【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】	2023年2月10日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は販売会社にお問い合わせください。

※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2023年2月11日から2023年8月10日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（９）【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。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。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

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

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

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

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

＜ファンドの特色＞

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

＊2022年11月末時点

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

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

4 「隔月分配型」（分配金受取専用）のファンドです。

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

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

・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ

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

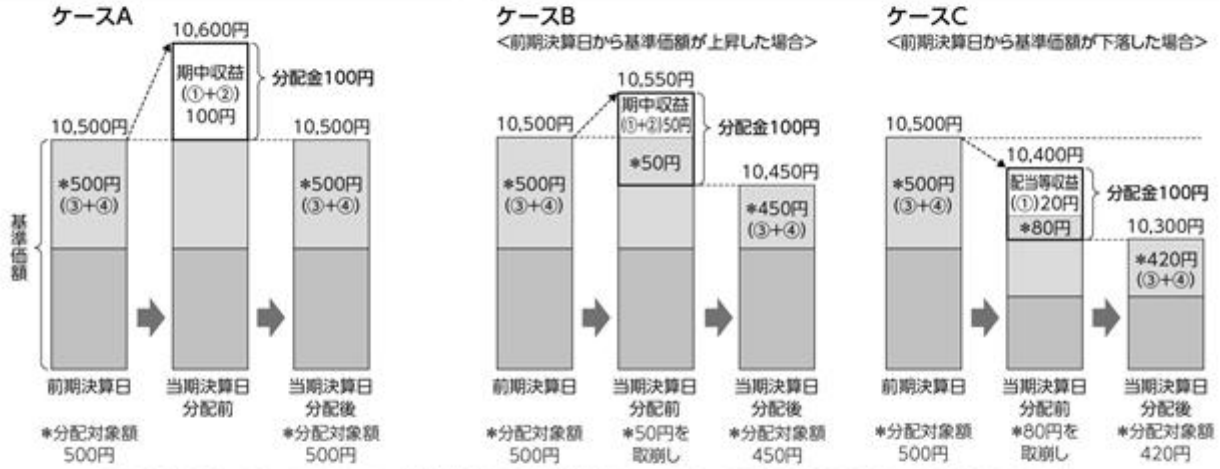
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



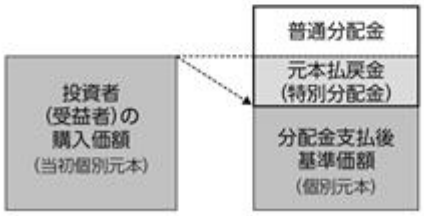
上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

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

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

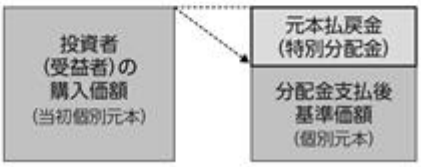
◆投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は、非課税扱いとなります。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金　　：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

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

○商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

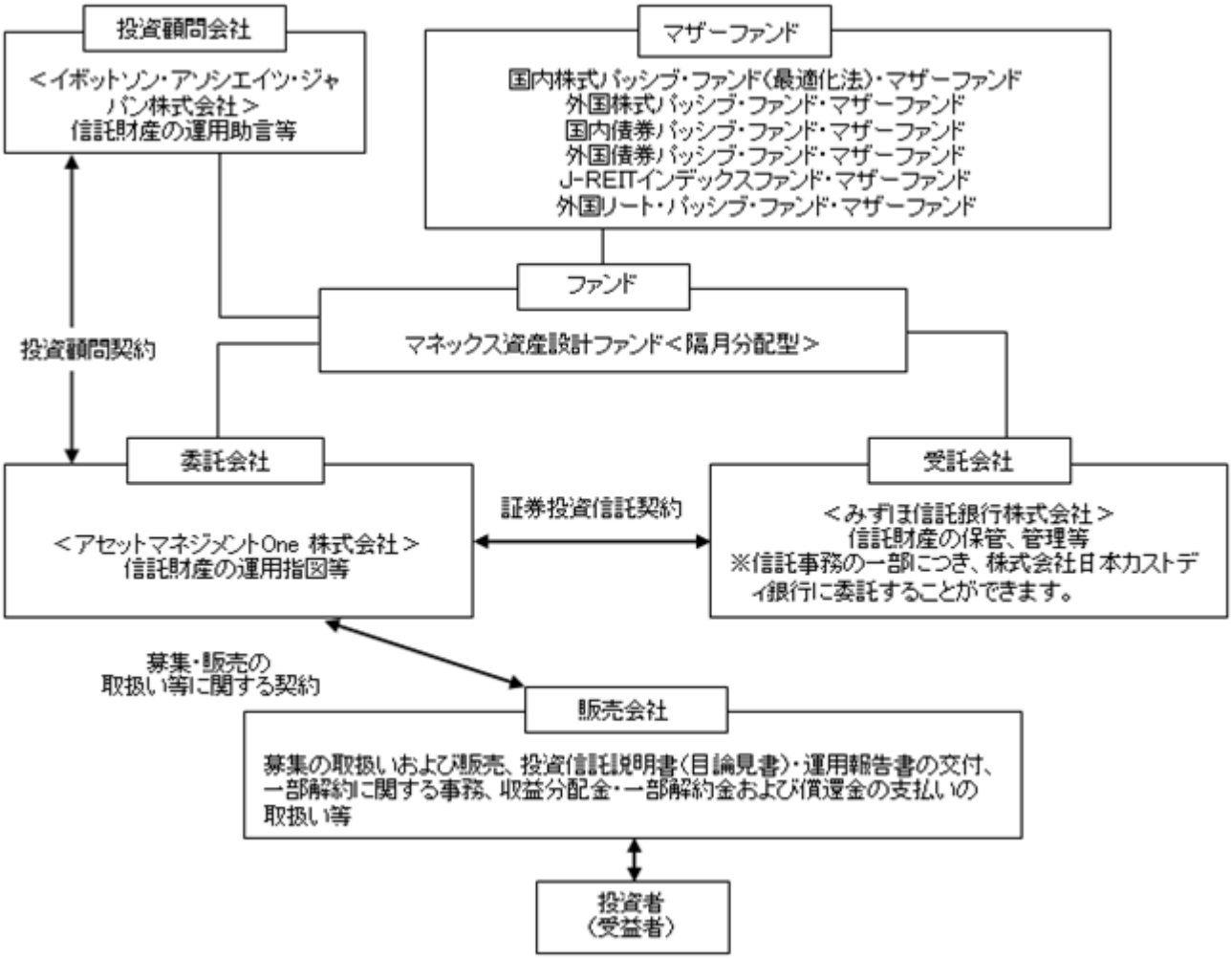
その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年6回（隔月）	目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
グロー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

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

（２）【ファンドの沿革】

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

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

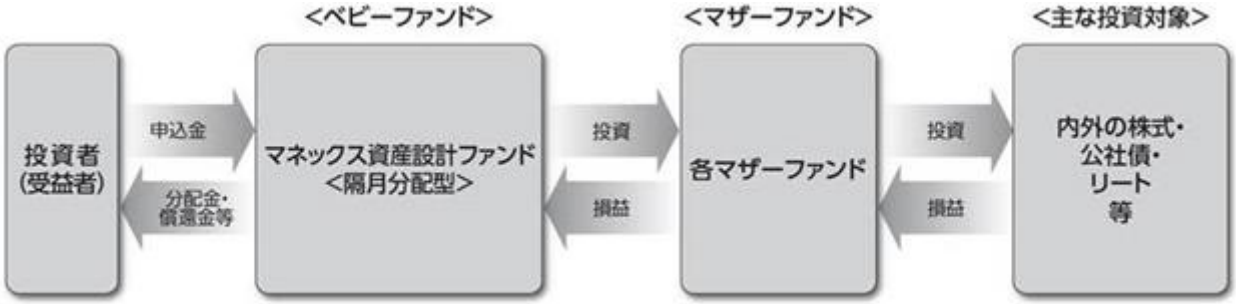
委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

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

資本金の額
20億円（2022年11月30日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「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11月30日現在）

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

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

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

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

＜投資対象＞

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

＜投資態度＞

①主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、Ｊ-ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンドおよび外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）の計6資産への分散投資を行います。
②基本資産配分比率は原則として年１回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。
③基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。
④分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。
⑤実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

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

※投資対象の詳細は、約款をご覧下さい。

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

（２）【投資対象】

1.投資の対象とする資産（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

2.有価証券の指図範囲　（約款第16条第1項）

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

1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

5) Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

6) 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

7) 株券または新株引受権証書

8) 国債証券

9) 地方債証券

10)特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

16)コマーシャル・ペーパー

17)新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券

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

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

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

21)外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

22)オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

23)預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

24)外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

26)抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

27)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

28)外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの

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

3.金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

1)預金

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

3)コール・ローン

4)手形割引市場において売買される手形

5)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

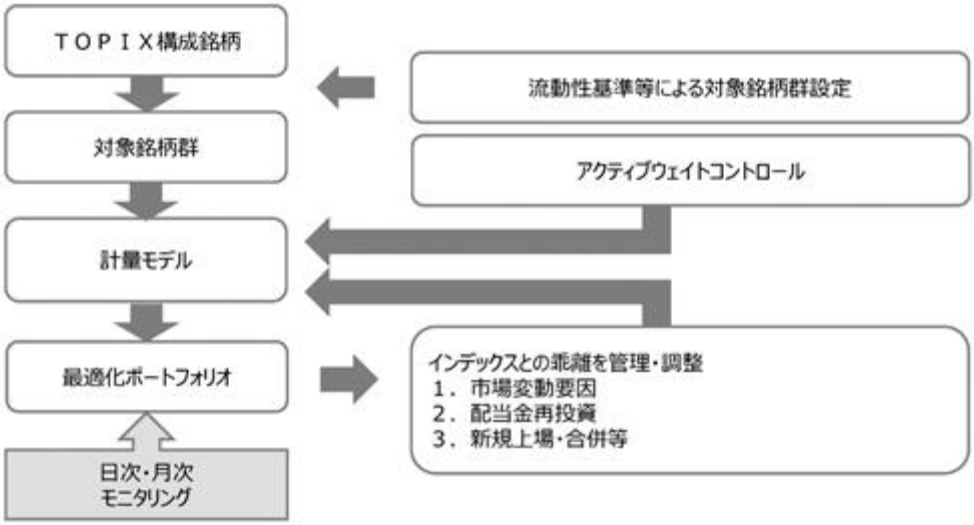
6)外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	**国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド**

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

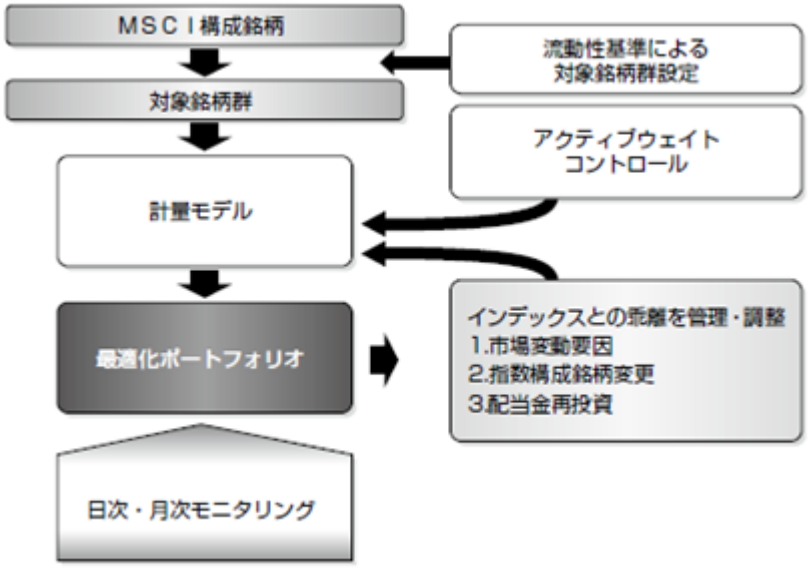
ファンド名	**外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。**
主な投資対象	**海外の株式を主要投資対象とします。**

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）(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。**

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

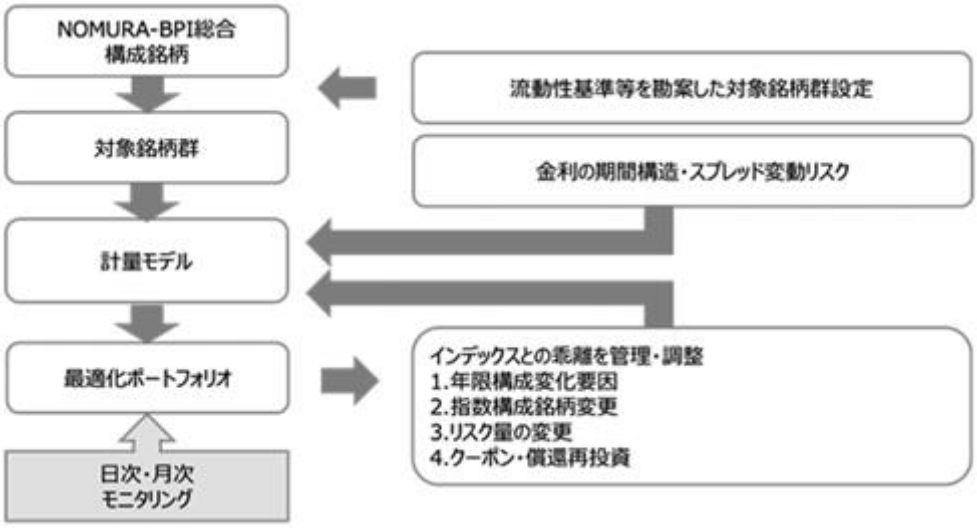
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

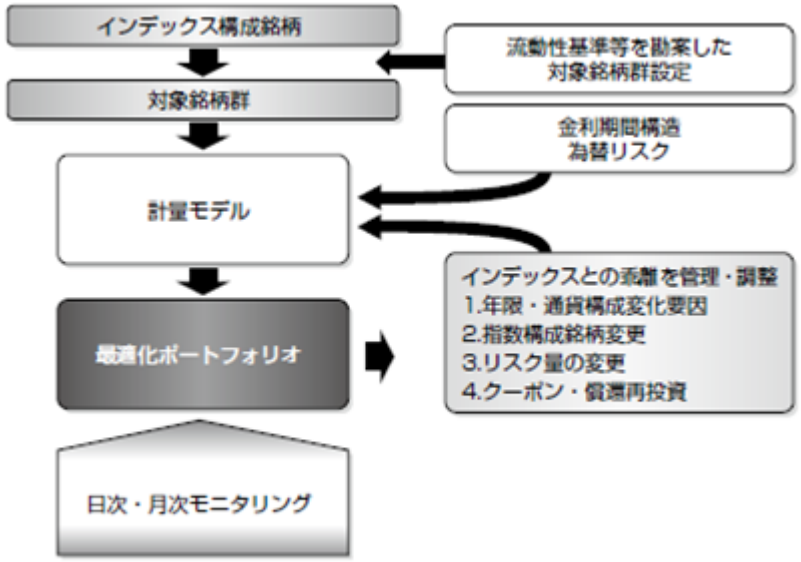
主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④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

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。 （注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、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。
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。

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。

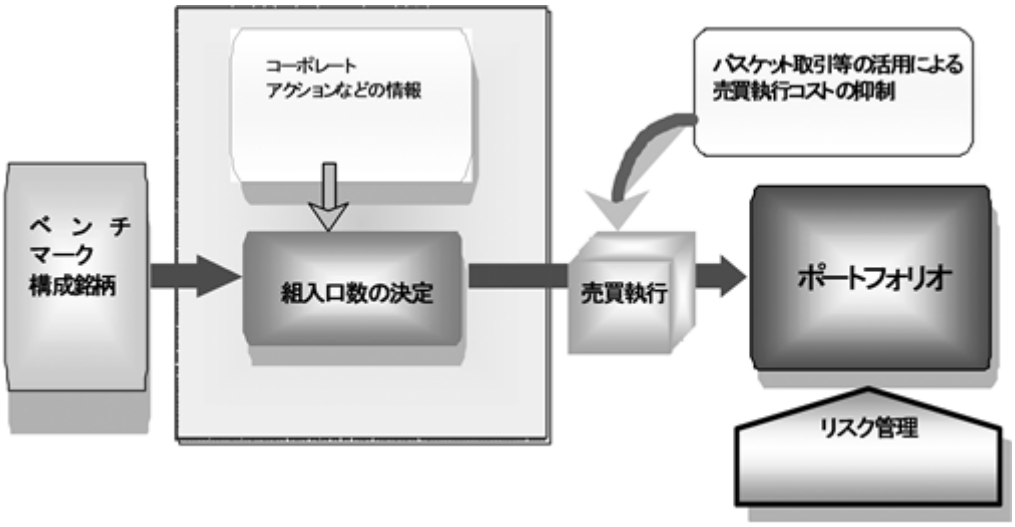
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	①主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 （注）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 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。

