VOEST-ALPINE AG	10,593	19.350	204,974.550	
HENKEL AG & CO KGAA	14,601	60.300	880,440.300	
SIEMENS AG-REG	88,927	102.020	9,072,332.540	
UPM-KYMMENE OYJ	62,233	34.560	2,150,772.480	
ING GROEP NV-CVA	470,393	9.940	4,675,706.420	
PUMA AG	10,980	57.300	629,154.000	
BAYER AG	114,709	53.120	6,093,342.080	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	14.210	831,782.350	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	62.440	1,226,571.360	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	89,877	57.550	5,172,421.350	
BASF SE	104,334	42.255	4,408,633.170	

BEIERSDORF AG	10,944	103.800	1,135,987.200	
HEIDELBERGCEMENT AG	20,187	46.080	930,216.960	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	33.590	801,289.450	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	265.150	1,375,598.200	
ORANGE	228,746	10.148	2,321,314.400	
SAMPO OYJ-A SHS	59,280	46.470	2,754,741.600	
RANDSTAD NV	11,897	47.630	566,654.110	
ALLIANZ SE	47,101	173.520	8,172,965.520	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.900	1,557,984.400	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	124,059	27.650	3,430,231.350	
HERMES INTL	3,559	1,245.500	4,432,734.500	
ENDESA S.A.	37,701	17.520	660,521.520	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	6.246	451,848.130	
ERSTE GROUP BANK AG	38,446	26.700	1,026,508.200	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,818	261.900	4,142,734.200	
ARCELOR MITTAL (NL)	67,059	22.000	1,475,298.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	75,193	36.410	2,737,777.130	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	23.290	548,968.590	
RHEINMETALL STAMM	4,693	144.700	679,077.100	
HEINEKEN NV	29,630	91.440	2,709,367.200	
AKZO NOBEL	19,812	60.160	1,191,889.920	
ASML HOLDING NV	46,889	467.450	21,918,263.050	
AEGON NV	196,332	4.672	917,263.100	
VOLKSWAGEN AG	3,315	197.300	654,049.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	20,739	149.300	3,096,332.700	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	776,249	4.987	3,871,153.760	
KERING	8,379	504.200	4,224,691.800	
ACCIONA S.A.	2,642	203.200	536,854.400	
FORTUM OYJ	54,194	10.235	554,675.590	
AGEAS	18,136	39.660	719,273.760	
UCB SA	13,322	68.800	916,553.600	
NEMETSCHEK SE	5,104	52.000	265,408.000	
CARREFOUR SA	64,831	16.300	1,056,745.300	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.420	467,026.340	
NOKIA OYJ	636,441	4.909	3,124,288.860	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	101,426	17.814	1,806,802.760	
WOLTERS KLUWER-CVA	30,322	100.500	3,047,361.000	
SANOFI	129,197	81.600	10,542,475.200	
STMICROELECTRONICS NV	82,664	35.760	2,956,064.640	
ELISA OYJ	14,618	51.180	748,149.240	
BANCO SANTANDER SA	1,937,631	2.676	5,185,100.550	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	17.755	870,190.300	
QIAGEN N.V.	27,412	44.970	1,232,717.640	

DEUTSCHE BANK AG-REG	226,269	9.232	2,088,915.400	
BMW VORZUG	7,821	69.900	546,687.900	
ENEL SPA	965,680	4.897	4,728,934.960	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	376,483	19.086	7,185,554.530	
SARTORIUS AG	2,847	419.400	1,194,031.800	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	34.590	381,596.880	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	148,000	24.450	3,618,600.000	
RATIONAL AG	516	446.000	230,136.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	116.250	565,672.500	
BECHTLE AG	8,139	40.060	326,048.340	
KONINKLIJKE KPN NV	358,749	3.088	1,107,816.910	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	67.560	998,469.240	
TELEPERFORMANCE	6,746	288.800	1,948,244.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	21,263	172.200	3,661,488.600	
EURAZEO	5,673	57.200	324,495.600	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	75.180	850,887.240	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	72.450	786,299.850	
INDITEX	126,694	22.420	2,840,479.480	
ESSILORLUXOTTICA	33,593	149.100	5,008,716.300	
SNAM SPA	210,122	4.794	1,007,324.860	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	9.651	1,387,041.720	
ENAGAS	24,864	17.490	434,871.360	
WENDEL	2,354	76.250	179,492.500	
TENARIS SA	55,855	13.930	778,060.150	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.199	180,748.910	
ATLANTIA SPA	55,336	22.830	1,263,320.880	
PROXIMUS	14,640	11.840	173,337.600	
TERNA SPA	166,064	7.116	1,181,711.420	
BIOMERIEUX	4,870	88.040	428,754.800	
GRIFOLS SA	31,982	12.050	385,383.100	
FERROVIAL SA	55,374	25.070	1,388,226.180	
NESTE OYJ	45,715	44.530	2,035,688.950	
RECORDATI SPA	10,908	40.160	438,065.280	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.180	530,374.500	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	161.650	971,193.200	
KONE OYJ	39,178	40.720	1,595,328.160	
ELIA GROUP	4,078	136.800	557,870.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	367.000	1,141,003.000	
ENGIE	206,708	12.942	2,675,214.930	
ALSTOM	37,007	20.410	755,312.870	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	11.915	774,617.980	
IPSEN SA	3,873	101.700	393,884.100	
ARKEMA SA	6,392	80.780	516,345.760	
LEGRAND SA	30,081	71.080	2,138,157.480	
AMPLIFON SPA	12,300	24.960	307,008.000	
ADP	3,975	133.650	531,258.750	
ORION OYJ	13,559	44.820	607,714.380	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.390	617,228.340	
SYMRISE AG	15,064	99.740	1,502,483.360	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,552	33.470	855,225.440	
PRYSMIAN SPA	30,728	32.050	984,832.400	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	129.550	314,676.950	
CAIXABANK	498,058	3.623	1,804,464.130	
BUREAU VERITAS SA	31,295	24.500	766,727.500	
GETLINK	44,292	17.900	792,826.800	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	24.320	718,923.520	
AMADEUS IT GROUP SA	51,056	52.040	2,656,954.240	
BRENNTAG SE	17,934	66.780	1,197,632.520	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	18.320	452,265.840	
EDENRED	26,160	51.160	1,338,345.600	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.492	262,841.200	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	66.480	545,734.320	
KION GROUP AG	7,874	22.180	174,645.320	
VONOVIA SE	87,610	24.320	2,130,675.200	
KNORR-BREMSE AG	7,195	45.550	327,732.250	
OCI NV	12,329	38.340	472,693.860	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	30,120	46.460	1,399,375.200	
FERRARI NV	14,074	199.400	2,806,355.600	
CNH INDUSTRIAL NV	112,387	12.355	1,388,541.380	
AROUNDTOWN SA	113,225	2.649	299,933.020	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,858	32.390	286,910.620	
MONCLER SPA	25,014	44.050	1,101,866.700	
NEXI SPA	58,847	8.948	526,562.950	
PROSUS NV	93,541	59.080	5,526,402.280	
JDE PEET'S BV	7,893	29.860	235,684.980	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	13.025	605,766.700	
EURONEXT NV	10,081	69.340	699,016.540	
IMCD NV	6,823	127.450	869,591.350	
WORLDLINE SA	24,912	44.920	1,119,047.040	
NN GROUP NV	31,214	41.500	1,295,381.000	
FINECOBANK SPA	75,180	12.800	962,304.000	
ARGENX SE	6,581	381.100	2,508,019.100	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	82,533	19.580	1,615,996.140	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	47,088	25.650	1,207,807.200	
ZALANDO SE	24,405	21.920	534,957.600	
STELLANTIS NV	245,839	13.684	3,364,060.870	
AENA SME SA	8,494	118.650	1,007,813.100	
CELLNEX TELECOM SAU	64,910	36.810	2,389,337.100	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	17.334	392,961.780	
ABN AMRO BANK NV	52,835	10.680	564,277.800	
EXOR NV	14,142	65.080	920,361.360	
SCOUT24 SE	10,048	56.740	570,123.520	
COVESTRO AG	20,258	29.720	602,067.760	

	HELLOFRESH SE	17,856	25.120	448,542.720	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	97,316	49.250	4,792,813.000	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	8.402	494,785.370	
	AMUNDI SA	6,292	49.980	314,474.160	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.870	413,345.730	
	ADYEN NV	2,458	1,393.000	3,423,994.000	
	UNIPER SE	11,072	3.918	43,380.090	
	DELIVERY HERO SE	17,246	45.280	780,898.880	
ユーロ　小計		20,736,751		466,290,157.010 (66,777,413,385)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	13.400	3,443,800.000	
	CLP HOLDINGS LTD	197,296	65.350	12,893,293.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	57,314	43.150	2,473,099.100	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	141,891	303.600	43,078,107.600	
	MTR CORP	192,441	40.150	7,726,506.150	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	120.200	11,430,539.200	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	24.750	4,231,557.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	43.150	6,529,458.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,245,406	7.240	9,016,739.440	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	43.000	11,218,872.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	26.000	10,919,870.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	26.100	4,517,022.600	
	SINO LAND CO	411,200	11.340	4,663,008.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	161,065	95.050	15,309,228.250	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	55.050	2,918,751.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	159,156	88.800	14,133,052.800	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	14.040	2,499,120.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	233,000	14.420	3,359,860.000	
	AIA GROUP LTD	1,379,716	71.500	98,649,694.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	10.380	4,807,351.680	
	SANDS CHINA LTD	260,600	17.340	4,518,804.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	17.100	2,394,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	114,400	18.300	2,093,520.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	36.800	7,217,768.000	
	ESR GROUP LTD	216,400	21.900	4,739,160.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	6.140	1,513,510.000	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	161,300	21.800	3,516,340.000	
	WH GROUP LTD	931,500	5.360	4,992,840.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	48.250	14,978,971.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	221,695	52.750	11,694,411.250	
香港・ドル　小計		9,199,969		331,478,254.920 (6,042,848,587)	
合計		126,903,268		750,270,963,911 (750,270,963,911)	

（２）株式以外の有価証券

2022年9月16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	910,500.240	
		GOODMAN GROUP	201,797.000	3,690,867.130	
		GPT GROUP	219,223.000	894,429.840	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	900,228.160	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,799,207.660	
		STOCKLAND	259,328.000	899,868.160	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	719,009.040	
	オーストラリア・ドル　小計		2,255,175.000	9,814,110.230 (941,565,736)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	440,678.000	1,251,525.520	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	568,831.000	1,183,168.480	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	805,970.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	206,400.000	390,096.000	
	シンガポール・ドル　小計		1,690,009.000	3,630,760.000 (369,066,754)	
投資信託受益証券　合計			3,945,184	1,310,632,490 (1,310,632,490)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,454.000	2,784,524.060	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	34,348.000	1,223,819.240	
		AMERICAN TOWER CORP	52,422.000	12,846,535.320	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	181,793.000	1,116,209.020	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,391.000	3,098,516.120	
		BOSTON PROPERTIES INC	18,438.000	1,526,113.260	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,279.000	1,456,457.270	
		CROWN CASTLE INC	49,865.000	8,058,184.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	32,050.000	3,586,074.500	
		DUKE REALTY TRUST	42,490.000	2,339,924.300	
		EQUINIX INC	10,561.000	6,508,955.520	