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

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

ファンド名	**Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド**

基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）(注)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 （注）①東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証ＲＥＩＴ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。 ②ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証ＲＥＩＴ指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 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ＲＥＩＴ指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 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。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ②不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 ③但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

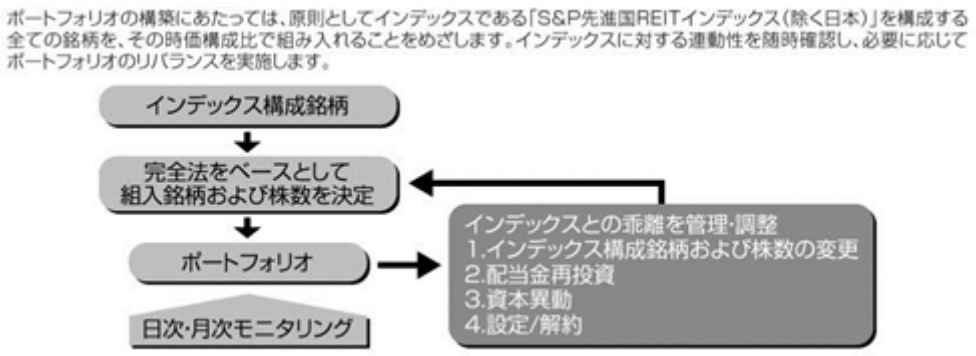
運用プロセス	①原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ②新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ③配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動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

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

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

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

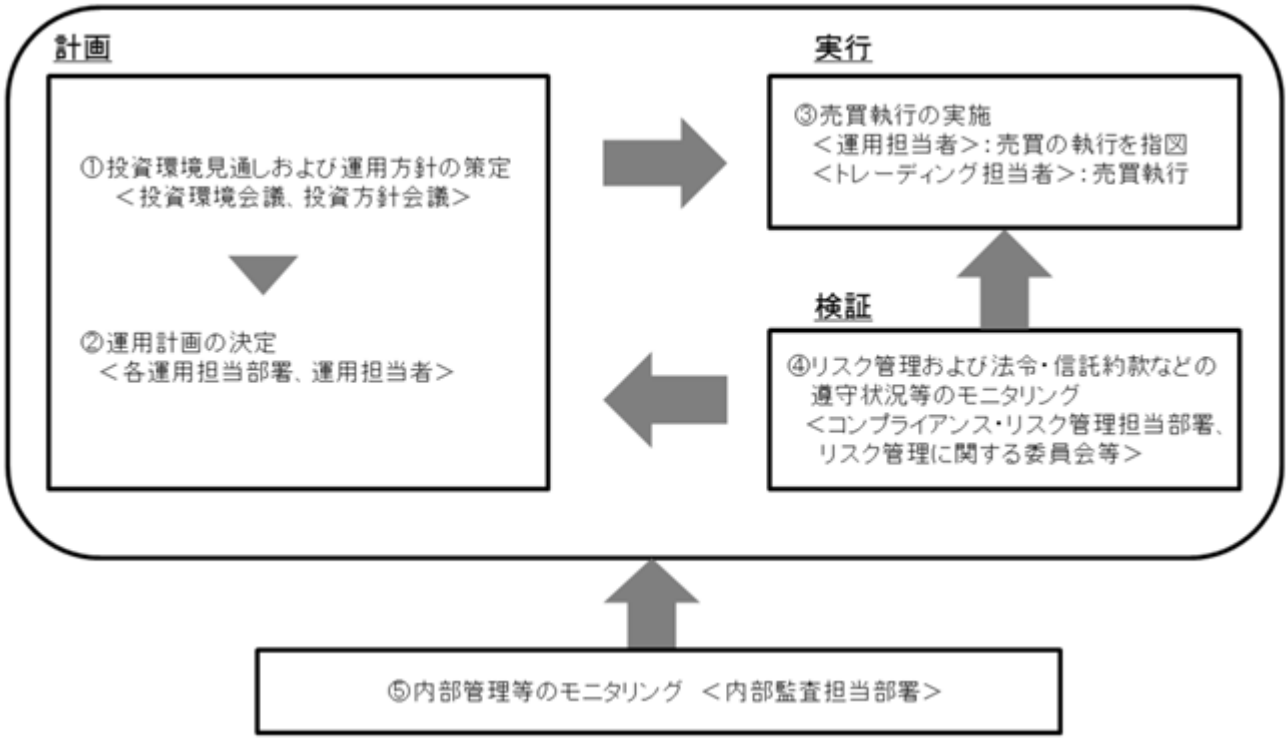
	はＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。
主な投資対象	**日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。** **※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。）とします。**
投資態度	**1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。**
運用プロセス	

主な投資制限	1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3.株式への直接投資は行いません。 4.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。
定期的に開催されるリスク管理に関する委員会等において運用リスク管理状況、運用実績、法令・信託約款などの遵守状況等について検証・報告を行います。

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

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

1)分配対象額の範囲

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

2)分配対象額についての分配方針

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

3)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

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

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

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

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

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

c.毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

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

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

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

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

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

⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」 2.運用方法 (3)投資制限）

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

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

⑨投資する株式等の範囲（約款第19条）

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

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

⑩信用取引の指図および範囲（約款第22条）

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

2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.～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（5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑪先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

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

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

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

⑫スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

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

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

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

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

⑬金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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

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

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

⑭デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条の2）

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

⑮有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1．2.の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

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

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

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

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

⑯公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

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

2)上記1)の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

⑰公社債の借入れ（約款第28条）

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

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

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

4)上記1)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

⑱特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

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

⑲外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

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

⑳資金の借入れ　（約款第37条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

3)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

○資産配分リスク

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

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

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

○リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

○信用リスク

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

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

○流動性リスク

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

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

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

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

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

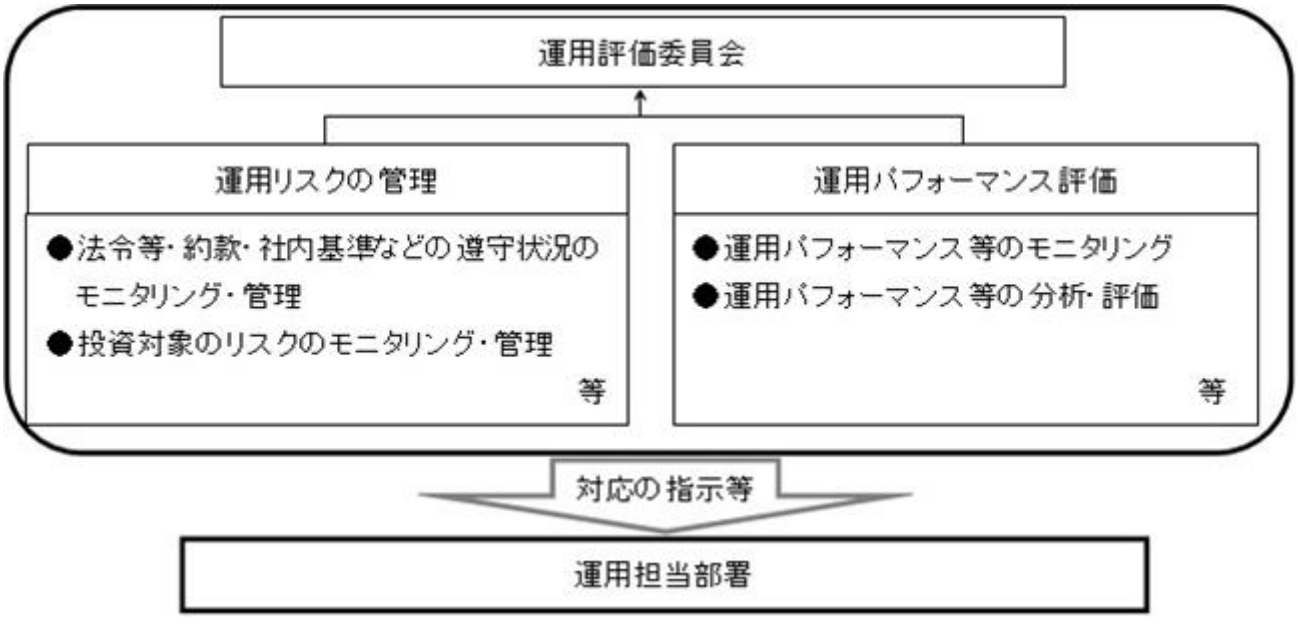
○注意事項

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

＜リスク管理体制＞

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

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

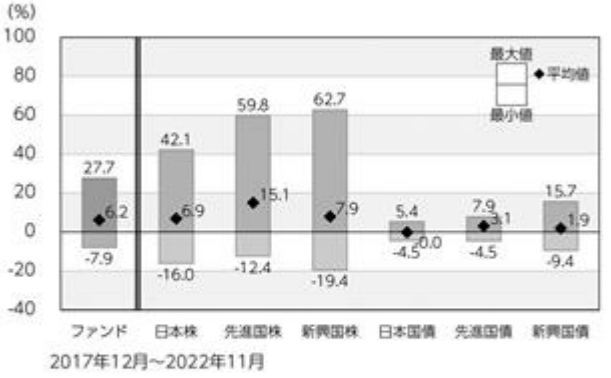
※リスク管理体制は2022年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2017年12月～2022年11月

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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）

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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

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

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

1.信託財産留保額

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

2.その他の費用

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

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

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎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貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

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

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		427,284,082	98.99
	内　日本	427,284,082	98.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,377,492	1.01
純資産総額		431,661,574	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11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		370,866,915,690	97.68
	内　日本	370,866,915,690	97.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,820,018,212	2.32
純資産総額		379,686,933,902	100.00

その他資産の投資状況

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		8,596,800,000	2.26
	内　日本	8,596,800,000	2.26

（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11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		768,866,787,001	95.39
	内　アメリカ	538,536,721,534	66.81
	内　イギリス	34,387,688,194	4.27
	内　カナダ	30,012,819,608	3.72
	内　スイス	26,327,988,227	3.27
	内　フランス	25,294,834,735	3.14
	内　ドイツ	18,919,600,363	2.35
	内　オーストラリア	17,453,607,251	2.17
	内　オランダ	14,639,666,505	1.82
	内　アイルランド	14,233,394,569	1.77
	内　スウェーデン	7,287,319,205	0.90
	内　デンマーク	6,521,551,422	0.81
	内　スペイン	5,721,565,225	0.71
	内　香港	4,882,381,759	0.61
	内　イタリア	4,012,874,098	0.50
	内　ジャージィー	3,021,281,912	0.37
	内　フィンランド	2,969,102,324	0.37

	内　シンガポール	2,772,312,234	0.34
	内　ベルギー	1,930,293,662	0.24
	内　ノルウェー	1,876,379,832	0.23
	内　イスラエル	1,752,174,900	0.22
	内　ケイマン諸島	1,501,710,060	0.19
	内　バミューダ	1,196,537,144	0.15
	内　オランダ領キュラソー	1,176,457,396	0.15
	内　ルクセンブルグ	560,679,608	0.07
	内　ニュージーランド	504,368,849	0.06
	内　オーストリア	415,175,001	0.05
	内　ポルトガル	406,788,560	0.05
	内　リベリア	228,676,758	0.03
	内　パナマ	179,119,698	0.02
	内　マン島	143,716,368	0.02
投資信託受益証券		1,366,275,330	0.17
	内　オーストラリア	1,010,633,450	0.13
	内　シンガポール	355,641,880	0.04
投資証券		16,736,454,902	2.08
	内　アメリカ	15,720,298,518	1.95
	内　イギリス	347,213,069	0.04
	内　フランス	291,503,045	0.04
	内　香港	245,512,313	0.03
	内　カナダ	69,924,543	0.01
	内　ベルギー	62,003,414	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		19,070,654,624	2.37
純資産総額		806,040,171,857	100.00

その他資産の投資状況

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		19,289,538,356	2.39
	内　アメリカ	14,360,296,734	1.78
	内　ドイツ	2,886,351,409	0.36
	内　イギリス	875,849,247	0.11
	内　カナダ	729,164,956	0.09
	内　オーストラリア	437,876,010	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11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		494,234,758,000	83.99
	内　日本	494,234,758,000	83.99
地方債証券		33,557,445,178	5.70
	内　日本	33,557,445,178	5.70
特殊債券		31,422,483,677	5.34
	内　日本	31,422,483,677	5.34

社債券		26,638,418,330	4.53
	内　日本	25,944,856,330	4.41
	内　フランス	693,562,000	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,565,918,346	0.44
純資産総額		588,419,023,531	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11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		182,011,926,646	98.70
	内　アメリカ	91,976,855,684	49.87
	内　フランス	15,755,159,837	8.54
	内　イタリア	14,053,164,023	7.62
	内　ドイツ	12,256,270,860	6.65
	内　スペイン	9,452,976,976	5.13
	内　イギリス	8,693,698,617	4.71
	内　中国	6,004,381,263	3.26
	内　カナダ	3,759,352,040	2.04
	内　ベルギー	3,495,237,450	1.90
	内　オランダ	2,921,689,594	1.58
	内　オーストラリア	2,822,104,802	1.53
	内　オーストリア	2,219,194,503	1.20
	内　メキシコ	1,535,710,950	0.83
	内　アイルランド	1,175,464,137	0.64
	内　フィンランド	929,323,471	0.50
	内　マレーシア	920,754,663	0.50
	内　シンガポール	832,816,565	0.45
	内　ポーランド	749,984,333	0.41
	内　デンマーク	657,973,084	0.36
	内　イスラエル	654,393,784	0.35
	内　スウェーデン	442,104,702	0.24
	内　ノルウェー	365,859,292	0.20
	内　ニュージーランド	337,456,016	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,404,611,081	1.30
純資産総額		184,416,537,727	100.00

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		208,076,000,200	97.77
	内　日本	208,076,000,200	97.77
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,755,699,909	2.23
純資産総額		212,831,700,109	100.00

その他資産の投資状況

2022年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）

不動産投信指数先物取引（買建）		4,603,890,000	2.16
	内　日本	4,603,890,000	2.16

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		6,899,547,948	10.29
	内　オーストラリア	4,450,417,594	6.63
	内　シンガポール	2,395,646,336	3.57
	内　香港	53,484,018	0.08
投資証券		59,955,524,002	89.38
	内　アメリカ	51,874,723,618	77.33
	内　イギリス	3,049,681,305	4.55
	内　カナダ	1,257,142,178	1.87
	内　フランス	1,143,056,040	1.70
	内　香港	839,440,246	1.25
	内　ベルギー	658,463,955	0.98
	内　スペイン	274,172,108	0.41
	内　ニュージーランド	258,547,866	0.39
	内　ガーンジィ	155,289,874	0.23
	内　韓国	148,976,156	0.22
	内　オランダ	127,525,767	0.19
	内　イスラエル	99,861,090	0.15
	内　ドイツ	31,585,983	0.05
	内　アイルランド	27,948,174	0.04
	内　イタリア	9,109,642	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		227,544,017	0.34
純資産総額		67,082,615,967	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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	99,738,983	1.2609 125,770,857	1.2538 125,052,736	－ －	28.97
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	32,407,197	3.3594 108,871,978	3.3730 109,309,475	－ －	25.32

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	17,659,398	6.2317 110,049,836	6.1492 108,591,170	－ －	25.16
4	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	12,475,526	2.4410 30,454,006	2.4373 30,406,599	－ －	7.04
5	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	14,352,119	2.0897 29,993,058	2.0802 29,855,277	－ －	6.92
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	14,409,019	1.7117 24,665,358	1.6704 24,068,825	－ －	5.58