	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,446,106.740	
	EQUITY RESIDENTIAL	41,966.000	3,060,580.380	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,316.000	1,908,963.880	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,919.000	2,784,631.350	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30,095.000	1,435,531.500	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42,371.000	973,685.580	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62,566.000	1,607,946.200	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,427,102.950	
	INVITATION HOMES INC	69,205.000	2,574,426.000	
	IRON MOUNTAIN INC	34,514.000	1,846,499.000	
	KIMCO REALTY	71,517.000	1,478,971.560	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	990,156.630	
	MID AMERICA	13,977.000	2,319,063.840	
	PROLOGIS INC	85,280.000	9,911,241.600	
	PUBLIC STORAGE	17,682.000	5,546,136.120	
	REALTY INCOME CORP	69,294.000	4,395,318.420	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,128,727.950	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,240.000	3,763,800.000	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,061.000	3,689,051.940	
	SUN COMMUNITIES INC	14,616.000	2,224,701.360	
	UDR INC	34,650.000	1,555,092.000	
	VENTAS INC	47,447.000	2,246,140.980	
	VICI PROPERTIES INC	111,902.000	3,705,075.220	
	VORNADO REALTY TRUST	16,223.000	426,502.670	
	WELLTOWER INC	52,826.000	3,842,563.240	
	WEYERHAEUSER CO	83,741.000	2,623,605.530	
	WP CAREY INC	21,266.000	1,774,860.360	
アメリカ・ドル　小計		1,650,604.000	115,231,795.610 (16,490,822,271)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	486,330.210	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	476,736.920	
	SEGRO PLC	139,569.000	1,224,578.400	
イギリス・ポンド　小計		335,772.000	2,187,645.530 (359,277,025)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	383,768.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	289,056.960	
カナダ・ドル　小計		23,146.000	672,824.960 (72,759,291)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	269,764.500	
	GECINA SA	5,045.000	445,473.500	
	KLEPIERRE	25,279.000	512,405.330	

		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	695,292.950	
		WAREHOUSES DE PAUW	16,790.000	476,500.200	
	ユーロ　小計		65,715.000	2,399,436.480 (343,623,298)	
	香港・ドル	LINK REIT	233,616.000	14,273,937.600	
	香港・ドル　小計		233,616.000	14,273,937.600 (260,213,882)	
投資証券　合計			2,308,853	17,526,695,767 (17,526,695,767)	
合計				18,837,328,257 (18,837,328,257)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率(%)	組入投資信託受益証券時価比率(%)	組入投資証券時価比率(%)	有価証券の合計金額に対する比率(%)
アメリカ・ドル	株式　602銘柄	71.32	－	－	74.43
	投資証券　38銘柄	－	－	2.12	
イギリス・ポンド	株式　79銘柄	4.28	－	－	4.39
	投資証券　3銘柄	－	－	0.05	
イスラエル・シュケル	株式　10銘柄	0.16	－	－	0.16
オーストラリア・ドル	株式　52銘柄	2.13	－	－	2.28
	投資信託受益証券　7銘柄	－	0.12	－	
カナダ・ドル	株式　86銘柄	3.73	－	－	3.79
	投資証券　2銘柄	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式　14銘柄	0.32	－	－	0.38
	投資信託受益証券　4銘柄	－	0.05	－	
スイス・フラン	株式　41銘柄	2.97	－	－	3.01
スウェーデン・クローナ	株式　46銘柄	0.96	－	－	0.97
デンマーク・クローネ	株式　17銘柄	0.74	－	－	0.75
ニュージーランド・ドル	株式　5銘柄	0.05	－	－	0.05
ノルウェー・クローネ	株式　12銘柄	0.23	－	－	0.24
ユーロ	株式　223銘柄	8.57	－	－	8.73
	投資証券　5銘柄	－	－	0.04	
香港・ドル	株式　30銘柄	0.78	－	－	0.82
	投資証券　1銘柄	－	－	0.03	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年9月16日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,436,650,188
国債証券	653,364,088,200
地方債証券	32,667,067,787
特殊債券	30,254,682,057
社債券	25,972,912,850
未収利息	989,646,741
前払費用	638,068,082
流動資産合計	749,323,115,905
資産合計	749,323,115,905
負債の部	
流動負債	
未払解約金	108,933,000
流動負債合計	108,933,000
負債合計	108,933,000
純資産の部	
元本等	
元本	591,725,550,821
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	157,488,632,084
元本等合計	749,214,182,905
純資産合計	749,214,182,905
負債純資産合計	749,323,115,905

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9月16日 至　2022年9月16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9月16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	355,207,705,009円
同期中追加設定元本額	1,030,916,039,999円
同期中一部解約元本額	794,398,194,187円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	25,500,013,422円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	127,131,638円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	153,384,977円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	125,181,990円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	687,572,696円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	120,288,329円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	38,934,101円
たわらノーロード　国内債券	17,048,759,735円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,361,628,753円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,086,408,970円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,890,323,699円
たわらノーロード　バランス（積極型）	241,927,111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）	119,905,092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）	1,431,757,955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）	1,527,346,156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）	440,619,428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）	80,946,010円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	22,441,970円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	17,277,600円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	139,270,062円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,885,176円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	905,004円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,001,831,223円
Ｏｎｅグローバルバランス	19,073,036円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	9,508,774,217円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	13,333,126,253円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	5,594,687,602円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,303,612,007円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,407,522,241円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	408,535,624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＞	3,496,577,883円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	13,441,521円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	4,524,247,811円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,909,912,404円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	370,895,676円
投資のソムリエ	168,233,210,842円
クルーズコントロール	1,411,350,524円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	11,253,999,758円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	5,294,282,131円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,112,777,138円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	13,170,912,203円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	62,495,035,599円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	279,394,477円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	140,050,689円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	89,497,775円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,567,049,310円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,132,804,142円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	7,237,155,533円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,222,800,879円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	409,600,926円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	144,925,960円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	94,322,835円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	940,386,326円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	17,395,636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）	1,955,184,956円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	2,002,989,505円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,531,680,702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）	1,223,907,947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）	1,933,997,843円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	5,002,180,152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）	1,904,753,092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）	1,744,771,423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）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	1,960,749,140円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	9,131,747,461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）	2,249,449,034円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	4,252,578,022円
ＡＭＯｎｅ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）（適格機関投資家限定）	583,158,520円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	268,546,563円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	4,870,266,482円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	4,881,603,781円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	4,838,160,658円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	3,316,444,550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）	111,628,544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）	513,360,115円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	160,877,352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）	154,189,522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）	99,305,688円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,700,097円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	95,341,422円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,083,809円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,242,951円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,490,834円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,772,304円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,287,372,011円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,192,112,675円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,267,355,531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）	65,365,286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）	160,133,115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）	1,963,871,639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）	164,126,081円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,128,550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）	2,073,558,251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）	44,506,280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）	317,789,762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）	469,729,153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）	896,432,516円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	281,741,307円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	98,661,116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＞	477,369,641円
コア資産形成ファンド	319,418,088円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	45,290,602,222円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	63,728,642,034円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	13,101,605,566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］	2,192,575,940円
計	591,725,550,821円
２．　受益権の総数	591,725,550,821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9月16日 至　2022年9月16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9月16日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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9月16日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△6,972,055,150
地方債証券	△416,720,057
特殊債券	△555,334,133
社債券	△434,181,190
合計	△8,378,290,530

（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9月16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9月16日現在
1口当たり純資産額	1.2662円

（1万口当たり純資産額）	(12,662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9月16日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４３２回　利付国庫債券（２年）	2,800,000,000	2,804,648,000	
	４３３回　利付国庫債券（２年）	3,400,000,000	3,405,338,000	
	４３４回　利付国庫債券（２年）	3,500,000,000	3,505,565,000	
	４３５回　利付国庫債券（２年）	3,720,000,000	3,725,952,000	
	４３６回　利付国庫債券（２年）	6,700,000,000	6,710,787,000	
	４３７回　利付国庫債券（２年）	3,850,000,000	3,855,852,000	
	４３８回　利付国庫債券（２年）	3,800,000,000	3,805,738,000	
	４３９回　利付国庫債券（２年）	3,100,000,000	3,104,898,000	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	5,000,000,000	5,013,750,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	4,050,000,000	4,062,109,500	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	6,190,000,000	6,209,993,700	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	6,410,000,000	6,433,076,000	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	3,230,000,000	3,242,726,200	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	3,100,000,000	3,113,175,000	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	6,700,000,000	6,730,418,000	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	5,550,000,000	5,576,640,000	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	6,000,000,000	6,030,240,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	7,480,000,000	7,493,090,000	
	１４８回　利付国庫債券（５年）	6,290,000,000	6,299,435,000	
	１４９回　利付国庫債券（５年）	7,650,000,000	7,657,650,000	

１５０回　利付国庫債券（５年）	6,640,000,000	6,641,394,400	
１５１回　利付国庫債券（５年）	4,840,000,000	4,835,644,000	
１５２回　利付国庫債券（５年）	3,130,000,000	3,140,516,800	
１５３回　利付国庫債券（５年）	4,500,000,000	4,490,370,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	139,444,800	
２回　利付国庫債券（４０年）	630,000,000	769,803,300	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	661,899,600	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	882,252,000	
５回　利付国庫債券（４０年）	1,010,000,000	1,189,911,300	
６回　利付国庫債券（４０年）	1,720,000,000	1,979,960,800	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,690,000,000	1,863,968,600	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,550,000,000	1,589,029,000	
９回　利付国庫債券（４０年）	2,830,000,000	2,133,593,600	
１０回　利付国庫債券（４０年）	2,530,000,000	2,240,947,500	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,820,000,000	1,555,517,600	
１２回　利付国庫債券（４０年）	2,210,000,000	1,688,771,500	
１３回　利付国庫債券（４０年）	2,680,000,000	2,036,826,800	
１４回　利付国庫債券（４０年）	2,570,000,000	2,088,639,000	
１５回　利付国庫債券（４０年）	1,200,000,000	1,068,408,000	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	11,310,000,000	11,411,790,000	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	4,330,000,000	4,375,378,400	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	6,520,000,000	6,598,174,800	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	7,910,000,000	8,001,835,100	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,038,850,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	4,800,000,000	4,840,512,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	4,630,000,000	4,684,402,500	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	5,580,000,000	5,651,424,000	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	7,540,000,000	7,644,202,800	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	6,720,000,000	6,797,616,000	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	7,880,000,000	7,919,951,600	

３４３回　利付国庫債券（１０年）	7,850,000,000	7,889,721,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	7,830,000,000	7,867,584,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	9,090,000,000	9,128,541,600	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	7,570,000,000	7,595,435,200	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	7,310,000,000	7,329,006,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	6,590,000,000	6,603,114,100	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	7,230,000,000	7,239,399,000	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	8,660,000,000	8,664,676,400	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	5,900,000,000	5,898,289,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	5,990,000,000	5,982,812,000	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	7,240,000,000	7,224,289,200	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	7,060,000,000	7,037,266,800	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	6,910,000,000	6,880,010,600	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	6,940,000,000	6,903,981,400	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	6,810,000,000	6,761,308,500	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	6,750,000,000	6,687,765,000	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	7,600,000,000	7,519,060,000	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	7,840,000,000	7,747,723,200	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	5,800,000,000	5,725,006,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	5,840,000,000	5,759,933,600	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	6,000,000,000	5,912,820,000	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	6,800,000,000	6,704,256,000	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	7,540,000,000	7,451,178,800	
３６６回　利付国庫債券（１０年）	4,100,000,000	4,105,699,000	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	5,490,000,000	5,463,867,600	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	130,057,400	

２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	116,083,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	242,710,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	238,748,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	229,614,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	284,810,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	272,055,500	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	176,025,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	414,963,200	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	320,902,400	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	296,858,400	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	331,506,000	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	486,968,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	341,216,400	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	411,064,500	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	379,102,100	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	362,639,200	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	438,354,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	338,658,300	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	405,504,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	770,883,200	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	781,572,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	971,901,700	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,073,443,400	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,086,606,400	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	878,068,800	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,197,901,500	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,400,589,200	

３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,464,768,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,733,224,400	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	2,103,379,500	
３７回　利付国庫債券（３０年）	2,660,000,000	3,113,476,800	
３８回　利付国庫債券（３０年）	1,650,000,000	1,900,371,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,480,000,000	1,731,185,600	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,620,000,000	1,864,328,400	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,880,000,000	2,127,408,000	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,960,000,000	2,216,466,000	
４３回　利付国庫債券（３０年）	2,120,000,000	2,395,769,600	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,450,000,000	1,637,456,000	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,540,000,000	1,677,075,400	
４６回　利付国庫債券（３０年）	2,690,000,000	2,926,235,800	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,760,000,000	1,948,478,400	
４８回　利付国庫債券（３０年）	2,440,000,000	2,598,209,600	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,810,000,000	1,924,772,100	
５０回　利付国庫債券（３０年）	2,260,000,000	2,119,563,600	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,650,000,000	1,371,744,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	2,310,000,000	2,008,683,600	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,870,000,000	1,660,803,100	
５４回　利付国庫債券（３０年）	2,050,000,000	1,901,949,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,720,000,000	1,591,756,800	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,480,000,000	1,366,143,600	
５７回　利付国庫債券（３０年）	1,570,000,000	1,444,101,700	
５８回　利付国庫債券（３０年）	2,370,000,000	2,172,199,800	

５９回　利付国庫債券（３０年）	1,570,000,000	1,400,424,300	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,470,000,000	1,371,730,500	
６１回　利付国庫債券（３０年）	2,140,000,000	1,896,125,600	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	1,483,614,000	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,810,000,000	1,469,195,100	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,670,000,000	1,350,712,700	
６５回　利付国庫債券（３０年）	1,950,000,000	1,576,243,500	
６６回　利付国庫債券（３０年）	1,630,000,000	1,318,164,700	
６７回　利付国庫債券（３０年）	2,450,000,000	2,076,963,000	
６８回　利付国庫債券（３０年）	2,410,000,000	2,040,643,400	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,970,000,000	1,713,387,800	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,790,000,000	1,552,144,800	
７１回　利付国庫債券（３０年）	2,240,000,000	1,940,444,800	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,800,000,000	1,556,154,000	
７３回　利付国庫債券（３０年）	2,250,000,000	1,943,302,500	
７４回　利付国庫債券（３０年）	1,900,000,000	1,772,795,000	
７５回　利付国庫債券（３０年）	1,550,000,000	1,554,991,000	
６５回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	61,516,200	
６７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,498,000	
７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,175,000	
７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,599,600	
７２回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	480,083,600	
７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	397,765,000	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,960,000	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	189,765,000	

７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	73,447,500	
７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,070,000	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	263,522,500	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,842,000	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	95,363,100	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	424,764,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	149,087,400	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	74,909,800	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	181,371,300	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	634,309,000	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	129,852,000	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	129,432,000	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	641,695,800	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,838,700	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	511,768,900	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	120,215,700	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,263,506,800	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	402,815,300	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	732,430,600	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	608,613,500	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	131,652,000	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	730,402,200	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	176,270,400	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	829,410,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	926,022,700	

１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	259,124,900	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	565,720,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	180,116,800	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	122,573,000	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	715,699,200	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	562,120,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	673,266,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	765,706,800	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	389,651,500	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	495,514,800	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	522,817,600	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	836,111,200	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,170,000,000	1,326,663,000	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	820,000,000	931,995,600	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	411,742,800	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	607,830,500	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,219,232,900	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	630,013,800	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	526,367,100	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	740,149,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	893,284,600	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	640,041,600	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,207,489,500	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	685,140,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	697,332,000	

１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	584,245,800	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	614,120,400	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,562,841,200	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	860,472,000	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,034,151,300	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	890,819,800	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	939,643,000	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,175,384,500	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,028,916,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	839,137,800	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	404,892,000	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	880,000,000	999,996,800	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	920,000,000	1,027,962,000	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	1,000,000,000	1,126,850,000	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	2,790,000,000	3,173,820,300	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	3,580,000,000	4,074,290,600	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	2,510,000,000	2,881,505,100	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	2,220,000,000	2,504,737,200	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	2,650,000,000	2,963,018,000	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	3,550,000,000	4,044,302,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	3,980,000,000	4,537,080,600	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	4,090,000,000	4,620,800,200	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	3,900,000,000	4,366,674,000	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	3,160,000,000	3,540,084,800	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	4,250,000,000	4,712,357,500	

１５１回　利付国庫債券（２０年）	4,460,000,000	4,839,902,800	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	3,540,000,000	3,838,209,600	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	4,220,000,000	4,624,571,400	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	3,990,000,000	4,320,372,000	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	3,360,000,000	3,551,083,200	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	3,700,000,000	3,618,896,000	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	3,230,000,000	3,065,883,700	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	4,290,000,000	4,231,827,600	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	3,880,000,000	3,869,834,400	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	2,700,000,000	2,723,274,000	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	3,190,000,000	3,166,394,000	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	3,530,000,000	3,493,923,400	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	3,070,000,000	3,029,783,000	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	3,030,000,000	2,937,069,900	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	2,490,000,000	2,405,688,600	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	2,340,000,000	2,323,269,000	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	2,770,000,000	2,658,119,700	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	2,170,000,000	2,042,013,400	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	2,500,000,000	2,305,150,000	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	2,520,000,000	2,314,116,000	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	2,440,000,000	2,231,380,000	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	2,460,000,000	2,280,961,200	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	3,620,000,000	3,345,531,600	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	3,690,000,000	3,398,932,800	
１７５回　利付国庫債券（２０年）	3,530,000,000	3,298,326,100	

	１７６回　利付国庫債券（２０年）	3,280,000,000	3,054,992,000	
	１７７回　利付国庫債券（２０年）	3,330,000,000	3,036,094,200	
	１７８回　利付国庫債券（２０年）	3,200,000,000	2,965,824,000	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	3,460,000,000	3,198,804,600	
	１８０回　利付国庫債券（２０年）	3,000,000,000	2,925,960,000	
	１８１回　利付国庫債券（２０年）	2,300,000,000	2,280,864,000	
国債証券　合計		647,275,000,000	653,364,088,200	
地方債証券	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	403,628,000	
	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,839,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	109,968,100	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	196,496,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	393,564,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	295,167,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	235,772,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	117,641,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	105,181,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	106,338,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	217,678,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	326,886,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	112,467,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	113,308,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,897,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	398,412,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	97,995,000	
	２９回１号　宮城県公募公債　１０年	100,000,000	100,742,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	245,327,500	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	302,772,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	101,238,000	
	２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	198,532,000	
	２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	196,932,000	
	３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	125,726,000	
	１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	112,020,000	
	１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	341,829,000	

１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	113,315,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,677,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	100,233,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	194,844,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	196,230,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	195,460,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	194,864,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	225,112,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	106,772,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	97,816,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	298,557,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	353,475,500	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	109,299,387	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	393,656,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	197,188,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	202,056,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	196,454,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	98,249,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	122,776,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	212,156,000	
１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	305,694,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	318,378,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	104,892,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	102,537,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	196,632,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	98,209,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	195,960,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	105,952,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	106,367,000	

８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	207,032,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	106,382,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	337,194,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	341,208,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	119,253,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	161,883,000	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	101,314,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	198,014,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	234,693,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	100,081,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	197,180,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	89,704,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	92,026,000	
２５年度８回　埼玉県公募公債	100,000,000	100,883,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	404,328,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	197,120,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	187,902,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	240,666,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	113,470,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	111,590,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	333,243,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	106,598,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	201,976,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	100,531,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	199,332,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	196,602,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	98,137,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	105,868,000	
令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	159,330,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	111,070,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	113,748,000	

２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	335,238,000	
２７年度４回　千葉県公募公債	200,000,000	203,146,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	100,070,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	195,120,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	106,772,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	106,227,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	96,374,000	
２５年度２回　新潟県公募公債	100,000,000	100,957,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	196,758,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	110,867,000	
１２７回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,742,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,316,000	
１３２回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,986,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,590,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,340,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	608,166,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,165,000	
１５０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,167,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,322,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,020,400	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,888,000	
１６０回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,265,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,420,000	
１６９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,595,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,880,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,825,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,158,000	

１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,940,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,727,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,622,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	492,330,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,221,000	
２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	493,025,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	99,605,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	101,055,000	
２５年度２回　島根県公募公債	106,000,000	106,837,400	
令和元年度１回　島根県公募公債	200,000,000	188,230,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	196,200,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	101,049,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	100,693,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	199,700,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	294,975,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	224,112,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	455,080,500	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	195,966,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	110,751,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	106,987,000	
５回　京都市公募公債　３０年定時償還	200,000,000	185,674,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	109,680,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	228,402,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	225,158,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	101,056,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	300,246,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	169,212,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	393,064,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	122,352,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	111,193,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	110,867,000	