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	98.99
合計	98.99

（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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率（%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,106,300	2,178.62 15,481,942,769	2,010.50 14,287,216,150	－ －	3.76
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	915,500	12,129.00 11,104,106,340	11,255.00 10,303,952,500	－ －	2.71
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	129,500	54,656.78 7,078,054,067	57,140.00 7,399,630,000	－ －	1.95
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,663,200	3,655.20 6,079,331,088	3,820.00 6,353,424,000	－ －	1.67
5	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,356,500	746.90 6,241,525,131	755.10 6,309,993,150	－ －	1.66
6	第一三共 日本	株式 医薬品	1,130,700	2,952.15 3,338,004,008	4,518.00 5,108,502,600	－ －	1.35
7	任天堂 日本	株式 その他製品	817,100	5,888.51 4,811,508,653	5,894.00 4,815,987,400	－ －	1.27
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	656,300	6,210.24 4,075,781,943	7,299.00 4,790,333,700	－ －	1.26
9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,148,600	3,603.82 4,139,351,702	4,050.00 4,651,830,000	－ －	1.23

10	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	750,500	5,369.79 4,030,031,678	5,952.00 4,466,976,000	－ －	1.18
11	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	931,400	4,207.74 3,919,093,645	4,673.00 4,352,432,200	－ －	1.15
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	985,100	5,131.26 5,054,804,236	4,329.00 4,264,497,900	－ －	1.12
13	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,003,000	4,061.05 4,073,241,919	4,111.00 4,123,333,000	－ －	1.09
14	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	91,300	54,004.53 4,930,613,819	45,090.00 4,116,717,000	－ －	1.08
15	三井物産 日本	株式 卸売業	1,001,800	3,069.34 3,074,867,026	3,983.00 3,990,169,400	－ －	1.05
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	856,100	4,125.70 3,532,019,670	4,605.00 3,942,340,500	－ －	1.04
17	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	279,600	14,199.72 3,970,243,547	14,060.00 3,931,176,000	－ －	1.04
18	信越化学工業 日本	株式 化学	221,700	18,082.14 4,008,811,878	17,570.00 3,895,269,000	－ －	1.03
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,283,400	2,478.66 3,181,117,263	2,827.00 3,628,171,800	－ －	0.96
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	843,700	3,788.00 3,195,943,101	4,287.00 3,616,941,900	－ －	0.95
21	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,052,100	3,364.89 3,540,203,506	3,356.00 3,530,847,600	－ －	0.93
22	ダイキン工業 日本	株式 機械	156,000	22,071.05 3,443,084,178	22,405.00 3,495,180,000	－ －	0.92
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,843,400	1,595.25 2,940,699,887	1,717.00 3,165,117,800	－ －	0.83
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,085,100	1,476.21 3,078,054,818	1,497.50 3,122,437,250	－ －	0.82
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	392,400	8,063.35 3,164,061,009	7,464.00 2,928,873,600	－ －	0.77
26	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	140,800	20,649.49 2,907,449,176	19,720.00 2,776,576,000	－ －	0.73
27	日本電産 日本	株式 電気機器	317,500	9,383.69 2,979,323,667	8,534.00 2,709,545,000	－ －	0.71
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,243,900	2,036.05 2,532,644,412	2,128.00 2,647,019,200	－ －	0.70
29	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	471,900	5,589.70 2,637,783,719	5,579.00 2,632,730,100	－ －	0.69
30	ＳＭＣ 日本	株式 機械	42,400	64,237.93 2,723,688,461	61,760.00 2,618,624,000	－ －	0.69

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.68
合計	97.68

（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11月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	17.05
情報・通信業		8.63
輸送用機器		7.57
化学		6.01
卸売業		5.80
医薬品		5.63
銀行業		5.44
サービス業		5.27
機械		5.05
小売業		4.40
食料品		3.42
陸運業		3.05
精密機器		2.69
その他製品		2.31
保険業		2.30
不動産業		2.07
建設業		1.90
電気・ガス業		1.17
その他金融業		1.09
ゴム製品		0.73
証券、商品先物取引業		0.72
非鉄金属		0.71
鉄鋼		0.71
ガラス・土石製品		0.69
海運業		0.58
金属製品		0.55
空運業		0.50
石油・石炭製品		0.47
繊維製品		0.44
鉱業		0.31
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業		0.09
合計		97.68

（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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	1,912,294	22,830.42 43,658,484,735	19,604.27 37,489,143,002	－ －	4.65
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	839,523	40,005.57 33,585,597,797	33,374.62 28,018,767,066	－ －	3.48
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	1,082,307	20,470.14 22,154,978,931	12,834.36 13,890,723,512	－ －	1.72
4	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	709,886	18,100.92 12,849,596,006	13,219.03 9,384,008,092	－ －	1.16
5	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	667,640	18,124.96 12,100,948,454	13,253.75 8,848,735,519	－ －	1.10
6	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	110,961	67,117.25 7,447,397,931	73,323.35 8,136,033,348	－ －	1.01
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	312,319	38,953.31 12,165,858,887	25,111.86 7,842,911,659	－ －	0.97
8	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	498,136	11,514.76 5,735,919,797	15,350.68 7,646,731,214	－ －	0.95
9	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	310,792	23,296.69 7,240,425,911	24,453.61 7,599,988,938	－ －	0.94
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	151,906	43,495.81 6,607,275,864	43,762.10 6,647,726,033	－ －	0.82
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	347,318	20,177.60 7,008,045,940	18,964.08 6,586,568,838	－ －	0.82

12	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	296,178	31,505.06 9,331,106,982	21,717.87 6,432,358,055	－ －	0.80
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	283,840	21,262.62 6,035,184,404	20,202.80 5,734,364,909	－ －	0.71
14	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	194,438	30,537.81 5,937,712,125	29,032.16 5,644,955,553	－ －	0.70
15	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	220,589	20,142.72 4,443,263,783	25,139.63 5,545,527,187	－ －	0.69
16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	332,068	16,989.50 5,641,671,734	16,207.24 5,381,907,167	－ －	0.67
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	121,657	46,854.13 5,700,132,911	43,877.36 5,337,988,618	－ －	0.66
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	102,624	50,428.01 5,175,124,920	47,650.46 4,890,081,125	－ －	0.61
19	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	95,491	35,467.03 3,386,782,355	50,541.73 4,826,280,960	－ －	0.60
20	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	208,795	20,172.49 4,211,916,619	21,969.23 4,587,066,213	－ －	0.57
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	663,386	6,926.18 4,594,732,664	6,872.67 4,559,237,239	－ －	0.57
22	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	298,936	11,099.28 3,317,976,493	15,114.61 4,518,301,294	－ －	0.56
23	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	857,910	6,181.73 5,303,372,352	5,138.18 4,408,104,582	－ －	0.55
24	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	486,812	8,457.04 4,116,990,561	8,676.59 4,223,871,830	－ －	0.52
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	163,245	23,184.91 3,784,821,402	25,356.27 4,139,284,834	－ －	0.51
26	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	271,410	28,680.79 7,784,253,858	15,200.71 4,125,624,755	－ －	0.51
27	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	48,103	79,275.71 3,813,399,819	80,376.08 3,866,330,768	－ －	0.48

28	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	52,389	70,060.71 3,670,410,988	73,456.67 3,848,321,757	－ －	0.48
29	WALMART INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	179,075	18,595.90 3,330,062,227	21,242.94 3,804,080,178	－ －	0.47
30	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	82,297	49,638.42 4,085,093,281	45,048.44 3,707,352,083	－ －	0.46

（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11月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.39
投資信託受益証券	0.17
投資証券	2.08
合計	97.63

（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11月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	6.46
銀行		6.01
石油・ガス・消耗燃料		5.59
医薬品		5.55
コンピュータ・周辺機器		4.87
半導体・半導体製造装置		4.23
情報技術サービス		3.67
保険		3.30
資本市場		3.29
インタラクティブ・メディアおよびサービス		2.92
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.54
ヘルスケア機器・用品		2.32
バイオテクノロジー		2.16
化学		2.12
インターネット販売・通信販売		2.06
ホテル・レストラン・レジャー		1.88
電力		1.88
飲料		1.88
機械		1.81
専門小売り		1.73
食品		1.71
航空宇宙・防衛		1.69
自動車		1.65
金属・鉱業		1.62
食品・生活必需品小売り		1.61
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.46

繊維・アパレル・贅沢品	1.26
家庭用品	1.18
各種電気通信サービス	1.13
陸運・鉄道	1.09
各種金融サービス	1.07
娯楽	1.07
コングロマリット	0.96
総合公益事業	0.82
電気設備	0.81
メディア	0.79
タバコ	0.70
通信機器	0.69
専門サービス	0.69
パーソナル用品	0.59
建設関連製品	0.58
航空貨物・物流サービス	0.57
電子装置・機器・部品	0.55
商業サービス・用品	0.52
複合小売り	0.48
消費者金融	0.40
商社・流通業	0.36
不動産管理・開発	0.32
無線通信サービス	0.29
エネルギー設備・サービス	0.29
家庭用耐久財	0.27
建設・土木	0.26
容器・包装	0.26
建設資材	0.25
自動車部品	0.18
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
ガス	0.14
運送インフラ	0.12
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	0.06
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.01
合計	95.39

（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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）

1	３３４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,520,000,000	101.36 6,608,744,400	101.00 6,585,200,000	0.6 2024/6/20	1.12
2	３３３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,330,000,000	101.06 6,397,382,000	100.85 6,384,248,100	0.6 2024/3/20	1.08
3	１４０回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	6,190,000,000	100.32 6,210,222,600	100.22 6,203,927,500	0.1 2024/6/20	1.05
4	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,990,000,000	100.46 6,017,740,000	100.20 6,002,099,800	0.1 2026/12/20	1.02
5	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,860,000,000	100.24 5,874,064,000	99.84 5,850,741,200	0.1 2028/3/20	0.99
6	３４２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,680,000,000	100.54 5,710,672,000	100.31 5,697,778,400	0.1 2026/3/20	0.97
7	３３９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,580,000,000	101.36 5,656,263,000	101.05 5,639,036,400	0.4 2025/6/20	0.96
8	１５３回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,500,000,000	99.88 5,493,421,000	99.61 5,478,770,000	0.005 2027/6/20	0.93
9	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,470,000,000	100.44 5,494,068,000	100.12 5,477,001,600	0.1 2027/3/20	0.93
10	３４３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,450,000,000	100.57 5,481,207,000	100.30 5,466,404,500	0.1 2026/6/20	0.93
11	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,410,000,000	100.35 5,429,325,000	100.04 5,412,434,500	0.1 2027/6/20	0.92
12	１４７回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,380,000,000	100.18 5,390,098,000	100.00 5,380,000,000	0.005 2026/3/20	0.91
13	３６０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,340,000,000	99.19 5,296,747,000	98.73 5,272,609,200	0.1 2030/9/20	0.90
14	１４２回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,230,000,000	100.35 5,248,651,000	100.25 5,243,388,800	0.1 2024/12/20	0.89
15	３５９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,300,000,000	99.18 5,256,647,000	98.88 5,241,064,000	0.1 2030/6/20	0.89
16	３５４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,260,000,000	99.79 5,249,019,000	99.59 5,238,644,400	0.1 2029/3/20	0.89
17	３６１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,300,000,000	99.05 5,249,995,000	98.62 5,226,913,000	0.1 2030/12/20	0.89

18	３４８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,190,000,000	100.30 5,205,971,000	99.95 5,187,508,800	0.1 2027/9/20	0.88
19	３５２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,190,000,000	100.03 5,191,782,000	99.74 5,176,557,900	0.1 2028/9/20	0.88
20	３６２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,240,000,000	98.93 5,184,088,000	98.50 5,161,400,000	0.1 2031/3/20	0.88
21	３４４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,130,000,000	100.56 5,158,728,000	100.26 5,143,594,500	0.1 2026/9/20	0.87
22	３６４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,200,000,000	98.79 5,137,400,000	98.32 5,112,952,000	0.1 2031/9/20	0.87
23	３４０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,040,000,000	101.47 5,114,088,000	101.14 5,097,909,600	0.4 2025/9/20	0.87
24	３４９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,930,000,000	100.30 4,945,063,000	99.87 4,923,788,200	0.1 2027/12/20	0.84
25	３３７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,800,000,000	100.91 4,844,084,000	100.66 4,832,016,000	0.3 2024/12/20	0.82
26	３４１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,720,000,000	101.24 4,778,832,000	100.93 4,763,943,200	0.3 2025/12/20	0.81
27	３３８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,630,000,000	101.27 4,688,801,000	100.95 4,674,170,200	0.4 2025/3/20	0.79
28	３５７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,710,000,000	99.43 4,683,215,000	99.20 4,672,367,100	0.1 2029/12/20	0.79
29	１５０回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,640,000,000	100.05 4,642,517,000	99.81 4,631,555,200	0.005 2026/12/20	0.79
30	３６３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,700,000,000	98.89 4,648,048,000	98.41 4,625,458,000	0.1 2031/6/20	0.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	83.99
地方債証券	5.70
特殊債券	5.34
社債券	4.53
合計	99.56

（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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,352,593,800	91.32 1,235,308,346	84.85 1,147,802,642	1.625 2031/5/15	0.62
2	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,063,744,200	93.74 997,168,422	94.18 1,001,914,068	2 2025/8/15	0.54
3	US T N/B 0.25 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,041,525,000	95.90 998,887,678	93.76 976,592,425	0.25 2024/5/15	0.53
4	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,129,013,100	93.90 1,060,149,597	81.71 922,527,178	1.25 2031/8/15	0.50
5	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,109,571,300	94.94 1,053,467,297	82.11 911,148,737	1.375 2031/11/15	0.49
6	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,095,684,300	93.51 1,024,601,410	82.26 901,414,331	1.125 2031/2/15	0.49
7	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	883,213,200	102.26 903,250,131	98.14 866,790,954	2.75 2023/11/15	0.47
8	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,010,973,600	92.77 937,892,833	85.50 864,382,428	1.875 2032/2/15	0.47
9	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	923,485,500	100.61 929,205,985	93.05 859,310,467	2.875 2032/5/15	0.47
10	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	877,273,800	94.63 830,202,618	92.60 812,406,420	0.75 2028/5/25	0.44
11	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	997,086,600	82.68 824,483,132	80.75 805,225,320	0.875 2030/11/15	0.44
12	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	824,887,800	98.82 815,177,268	90.24 744,461,239	1.5 2027/1/31	0.40
13	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	880,435,800	82.17 723,514,963	79.32 698,433,208	0.625 2030/8/15	0.38
14	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	708,237,000	102.14 723,405,518	96.88 686,159,919	2.5 2024/5/15	0.37
15	US T N/B 3.0 07/31/24 アメリカ	国債証券	697,127,400	97.30 678,346,787	97.43 679,236,272	3 2024/7/31	0.37
16	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	727,678,800	96.62 703,095,684	92.62 674,012,488	2.25 2027/8/15	0.37
17	US T N/B 2.25 03/31/24 アメリカ	国債証券	659,632,500	99.49 656,285,980	96.80 638,555,176	2.25 2024/3/31	0.35
18	US T N/B 1.125 01/15/25 アメリカ	国債証券	677,685,600	95.23 645,402,157	93.30 632,285,957	1.125 2025/1/15	0.34
19	US T N/B 2.0 04/30/24 アメリカ	国債証券	655,466,400	98.14 643,327,162	96.26 630,963,216	2 2024/4/30	0.34
20	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証券	666,576,000	97.41 649,336,849	94.60 630,591,307	0.125 2024/2/15	0.34
21	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	784,615,500	84.50 663,059,392	79.72 625,516,314	0.625 2030/5/15	0.34
22	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	640,190,700	101.93 652,573,053	96.28 616,433,618	2.375 2024/8/15	0.33

23	US T N/B 1.0 12/15/24 アメリカ	国債証券	640,190,700	98.31 629,411,963	93.28 597,227,897	1 2024/12/15	0.32
24	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	629,081,100	106.13 667,670,998	94.49 594,481,639	2.875 2028/8/15	0.32
25	US T N/B 1.5 02/15/25 アメリカ	国債証券	631,858,500	99.66 629,759,909	93.84 592,984,390	1.5 2025/2/15	0.32
26	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	608,250,600	107.87 656,173,046	95.65 581,829,713	3.125 2028/11/15	0.32
27	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27 中国	国債証券	584,397,520	99.83 583,446,703	99.10 579,176,787	2.48 2027/4/15	0.31
28	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	615,194,100	97.54 600,105,868	93.30 574,004,927	2.375 2027/5/15	0.31
29	US T N/B 1.5 09/30/24 アメリカ	国債証券	598,529,700	96.81 579,454,558	94.66 566,569,147	1.5 2024/9/30	0.31
30	US T N/B 2.5 05/31/24 アメリカ	国債証券	580,476,600	99.54 577,842,351	96.80 561,928,554	2.5 2024/5/31	0.30