	２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	118,722,000	
	２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	100,905,000	
	２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	293,220,000	
	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	199,346,000	
	６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	225,396,000	
	５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	118,821,000	
	６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	110,912,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	110,754,000	
	２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	121,623,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	195,920,000	
	２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	90,607,000	
	２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	100,951,000	
	２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	196,012,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	300,402,000	
	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	98,427,000	
	令和３年度３回　仙台市公募公債　５年	300,000,000	298,518,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	197,014,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	196,200,000	
	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	100,990,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	100,955,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	198,464,000	
地方債証券　合計		32,145,330,000	32,667,067,787	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	210,550,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	208,882,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	300,678,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	452,140,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,879,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	83,900,000	
	３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,790,000	
	１回　高速道路機構債	300,000,000	404,352,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	195,490,500	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	252,194,000	
	３６回　高速道路機構債	300,000,000	397,209,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,420,000	

１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,577,000	
１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,871,000	
１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,594,000	
１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,551,000	
１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,219,000	
１６９回　高速道路機構債	100,000,000	98,985,000	
１７２回　高速道路機構債	200,000,000	188,692,000	
２１０回　高速道路機構債	100,000,000	97,151,000	
９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,988,000	
１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,389,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	558,270,000	
１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,442,000	
１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,013,000	
２０２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	105,847,350	
２１１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,986,000	
２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,143,000	
２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,308,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	321,318,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	505,590,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,437,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,238,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	209,138,000	
第２６２回　政保道路債	500,000,000	531,460,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,213,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,733,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,111,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	800,912,000	

３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	197,454,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	97,608,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	240,168,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	159,206,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	167,182,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	169,474,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	622,245,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	221,906,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	338,985,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	339,651,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	113,886,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,950,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	225,976,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	111,912,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	224,570,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,116,000	
Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	345,858,000	
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	547,577,180	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	111,033,000	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,246,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	547,215,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,980,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	215,548,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	322,128,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	399,780,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,024,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	98,611,000	

９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,580,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,119,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,973,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,076,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	265,830,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,785,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	223,548,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,928,930	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	106,499,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	105,035,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	207,562,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	168,152,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	108,633,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	101,101,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	224,712,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,655,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	398,573,000	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,834,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,185,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,227,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	288,405,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,496,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,304,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,946,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,691,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,078,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,190,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,605,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,605,000	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	19,132,000	19,151,514	

９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	29,364,000	29,394,244	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	30,867,000	31,168,261	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,064,000	48,066,463	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,507,000	10,614,801	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,520,000	51,049,448	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,063,000	30,320,639	
１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,185,000	49,238,119	
４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,233,000	10,324,585	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,047,000	17,896,963	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	105,305,000	111,433,751	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,400,000	169,460,316	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,458,000	23,526,776	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,277,000	20,168,946	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,734,000	23,694,966	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,823,000	24,831,665	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,554,000	30,740,297	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,520,000	75,091,559	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,688,000	33,893,533	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,694,000	39,783,236	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,244,000	40,373,049	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,049,000	44,262,981	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,084,000	46,056,011	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,241,000	50,539,933	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,609,000	57,379,448	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,607,000	59,813,132	

１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	219,345,000	216,291,717	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,396,000	73,838,030	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,123,000	73,661,213	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,159,000	73,637,662	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	231,951,000	229,536,390	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	232,206,000	229,637,801	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,072,000	155,292,374	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,112,000	232,966,988	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,154,000	233,086,359	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	406,905,000	403,173,680	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,472,000	80,650,762	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,877,000	82,192,749	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	267,621,000	261,238,239	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	357,316,000	349,887,400	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	275,349,000	270,745,164	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	282,732,000	278,284,625	
１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	857,979,000	841,291,308	
２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,503,000	
い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,086,000	
い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,926,000	
い第８５１号　利付商工債	300,000,000	298,977,000	
い第８５４号　利付商工債	300,000,000	298,584,000	
い第８５５号　利付商工債	200,000,000	199,010,000	
３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	399,292,000	
３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	298,866,000	
７回　広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	100,852,000	
１５回　国際協力機構債	100,000,000	112,305,000	
７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,590,000	
７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	297,123,000	
８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	299,262,000	

	８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	398,400,000	
	７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,007,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,878,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	196,056,000	
特殊債券　合計		29,364,038,000	30,254,682,057	
社債券	２５回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１７）	300,000,000	296,085,000	
	２６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,030,000	
	２回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,605,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	201,112,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	98,592,000	
	２５回　首都高速道路社債	100,000,000	99,847,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	398,716,000	
	１６回　成田国際空港社債	100,000,000	100,894,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	90,137,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	99,720,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	196,996,000	
	７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	298,488,000	
	８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,992,000	
	５６回　中日本高速道路社債	100,000,000	100,861,000	
	９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	198,902,000	
	９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	496,720,000	
	２５回　西日本高速道路社債	200,000,000	201,864,000	
	２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	101,305,000	
	３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	300,642,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	200,876,000	
	６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	496,715,000	
	２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	199,422,000	
	１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	100,944,000	
	９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	97,799,000	
	１２回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,451,000	
	１４回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,404,000	
	３０回　東レ社債	300,000,000	299,856,000	
	４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	199,350,000	
	４９回　住友化学社債	100,000,000	101,275,000	
	２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	197,306,000	

４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,418,000	
１７回　ダイセル社債	300,000,000	296,757,000	
１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	483,720,000	
４回　住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,652,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	298,470,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	298,251,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	100,658,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	98,170,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	195,714,000	
２９回　三菱重工業社債	100,000,000	100,971,000	
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	98,885,000	
１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	201,754,000	
２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	199,442,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	96,581,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	393,840,000	
４７回　住友商事社債	100,000,000	100,804,000	
４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	100,928,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	398,540,000	
１３回　新生銀行社債	200,000,000	199,256,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	109,142,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,427,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	297,615,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	201,430,000	
１１回　セブン銀行社債	200,000,000	201,532,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	296,784,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	298,569,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	394,848,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,509,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,698,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,732,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	194,514,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	291,528,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	98,363,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	198,242,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,260,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	194,664,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	298,557,000	

３回　野村ホールディングス社債	300,000,000	295,605,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	104,281,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	100,518,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	200,266,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	104,121,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	93,676,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,883,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	211,012,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	111,635,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	110,672,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	224,732,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	102,770,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,172,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,311,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,921,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	80,720,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,396,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	182,010,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	169,388,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,297,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	195,582,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	85,768,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	81,068,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,172,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	181,696,000	
１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	204,640,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,013,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,368,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	129,295,200	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	79,871,000	
６回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	195,130,000	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	390,984,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	188,552,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	96,564,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	193,100,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	101,573,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	298,116,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	389,988,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	183,830,000	
５４１回　関西電力社債	300,000,000	285,189,000	
３９６回　中国電力社債	200,000,000	195,106,000	
４２５回　中国電力社債	100,000,000	96,676,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	102,283,000	
３１１回　北陸電力社債	100,000,000	101,376,000	
４７１回　東北電力社債	400,000,000	404,816,000	
４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,157,000	

	５２１回　東北電力社債	400,000,000	388,736,000	
	５２５回　東北電力社債	200,000,000	196,330,000	
	５３６回　東北電力社債	300,000,000	285,438,000	
	４２４回　九州電力社債	200,000,000	202,402,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	404,604,000	
	４２８回　九州電力社債	100,000,000	101,209,000	
	４６３回　九州電力社債	100,000,000	95,363,000	
	４６６回　九州電力社債	100,000,000	94,102,000	
	４９１回　九州電力社債	300,000,000	286,917,000	
	４９２回　九州電力社債	100,000,000	89,686,000	
	４９３回　九州電力社債	200,000,000	197,316,000	
	３２１回　北海道電力社債	261,000,000	264,301,650	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	298,989,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	189,556,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	209,172,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	302,850,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	98,859,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	191,244,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	193,154,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	92,054,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	88,386,000	
	7回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,460,000	
	8回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	192,354,000	
社債券　合計		26,281,000,000	25,972,912,850	
合計			742,258,750,894	

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9月16日現在
資産の部	
流動資産	
預金	980,809,681
コール・ローン	737,777,082
国債証券	182,953,742,085
派生商品評価勘定	310,128
未収利息	952,551,424
前払費用	134,937,638
流動資産合計	185,760,128,038
資産合計	185,760,128,038
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	402,802
未払金	214,706,871
未払解約金	136,126,000
流動負債合計	351,235,673
負債合計	351,235,673
純資産の部	
元本等	
元本	87,114,523,685
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	98,294,368,680
元本等合計	185,408,892,365
純資産合計	185,408,892,365
負債純資産合計	185,760,128,038

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9月16日 至　2022年9月16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礎となる事項	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9月16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	71,978,913,518円
同期中追加設定元本額	53,629,465,238円
同期中一部解約元本額	38,493,855,071円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	7,932,847,249円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	9,798,805円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	35,910,385円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	113,845,344円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	52,979,460円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	27,275,789円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	35,097,785円
たわらノーロード　先進国債券	15,449,817,740円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	233,438,341円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,076,559,080円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	54,200,062円
たわらノーロード　バランス（標準型）	271,989,693円
たわらノーロード　バランス（積極型）	58,707,878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）	14,690,891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）	538,042,902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）	742,774,895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）	281,947,712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）	196,832,370円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,008,785円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	6,853,090円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	82,064,312円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,675,191円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,100,643円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,472,135,008円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	674,533,195円

Ｏｎｅグローバルバランス	8,375,044円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	705,257,749円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,217,676,675円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,470,641,221円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	402,643,176円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	825,504,815円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	714,984,230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＞	503,003,585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）	141,979,694円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	145,999,241円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	226,484,099円
クルーズコントロール	1,281,179,633円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	168,044,942円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	492,531,948円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	539,390,748円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	168,767,510円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	225,089,009円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,138,219,592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）	258,326,231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）	264,600,550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）	92,375,981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）	161,898,192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）	255,636,599円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	451,720,991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）	246,284,150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）	230,497,335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）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	330,326,593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）	5,013,613,157円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	2,610,280,121円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,559,035,426円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,286,659,111円
ＡＭＯｎｅ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）（適格機関投資家限定）	89,407,541円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,662,264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）	438,289,325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）	374,474,361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）	241,742,064円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,795,968円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	38,644,202円

ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,800,012円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	338,671円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,109,040円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	43,583,007円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,747,371,593円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,444,165,967円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,593,105,352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）	66,264,465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）	136,349,222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）	1,581,657,180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）	363,319,679円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	959,596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）	315,020,159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）	285,728,863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）	436,054,833円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,934,475円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	36,349,342円
コア資産形成ファンド	23,678,879円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	2,535,784,800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）	265,898,419円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	4,807,866,699円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,539,331,376円
計	87,114,523,685円
２．　受益権の総数	87,114,523,685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9月16日 至　2022年9月16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9月16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9月16日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△18,867,339,636
合計	△18,867,339,636