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.70
合計	98.70

（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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	22,061	699,590.00 15,433,655,004	640,000.00 14,119,040,000	－ －	6.63
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	18,911	636,871.63 12,043,879,570	609,000.00 11,516,799,000	－ －	5.41
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	61,153	168,535.21 10,306,433,718	172,500.00 10,548,892,500	－ －	4.96
4	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	95,415	106,884.50 10,198,384,624	110,100.00 10,505,191,500	－ －	4.94
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	30,987	340,131.99 10,539,670,040	337,500.00 10,458,112,500	－ －	4.91
6	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	61,037	165,192.16 10,082,834,126	154,000.00 9,399,698,000	－ －	4.42
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	28,505	313,310.20 8,930,907,302	307,500.00 8,765,287,500	－ －	4.12

8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	37,680	186,444.62 7,025,233,650	193,500.00 7,291,080,000	－ －	3.43
9	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	42,302	147,527.71 6,240,717,257	154,200.00 6,522,968,400	－ －	3.06
10	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	18,908	357,281.53 6,755,479,257	344,000.00 6,504,352,000	－ －	3.06
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	12,933	409,257.79 5,292,931,051	393,000.00 5,082,669,000	－ －	2.39
12	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	56,825	80,224.16 4,558,738,256	80,500.00 4,574,412,500	－ －	2.15
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	60,984	68,551.58 4,180,549,558	74,700.00 4,555,504,800	－ －	2.14
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	28,260	181,054.86 5,116,610,372	159,100.00 4,496,166,000	－ －	2.11
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	9,984	417,509.50 4,168,414,930	427,000.00 4,263,168,000	－ －	2.00
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	6,530	664,351.08 4,338,212,573	627,000.00 4,094,310,000	－ －	1.92
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	12,751	324,724.62 4,140,563,735	320,500.00 4,086,695,500	－ －	1.92
18	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	83,234	42,695.81 3,553,743,236	47,650.00 3,966,100,100	－ －	1.86
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	23,150	173,903.79 4,025,872,811	161,300.00 3,734,095,000	－ －	1.75
20	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	7,470	536,897.71 4,010,625,904	499,500.00 3,731,265,000	－ －	1.75
21	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	11,004	334,479.93 3,680,617,229	337,500.00 3,713,850,000	－ －	1.74
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	7,016	528,993.78 3,711,420,402	529,000.00 3,711,464,000	－ －	1.74
23	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	22,238	153,836.66 3,421,019,796	161,500.00 3,591,437,000	－ －	1.69
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	20,933	154,710.48 3,238,554,610	159,600.00 3,340,906,800	－ －	1.57
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	26,205	116,456.49 3,051,742,495	118,000.00 3,092,190,000	－ －	1.45
26	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	17,693	163,974.05 2,901,192,933	172,400.00 3,050,273,200	－ －	1.43

27	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	6,497	457,894.44 2,974,940,191	440,500.00 2,861,928,500	－ －	1.34
28	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	13,563	214,939.34 2,915,222,310	208,900.00 2,833,310,700	－ －	1.33
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,797	332,883.83 2,928,379,117	315,500.00 2,775,453,500	－ －	1.30
30	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	12,679	196,411.76 2,490,304,803	215,600.00 2,733,592,400	－ －	1.28

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.77
合計	97.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	347,651	15,637.49 5,436,391,636	15,804.79 5,494,552,682	－ －	8.19
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	34,302	86,827.13 2,978,344,377	93,176.21 3,196,130,533	－ －	4.76
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	59,436	42,244.47 2,510,842,703	40,355.62 2,398,576,749	－ －	3.58
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	232,366	9,028.86 2,098,000,216	8,651.60 2,010,337,917	－ －	3.00
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	123,169	13,796.12 1,699,255,421	16,311.67 2,009,092,106	－ －	2.99
6	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	362,901	4,220.75 1,531,717,155	4,675.75 1,696,835,403	－ －	2.53
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	174,608	10,415.28 1,818,592,378	9,609.80 1,677,948,656	－ －	2.50
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	108,301	16,942.71 1,834,913,342	15,102.11 1,635,573,885	－ －	2.44
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	52,708	26,273.20 1,384,808,262	23,717.60 1,250,107,645	－ －	1.86
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	55,974	19,016.68 1,064,439,847	21,180.45 1,185,554,642	－ －	1.77

11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	127,617	9,731.12 1,241,857,038	8,829.35 1,126,775,745	－ －	1.68
12	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	638,663	1,632.82 1,042,828,063	1,734.24 1,107,598,178	－ －	1.65
13	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	50,308	23,192.72 1,166,779,692	21,319.32 1,072,532,471	－ －	1.60
14	MID AMERICA アメリカ	投資証券	43,376	22,664.69 983,103,754	22,485.83 975,345,379	－ －	1.45
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	217,881	4,752.61 1,035,503,945	4,432.73 965,807,732	－ －	1.44
16	VENTAS INC アメリカ	投資証券	150,540	6,490.28 977,047,497	6,304.69 949,109,236	－ －	1.41
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	46,447	20,852.29 968,526,404	20,109.76 934,038,241	－ －	1.39
18	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	78,179	11,350.03 887,334,699	10,862.41 849,212,460	－ －	1.27
19	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	109,510	6,719.28 735,828,740	7,479.53 819,084,228	－ －	1.22
20	LINK REIT 香港	投資証券	794,420	1,080.12 858,071,156	935.22 742,963,827	－ －	1.11
21	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	233,054	2,727.40 635,633,253	3,155.12 735,314,828	－ －	1.10
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	24,541	34,934.90 857,337,387	29,786.22 730,983,779	－ －	1.09
23	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	203,333	3,423.32 696,075,095	3,560.62 723,992,929	－ －	1.08
24	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	269,423	2,336.67 629,554,559	2,591.31 698,159,645	－ －	1.04
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	96,285	6,466.11 622,589,806	7,161.52 689,547,521	－ －	1.03
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	40,152	17,737.16 712,182,624	16,351.94 656,563,195	－ －	0.98
27	UDR INC アメリカ	投資証券	115,124	6,043.77 695,783,300	5,658.95 651,481,247	－ －	0.97
28	SEGRO PLC イギリス	投資証券	455,045	1,572.79 715,690,997	1,343.80 611,490,981	－ －	0.91
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	66,030	9,459.68 624,622,710	9,086.26 599,966,018	－ －	0.89
30	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	58,157	8,177.04 475,552,143	9,140.42 531,579,603	－ －	0.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	10.29
投資証券	89.38
合計	99.66

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０４１２月	買建	432	8,347,697,560	8,596,800,000	2.26

（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11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Dec22	買建	522	14,114,208,678	14,360,296,734	1.78
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec22	買建	511	2,794,164,434	2,886,351,409	0.36
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec22	買建	70	852,903,688	875,849,247	0.11

	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec22	買建	29	710,005,870	729,164,956	0.09
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec22	買建	26	425,657,886	437,876,010	0.05

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０４１２月	買建	2,337	4,701,833,670	4,603,890,000	2.16

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2022年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第13特定期間末(2013年5月13日)	824	825	0.8225	0.8240
第14特定期間末(2013年11月11日)	736	738	0.8118	0.8133
第15特定期間末(2014年5月12日)	712	713	0.8414	0.8429
第16特定期間末(2014年11月11日)	684	685	0.9368	0.9383
第17特定期間末(2015年5月11日)	622	623	1.0095	1.0110
第18特定期間末(2015年11月11日)	534	535	0.9947	0.9962
第19特定期間末(2016年5月11日)	498	499	0.9354	0.9369
第20特定期間末(2016年11月11日)	482	483	0.9205	0.9220

第21特定期間末 (2017年5月11日)	492	493	1.0090	1.0105
第22特定期間末 (2017年11月13日)	477	478	1.0570	1.0585
第23特定期間末 (2018年5月11日)	448	449	1.0565	1.0580
第24特定期間末 (2018年11月12日)	428	428	1.0434	1.0449
第25特定期間末 (2019年5月13日)	411	411	1.0361	1.0376
第26特定期間末 (2019年11月11日)	430	431	1.0940	1.0955
第27特定期間末 (2020年5月11日)	370	371	0.9993	1.0008
第28特定期間末 (2020年11月11日)	401	401	1.1046	1.1061
第29特定期間末 (2021年5月11日)	421	421	1.2325	1.2340
第30特定期間末 (2021年11月11日)	433	433	1.3083	1.3098
第31特定期間末 (2022年5月11日)	418	419	1.2591	1.2606
第32特定期間末 (2022年11月11日)	434	434	1.3015	1.3030
2021年11月末日	426	－	1.2864	－
12月末日	436	－	1.3196	－
2022年1月末日	418	－	1.2609	－
2月末日	418	－	1.2511	－
3月末日	439	－	1.3155	－
4月末日	428	－	1.2927	－
5月末日	427	－	1.2862	－
6月末日	423	－	1.2669	－
7月末日	433	－	1.2981	－
8月末日	436	－	1.3010	－
9月末日	417	－	1.2485	－
10月末日	434	－	1.3024	－
11月末日	431	－	1.2935	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第13特定期間	0.0045
第14特定期間	0.0045
第15特定期間	0.0045
第16特定期間	0.0045
第17特定期間	0.0045
第18特定期間	0.0045
第19特定期間	0.0045
第20特定期間	0.0045
第21特定期間	0.0045

第22特定期間	0.0045
第23特定期間	0.0045
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045
第32特定期間	0.0045

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第13特定期間	33.0
第14特定期間	△0.8
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.9
第17特定期間	8.2
第18特定期間	△1.0
第19特定期間	△5.5
第20特定期間	△1.1
第21特定期間	10.1
第22特定期間	5.2
第23特定期間	0.4
第24特定期間	△0.8
第25特定期間	△0.3
第26特定期間	6.0
第27特定期間	△8.2
第28特定期間	11.0
第29特定期間	12.0
第30特定期間	6.5
第31特定期間	△3.4
第32特定期間	3.7

（注1）収益率は期間騰落率です。
（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第13特定期間	22,800,000	69,530,000
第14特定期間	13,700,000	108,500,000
第15特定期間	52,399,738	112,932,769
第16特定期間	31,449,359	147,724,782
第17特定期間	44,688,338	158,989,550
第18特定期間	22,117,058	100,883,651
第19特定期間	21,980,050	26,586,206
第20特定期間	10,137,344	18,761,221
第21特定期間	9,179,637	45,104,386
第22特定期間	6,636,994	43,222,568

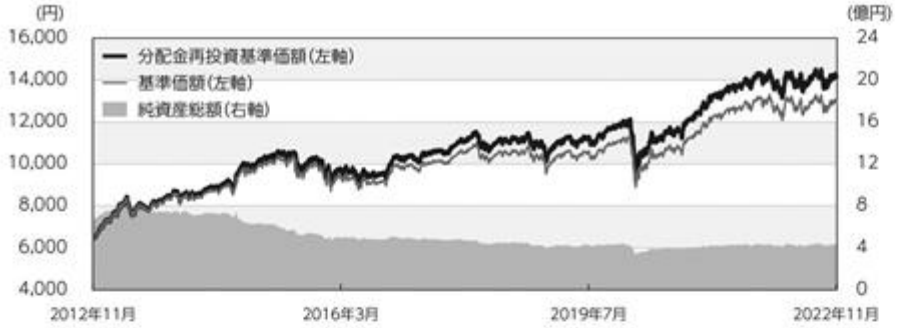
第23特定期間	4,576,025	31,482,595
第24特定期間	6,951,749	21,627,662
第25特定期間	6,012,015	19,263,147
第26特定期間	13,077,272	16,654,903
第27特定期間	11,204,748	33,518,095
第28特定期間	4,242,197	12,089,221
第29特定期間	7,387,321	28,854,017
第30特定期間	7,665,051	18,275,352
第31特定期間	8,633,053	7,395,440
第32特定期間	8,745,065	7,360,714

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2022年11月30日

基準価額・純資産の推移 〈2012年11月30日～2022年11月30日〉



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2007年1月26日)

分配の推移(税引前)

2022年 3月	15円
2022年 5月	15円
2022年 7月	15円
2022年 9月	15円
2022年11月	15円
直近1年間累計	90円
設定来累計	1,920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	28.97
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	25.32
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.16
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	7.04
5	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.92
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.58

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.76
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.71
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.95
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.67
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.66

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.65
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.48
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.72
4	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.16
5	ALPHABET INC-CL C	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	1.10

○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11月30日

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	334回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/6/20	1.12
2	333回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/3/20	1.08
3	140回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2024/6/20	1.05
4	345回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	1.02
5	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	0.99

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.62
2	US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	アメリカ	2	2025/8/15	0.54
3	US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	アメリカ	0.25	2024/5/15	0.53
4	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.50
5	US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	アメリカ	1.375	2031/11/15	0.49

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.63
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.41
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.96
4	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.94
5	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.91

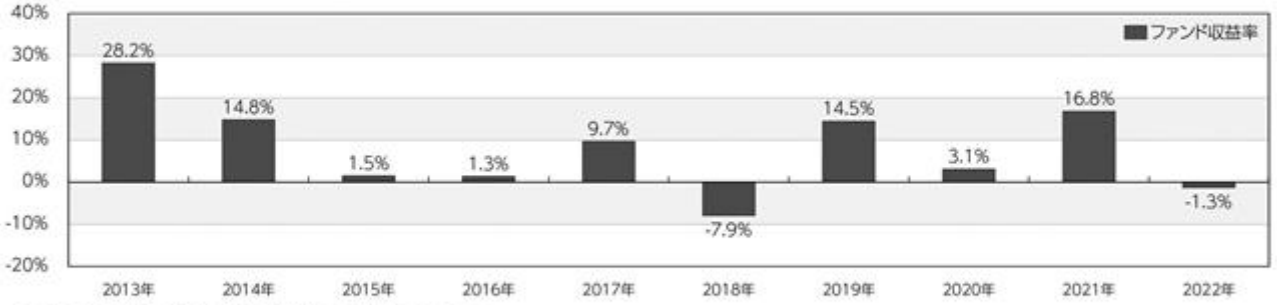
■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	8.19
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.76
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.58
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.00
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	2.99

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を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、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

・解約価額

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

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社への問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

信託期間は2007年1月26日から無期限です。

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

（4）【計算期間】

a.計算期間は原則として毎奇数月の12日から翌奇数月の11日までとします。

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

（５）【その他】

イ.償還規定

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

b.委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

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

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

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

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

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

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

i.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

j.受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

ロ.信託約款の変更

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

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

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

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

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

f.委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定に従います。

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

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

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ.運用報告書

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

4【受益者の権利等】

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、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。
収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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。

②償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。
受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

③一部解約請求権

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

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2022年5月12日から2022年11月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2022年5月11日現在	当期 2022年11月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,493,945	5,558,262
親投資信託受益証券	412,996,307	429,805,093
流動資産合計	419,490,252	435,363,355
資産合計	419,490,252	435,363,355
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	498,663	500,740
未払解約金	25,534	7,903
未払受託者報酬	31,612	30,878
未払委託者報酬	363,730	355,240
その他未払費用	2,785	2,717
流動負債合計	922,324	897,478
負債合計	922,324	897,478
純資産の部		
元本等		
元本	332,442,384	333,826,735
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	86,125,544	100,639,142
（分配準備積立金）	110,560,014	111,935,227
元本等合計	418,567,928	434,465,877
純資産合計	418,567,928	434,465,877
負債純資産合計	419,490,252	435,363,355

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2021年11月12日 至　2022年5月11日	当期 自　2022年5月12日 至　2022年11月11日
営業収益		
受取利息	12	32
有価証券売買等損益	△13,679,522	16,808,786
営業収益合計	△13,679,510	16,808,818
営業費用		
支払利息	455	1,204
受託者報酬	93,263	94,832
委託者報酬	1,073,139	1,090,897
その他費用	8,215	8,349
営業費用合計	1,175,072	1,195,282
営業利益又は営業損失（△）	△14,854,582	15,613,536
経常利益又は経常損失（△）	△14,854,582	15,613,536
当期純利益又は当期純損失（△）	△14,854,582	15,613,536
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（△）	178,851	△18,626
期首剰余金又は期首欠損金（△）	102,116,532	86,125,544
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,469,254	2,499,888
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,469,254	2,499,888
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,928,862	2,114,265
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,928,862	2,114,265
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	1,497,947	1,504,187
期末剰余金又は期末欠損金（△）	86,125,544	100,639,142

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	前期 2022年5月11日現在	当期 2022年11月11日現在
１．　期首元本額	331,204,771円	332,442,384円
期中追加設定元本額	8,633,053円	8,745,065円
期中一部解約元本額	7,395,440円	7,360,714円
２．　受益権の総数	332,442,384口	333,826,735口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自　2021年11月12日 至　2022年5月11日	当期 自　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　分配金の計算過程	（自2021年11月12日　至2022年1月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（535,437円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（15,061,551円）及び分配準備積立金（110,513,508円）より分配対象収益は126,110,496円（1万口当たり3,802.78円）であり、うち497,440円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （自2022年1月12日　至2022年3月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（572,377円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（16,346,167円）及び分配準備積立金（110,380,226円）より分配対象収益は127,298,770円（1万口当たり3,804.92円）であり、うち501,844円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	（自2022年5月12日　至2022年7月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,031,361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（18,380,896円）及び分配準備積立金（109,598,654円）より分配対象収益は129,010,911円（1万口当たり3,866.38円）であり、うち500,510円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （自2022年7月12日　至2022年9月12日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,047,941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（1,822,287円）、信託約款に規定される収益調整金（19,486,153円）及び分配準備積立金（109,650,115円）より分配対象収益は132,006,496円（1万口当たり3,937.06円）であり、うち502,937円（1万口当たり15円）を分配金額としております。

	（自2022年3月12日　至2022年5月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,005,539円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（16,944,327円）及び分配準備積立金（109,053,138円）より分配対象収益は128,003,004円（1万口当たり3,850.38円）であり、うち498,663円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	（自2022年9月13日　至2022年11月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,418,514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（19,915,359円）及び分配準備積立金（111,017,453円）より分配対象収益は132,351,326円（1万口当たり3,964.67円）であり、うち500,740円（1万口当たり15円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 2022年5月11日現在	当期 2022年11月11日現在

１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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	前期 2022年5月11日現在	当期 2022年11月11日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	9,353,195	△5,582,459
合計	9,353,195	△5,582,459

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	前期 2022年5月11日現在	当期 2022年11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2591円 (12,591円)	1.3015円 (13,015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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	32,407,197	108,871,978	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	99,738,983	125,770,857	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	12,475,526	30,454,006	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	17,659,398	110,049,836	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14,352,119	29,993,058	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	14,409,019	24,665,358	
親投資信託受益証券　合計		191,042,242	429,805,093	
合計			429,805,093	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,742,539,968
株式	369,641,938,680
派生商品評価勘定	279,002,160
未収配当金	3,732,089,883
差入委託証拠金	315,090,000
流動資産合計	383,710,660,691
資産合計	383,710,660,691
負債の部	
流動負債	
前受金	89,745,000
未払金	5,975,785,629
未払解約金	237,892,000
流動負債合計	6,303,422,629
負債合計	6,303,422,629
純資産の部	
元本等	
元本	112,340,543,501
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	265,066,694,561
元本等合計	377,407,238,062
純資産合計	377,407,238,062
負債純資産合計	383,710,660,691

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年11月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	111,675,457,342円
同期中追加設定元本額	66,574,333,119円
同期中一部解約元本額	65,909,246,960円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM　ＴＯＰＩＸオープン	2,644,249,719円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	4,104,798,560円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	23,557,449,042円
ＤＩAM国内株式パッシブ・ファンド	4,855,529,092円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,314,816円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	19,054,777円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	52,565,399円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,211,925円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	20,313,275円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	28,002,126円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,598,035,347円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,374,586,071円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	48,303,590円
たわらノーロード　バランス（標準型）	320,087,690円
たわらノーロード　バランス（積極型）	506,308,448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）	4,145,066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）	188,774,622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）	457,531,588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）	319,672,524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）	451,904,286円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	659,285円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,858,895円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	45,945,183円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,667,114円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	16,378,587円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,740,650,941円
Ｏｎｅグローバルバランス	5,321,865円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,080,110,534円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,630,732,823円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,989,964,000円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	346,614,178円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,096,155,174円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,143,931,943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＞	1,143,748,865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）	312,476,258円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	358,247,282円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	579,138,973円
投資のソムリエ	5,853,893,573円
クルーズコントロール	472,830,786円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	404,634,141円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	362,738,228円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	815,799,590円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	375,780,818円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,710,910,524円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	37,364,785円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	18,676,534円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,538,037円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	68,085,245円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	477,755,844円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	88,414,162円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	268,097,187円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	36,490,417円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	19,205,151円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	12,432,660円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	309,174,567円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	2,351,519円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	23,255,514円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	23,957,057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）	12,773,022円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	14,627,936円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	23,070,411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）	52,598,309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）	139,550,798円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	20,856,849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）	93,420,529円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	500,696,767円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	151,442,697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）	5,355,744円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,042,700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）	49,054,999円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	39,640,070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）	3,195,139円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	4,488,456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）	50,671,328円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	98,264,863円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,816,106円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,799,446円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,995,143円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	94,241円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,939,768円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,735,068円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	466,643,569円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	562,273,673円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,646,815,092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）	16,469,736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）	23,798,158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）	245,409,288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）	61,347,605円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	67,381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）	292,359,203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）	17,193,749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）	57,203,815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）	131,906,920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）	197,952,397円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,971,593円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,927,213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）	177,619,994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＞	20,491,294円
コア資産形成ファンド	13,745,203円
ＭＨＡＭトピックスファンド	770,540,564円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	54,485,328円

MHAM動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	2,696,898,556円
MHAM日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,542,332,531円
計	112,340,543,501円
２．　受益権の総数	112,340,543,501口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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11月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	11,061,730,931
合計	11,061,730,931

（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11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年11月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち１年超		
市場取引 先物取引 買建	8,602,450,000	－	8,881,600,000	279,150,000
合計	8,602,450,000	－	8,881,600,000	279,150,000

（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11月11日現在
1口当たり純資産額	3.3595円
（1万口当たり純資産額）	(33,595円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年11月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	6,900	3,660.00	25,254,000	
日本水産	181,400	503.00	91,244,200	
マルハニチロ	28,100	2,384.00	66,990,400	
雪国まいたけ	15,500	1,050.00	16,275,000	
カネコ種苗	6,000	1,433.00	8,598,000	
サカタのタネ	23,000	4,760.00	109,480,000	
ホクト	16,300	1,897.00	30,921,100	
ホクリヨウ	2,600	633.00	1,645,800	
ショーボンドホールディングス	24,700	6,020.00	148,694,000	
ミライト・ワン	62,900	1,461.00	91,896,900	

タマホーム	12,800	2,404.00	30,771,200	
サンヨーホームズ	2,200	696.00	1,531,200	
日本アクア	7,600	796.00	6,049,600	
ファーストコーポレーション	4,800	722.00	3,465,600	
ベステラ	4,000	996.00	3,984,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	30,900	185.00	5,716,500	
キャンディル	2,800	493.00	1,380,400	
住石ホールディングス	28,300	206.00	5,829,800	
日鉄鉱業	7,200	3,100.00	22,320,000	
三井松島ホールディングス	8,100	2,709.00	21,942,900	
ＩＮＰＥＸ	671,100	1,569.00	1,052,955,900	
石油資源開発	21,000	4,120.00	86,520,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8,200	2,116.00	17,351,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	802.00	3,047,600	
第一カッター興業	4,700	1,194.00	5,611,800	
明豊ファシリティワークス	6,700	709.00	4,750,300	
安藤・間	105,100	872.00	91,647,200	
東急建設	51,700	645.00	33,346,500	
コムシスホールディングス	61,400	2,449.00	150,368,600	
ビーアールホールディングス	28,900	347.00	10,028,300	
高松コンストラクショングループ	11,800	1,949.00	22,998,200	
東建コーポレーション	5,900	7,910.00	46,669,000	
ソネック	2,000	922.00	1,844,000	
ヤマウラ	9,400	985.00	9,259,000	
オリエンタル白石	65,400	269.00	17,592,600	
大成建設	126,300	4,025.00	508,357,500	
大林組	453,900	994.00	451,176,600	
清水建設	381,700	727.00	277,495,900	
飛島建設	14,000	1,037.00	14,518,000	
長谷工コーポレーション	131,000	1,512.00	198,072,000	
松井建設	11,900	565.00	6,723,500	
錢高組	1,500	2,803.00	4,204,500	
鹿島建設	281,500	1,521.00	428,161,500	
不動テトラ	8,700	1,494.00	12,997,800	
大末建設	4,700	1,194.00	5,611,800	
鉄建建設	9,300	1,755.00	16,321,500	
西松建設	21,600	3,695.00	79,812,000	
三井住友建設	102,400	407.00	41,676,800	
大豊建設	5,300	4,180.00	22,154,000	
佐田建設	8,200	437.00	3,583,400	
ナカノフドー建設	9,300	309.00	2,873,700	
奥村組	20,500	2,830.00	58,015,000	
東鉄工業	17,500	2,434.00	42,595,000	
イチケン	2,800	1,768.00	4,950,400	
富士ピー・エス	6,000	439.00	2,634,000	
淺沼組	10,200	2,819.00	28,753,800	
戸田建設	156,200	707.00	110,433,400	
熊谷組	22,000	2,496.00	54,912,000	
北野建設	2,300	2,364.00	5,437,200	
植木組	3,700	1,223.00	4,525,100	

矢作建設工業	17,400	727.00	12,649,800	
ピーエス三菱	16,200	588.00	9,525,600	
日本ハウスホールディングス	25,100	424.00	10,642,400	
大東建託	46,700	14,830.00	692,561,000	
新日本建設	17,900	739.00	13,228,100	
東亜道路工業	2,300	5,980.00	13,754,000	
日本道路	2,500	6,230.00	15,575,000	
東亜建設工業	10,900	2,228.00	24,285,200	
日本国土開発	38,100	581.00	22,136,100	
若築建設	5,700	2,526.00	14,398,200	
東洋建設	41,200	851.00	35,061,200	
五洋建設	180,000	633.00	113,940,000	
世紀東急工業	16,900	785.00	13,266,500	
福田組	4,400	4,805.00	21,142,000	
日本ドライケミカル	3,300	1,524.00	5,029,200	
住友林業	97,300	2,344.00	228,071,200	
日本基礎技術	8,000	416.00	3,328,000	
巴コーポレーション	14,200	376.00	5,339,200	
大和ハウス工業	354,700	3,163.00	1,121,916,100	
ライト工業	24,200	2,030.00	49,126,000	
積水ハウス	397,600	2,501.00	994,397,600	
日特建設	12,200	899.00	10,967,800	
北陸電気工事	8,700	671.00	5,837,700	
ユアテック	28,100	705.00	19,810,500	
日本リーテック	8,300	744.00	6,175,200	
四電工	5,400	1,711.00	9,239,400	
中電工	19,700	2,057.00	40,522,900	
関電工	69,700	849.00	59,175,300	
きんでん	89,500	1,452.00	129,954,000	
東京エネシス	12,600	943.00	11,881,800	
トーエネック	4,300	3,405.00	14,641,500	
住友電設	12,100	2,526.00	30,564,600	
日本電設工業	20,900	1,610.00	33,649,000	
エクシオグループ	62,200	2,133.00	132,672,600	
新日本空調	7,000	1,933.00	13,531,000	
日本工営	9,600	3,420.00	32,832,000	
九電工	30,900	3,335.00	103,051,500	
三機工業	28,300	1,574.00	44,544,200	
日揮ホールディングス	125,600	1,855.00	232,988,000	
中外炉工業	4,200	1,559.00	6,547,800	
ヤマト	10,700	679.00	7,265,300	
太平電業	7,800	3,155.00	24,609,000	
高砂熱学工業	30,600	1,828.00	55,936,800	
三晃金属工業	1,500	2,930.00	4,395,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	43,300	1,682.00	72,830,600	
朝日工業社	5,300	1,920.00	10,176,000	
明星工業	22,000	733.00	16,126,000	
大氣社	15,400	3,520.00	54,208,000	
ダイダン	8,300	2,112.00	17,529,600	
日比谷総合設備	11,000	1,881.00	20,691,000	

ニップン	34,500	1,574.00	54,303,000	
日清製粉グループ本社	117,800	1,577.00	185,770,600	
日東富士製粉	2,200	4,295.00	9,449,000	
昭和産業	11,200	2,524.00	28,268,800	
鳥越製粉	10,300	622.00	6,406,600	
中部飼料	17,700	1,048.00	18,549,600	
フィード・ワン	18,600	692.00	12,871,200	
東洋精糖	1,600	882.00	1,411,200	
日本甜菜製糖	7,500	1,632.00	12,240,000	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	12,700	1,925.00	24,447,500	
塩水港精糖	15,800	196.00	3,096,800	
日新製糖	6,600	1,691.00	11,160,600	
ＬＩＦＵＬＬ	45,400	244.00	11,077,600	
ＭＩＸＩ	30,300	2,344.00	71,023,200	
ジェイエイシーリクルートメント	12,000	2,534.00	30,408,000	
日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	228,200	1,790.00	408,478,000	
メンバーズ	4,000	2,021.00	8,084,000	
中広	1,000	365.00	365,000	
ＵＴグループ	19,500	2,644.00	51,558,000	
アイティメディア	5,100	1,748.00	8,914,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	8,500	1,289.00	10,956,500	
夢真ビーネックスグループ	48,600	1,963.00	95,401,800	
コシダカホールディングス	39,900	1,099.00	43,850,100	
アルトナー	3,300	1,000.00	3,300,000	
パソナグループ	16,200	2,013.00	32,610,600	
ＣＤＳ	3,400	1,936.00	6,582,400	
リンクアンドモチベーション	38,200	880.00	33,616,000	
エス・エム・エス	50,600	3,575.00	180,895,000	
サニーサイドアップグループ	4,700	562.00	2,641,400	
パーソルホールディングス	148,900	3,230.00	480,947,000	
リニカル	7,500	735.00	5,512,500	
クックパッド	36,500	199.00	7,263,500	
エスクリ	5,400	363.00	1,960,200	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,600	622.00	4,105,200	
森永製菓	26,200	3,630.00	95,106,000	
中村屋	2,800	3,085.00	8,638,000	
江崎グリコ	36,500	3,515.00	128,297,500	
名糖産業	5,100	1,566.00	7,986,600	
井村屋グループ	7,000	2,234.00	15,638,000	
不二家	8,700	2,611.00	22,715,700	
山崎製パン	85,300	1,521.00	129,741,300	
第一屋製パン	2,500	407.00	1,017,500	
モロゾフ	4,200	3,595.00	15,099,000	
亀田製菓	8,100	4,245.00	34,384,500	
寿スピリッツ	13,500	7,290.00	98,415,000	
カルビー	58,400	2,842.00	165,972,800	
森永乳業	23,200	4,420.00	102,544,000	
六甲バター	9,500	1,355.00	12,872,500	
ヤクルト本社	91,000	7,940.00	722,540,000	
明治ホールディングス	79,000	6,460.00	510,340,000	