（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9月16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9月16日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	227,437,000	－	227,363,823	73,177
アメリカ・ドル	60,000,000	－	59,996,769	3,231
オフショア・人民元	146,212,000	－	146,139,001	72,999
ユーロ	21,225,000	－	21,228,053	△3,053
買建	396,853,702	－	396,687,851	△165,851
アメリカ・ドル	255,468,240	－	255,068,491	△399,749
ユーロ	141,385,462	－	141,619,360	233,898
合計	624,290,702	－	624,051,674	△92,674

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年9月16日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1283円 (21,283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9月16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	1,660,000.000	1,579,853.120	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,800,000.000	4,549,124.970	
		US T N/B 0.125 08/31/23	530,000.000	510,870.310	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,924,687.500	
		US T N/B 0.125 10/15/23	230,000.000	220,692.180	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,160,000.000	2,063,812.500	
		US T N/B 0.25 03/15/24	3,910,000.000	3,702,281.250	
		US T N/B 0.25 05/15/24	7,500,000.000	7,050,585.900	
		US T N/B 0.25 05/31/25	3,890,000.000	3,530,023.010	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,543,750.000	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,168,593.750	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,428,312.500	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,229,036.700	
		US T N/B 0.25 09/30/23	2,500,000.000	2,405,859.370	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,338,554.650	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,577,812.480	
		US T N/B 0.25 11/15/23	800,000.000	767,375.000	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,296,468.750	
		US T N/B 0.375 04/15/24	4,140,000.000	3,913,755.450	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,337,600.000	
		US T N/B 0.375 07/15/24	4,000,000.000	3,752,968.720	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,228,060.910	

		US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,833,820.290	
		US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,865,390.620	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,310,000.000	2,809,103.880	
		US T N/B 0.375 10/31/23	890,000.000	855,303.900	
		US T N/B 0.375 11/30/25	3,190,000.000	2,857,417.540	
		US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,680,781.250	
		US T N/B 0.5 02/28/26	3,370,000.000	3,007,593.310	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,628,742.160	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,048,383.600	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,707,672.630	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,394,057.790	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,621,200.770	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,118,434.370	
		US T N/B 0.5 11/30/23	3,000,000.000	2,879,296.860	
		US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,917,265.630	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,565,906.250	
		US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,456,679.660	
		US T N/B 0.625 08/15/30	8,100,000.000	6,507,843.740	
		US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,740,312.480	
		US T N/B 0.625 11/30/27	2,700,000.000	2,311,242.170	
		US T N/B 0.625 12/31/27	3,320,000.000	2,835,098.420	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,760,640.620	
		US T N/B 0.75 03/31/26	3,220,000.000	2,892,842.930	
		US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,317,136.690	
		US T N/B 0.75 05/31/26	3,630,000.000	3,246,297.630	
		US T N/B 0.75 08/31/26	2,950,000.000	2,622,273.430	
		US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,439,738.260	
		US T N/B 0.75 12/31/23	1,990,000.000	1,909,700.370	
		US T N/B 0.875 01/31/24	200,000.000	191,750.000	
		US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	2,969,302.720	
		US T N/B 0.875 09/30/26	3,110,000.000	2,773,366.770	
		US T N/B 0.875 11/15/30	4,180,000.000	3,419,762.500	
		US T N/B 1.0 07/31/28	3,770,000.000	3,242,494.510	
		US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,322,955.440	
		US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,580,337.500	
		US T N/B 1.125 02/15/31	7,890,000.000	6,565,342.900	
		US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,789,326.540	
		US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	983,855.460	
		US T N/B 1.125 02/29/28	3,860,000.000	3,379,309.370	
		US T N/B 1.125 05/15/40	2,300,000.000	1,513,328.110	
		US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	2,055,481.240	
		US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,225,284.370	
		US T N/B 1.125 10/31/26	3,390,000.000	3,048,483.970	
		US T N/B 1.25 03/31/28	3,610,000.000	3,176,235.930	
		US T N/B 1.25 04/30/28	4,010,000.000	3,519,088.260	
		US T N/B 1.25 05/15/50	4,370,000.000	2,590,419.920	
		US T N/B 1.25 05/31/28	5,400,000.000	4,730,484.340	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,245,380.450	
		US T N/B 1.25 08/15/31	8,130,000.000	6,757,427.270	

		US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,727,621.070	
		US T N/B 1.25 09/30/28	3,980,000.000	3,462,289.040	
		US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,339,828.120	
		US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,504,039.050	
		US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	707,695.300	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	2,987,821.040	
		US T N/B 1.375 08/31/23	370,000.000	361,183.590	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,003,750.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	1,830,000.000	1,781,462.100	
		US T N/B 1.375 10/31/28	3,210,000.000	2,810,254.680	
		US T N/B 1.375 11/15/31	7,990,000.000	6,684,758.550	
		US T N/B 1.375 11/15/40	3,190,000.000	2,164,215.620	
		US T N/B 1.375 12/31/28	3,500,000.000	3,059,492.170	
		US T N/B 1.5 01/31/27	5,940,000.000	5,403,775.760	
		US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,298,505.840	
		US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,241,603.120	
		US T N/B 1.5 02/29/24	4,000,000.000	3,862,031.240	
		US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,419,506.620	
		US T N/B 1.5 09/30/24	4,310,000.000	4,109,989.060	
		US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,626,528.100	
		US T N/B 1.5 11/30/24	2,300,000.000	2,184,640.620	
		US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,521,250.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	2,890,000.000	2,686,119.510	
		US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,398,764.050	
		US T N/B 1.625 05/15/31	7,750,000.000	6,689,218.750	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,494,390.600	
		US T N/B 1.625 09/30/26	2,150,000.000	1,979,931.610	
		US T N/B 1.625 10/31/23	2,800,000.000	2,729,453.100	
		US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,569,860.140	
		US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	3,141,729.640	
		US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,660,392.180	
		US T N/B 1.75 01/31/29	3,000,000.000	2,678,203.110	
		US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,797,968.720	
		US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,290,273.430	
		US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,912,809.750	
		US T N/B 1.75 08/15/41	4,930,000.000	3,542,281.990	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,823,539.050	
		US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,898,117.950	
		US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,943,755.050	
		US T N/B 1.875 02/15/32	7,280,000.000	6,356,350.000	
		US T N/B 1.875 02/15/41	4,700,000.000	3,485,710.890	
		US T N/B 1.875 02/15/51	4,720,000.000	3,307,687.490	
		US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,336,852.700	
		US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,600,000.000	
		US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,753,981.240	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,864,375.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	789,121.870	
		US T N/B 1.875 11/15/51	5,070,000.000	3,547,811.680	
		US T N/B 2.0 02/15/25	5,930,000.000	5,672,415.620	

		US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,707,462.490	
		US T N/B 2.0 04/30/24	4,720,000.000	4,576,371.860	
		US T N/B 2.0 05/31/24	800,000.000	774,625.000	
		US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	280,325.770	
		US T N/B 2.0 08/15/25	4,280,000.000	4,059,646.840	
		US T N/B 2.0 08/15/51	5,110,000.000	3,690,777.280	
		US T N/B 2.0 11/15/26	2,830,000.000	2,636,653.480	
		US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,189,492.180	
		US T N/B 2.125 02/29/24	1,650,000.000	1,607,847.640	
		US T N/B 2.125 03/31/24	3,340,000.000	3,250,498.410	
		US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,773,484.370	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,350,000.000	2,213,498.030	
		US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	367,842.960	
		US T N/B 2.125 09/30/24	590,000.000	569,787.880	
		US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	1,957,656.240	
		US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,713,806.250	
		US T N/B 2.25 01/31/24	710,000.000	693,803.120	
		US T N/B 2.25 02/15/27	2,580,000.000	2,422,579.670	
		US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	3,300,921.870	
		US T N/B 2.25 03/31/24	4,750,000.000	4,628,652.320	
		US T N/B 2.25 03/31/26	1,300,000.000	1,232,460.920	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,212,472.640	
		US T N/B 2.25 05/15/41	3,520,000.000	2,780,249.990	
		US T N/B 2.25 08/15/27	5,240,000.000	4,898,376.510	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,070,000.000	1,569,480.450	
		US T N/B 2.25 08/15/49	3,040,000.000	2,348,637.470	
		US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,271,789.060	
		US T N/B 2.25 11/15/24	3,080,000.000	2,975,328.100	
		US T N/B 2.25 11/15/25	2,920,000.000	2,780,387.500	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,049,275.000	
		US T N/B 2.25 12/31/23	280,000.000	274,093.750	
		US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,892,656.250	
		US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,893,358.570	
		US T N/B 2.375 03/31/29	3,000,000.000	2,778,164.040	
		US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,961,264.830	
		US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,172,506.250	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,470,000.000	3,212,189.800	
		US T N/B 2.375 05/15/51	4,760,000.000	3,771,928.080	
		US T N/B 2.375 08/15/24	4,610,000.000	4,479,983.570	
		US T N/B 2.375 11/15/49	2,760,000.000	2,193,337.490	
		US T N/B 2.5 01/31/24	4,550,000.000	4,461,843.750	
		US T N/B 2.5 01/31/25	3,550,000.000	3,438,785.130	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,849,985.130	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,413,649.200	
		US T N/B 2.5 02/28/26	580,000.000	554,942.180	
		US T N/B 2.5 03/31/27	2,650,000.000	2,514,705.070	
		US T N/B 2.5 04/30/24	4,010,000.000	3,918,208.570	
		US T N/B 2.5 05/15/24	5,100,000.000	4,980,468.750	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,130,000.000	1,700,006.250	

		US T N/B 2.5 05/31/24	4,180,000.000	4,079,745.290	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,368,518.750	
		US T N/B 2.625 02/15/29	4,330,000.000	4,076,627.300	
		US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,735,880.450	
		US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,907,539.040	
		US T N/B 2.625 05/31/27	1,040,000.000	991,940.620	
		US T N/B 2.625 07/31/29	2,570,000.000	2,416,904.270	
		US T N/B 2.625 12/31/23	3,530,000.000	3,471,810.130	
		US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,204,303.890	
		US T N/B 2.75 02/15/24	2,090,000.000	2,055,384.370	
		US T N/B 2.75 02/15/28	4,580,000.000	4,368,890.610	
		US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,907,937.500	
		US T N/B 2.75 04/30/27	3,000,000.000	2,876,953.110	
		US T N/B 2.75 05/15/25	4,000,000.000	3,885,156.240	
		US T N/B 2.75 05/31/29	2,500,000.000	2,367,871.070	
		US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,009,531.240	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,540,000.000	1,310,082.790	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,240,000.000	1,882,824.970	
		US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,145,248.430	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,772,955.450	
		US T N/B 2.75 11/15/23	6,360,000.000	6,280,996.840	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,321,262.790	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,360,000.000	1,986,456.230	
		US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,949,062.500	
		US T N/B 2.875 04/30/29	3,000,000.000	2,863,828.100	
		US T N/B 2.875 05/15/28	5,090,000.000	4,877,253.870	
		US T N/B 2.875 05/15/32	6,650,000.000	6,327,630.800	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,977,092.940	
		US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,998,044.500	
		US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,529,523.430	
		US T N/B 2.875 06/15/25	1,000,000.000	973,671.870	
		US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,141,390.600	
		US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,336,767.180	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,515,700.770	
		US T N/B 2.875 09/30/23	1,220,000.000	1,206,560.930	
		US T N/B 2.875 10/31/23	3,990,000.000	3,943,553.880	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	926,184.350	
		US T N/B 2.875 11/30/25	2,360,000.000	2,290,306.250	
		US T N/B 3.0 02/15/47	1,960,000.000	1,720,818.740	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,345,042.940	
		US T N/B 3.0 02/15/49	3,310,000.000	2,975,896.870	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	962,550.000	
		US T N/B 3.0 05/15/45	400,000.000	350,281.240	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,425,346.860	
		US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,125,124.990	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,490,000.000	3,108,553.870	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,707,070.300	
		US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,212,540.620	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,367,071.850	

		US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	753,709.370	
		US T N/B 3.125 02/15/42	860,000.000	783,876.550	
		US T N/B 3.125 02/15/43	390,000.000	351,304.680	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,575,078.880	
		US T N/B 3.125 08/15/25	1,030,000.000	1,008,917.180	
		US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,873,162.500	
		US T N/B 3.125 08/31/27	1,730,000.000	1,687,425.770	
		US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,249,968.740	
		US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	930,829.680	
		US T N/B 3.25 05/15/42	2,070,000.000	1,921,461.310	
		US T N/B 3.25 06/30/27	3,500,000.000	3,430,273.420	
		US T N/B 3.25 06/30/29	2,000,000.000	1,954,843.740	
		US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,336,323.800	
		US T N/B 3.375 08/15/42	1,500,000.000	1,420,312.500	
		US T N/B 3.375 11/15/48	3,200,000.000	3,067,749.960	
		US T N/B 3.5 02/15/39	500,000.000	496,796.870	
		US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,584,920.300	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,433,020.300	
		US T N/B 3.75 08/15/41	820,000.000	821,409.360	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,350,756.240	
		US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,325,878.120	
		US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	1,034,164.050	
		US T N/B 4.25 11/15/40	1,700,000.000	1,834,273.420	
		US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	664,218.740	
		US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	1,000,360.140	
		US T N/B 4.375 05/15/41	1,150,000.000	1,258,621.080	
		US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,102,500.000	
		US T N/B 4.5 02/15/36	900,000.000	1,009,476.550	
		US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	672,843.740	
		US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,098,212.500	
		US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	1,011,749.200	
		US T N/B 4.75 02/15/41	830,000.000	954,240.620	
		US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	653,772.650	
		US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	922,515.620	
		US T N/B 5.375 02/15/31	860,000.000	975,025.000	
		US T N/B 6.0 02/15/26	1,100,000.000	1,175,453.120	
		US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	999,632.800	
		US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	895,086.310	
	アメリカ・ドル　小計		737,240,000.000 (105,506,416,400)	664,441,154.050 (95,088,173,558)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	950,000.000	861,080.000	
		UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,728,085.680	
		UK TREASURY 0.125 01/31/28	250,000.000	214,062.500	
		UK TREASURY 0.25 01/31/25	1,350,000.000	1,258,915.500	

		UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,470,000.000	1,141,574.070	
		UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,390,000.000	1,244,677.150	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	985,699.000	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	680,000.000	577,953.280	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	300,000.000	119,926.560	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	860,000.000	807,076.970	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,550,000.000	1,100,549.600	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	450,000.000	223,524.000	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	870,000.000	503,382.000	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	700,000.000	547,009.610	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	670,000.000	576,950.400	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	900,000.000	739,848.840	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	950,000.000	919,578.330	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	760,000.000	536,515.000	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	710,000.000	349,028.900	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,000,000.000	918,004.000	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,330,000.000	797,656.860	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,700,000.000	1,169,719.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,100,000.000	1,037,911.600	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	670,140.000	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	350,000.000	222,026.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	857,925.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	870,000.000	569,502.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	511,504.100	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	443,394.650	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,310,000.000	885,127.700	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	1,112,667.200	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	890,000.000	865,322.080	
		UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,380,000.000	1,368,262.270	

		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,100,000.000	917,367.000	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	810,000.000	805,330.430	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,470,000.000	1,403,511.900	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,350,000.000	1,337,931.000	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	930,000.000	991,259.100	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	870,000.000	917,745.600	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	1,034,019.000	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,100,000.000	1,200,565.070	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,170,000.000	1,278,161.820	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,000,000.000	1,097,570.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	910,000.000	958,505.890	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,178,326.800	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,080,000.000	1,201,813.200	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	1,146,907.510	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,416,682.560	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	1,004,456.700	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,265,000.000	1,443,294.160	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,095,000.000	1,230,068.250	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	980,000.000	1,139,318.600	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,095,000.000	1,143,489.220	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	790,109.000	
イギリス・ポンド　小計			54,544,000.000 (8,957,761,120)	49,501,032.660 (8,129,554,594)	
イスラエル・シュケル		ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	710,000.000	671,355.410	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	260,000.000	238,207.580	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,770,996.150	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,456,897.300	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,450,000.000	1,138,728.500	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	160,000.000	157,720.000	
		ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,300,000.000	2,217,446.100	

	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,110,000.000	2,014,860.100	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,460,000.000	1,391,438.400	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	1,630,000.000	1,647,524.130	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,540,000.000	1,583,092.280	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,190,000.000	1,533,580.370	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	220,000.000	246,750.460	
イスラエル・シュケル　小計		17,780,000.000 (738,904,796)	17,068,596.780 (709,340,159)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,540,000.000	1,443,359.320	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,314,210.510	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,510,000.000	1,345,873.570	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,020,000.000	1,602,572.140	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,357,382.960	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,890,000.000	1,518,440.870	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,610,000.000	1,350,832.340	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,150,000.000	717,945.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,370,000.000	1,145,315.280	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	800,000.000	749,360.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,676,723.910	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,160,000.000	1,153,348.620	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	900,000.000	756,182.830	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	579,986.690	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,230,000.000	1,188,364.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	360,000.000	344,768.010	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,550,000.000	1,469,865.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,120,000.000	948,774.410	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,110,000.000	1,036,278.630	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,380,000.000	1,377,288.530	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,200,000.000	1,179,329.580	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	520,000.000	476,551.990	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	930,000.000	916,525.790	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,200,000.000	1,234,162.660	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,030,000.000	1,101,887.610	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,440,000.000	1,520,126.200	
オーストラリア・ドル　小計		32,600,000.000 (3,127,644,000)	29,505,456.950 (2,830,753,540)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	4,200,000.000	4,210,962.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,498,824.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	23,500,000.000	23,554,122.850	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	12,000,000.000	12,052,365.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,426,607.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	30,100,000.000	30,138,588.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	4,410,000.000	4,422,568.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	17,000,000.000	17,122,490.100	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,594,291.460	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,891,658.360	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,000,000.000	20,030,700.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	17,000,000.000	17,105,740.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	3,000,000.000	3,024,045.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,099,880.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,149,897.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	15,600,000.000	15,874,716.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	1,000,000.000	1,021,995.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,642,139.550	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	8,320,000.000	8,676,188.350	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	18,550,000.000	20,061,825.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,327,674.440	
オフショア・人民元　小計			252,370,000.000 (5,155,742,441)	255,927,280.310 (5,228,415,188)	
カナダ・ドル		CANADA 0.25 03/01/26	1,010,000.000	903,841.930	
		CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,421,061.000	
		CANADA 0.5 09/01/25	1,910,000.000	1,743,543.500	
		CANADA 0.5 11/01/23	620,000.000	596,994.280	
		CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,450,459.800	
		CANADA 0.75 02/01/24	1,200,000.000	1,150,534.800	
		CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	762,515.370	
		CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	495,849.750	
		CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,156,920.470	
		CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	659,514.100	
		CANADA 1.25 03/01/27	970,000.000	886,323.920	
		CANADA 1.25 06/01/30	1,850,000.000	1,605,385.600	

	CANADA 1.5 04/01/25	1,300,000.000	1,230,170.500	
	CANADA 1.5 05/01/24	940,000.000	905,705.980	
	CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	653,266.600	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,070,000.000	1,804,441.770	
	CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	421,390.200	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,440,000.000	2,114,528.400	
	CANADA 1.75 12/01/53	1,610,000.000	1,188,001.290	
	CANADA 2.0 06/01/28	730,000.000	683,378.550	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,740,000.000	1,571,545.380	
	CANADA 2.0 09/01/23	880,000.000	863,780.720	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,580,000.000	2,048,922.480	
	CANADA 2.25 03/01/24	900,000.000	879,999.300	
	CANADA 2.25 06/01/25	800,000.000	771,904.800	
	CANADA 2.25 06/01/29	430,000.000	405,640.930	
	CANADA 2.25 12/01/29	500,000.000	470,093.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	970,000.000	949,508.750	
	CANADA 2.75 08/01/24	590,000.000	578,785.870	
	CANADA 2.75 09/01/27	570,000.000	555,212.490	
	CANADA 2.75 12/01/48	880,000.000	827,349.600	
	CANADA 2.75 12/01/64	510,000.000	471,934.110	
	CANADA 3.5 12/01/45	600,000.000	636,863.400	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	637,595.160	
	CANADA 5.0 06/01/37	290,000.000	351,211.750	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,090,000.000	1,255,184.050	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	749,417.940	
カナダ・ドル　小計		38,930,000.000 (4,209,890,200)	35,858,777.540 (3,877,768,203)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	380,000.000	351,044.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	410,000.000	380,603.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	350,000.000	309,321.490	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	375,095.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	640,000.000	485,222.400	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	275,603.980	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	370,000.000	357,605.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	531,610.650	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	440,000.000	431,684.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	10,000.000	8,985.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	420,000.000	409,710.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	500,000.000	466,250.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	460,000.000	432,981.900	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	550,000.000	541,585.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	608,530.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	660,000.000	658,716.300	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	330,000.000	337,095.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	812,400.000	
シンガポール・ドル　小計		8,300,000.000 (843,695,000)	7,774,042.720 (790,231,442)	

スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	3,040,000.000	2,598,033.240	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	2,890,000.000	2,682,304.560	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,010,000.000	2,750,530.170	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	6,210,000.000	5,902,159.970	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	5,780,000.000	5,732,158.990	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,200,000.000	3,306,960.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	8,540,000.000	8,559,481.440	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,900,000.000	4,814,440.010	
スウェーデン・クローナ　小計		36,570,000.000 (487,843,800)	36,346,068.380 (484,856,552)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	3,550,000.000	3,423,513.500	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,180,000.000	3,460,685.680	
	DENMARK 0.25 11/15/52	3,180,000.000	1,886,598.600	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,350,000.000	5,910,837.800	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,750,000.000	5,182,992.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,540,000.000	5,537,642.160	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,810,000.000	10,405,836.240	
デンマーク・クローネ　小計		36,360,000.000 (700,293,600)	35,808,106.480 (689,664,131)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,231,125.100	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,742,459.200	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,400,000.000	4,140,290.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,247,323.040	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,900,000.000	3,749,417.100	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,420,000.000	3,096,418.060	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,932,552.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,400,000.000	2,164,080.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	2,770,000.000	2,758,544.660	
ノルウェー・クローネ　小計		28,320,000.000 (399,312,000)	26,062,209.160 (367,477,149)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,465,648.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	2,570,000.000	2,239,883.500	
	POLAND 07/25/24	1,710,000.000	1,519,803.620	
	POLAND 1.25 10/25/30	3,930,000.000	2,737,638.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	2,040,000.000	1,412,598.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	3,200,000.000	2,939,577.600	
	POLAND 2.5 04/25/24	780,000.000	733,956.600	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,428,206.750	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	1,979,686.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,480,000.000	2,913,421.200	
	POLAND 2.75 10/25/29	710,000.000	573,254.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,780,000.000	2,545,229.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,740,000.000	2,658,457.600	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,404,835.200	
ポーランド・ズロチ　小計		32,410,000.000	27,552,195.070	

		(982,959,649)	(835,627,769)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	890,095.480	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	1,003,445.500	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,337,964.880	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,972,770.860	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,300,000.000	1,177,138.100	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,729,752.320	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,601,022.710	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	300,000.000	303,419.340	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	400,000.000	395,784.470	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	600,000.000	601,391.220	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,430,000.000	1,434,525.660	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,669,514.450	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	320,000.000	322,654.520	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,400,000.000	2,430,633.120	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	912,781.530	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	400,000.000	366,044.590	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,730,000.000	1,756,900.800	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	480,000.000	482,577.160	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,750,000.000	1,794,981.300	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,231,117.920	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	300,000.000	308,434.530	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	514,887.850	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	680,000.000	696,109.330	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	305,122.650	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,774,881.940	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	420,000.000	441,031.580	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,590,000.000	2,701,119.020	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,677,769.920	
マレーシア・リンギット　小計		31,840,000.000 (1,004,577,472)	31,833,872.750 (1,004,384,152)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	7,880,000.000	6,796,854.600	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	3,500,000.000	3,145,152.500	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	2,500,000.000	2,221,855.550	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,085,000.000	5,469,476.850	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	17,802,000.000	17,876,234.340	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	28,522,000.000	25,428,218.660	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	21,546,000.000	20,167,917.840	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	23,558,000.000	21,650,979.900	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	15,977,000.000	13,876,823.350	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	8,435,000.000	7,626,167.850	

	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,070,000.000	21,344,338.400	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	16,801,000.000	14,914,247.700	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	15,151,000.000	14,792,072.810	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	19,571,365.150	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,747,277.600	
メキシコ・ペソ　小計		224,628,000.000 (1,602,069,359)	209,628,983.100 (1,495,094,870)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	850,000.000	723,917.800	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	610,000.000	506,493.940	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	600,000.000	574,392.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	370,000.000	325,595.930	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	410,000.000	258,751.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	480,000.000	353,808.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	920,000.000	830,740.680	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,010,000.000	949,976.710	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	210,000.000	108,248.280	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	779,923.400	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	500,000.000	326,704.500	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	970,000.000	929,758.580	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	300,000.000	137,304.370	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	400,000.000	351,880.400	
	AUSTRIA 07/15/24	860,000.000	837,565.180	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	820,000.000	808,032.100	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	640,000.000	531,396.480	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	180,000.000	123,966.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	740,000.000	741,660.560	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	900,000.000	904,949.100	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	280,000.000	246,978.480	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	330,666.180	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	620,000.000	618,293.140	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	490,000.000	551,975.200	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	280,000.000	367,745.840	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	940,000.000	1,131,196.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	610,000.000	674,470.290	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	415,000.000	497,041.350	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	526,296.640	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	772,815.360	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	689,760.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	810,000.000	800,158.500	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	800,000.000	663,840.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	190,000.000	129,849.610	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	750,000.000	734,271.750	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	560,000.000	272,922.160	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,610,000.000	1,575,089.030	

		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,210,000.000	1,149,863.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	690,000.000	647,979.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	1,180,000.000	1,099,177.080	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,030,000.000	1,002,195.150	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,070,000.000	975,568.220	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	733,352.130	
		BELGIUM 1.4 06/22/53	610,000.000	444,544.820	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	530,000.000	455,654.780	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	800,000.000	648,090.400	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	800,000.000	648,035.200	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	554,875.520	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	393,210.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	356,933.070	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	1,040,000.000	1,059,018.480	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	1,180,000.000	1,246,208.620	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	560,000.000	662,779.040	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	630,000.000	726,456.840	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,250,000.000	1,534,943.750	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	610,000.000	666,879.450	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,320,000.000	1,675,613.280	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,390,000.000	1,655,666.530	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	2,110,000.000	2,004,943.100	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,533,303.780	
		BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,360,000.000	1,267,084.800	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,360,000.000	1,278,481.600	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,750,000.000	1,675,135.000	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	650,000.000	622,921.000	
		BUNDESOBL 04/05/24	1,260,000.000	1,236,677.400	
		BUNDESOBL 10/13/23	1,540,000.000	1,522,012.800	
		BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,544,871.030	
		BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,500,000.000	1,472,580.000	
		BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	60,000.000	59,152.800	
		BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	1,250,000.000	1,225,625.000	
		BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	1,600,000.000	1,566,416.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,820,000.000	1,619,490.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,540,000.000	1,345,498.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,620,000.000	2,241,446.680	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,660,000.000	1,320,115.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,580,000.000	1,233,205.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,630,000.000	2,317,582.300	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	590,000.000	519,967.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,890,000.000	1,635,114.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	693,090.690	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,410,000.000	1,503,384.510	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	640,000.000	400,364.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,130,000.000	676,711.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,320,000.000	1,218,069.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,060,000.000	1,871,462.620	

		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	2,008,615.200	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,080,000.000	1,912,551.680	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	870,000.000	804,680.400	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,857,801.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,010,000.000	1,946,303.100	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,640,000.000	2,493,559.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,910,000.000	1,818,474.710	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	1,980,000.000	1,871,219.580	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	1,490,000.000	1,336,963.590	
		DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	350,000.000	309,368.500	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,820,000.000	1,809,056.340	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,388,830.400	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,040,000.000	1,851,085.800	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,520,000.000	1,525,569.280	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,430,000.000	1,441,494.620	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,810,000.000	2,062,133.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	2,591,906.670	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,666,702.800	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,830,000.000	2,328,402.330	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,430,000.000	1,932,330.400	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	160,000.000	187,427.200	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,220,000.000	1,610,363.400	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	2,039,268.900	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,520,000.000	1,975,042.400	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,575,602.500	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	910,000.000	968,958.900	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	1,028,937.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	1,040,238.500	
		FINLAND 0.0 09/15/24	430,000.000	417,097.490	
		FINLAND 0.0 09/15/26	210,000.000	194,943.000	
		FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	177,643.200	
		FINLAND 0.125 04/15/36	290,000.000	213,906.320	
		FINLAND 0.125 04/15/52	280,000.000	148,486.240	
		FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	250,020.000	
		FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	197,221.170	
		FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	440,119.260	
		FINLAND 0.5 04/15/43	280,000.000	190,965.600	

		FINLAND 0.5 09/15/27	420,000.000	392,338.800	
		FINLAND 0.5 09/15/28	560,000.000	512,809.020	
		FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	269,832.600	
		FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	178,370.400	
		FINLAND 0.875 09/15/25	330,000.000	322,311.990	
		FINLAND 09/15/23	100,000.000	98,608.800	
		FINLAND 1.125 04/15/34	580,000.000	506,306.360	
		FINLAND 1.375 04/15/27	100,000.000	97,633.300	
		FINLAND 1.375 04/15/47	340,000.000	279,332.270	
		FINLAND 2.0 04/15/24	430,000.000	434,082.850	
		FINLAND 2.625 07/04/42	340,000.000	346,915.940	
		FINLAND 2.75 07/04/28	540,000.000	563,603.400	
		FINLAND 4.0 07/04/25	580,000.000	618,129.200	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,620,000.000	1,588,742.100	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,990,000.000	1,909,932.350	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,910,000.000	2,742,287.970	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,450,000.000	2,259,463.500	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,100,000.000	2,511,000.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,890,000.000	2,507,970.900	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,480,000.000	2,947,198.080	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,695,837.050	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,620,000.000	2,458,615.860	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,060,000.000	2,965,993.740	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,260,000.000	3,114,161.670	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,263,758.750	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,650,000.000	1,171,475.250	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	660,000.000	300,756.320	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	900,000.000	598,419.000	
		FRANCE OAT 0.75 02/25/28	740,000.000	694,194.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,040,000.000	2,848,431.360	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,360,000.000	1,483,602.200	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,060,000.000	1,265,983.300	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,600,000.000	3,351,139.200	
		FRANCE OAT 03/25/24	3,020,000.000	2,954,876.720	
		FRANCE OAT 03/25/25	3,320,000.000	3,184,324.880	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,360,000.000	2,271,265.250	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,680,199.500	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,860,000.000	2,525,594.500	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,890,000.000	1,621,053.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,780,000.000	3,624,702.480	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,630,000.000	2,080,524.620	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	803,600.820	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,070,000.000	1,852,919.100	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,790,000.000	2,798,515.080	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,742,250.900	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,531,312.500	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,930,000.000	4,081,238.190	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,490,000.000	3,638,597.220	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,030,000.000	2,264,477.180	