雪印メグミルク	30,800	1,731.00	53,314,800	
プリマハム	17,200	1,972.00	33,918,400	
日本ハム	49,800	3,630.00	180,774,000	
林兼産業	3,800	465.00	1,767,000	
丸大食品	12,900	1,407.00	18,150,300	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	14,000	2,810.00	39,340,000	
柿安本店	5,000	2,172.00	10,860,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	99,200	680.00	67,456,000	
学情	6,000	1,496.00	8,976,000	
スタジオアリス	6,700	2,089.00	13,996,300	
クロスキャット	7,400	1,357.00	10,041,800	
シミックホールディングス	7,300	1,580.00	11,534,000	
エプコ	2,800	669.00	1,873,200	
システナ	218,300	439.00	95,833,700	
ＮＪＳ	2,600	2,036.00	5,293,600	
デジタルアーツ	8,100	6,110.00	49,491,000	
日鉄ソリューションズ	22,200	3,505.00	77,811,000	
綜合警備保障	49,300	3,680.00	181,424,000	
キューブシステム	7,700	1,000.00	7,700,000	
いちご	146,700	324.00	47,530,800	
日本駐車場開発	151,800	252.00	38,253,600	
コア	5,800	1,465.00	8,497,000	
カカクコム	99,300	2,350.00	233,355,000	
アイロムグループ	4,800	2,262.00	10,857,600	
セントケア・ホールディング	8,400	817.00	6,862,800	
サイネックス	2,200	532.00	1,170,400	
ルネサンス	9,400	923.00	8,676,200	
ディップ	23,300	4,140.00	96,462,000	
ＳＢＳホールディングス	11,600	2,929.00	33,976,400	
デジタルホールディングス	10,400	1,193.00	12,407,200	
新日本科学	14,000	2,623.00	36,722,000	
キャリアデザインセンター	2,700	1,617.00	4,365,900	
ベネフィット・ワン	61,600	2,193.00	135,088,800	
エムスリー	262,800	4,567.00	1,200,207,600	
ツカダ・グローバルホールディング	8,600	385.00	3,311,000	
ブラス	1,700	902.00	1,533,400	
アウトソーシング	79,200	1,282.00	101,534,400	
ウェルネット	11,900	605.00	7,199,500	
ワールドホールディングス	6,000	2,852.00	17,112,000	
ディー・エヌ・エー	56,700	1,841.00	104,384,700	
博報堂ＤＹホールディングス	169,700	1,365.00	231,640,500	
ぐるなび	24,400	392.00	9,564,800	
タカミヤ	18,100	382.00	6,914,200	
ジャパンベストレスキューシステム	8,200	839.00	6,879,800	
ファンコミュニケーションズ	26,100	434.00	11,327,400	
ライク	5,000	2,097.00	10,485,000	
ビジネス・ブレークスルー	5,100	392.00	1,999,200	
エスプール	38,200	934.00	35,678,800	
ＷＤＢホールディングス	6,800	2,583.00	17,564,400	
手間いらず	2,100	5,080.00	10,668,000	

ティア	8,000	434.00	3,472,000	
ＣＤＧ	1,500	1,188.00	1,782,000	
アドウェイズ	18,300	600.00	10,980,000	
バリューコマース	10,100	2,227.00	22,492,700	
インフォマート	138,100	467.00	64,492,700	
サッポロホールディングス	42,000	3,535.00	148,470,000	
アサヒグループホールディングス	294,400	4,335.00	1,276,224,000	
キリンホールディングス	575,000	2,175.50	1,250,912,500	
宝ホールディングス	87,000	1,043.00	90,741,000	
オエノンホールディングス	38,100	270.00	10,287,000	
養命酒製造	4,300	1,799.00	7,735,700	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	99,800	1,453.00	145,009,400	
サントリー食品インターナショナル	89,700	5,110.00	458,367,000	
ダイドーグループホールディングス	7,200	4,575.00	32,940,000	
伊藤園	47,500	5,360.00	254,600,000	
キーコーヒー	14,200	2,074.00	29,450,800	
ユニカフェ	4,400	953.00	4,193,200	
ジャパンフーズ	1,500	1,054.00	1,581,000	
日清オイリオグループ	18,000	3,310.00	59,580,000	
不二製油グループ本社	29,700	2,057.00	61,092,900	
かどや製油	1,200	3,480.00	4,176,000	
Ｊ－オイルミルズ	13,000	1,529.00	19,877,000	
ローソン	34,000	4,795.00	163,030,000	
サンエー	10,500	4,240.00	44,520,000	
カワチ薬品	10,700	2,102.00	22,491,400	
エービーシー・マート	19,900	6,920.00	137,708,000	
ハードオフコーポレーション	5,500	1,257.00	6,913,500	
高千穂交易	4,900	2,138.00	10,476,200	
アスクル	33,000	1,588.00	52,404,000	
ゲオホールディングス	14,300	1,973.00	28,213,900	
アダストリア	16,600	2,034.00	33,764,400	
ジーフット	7,100	292.00	2,073,200	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,900	405.00	769,500	
オルバヘルスケアホールディングス	2,200	1,431.00	3,148,200	
伊藤忠食品	2,700	5,110.00	13,797,000	
くら寿司	16,100	3,425.00	55,142,500	
キャンドゥ	4,900	2,150.00	10,535,000	
エレマテック	12,300	1,516.00	18,646,800	
アイケイ	4,500	415.00	1,867,500	
パルグループホールディングス	13,400	2,216.00	29,694,400	
エディオン	54,200	1,208.00	65,473,600	
あらた	10,500	3,880.00	40,740,000	
サーラコーポレーション	28,800	758.00	21,830,400	
ワッツ	6,700	660.00	4,422,000	
トーメンデバイス	1,900	5,520.00	10,488,000	
ハローズ	6,200	2,929.00	18,159,800	
ＪＰホールディングス	38,200	285.00	10,887,000	
フジオフードグループ本社	11,500	1,367.00	15,720,500	
あみやき亭	3,400	2,898.00	9,853,200	

東京エレクトロン　デバイス	5,100	7,020.00	35,802,000	
ひらまつ	29,300	192.00	5,625,600	
円谷フィールズホールディングス	11,800	1,997.00	23,564,600	
双日	145,400	2,442.00	355,066,800	
アルフレッサ　ホールディングス	137,400	1,607.00	220,801,800	
大黒天物産	4,900	4,660.00	22,834,000	
ハニーズホールディングス	12,200	1,214.00	14,810,800	
ファーマライズホールディングス	3,100	640.00	1,984,000	
キッコーマン	84,400	7,860.00	663,384,000	
味の素	311,900	4,134.00	1,289,394,600	
ブルドックソース	5,100	1,679.00	8,562,900	
キユーピー	68,500	2,413.00	165,290,500	
ハウス食品グループ本社	39,000	2,685.00	104,715,000	
カゴメ	59,400	2,944.00	174,873,600	
焼津水産化学工業	5,800	803.00	4,657,400	
アリアケジャパン	11,100	4,905.00	54,445,500	
ピエトロ	1,700	1,797.00	3,054,900	
エバラ食品工業	3,300	3,085.00	10,180,500	
やまみ	1,100	1,307.00	1,437,700	
ニチレイ	58,500	2,619.00	153,211,500	
横浜冷凍	37,400	927.00	34,669,800	
東洋水産	64,500	5,550.00	357,975,000	
イートアンドホールディングス	5,400	2,215.00	11,961,000	
大冷	1,600	1,883.00	3,012,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	506.00	4,048,000	
日清食品ホールディングス	45,400	10,150.00	460,810,000	
永谷園ホールディングス	6,300	2,006.00	12,637,800	
一正蒲鉾	5,500	750.00	4,125,000	
フジッコ	13,100	1,915.00	25,086,500	
ロック・フィールド	15,700	1,459.00	22,906,300	
日本たばこ産業	839,000	2,780.50	2,332,839,500	
ケンコーマヨネーズ	8,700	1,620.00	14,094,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,500	1,802.00	17,119,000	
なとり	8,000	2,040.00	16,320,000	
イフジ産業	2,200	904.00	1,988,800	
ファーマフーズ	19,600	1,304.00	25,558,400	
北の達人コーポレーション	54,600	278.00	15,178,800	
ユーグレナ	82,000	883.00	72,406,000	
紀文食品	10,000	918.00	9,180,000	
ピックルスホールディングス	7,400	1,074.00	7,947,600	
スター・マイカ・ホールディングス	5,800	1,414.00	8,201,200	
ＳＲＥホールディングス	6,200	4,355.00	27,001,000	
ＡＤワークスグループ	31,800	165.00	5,247,000	
片倉工業	11,900	1,893.00	22,526,700	
グンゼ	9,800	3,820.00	37,436,000	
ヒューリック	297,300	1,116.00	331,786,800	
神栄	1,800	798.00	1,436,400	
ラサ商事	6,300	1,022.00	6,438,600	
アルペン	11,300	1,991.00	22,498,300	
ハブ	4,500	614.00	2,763,000	

ラクーンホールディングス	12,900	1,253.00	16,163,700	
クオールホールディングス	18,800	1,145.00	21,526,000	
アルコニックス	18,000	1,304.00	23,472,000	
神戸物産	105,900	3,485.00	369,061,500	
ソリトンシステムズ	6,700	1,180.00	7,906,000	
ジンズホールディングス	8,100	3,925.00	31,792,500	
ビックカメラ	91,000	1,143.00	104,013,000	
ＤＣＭホールディングス	83,600	1,176.00	98,313,600	
ペッパーフードサービス	28,600	220.00	6,292,000	
ハイパー	2,200	464.00	1,020,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	194,100	2,386.00	463,122,600	
東京一番フーズ	3,300	583.00	1,923,900	
ＤＤホールディングス	8,700	609.00	5,298,300	
あい　ホールディングス	22,000	2,245.00	49,390,000	
ディーブイエックス	3,900	970.00	3,783,000	
きちりホールディングス	3,800	309.00	1,174,200	
アークランドサービスホールディングス	11,300	2,163.00	24,441,900	
Ｊ．フロント　リテイリング	170,300	1,143.00	194,652,900	
ドトール・日レスホールディングス	24,300	1,652.00	40,143,600	
マツキヨココカラ＆カンパニー	83,100	5,130.00	426,303,000	
ブロンコビリー	7,300	2,478.00	18,089,400	
ＺＯＺＯ	90,500	3,290.00	297,745,000	
トレジャー・ファクトリー	4,100	2,168.00	8,888,800	
物語コーポレーション	7,600	7,240.00	55,024,000	
三越伊勢丹ホールディングス	230,500	1,229.00	283,284,500	
東洋紡	55,900	1,013.00	56,626,700	
ユニチカ	39,100	248.00	9,696,800	
富士紡ホールディングス	5,100	3,315.00	16,906,500	
日清紡ホールディングス	106,300	1,018.00	108,213,400	
倉敷紡績	9,800	2,031.00	19,903,800	
ダイワボウホールディングス	55,900	2,115.00	118,228,500	
シキボウ	7,200	861.00	6,199,200	
日東紡績	15,500	2,123.00	32,906,500	
トヨタ紡織	54,500	1,935.00	105,457,500	
マクニカホールディングス	33,600	3,500.00	117,600,000	
Ｈａｍｅｅ	5,500	866.00	4,763,000	
マーケットエンタープライズ	1,300	1,089.00	1,415,700	
ラクト・ジャパン	5,300	2,047.00	10,849,100	
ウエルシアホールディングス	71,100	3,025.00	215,077,500	
クリエイトＳＤホールディングス	22,700	3,195.00	72,526,500	
グリムス	5,700	1,755.00	10,003,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,900	760.00	15,124,000	
八洲電機	11,100	1,015.00	11,266,500	
メディアスホールディングス	8,700	706.00	6,142,200	
レスターホールディングス	13,100	2,151.00	28,178,100	
ジューテックホールディングス	2,700	1,130.00	3,051,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	16,400	325.00	5,330,000	
大光	6,000	688.00	4,128,000	

ＯＣＨＩホールディングス	3,300	1,231.00	4,062,300	
ＴＯＫＡＩホールディングス	67,600	875.00	59,150,000	
黒谷	3,900	568.00	2,215,200	
ミサワ	2,400	589.00	1,413,600	
ティーライフ	1,700	1,278.00	2,172,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,400	727.00	1,744,800	
エー・ピーホールディングス	1,900	443.00	841,700	
三洋貿易	14,000	1,135.00	15,890,000	
チムニー	4,300	1,087.00	4,674,100	
シュッピン	10,200	1,360.00	13,872,000	
ビューティガレージ	2,400	2,748.00	6,595,200	
オイシックス・ラ・大地	18,400	1,859.00	34,205,600	
ウイン・パートナーズ	10,100	979.00	9,887,900	
ネクステージ	31,200	2,778.00	86,673,600	
ジョイフル本田	44,000	1,835.00	80,740,000	
鳥貴族ホールディングス	5,100	2,133.00	10,878,300	
ホットランド	10,500	1,390.00	14,595,000	
すかいらーくホールディングス	187,200	1,549.00	289,972,800	
ＳＦＰホールディングス	7,500	1,610.00	12,075,000	
綿半ホールディングス	10,700	1,351.00	14,455,700	
日本毛織	37,600	1,005.00	37,788,000	
ダイトウボウ	21,600	84.00	1,814,400	
トーア紡コーポレーション	4,100	355.00	1,455,500	
ダイドーリミテッド	19,800	173.00	3,425,400	
ヨシックスホールディングス	2,600	2,102.00	5,465,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,700	1,059.00	47,337,300	
三栄建築設計	6,200	1,448.00	8,977,600	
野村不動産ホールディングス	79,600	3,230.00	257,108,000	
三重交通グループホールディングス	27,300	496.00	13,540,800	
サムティ	20,200	2,346.00	47,389,200	
ディア・ライフ	19,200	606.00	11,635,200	
コーセーアールイー	4,200	671.00	2,818,200	
地主	9,800	2,048.00	20,070,400	
プレサンスコーポレーション	16,800	1,486.00	24,964,800	
フィル・カンパニー	2,200	1,086.00	2,389,200	
ＴＨＥグローバル社	7,500	220.00	1,650,000	
ハウスコム	2,000	970.00	1,940,000	
ＪＰＭＣ	6,500	1,019.00	6,623,500	
サンセイランディック	3,900	857.00	3,342,300	
エストラスト	1,500	563.00	844,500	
フージャースホールディングス	19,600	746.00	14,621,600	
オープンハウスグループ	46,700	5,610.00	261,987,000	
東急不動産ホールディングス	383,200	746.00	285,867,200	
飯田グループホールディングス	111,600	2,202.00	245,743,200	
イーグランド	1,900	1,544.00	2,933,600	
ムゲンエステート	8,500	471.00	4,003,500	
帝国繊維	14,500	1,580.00	22,910,000	
日本コークス工業	117,100	84.00	9,836,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	1,398.00	8,667,600	

ミタチ産業	3,600	992.00	3,571,200	
ＢＥＥＮＯＳ	7,700	2,968.00	22,853,600	
あさひ	11,500	1,298.00	14,927,000	
日本調剤	9,400	1,198.00	11,261,200	
コスモス薬品	15,600	14,390.00	224,484,000	
シップヘルスケアホールディングス	49,200	2,887.00	142,040,400	
トーエル	6,100	701.00	4,276,100	
ソフトクリエイトホールディングス	5,400	3,470.00	18,738,000	
セブン&アイ・ホールディングス	471,900	5,669.00	2,675,201,100	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	103,000	922.00	94,966,000	
明治電機工業	5,100	1,026.00	5,232,600	
ツルハホールディングス	33,600	8,700.00	292,320,000	
デリカフーズホールディングス	5,600	510.00	2,856,000	
スターティアホールディングス	2,600	1,203.00	3,127,800	
サンマルクホールディングス	11,100	1,590.00	17,649,000	
フェリシモ	3,200	989.00	3,164,800	
トリドールホールディングス	34,100	2,611.00	89,035,100	
帝人	124,500	1,241.00	154,504,500	
東レ	868,500	723.50	628,359,750	
クラレ	206,200	1,047.00	215,891,400	
旭化成	809,600	980.00	793,408,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	14,000	343.00	4,802,000	
稲葉製作所	7,800	1,370.00	10,686,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,800	3,310.00	12,578,000	
トーカロ	36,700	1,237.00	45,397,900	
アルファ	5,000	931.00	4,655,000	
ＳＵＭＣＯ	254,200	2,078.00	528,227,600	
川田テクノロジーズ	3,300	3,560.00	11,748,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4,400	9,410.00	41,404,000	
ジェイテックコーポレーション	1,700	1,548.00	2,631,600	
信和	7,300	800.00	5,840,000	
ビーロット	8,600	561.00	4,824,600	
ファーストブラザーズ	2,500	865.00	2,162,500	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	7,500	840.00	6,300,000	
シーアールイー	5,800	1,498.00	8,688,400	
プロパティエージェント	1,500	1,317.00	1,975,500	
ケイアイスター不動産	6,100	4,760.00	29,036,000	
アグレ都市デザイン	2,200	1,459.00	3,209,800	
グッドコムアセット	11,800	682.00	8,047,600	
ジェイ・エス・ビー	3,200	4,155.00	13,296,000	
ロードスターキャピタル	5,500	1,615.00	8,882,500	
テンポイノベーション	4,000	937.00	3,748,000	
グローバル・リンク・マネジメント	2,400	1,069.00	2,565,600	
フェイスネットワーク	1,700	1,345.00	2,286,500	
住江織物	2,300	1,795.00	4,128,500	
日本フエルト	7,300	397.00	2,898,100	
イチカワ	1,500	1,300.00	1,950,000	
エコナックホールディングス	23,100	90.00	2,079,000	
日東製網	1,500	1,333.00	1,999,500	