		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,000,000.000	4,244,000.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,140,000.000	1,484,508.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,170,000.000	1,579,913.010	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,316,495.800	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,375,000.000	3,482,067.480	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,395,818.800	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,980,000.000	2,475,586.080	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,280,000.000	2,771,362.550	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,299,264.480	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,450,425.180	
		IRISH 0.0 10/18/31	770,000.000	634,272.100	
		IRISH 0.2 05/15/27	520,000.000	482,238.640	
		IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	473,503.800	
		IRISH 0.35 10/18/32	60,000.000	49,576.630	
		IRISH 0.4 05/15/35	390,000.000	306,380.880	
		IRISH 0.55 04/22/41	240,000.000	169,179.360	
		IRISH 0.9 05/15/28	700,000.000	660,835.000	
		IRISH 1.0 05/15/26	800,000.000	780,120.000	
		IRISH 1.1 05/15/29	600,000.000	566,406.000	
		IRISH 1.3 05/15/33	390,000.000	353,685.540	
		IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	341,852.400	
		IRISH 1.5 05/15/50	490,000.000	381,881.010	
		IRISH 1.7 05/15/37	490,000.000	444,998.400	
		IRISH 2.0 02/18/45	730,000.000	659,653.550	
		IRISH 2.4 05/15/30	590,000.000	606,777.830	
		IRISH 3.4 03/18/24	390,000.000	400,879.890	
		IRISH 5.4 03/13/25	920,000.000	1,004,375.960	
		ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	969,700.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	850,000.000	764,235.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,400,000.000	1,349,768.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,250,000.000	1,111,250.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/15/24	890,000.000	848,615.000	
		ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,283,024.000	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,233,262.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,800,000.000	1,704,780.000	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,200,000.000	990,960.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,484,901.390	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	932,910.000	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,380,000.000	1,358,946.030	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,310,000.000	1,190,855.500	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,900,000.000	1,507,106.600	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,080,000.000	726,300.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,380,000.000	1,055,562.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,100,115.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,180,000.000	1,056,336.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	1,013,032.800	
		ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,002,540.000	
		ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,500,000.000	1,429,875.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,530,000.000	1,421,795.750	

		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,750,000.000	1,490,650.000	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	829,248.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,486,997.820	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,016,108.080	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	512,406.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,110,000.000	2,040,728.700	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,350,000.000	1,286,145.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,690,000.000	1,402,243.700	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,488,248.100	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,020,000.000	639,673.620	
		ITALY BTPS 1.75 05/30/24	360,000.000	355,140.000	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,184,535.600	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,240,000.000	882,012.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	979,902.000	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,400,000.000	1,362,900.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,350,000.000	1,265,413.050	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,200,000.000	1,168,154.400	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,740,000.000	1,648,681.560	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	890,000.000	861,095.470	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	232,632.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	440,000.000	299,596.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,290,000.000	1,234,272.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	860,000.000	703,566.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,151,766.700	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	848,815.000	
		ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	933,333.580	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,350,000.000	1,333,889.100	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,634,387.340	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	500,000.000	437,130.000	
		ITALY BTPS 2.65 12/01/27	300,000.000	290,640.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,330,000.000	1,068,788.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	538,020.000	
		ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.000	953,300.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,040,000.000	1,971,815.040	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,210,000.000	1,051,127.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,560,867.630	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,680,000.000	1,481,126.640	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	542,160.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	1,046,095.960	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,020,000.000	954,079.440	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,085,575.120	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,870,000.000	1,865,414.760	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,657,789.740	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	850,000.000	823,980.650	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,830,000.000	1,841,895.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,710,000.000	1,761,224.760	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,910,000.000	2,011,994.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,800,408.960	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,222,716.060	

		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	60,000.000	63,294.900	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,817,700.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	830,000.000	929,600.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,550,000.000	1,731,040.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,140,000.000	2,380,750.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,530,000.000	1,762,101.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,780,000.000	2,084,202.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,510,000.000	1,748,127.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	408,730.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,270,000.000	1,364,653.100	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/26	840,000.000	795,257.740	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,095,701.020	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	910,000.000	809,172.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	397,526.250	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,090,000.000	606,873.850	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	606,825.800	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	700,000.000	593,593.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	630,000.000	607,049.990	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	860,000.000	772,477.440	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	920,000.000	709,272.160	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,160,000.000	1,109,424.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,107,613.240	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,380,000.000	1,300,810.080	
		NETHERLANDS 01/15/24	1,440,000.000	1,414,330.560	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,620,000.000	1,636,289.100	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,157,652.300	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,520,000.000	1,736,482.960	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,330,000.000	1,686,865.310	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,290,000.000	1,581,540.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	490,000.000	581,679.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,340,010.000	
		SPAIN 0.0 01/31/26	1,570,000.000	1,466,690.750	
		SPAIN 0.0 01/31/27	430,000.000	390,612.000	
		SPAIN 0.0 01/31/28	1,160,000.000	1,026,600.000	
		SPAIN 0.0 05/31/24	1,260,000.000	1,224,471.780	
		SPAIN 0.0 05/31/25	670,000.000	634,981.080	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,840,000.000	1,479,360.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	1,080,000.000	1,050,667.200	
		SPAIN 0.5 04/30/30	1,500,000.000	1,293,390.000	
		SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,351,112.360	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,830,000.000	1,609,106.190	
		SPAIN 0.7 04/30/32	1,550,000.000	1,280,920.000	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,550,000.000	1,446,692.500	

		SPAIN 0.8 07/30/29	700,000.000	625,730.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	730,000.000	531,002.000	
		SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	368,064.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,240,000.000	737,411.880	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	911,319.780	
		SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,580,600.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,730,000.000	1,678,650.140	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,640,000.000	1,560,701.080	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,570,000.000	1,491,107.500	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,400,000.000	1,317,982.400	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,560,000.000	1,499,289.480	
		SPAIN 1.45 10/31/71	420,000.000	225,720.600	
		SPAIN 1.5 04/30/27	2,210,000.000	2,143,810.500	
		SPAIN 1.6 04/30/25	2,390,000.000	2,373,915.300	
		SPAIN 1.85 07/30/35	1,640,000.000	1,439,611.680	
		SPAIN 1.9 10/31/52	900,000.000	657,090.900	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,330,000.000	1,325,701.440	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,694,598.000	
		SPAIN 2.15 10/31/25	1,710,000.000	1,722,294.900	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,470,000.000	1,397,235.000	
		SPAIN 2.55 10/31/32	880,000.000	855,777.640	
		SPAIN 2.7 10/31/48	1,190,000.000	1,087,512.440	
		SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,572,179.840	
		SPAIN 2.9 10/31/46	980,000.000	937,350.400	
		SPAIN 3.45 07/30/66	880,000.000	877,254.010	
		SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,519,228.830	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,500,000.000	1,700,648.090	
		SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,145,279.130	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,635,000.000	1,762,131.060	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,480,000.000	1,802,363.240	
		SPAIN 4.8 01/31/24	1,300,000.000	1,356,893.200	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,290,000.000	1,595,085.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	290,000.000	335,762.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	870,000.000	1,143,602.820	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,615,000.000	2,039,874.200	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,865,861.000	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,680,000.000	2,038,757.280	
	ユーロ　小計		446,982,000.000 (64,012,292,220)	428,897,428.800 (61,422,400,778)	
国債証券　合計			197,729,402,056.800 (197,729,402,057)	182,953,742,085 (182,953,742,085)	
合計				182,953,742,085 (182,953,742,085)	

（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	256銘柄	51.29	51.97
イギリス・ポンド	国債証券	54銘柄	4.38	4.44
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	26銘柄	1.53	1.55
オフショア・人民元	国債証券	21銘柄	2.82	2.86
カナダ・ドル	国債証券	37銘柄	2.09	2.12
シンガポール・ドル	国債証券	18銘柄	0.43	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	0.37	0.38
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.20	0.20
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	0.45	0.46
マレーシア・リンギット	国債証券	28銘柄	0.54	0.55
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.81	0.82
ユーロ	国債証券	349銘柄	33.13	33.57

（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9月30日現在

Ⅰ　資産総額	69,272,207円
Ⅱ　負債総額	350,328円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	68,921,879円
Ⅳ　発行済数量	71,707,772口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9611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9月30日現在

Ⅰ　資産総額	349,588,610,758円
Ⅱ　負債総額	557,271,603円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	349,031,339,155円
Ⅳ　発行済数量	111,954,114,221口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1176円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	718,849,011,476円
Ⅱ　負債総額	1,247,585,525円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	717,601,425,951円
Ⅳ　発行済数量	124,113,995,673口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.7818円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	775,295,170,390円
Ⅱ　負債総額	32,555,968,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	742,739,202,390円
Ⅳ　発行済数量	588,921,856,048口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2612円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	178,250,389,217円
Ⅱ　負債総額	214,764,785円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	178,035,624,432円
Ⅳ　発行済数量	85,472,217,441口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0830円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2022年9月30日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2022年9月30日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年9月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,409,829,470,021
追加型株式投資信託	809	13,996,223,441,636
単位型公社債投資信託	25	48,976,536,231
単位型株式投資信託	220	1,121,972,007,292
合計	1,080	16,577,001,455,180

３【委託会社等の経理状況】

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

2. 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の財務諸表及び中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

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

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第36期（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第37期（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

重要な会計方針

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

6. 収益及び費用の計上基準	**当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。** **(1) 委託者報酬** **委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年１回又は２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。** **(2) 運用受託報酬** **運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年１回又は２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。** **(3) 投資助言報酬** **投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年１回又は４回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。** **(4) 成功報酬** **成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。**
7. 消費税等の会計処理	**消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。**

（会計上の見積りの変更）

第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
当社は、当事業年度において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万円減少しております。

（会計方針の変更）

1．収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

2．時価の算定に関する会計基準等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年7月4日）第44-２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

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

（未適用の会計基準等）

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2022年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

（百万円）

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

（損益計算書関係）

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

（百万円）

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

※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

（株主資本等変動計算書関係）

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期（2021年3月31日現在）

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

第37期（2022年3月31日現在）

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

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

（注2）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期（2021年3月31日現在）

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

第37期（2022年3月31日現在）

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

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

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2020年3月31日）第5項に従い、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

（百万円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

第36期（2021年3月31日現在）

（百万円）

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

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

第37期（2022年3月31日現在）

（百万円）

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（百万円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（百万円）

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

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

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

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

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度97百万円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

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

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

（2）損益計算書項目

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

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1．収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

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

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

2．収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	6,435	未払手数料	1,457
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	12,767	未払手数料	2,524

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

（東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

（1株当たり情報）

	第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
1株当たり純資産額	1,833,828円44銭	1,939,327円79銭
1株当たり当期純利益金額	353,145円08銭	387,499円36銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	―	―
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は、アストマックス株式会社からPayPayアセットマネジメント株式会社（以下「PPAM」といいます。）の発行済株式の49.9%を2022年8月1日付で譲り受けており、同日付でPPAMは委託会社の関連会社となりました。

(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（2022年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
ＰａｙＰａｙ証券株式会社	8,725	「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2022年3月末日現在

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)受益者に対する収益分配金の再投資

(6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7)その他上記に付帯する業務

３【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

②請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨

・目論見書の使用開始日

・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

２０２２年5月２６日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　丘本　正彦

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　長谷川　敬

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の２０２１年４月１日から２０２２年３月３１日までの第３７期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の２０２２年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

２０２２年１１月１８日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

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Ｏｎｅグローバルバランスの２０２１年9月１６日から２０２２年9月１６日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、Ｏｎｅグローバルバランスの２０２２年9月１６日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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