芦森工業	2,300	1,104.00	2,539,200	
アツギ	7,400	365.00	2,701,000	
ウイルプラスホールディングス	2,500	978.00	2,445,000	
ＪＭホールディングス	11,600	1,700.00	19,720,000	
コメダホールディングス	33,600	2,420.00	81,312,000	
サツドラホールディングス	6,200	680.00	4,216,000	
アレンザホールディングス	10,300	969.00	9,980,700	
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,810.00	6,697,000	
バロックジャパンリミテッド	8,900	782.00	6,959,800	
クスリのアオキホールディングス	13,700	7,270.00	99,599,000	
ダイニック	3,400	605.00	2,057,000	
共和レザー	7,500	500.00	3,750,000	
ピーバンドットコム	1,700	514.00	873,800	
力の源ホールディングス	7,500	762.00	5,715,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	78,600	2,795.00	219,687,000	
アセンテック	4,600	521.00	2,396,600	
セーレン	25,000	2,488.00	62,200,000	
ソトー	4,200	781.00	3,280,200	
東海染工	1,300	1,132.00	1,471,600	
小松マテーレ	18,800	797.00	14,983,600	
ワコールホールディングス	24,900	2,436.00	60,656,400	
ホギメディカル	17,400	3,360.00	58,464,000	
クラウディアホールディングス	3,100	293.00	908,300	
ＴＳＩホールディングス	46,400	453.00	21,019,200	
マツオカコーポレーション	3,600	980.00	3,528,000	
ワールド	16,700	1,313.00	21,927,100	
ＴＩＳ	145,900	4,195.00	612,050,500	
ＪＮＳホールディングス	5,800	344.00	1,995,200	
グリー	69,600	797.00	55,471,200	
GMOペパボ	1,800	2,119.00	3,814,200	
コーエーテクモホールディングス	81,300	2,355.00	191,461,500	
三菱総合研究所	6,400	4,950.00	31,680,000	
ボルテージ	3,800	321.00	1,219,800	
電算	800	1,610.00	1,288,000	
ＡＧＳ	5,500	626.00	3,443,000	
ファインデックス	10,400	581.00	6,042,400	
ブレインパッド	12,900	904.00	11,661,600	
ＫＬａｂ	25,500	498.00	12,699,000	
ポールトゥウィンホールディングス	22,200	934.00	20,734,800	
ネクソン	335,400	2,560.00	858,624,000	
アイスタイル	41,500	529.00	21,953,500	
エムアップホールディングス	16,000	1,407.00	22,512,000	
エイチーム	9,700	773.00	7,498,100	
エニグモ	16,500	569.00	9,388,500	
テクノスジャパン	10,700	477.00	5,103,900	
ｅｎｉｓｈ	9,800	496.00	4,860,800	
コロプラ	50,400	698.00	35,179,200	
オルトプラス	9,900	268.00	2,653,200	
ブロードリーフ	75,800	506.00	38,354,800	

クロス・マーケティンググループ	5,200	899.00	4,674,800	
デジタルハーツホールディングス	8,000	2,006.00	16,048,000	
システム情報	11,500	996.00	11,454,000	
メディアドゥ	5,300	2,024.00	10,727,200	
じげん	37,700	370.00	13,949,000	
ブイキューブ	15,600	859.00	13,400,400	
エンカレッジ・テクノロジ	3,200	511.00	1,635,200	
サイバーリンクス	4,200	1,365.00	5,733,000	
ディー・エル・イー	9,400	340.00	3,196,000	
フィックスターズ	14,600	1,154.00	16,848,400	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,200	1,742.00	10,800,400	
オプティム	10,700	974.00	10,421,800	
セレス	5,200	976.00	5,075,200	
ＳＨＩＦＴ	9,600	26,510.00	254,496,000	
特種東海製紙	6,500	3,010.00	19,565,000	
ティーガイア	13,500	1,650.00	22,275,000	
セック	1,700	2,275.00	3,867,500	
テクマトリックス	23,700	1,714.00	40,621,800	
プロシップ	5,700	1,560.00	8,892,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,800	2,228.00	88,674,400	
GMOペイメントゲートウェイ	29,700	11,820.00	351,054,000	
ザッパラス	4,900	365.00	1,788,500	
システムリサーチ	4,100	2,040.00	8,364,000	
インターネットイニシアティブ	72,400	2,462.00	178,248,800	
さくらインターネット	14,500	533.00	7,728,500	
ヴィンクス	3,900	1,433.00	5,588,700	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,000	4,695.00	18,780,000	
ＳＲＡホールディングス	6,600	3,305.00	21,813,000	
システムインテグレータ	4,000	460.00	1,840,000	
朝日ネット	13,900	591.00	8,214,900	
ｅＢＡＳＥ	18,200	592.00	10,774,400	
アバントグループ	16,400	1,503.00	24,649,200	
アドソル日進	5,500	1,433.00	7,881,500	
ＯＤＫソリューションズ	2,800	608.00	1,702,400	
フリービット	7,900	1,107.00	8,745,300	
コムチュア	17,200	2,569.00	44,186,800	
サイバーコム	2,000	1,419.00	2,838,000	
アステリア	10,200	844.00	8,608,800	
アイル	7,200	1,875.00	13,500,000	
王子ホールディングス	540,100	536.00	289,493,600	
日本製紙	67,400	936.00	63,086,400	
三菱製紙	15,700	280.00	4,396,000	
北越コーポレーション	81,900	846.00	69,287,400	
中越パルプ工業	5,200	934.00	4,856,800	
巴川製紙所	4,100	796.00	3,263,600	
大王製紙	57,300	1,112.00	63,717,600	
阿波製紙	3,300	303.00	999,900	
マークラインズ	7,000	2,630.00	18,410,000	

メディカル・データ・ビジョン	19,300	1,074.00	20,728,200	
ｇｕｍｉ	21,200	820.00	17,384,000	
ショーケース	3,200	363.00	1,161,600	
モバイルファクトリー	2,600	987.00	2,566,200	
テラスカイ	5,600	2,440.00	13,664,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,700	1,750.00	11,725,000	
ＰＣＩホールディングス	5,400	1,074.00	5,799,600	
アイビーシー	1,900	475.00	902,500	
ネオジャパン	4,400	1,033.00	4,545,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,400	2,407.00	8,183,800	
ラクス	61,300	1,867.00	114,447,100	
ランドコンピュータ	3,300	844.00	2,785,200	
ダブルスタンダード	5,300	2,662.00	14,108,600	
オープンドア	9,200	1,769.00	16,274,800	
マイネット	4,200	461.00	1,936,200	
アカツキ	6,100	2,258.00	13,773,800	
ベネフィットジャパン	800	1,340.00	1,072,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,100	2,120.00	8,692,000	
カナミックネットワーク	18,700	675.00	12,622,500	
ノムラシステムコーポレーション	12,400	124.00	1,537,600	
レンゴー	118,000	871.00	102,778,000	
トーモク	7,500	1,611.00	12,082,500	
ザ・パック	9,700	2,487.00	24,123,900	
チェンジ	31,700	1,990.00	63,083,000	
シンクロ・フード	8,100	481.00	3,896,100	
オークネット	6,700	1,863.00	12,482,100	
キャピタル・アセット・プランニング	2,500	570.00	1,425,000	
セグエグループ	3,600	872.00	3,139,200	
エイトレッド	1,900	1,472.00	2,796,800	
マクロミル	29,400	1,110.00	32,634,000	
ビーグリー	2,100	1,410.00	2,961,000	
オロ	4,000	1,671.00	6,684,000	
ユーザーローカル	4,700	1,620.00	7,614,000	
テモナ	2,500	258.00	645,000	
ニーズウェル	4,100	672.00	2,755,200	
マネーフォワード	31,200	5,030.00	156,936,000	
サインポスト	5,000	736.00	3,680,000	
昭和電工	125,300	2,189.00	274,281,700	
住友化学	961,700	480.00	461,616,000	
住友精化	5,400	3,720.00	20,088,000	
日産化学	61,500	6,690.00	411,435,000	
ラサ工業	5,000	2,361.00	11,805,000	
クレハ	11,100	10,040.00	111,444,000	
多木化学	5,100	5,190.00	26,469,000	
テイカ	8,600	1,311.00	11,274,600	
石原産業	23,500	1,076.00	25,286,000	
片倉コープアグリ	2,600	1,238.00	3,218,800	
日本曹達	13,900	4,230.00	58,797,000	
東ソー	173,000	1,565.00	270,745,000	

トクヤマ	41,900	1,799.00	75,378,100	
セントラル硝子	20,800	3,805.00	79,144,000	
東亞合成	66,600	1,164.00	77,522,400	
大阪ソーダ	7,700	3,920.00	30,184,000	
関東電化工業	25,000	996.00	24,900,000	
デンカ	47,200	3,390.00	160,008,000	
イビデン	75,000	5,710.00	428,250,000	
信越化学工業	221,700	17,045.00	3,778,876,500	
日本カーバイド工業	5,000	1,262.00	6,310,000	
電算システムホールディングス	6,300	2,367.00	14,912,100	
堺化学工業	9,900	1,864.00	18,453,600	
第一稀元素化学工業	11,800	1,301.00	15,351,800	
エア・ウォーター	122,300	1,592.00	194,701,600	
日本酸素ホールディングス	125,800	2,239.00	281,666,200	
日本化学工業	4,400	1,812.00	7,972,800	
東邦アセチレン	2,700	1,103.00	2,978,100	
日本パーカライジング	64,300	978.00	62,885,400	
高圧ガス工業	18,900	657.00	12,417,300	
チタン工業	1,500	1,684.00	2,526,000	
四国化成工業	15,500	1,323.00	20,506,500	
戸田工業	2,800	3,165.00	8,862,000	
ステラ　ケミファ	7,600	2,593.00	19,706,800	
保土谷化学工業	3,700	3,080.00	11,396,000	
日本触媒	19,700	5,380.00	105,986,000	
大日精化工業	9,000	1,729.00	15,561,000	
カネカ	29,600	3,365.00	99,604,000	
協和キリン	156,900	3,165.00	496,588,500	
三菱瓦斯化学	96,800	1,920.00	185,856,000	
三井化学	109,000	3,060.00	333,540,000	
ＪＳＲ	121,000	2,799.00	338,679,000	
東京応化工業	22,700	6,560.00	148,912,000	
大阪有機化学工業	9,800	2,116.00	20,736,800	
三菱ケミカルグループ	874,700	722.10	631,620,870	
ＫＨネオケム	21,600	2,739.00	59,162,400	
ダイセル	190,500	970.00	184,785,000	
住友ベークライト	19,200	4,240.00	81,408,000	
積水化学工業	269,200	1,925.00	518,210,000	
日本ゼオン	77,800	1,367.00	106,352,600	
アイカ工業	32,700	3,245.00	106,111,500	
ＵＢＥ	66,800	1,942.00	129,725,600	
積水樹脂	18,900	1,729.00	32,678,100	
タキロンシーアイ	28,500	511.00	14,563,500	
旭有機材	8,500	2,644.00	22,474,000	
ニチバン	8,000	1,753.00	14,024,000	
リケンテクノス	28,000	497.00	13,916,000	
大倉工業	6,000	1,886.00	11,316,000	
積水化成品工業	18,200	386.00	7,025,200	
群栄化学工業	2,700	2,421.00	6,536,700	
タイガースポリマー	6,100	393.00	2,397,300	
ミライアル	4,000	1,675.00	6,700,000	

ダイキアクシス	4,800	714.00	3,427,200	
ダイキョーニシカワ	28,600	630.00	18,018,000	
竹本容器	4,500	725.00	3,262,500	
森六ホールディングス	6,600	1,769.00	11,675,400	
恵和	4,300	3,695.00	15,888,500	
日本化薬	99,000	1,196.00	118,404,000	
カーリットホールディングス	11,700	672.00	7,862,400	
ソルクシーズ	10,600	370.00	3,922,000	
ＣＬホールディングス	3,800	862.00	3,275,600	
プレステージ・インターナショナル	55,900	735.00	41,086,500	
フェイス	3,800	545.00	2,071,000	
プロトコーポレーション	16,300	1,185.00	19,315,500	
ハイマックス	4,100	1,518.00	6,223,800	
アミューズ	7,200	1,753.00	12,621,600	
野村総合研究所	266,300	3,335.00	888,110,500	
ドリームインキュベータ	4,100	2,629.00	10,778,900	
サイバネットシステム	10,900	1,009.00	10,998,100	
クイック	10,200	2,043.00	20,838,600	
ＴＡＣ	6,700	204.00	1,366,800	
ＣＥホールディングス	6,700	496.00	3,323,200	
日本システム技術	5,400	1,664.00	8,985,600	
電通グループ	139,600	4,610.00	643,556,000	
インテージホールディングス	17,600	1,486.00	26,153,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,538.00	7,074,800	
東邦システムサイエンス	3,800	1,013.00	3,849,400	
ぴあ	4,500	3,310.00	14,895,000	
イオンファンタジー	5,800	2,707.00	15,700,600	
ソースネクスト	66,000	302.00	19,932,000	
シーティーエス	14,800	843.00	12,476,400	
ネクシィーズグループ	4,200	701.00	2,944,200	
インフォコム	16,800	2,073.00	34,826,400	
メディカルシステムネットワーク	11,900	409.00	4,867,100	
日本精化	7,300	2,204.00	16,089,200	
扶桑化学工業	12,000	3,460.00	41,520,000	
トリケミカル研究所	17,300	2,392.00	41,381,600	
シンプレクス・ホールディングス	21,800	2,271.00	49,507,800	
ＨＥＲＯＺ	4,400	1,120.00	4,928,000	
ラクスル	18,300	3,095.00	56,638,500	
メルカリ	58,400	3,020.00	176,368,000	
ＩＰＳ	4,300	3,130.00	13,459,000	
ＦＩＧ	15,000	395.00	5,925,000	
システムサポート	5,600	1,483.00	8,304,800	
ＡＤＥＫＡ	45,200	2,202.00	99,530,400	
日油	40,200	5,460.00	219,492,000	
ミヨシ油脂	4,600	987.00	4,540,200	
新日本理化	17,900	267.00	4,779,300	
ハリマ化成グループ	9,200	821.00	7,553,200	
イーソル	8,200	652.00	5,346,400	
アルテリア・ネットワークス	12,100	1,232.00	14,907,200	
東海ソフト	2,100	904.00	1,898,400	

ウイングアーク１ｓｔ	13,300	2,314.00	30,776,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,600	1,693.00	6,094,800	
サーバーワークス	2,500	2,620.00	6,550,000	
東名	900	1,497.00	1,347,300	
ヴィッツ	1,200	954.00	1,144,800	
トビラシステムズ	3,300	1,046.00	3,451,800	
Ｓａｎｓａｎ	48,400	1,720.00	83,248,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,400	843.00	2,023,200	
ギフティ	13,900	2,297.00	31,928,300	
花王	315,700	5,430.00	1,714,251,000	
第一工業製薬	4,700	1,922.00	9,033,400	
石原ケミカル	5,900	1,232.00	7,268,800	
日華化学	5,300	876.00	4,642,800	
ニイタカ	2,500	2,088.00	5,220,000	
三洋化成工業	7,900	4,305.00	34,009,500	
ベース	4,500	4,115.00	18,517,500	
ＪＭＤＣ	21,400	5,280.00	112,992,000	
武田薬品工業	1,148,600	3,868.00	4,442,784,800	
アステラス製薬	1,243,900	2,076.00	2,582,336,400	
住友ファーマ	96,300	1,028.00	98,996,400	
塩野義製薬	165,900	6,679.00	1,108,046,100	
わかもと製薬	12,100	224.00	2,710,400	
日本新薬	30,600	8,330.00	254,898,000	
中外製薬	406,400	3,436.00	1,396,390,400	
科研製薬	22,300	3,810.00	84,963,000	
エーザイ	157,900	8,387.00	1,324,307,300	
理研ビタミン	11,100	1,837.00	20,390,700	
ロート製薬	62,900	4,155.00	261,349,500	
小野薬品工業	250,400	3,368.00	843,347,200	
久光製薬	28,900	3,600.00	104,040,000	
有機合成薬品工業	9,800	300.00	2,940,000	
持田製薬	15,600	3,170.00	49,452,000	
参天製薬	252,100	1,035.00	260,923,500	
扶桑薬品工業	4,200	2,032.00	8,534,400	
日本ケミファ	1,300	1,680.00	2,184,000	
ツムラ	40,900	2,966.00	121,309,400	
日医工	37,900	362.00	13,719,800	
テルモ	404,300	4,059.00	1,641,053,700	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	38,900	2,824.00	109,853,600	
キッセイ薬品工業	20,000	2,444.00	48,880,000	
生化学工業	24,700	917.00	22,649,900	
栄研化学	21,100	1,895.00	39,984,500	
鳥居薬品	6,900	2,912.00	20,092,800	
ＪＣＲファーマ	43,900	1,896.00	83,234,400	
東和薬品	19,900	2,221.00	44,197,900	
富士製薬工業	8,300	1,038.00	8,615,400	
ゼリア新薬工業	18,000	2,198.00	39,564,000	
第一三共	1,130,700	4,656.00	5,264,539,200	
キョーリン製薬ホールディングス	28,200	1,771.00	49,942,200	

大幸薬品	23,500	531.00	12,478,500	
ダイト	9,800	2,548.00	24,970,400	
大塚ホールディングス	297,000	4,582.00	1,360,854,000	
大正製薬ホールディングス	28,900	5,320.00	153,748,000	
ペプチドリーム	62,900	1,815.00	114,163,500	
大日本塗料	16,000	761.00	12,176,000	
日本ペイントホールディングス	573,600	1,016.00	582,777,600	
関西ペイント	118,700	1,844.00	218,882,800	
神東塗料	11,500	131.00	1,506,500	
中国塗料	24,000	1,029.00	24,696,000	
日本特殊塗料	8,200	864.00	7,084,800	
藤倉化成	17,600	398.00	7,004,800	
太陽ホールディングス	19,700	2,558.00	50,392,600	
ＤＩＣ	50,700	2,544.00	128,980,800	
サカタインクス	28,900	1,051.00	30,373,900	
東洋インキＳＣホールディングス	25,400	1,922.00	48,818,800	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	11,500	899.00	10,338,500	
アルプス技研	11,600	2,127.00	24,673,200	
サニックス	21,400	229.00	4,900,600	
日本空調サービス	14,300	708.00	10,124,400	
オリエンタルランド	140,800	19,655.00	2,767,424,000	
フォーカスシステムズ	9,600	1,025.00	9,840,000	
ダスキン	29,600	2,931.00	86,757,600	
パーク２４	99,300	1,942.00	192,840,600	
明光ネットワークジャパン	17,500	613.00	10,727,500	
ファルコホールディングス	6,000	1,783.00	10,698,000	
クレスコ	10,100	1,732.00	17,493,200	
フジ・メディア・ホールディングス	124,600	1,027.00	127,964,200	
秀英予備校	3,100	430.00	1,333,000	
田谷	1,600	538.00	860,800	
ラウンドワン	111,200	617.00	68,610,400	
リゾートトラスト	52,600	2,266.00	119,191,600	
オービック	43,300	22,070.00	955,631,000	
ジャストシステム	18,600	3,300.00	61,380,000	
ＴＤＣソフト	11,000	1,304.00	14,344,000	
Ｚホールディングス	1,847,100	365.10	674,376,210	
ビー・エム・エル	16,500	3,365.00	55,522,500	
トレンドマイクロ	75,000	7,190.00	539,250,000	
りらいあコミュニケーションズ	22,000	1,044.00	22,968,000	
ＩＤホールディングス	8,700	926.00	8,056,200	
リソー教育	60,500	325.00	19,662,500	
日本オラクル	24,800	8,120.00	201,376,000	
早稲田アカデミー	7,400	1,109.00	8,206,600	
アルファシステムズ	4,200	4,325.00	18,165,000	
フューチャー	32,200	1,659.00	53,419,800	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,000	1,484.00	11,872,000	
ＳＢテクノロジー	5,500	2,094.00	11,517,000	
トーセ	3,500	773.00	2,705,500	
ユー・エス・エス	136,800	2,162.00	295,761,600	
オービックビジネスコンサルタント	25,500	4,325.00	110,287,500	

伊藤忠テクノソリューションズ	69,700	3,335.00	232,449,500	
アイティフォー	17,100	785.00	13,423,500	
東京個別指導学院	15,900	530.00	8,427,000	
東計電算	1,600	5,860.00	9,376,000	
サイバーエージェント	318,300	1,184.00	376,867,200	
楽天グループ	615,200	696.00	428,179,200	
エックスネット	1,800	998.00	1,796,400	
クリーク・アンド・リバー社	7,700	2,107.00	16,223,900	
モーニングスター	21,800	456.00	9,940,800	
テー・オー・ダブリュー	28,600	305.00	8,723,000	
大塚商会	73,500	4,535.00	333,322,500	
サイボウズ	17,900	2,142.00	38,341,800	
山田コンサルティンググループ	6,700	1,145.00	7,671,500	
セントラルスポーツ	5,100	2,386.00	12,168,600	
パラカ	4,600	1,813.00	8,339,800	
電通国際情報サービス	15,900	4,785.00	76,081,500	
ＡＣＣＥＳＳ	15,500	802.00	12,431,000	
デジタルガレージ	23,100	3,830.00	88,473,000	
イーエムシステムズ	21,700	971.00	21,070,700	
ウェザーニューズ	4,600	7,860.00	36,156,000	
ＣＩＪ	11,900	825.00	9,817,500	
ビジネスエンジニアリング	2,700	2,140.00	5,778,000	
日本エンタープライズ	13,700	140.00	1,918,000	
WOWOW	7,300	1,223.00	8,927,900	
スカラ	12,800	746.00	9,548,800	
インテリジェント　ウェイブ	6,900	739.00	5,099,100	
フルキャストホールディングス	12,700	2,968.00	37,693,600	
エン・ジャパン	24,100	2,463.00	59,358,300	
あすか製薬ホールディングス	13,300	1,121.00	14,909,300	
サワイグループホールディングス	29,700	4,115.00	122,215,500	
富士フイルムホールディングス	249,100	7,525.00	1,874,477,500	
コニカミノルタ	291,900	536.00	156,458,400	
資生堂	271,000	5,638.00	1,527,898,000	
ライオン	155,800	1,443.00	224,819,400	
高砂香料工業	8,700	2,826.00	24,586,200	
マンダム	28,100	1,357.00	38,131,700	
ミルボン	19,200	6,220.00	119,424,000	
ファンケル	56,800	2,582.00	146,657,600	
コーセー	26,300	15,550.00	408,965,000	
コタ	10,900	1,661.00	18,104,900	
シーボン	1,500	1,584.00	2,376,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	66,500	1,675.00	111,387,500	
ノエビアホールディングス	11,600	5,630.00	65,308,000	
アジュバンホールディングス	3,300	917.00	3,026,100	
新日本製薬	7,400	1,565.00	11,581,000	
エステー	10,100	1,511.00	15,261,100	
アグロ　カネショウ	4,800	1,348.00	6,470,400	
コニシ	21,800	1,809.00	39,436,200	
長谷川香料	26,900	3,230.00	86,887,000	
星光ＰＭＣ	6,600	536.00	3,537,600	

小林製薬	39,800	8,190.00	325,962,000	
荒川化学工業	11,100	942.00	10,456,200	
メック	10,700	2,435.00	26,054,500	
日本高純度化学	3,500	2,329.00	8,151,500	
タカラバイオ	35,000	1,807.00	63,245,000	
ＪＣＵ	14,600	3,345.00	48,837,000	
新田ゼラチン	7,900	954.00	7,536,600	
ＯＡＴアグリオ	5,300	1,593.00	8,442,900	
デクセリアルズ	37,400	3,240.00	121,176,000	
アース製薬	11,800	5,300.00	62,540,000	
北興化学工業	13,000	914.00	11,882,000	
大成ラミック	4,200	3,020.00	12,684,000	
クミアイ化学工業	51,600	937.00	48,349,200	
日本農薬	23,800	741.00	17,635,800	
富士興産	3,200	1,178.00	3,769,600	
ニチレキ	15,500	1,262.00	19,561,000	
ユシロ化学工業	6,700	804.00	5,386,800	
ビーピー・カストロール	5,100	924.00	4,712,400	
富士石油	26,400	274.00	7,233,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,300	1,051.00	4,519,300	
出光興産	144,100	3,195.00	460,399,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,344,900	490.60	1,150,407,940	
コスモエネルギーホールディングス	49,200	4,000.00	196,800,000	
テスホールディングス	13,600	1,039.00	14,130,400	
インフロニア・ホールディングス	133,000	1,011.00	134,463,000	
横浜ゴム	73,800	2,261.00	166,861,800	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	74,600	1,675.00	124,955,000	
ブリヂストン	414,500	5,398.00	2,237,471,000	
住友ゴム工業	127,400	1,123.00	143,070,200	
藤倉コンポジット	9,300	842.00	7,830,600	
オカモト	7,200	3,785.00	27,252,000	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ　ＧＲＯＵＰ	2,200	1,048.00	2,305,600	
アキレス	8,400	1,374.00	11,541,600	
フコク	6,800	1,026.00	6,976,800	
ニッタ	13,200	2,911.00	38,425,200	
クリエートメディック	4,400	871.00	3,832,400	
住友理工	25,200	612.00	15,422,400	
三ツ星ベルト	18,900	3,305.00	62,464,500	
バンドー化学	20,500	1,011.00	20,725,500	
ＡＧＣ	132,100	4,500.00	594,450,000	
日本板硝子	66,100	558.00	36,883,800	
石塚硝子	2,000	1,472.00	2,944,000	
有沢製作所	21,200	1,242.00	26,330,400	
日本山村硝子	4,900	585.00	2,866,500	
日本電気硝子	53,000	2,518.00	133,454,000	
オハラ	6,200	1,244.00	7,712,800	
住友大阪セメント	18,300	3,115.00	57,004,500	
太平洋セメント	82,700	2,009.00	166,144,300	
リソルホールディングス	1,200	4,515.00	5,418,000	
日本ヒューム	11,600	631.00	7,319,600	

日本コンクリート工業	25,400	242.00	6,146,800	
三谷セキサン	5,500	3,960.00	21,780,000	
アジアパイルホールディングス	20,400	515.00	10,506,000	
東海カーボン	108,800	1,070.00	116,416,000	
日本カーボン	7,400	4,300.00	31,820,000	
東洋炭素	8,100	3,855.00	31,225,500	
ノリタケカンパニーリミテド	6,500	3,995.00	25,967,500	
ＴＯＴＯ	85,600	4,475.00	383,060,000	
日本碍子	153,600	1,768.00	271,564,800	
日本特殊陶業	98,800	2,635.00	260,338,000	
ダントーホールディングス	9,300	257.00	2,390,100	
ＭＡＲＵＷＡ	4,800	18,430.00	88,464,000	
品川リフラクトリーズ	3,700	4,010.00	14,837,000	
黒崎播磨	2,600	4,905.00	12,753,000	
ヨータイ	8,600	1,419.00	12,203,400	
東京窯業	11,900	270.00	3,213,000	
ニッカトー	5,800	467.00	2,708,600	
フジミインコーポレーテッド	10,400	6,510.00	67,704,000	
クニミネ工業	3,900	802.00	3,127,800	
エーアンドエーマテリアル	2,400	855.00	2,052,000	
ニチアス	32,800	2,418.00	79,310,400	
日本製鉄	597,900	2,188.50	1,308,504,150	
神戸製鋼所	268,500	606.00	162,711,000	
中山製鋼所	27,600	691.00	19,071,600	
合同製鐵	6,600	1,872.00	12,355,200	
ＪＦＥホールディングス	356,900	1,496.00	533,922,400	
東京製鐵	37,500	1,362.00	51,075,000	
共英製鋼	15,300	1,318.00	20,165,400	
大和工業	22,100	4,780.00	105,638,000	
東京鐵鋼	6,400	1,396.00	8,934,400	
大阪製鐵	6,200	1,127.00	6,987,400	
淀川製鋼所	15,300	2,510.00	38,403,000	
丸一鋼管	40,700	2,825.00	114,977,500	
モリ工業	3,200	2,764.00	8,844,800	
大同特殊鋼	16,900	4,290.00	72,501,000	
日本高周波鋼業	4,100	321.00	1,316,100	
日本冶金工業	9,800	3,790.00	37,142,000	
山陽特殊製鋼	13,200	2,210.00	29,172,000	
愛知製鋼	7,700	2,366.00	18,218,200	
日本金属	2,800	955.00	2,674,000	
大平洋金属	9,600	1,917.00	18,403,200	
新日本電工	85,400	406.00	34,672,400	
栗本鐵工所	6,400	1,782.00	11,404,800	
虹　技	1,600	881.00	1,409,600	
日本鋳鉄管	1,400	951.00	1,331,400	
日本製鋼所	36,000	3,130.00	112,680,000	
三菱製鋼	8,300	980.00	8,134,000	
日亜鋼業	13,900	235.00	3,266,500	
日本精線	1,800	4,190.00	7,542,000	
エンビプロ・ホールディングス	9,300	702.00	6,528,600	

大紀アルミニウム工業所	19,000	1,289.00	24,491,000	
日本軽金属ホールディングス	36,100	1,514.00	54,655,400	
三井金属鉱業	38,900	3,135.00	121,951,500	
東邦亜鉛	7,800	2,199.00	17,152,200	
三菱マテリアル	89,200	2,099.00	187,230,800	
住友金属鉱山	154,800	4,536.00	702,172,800	
ＤＯＷＡホールディングス	30,000	4,925.00	147,750,000	
古河機械金属	19,600	1,328.00	26,028,800	
エス・サイエンス	80,900	28.00	2,265,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,500	4,370.00	85,215,000	
東邦チタニウム	24,200	3,050.00	73,810,000	
ＵＡＣＪ	18,700	2,099.00	39,251,300	
ＣＫサンエツ	2,600	4,170.00	10,842,000	
古河電気工業	44,500	2,500.00	111,250,000	
住友電気工業	461,100	1,606.50	740,757,150	
フジクラ	143,100	1,110.00	158,841,000	
昭和電線ホールディングス	14,900	1,648.00	24,555,200	
東京特殊電線	1,700	5,640.00	9,588,000	
タツタ電線	27,300	437.00	11,930,100	
カナレ電気	2,100	1,473.00	3,093,300	
平河ヒューテック	7,700	1,128.00	8,685,600	
いよぎんホールディングス	151,800	661.00	100,339,800	
しずおかフィナンシャルグループ	288,100	928.00	267,356,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	107,400	881.00	94,619,400	
リョービ	14,100	1,195.00	16,849,500	
アーレスティ	14,600	375.00	5,475,000	
アサヒホールディングス	54,000	1,959.00	105,786,000	
東洋製罐グループホールディングス	88,300	1,558.00	137,571,400	
ホッカンホールディングス	7,200	1,311.00	9,439,200	
コロナ	7,600	850.00	6,460,000	
横河ブリッジホールディングス	17,700	1,872.00	33,134,400	
駒井ハルテック	2,100	1,542.00	3,238,200	
高田機工	600	2,368.00	1,420,800	
三和ホールディングス	123,000	1,280.00	157,440,000	
文化シヤッター	38,500	1,121.00	43,158,500	
三協立山	18,300	569.00	10,412,700	
アルインコ	10,300	988.00	10,176,400	
東洋シヤッター	2,200	495.00	1,089,000	
ＬＩＸＩＬ	194,500	2,100.00	408,450,000	
日本フイルコン	8,900	461.00	4,102,900	
ノーリツ	19,600	1,490.00	29,204,000	
長府製作所	13,400	1,961.00	26,277,400	
リンナイ	24,200	10,150.00	245,630,000	
ユニプレス	23,200	870.00	20,184,000	
ダイニチ工業	6,600	669.00	4,415,400	
日東精工	19,300	510.00	9,843,000	
三洋工業	1,500	1,709.00	2,563,500	
岡部	21,600	712.00	15,379,200	
ジーテクト	14,900	1,461.00	21,768,900	
東プレ	23,500	1,216.00	28,576,000	

高周波熱錬	21,900	683.00	14,957,700	
東京製綱	7,800	889.00	6,934,200	
サンコール	11,900	672.00	7,996,800	
モリテックスチール	10,000	275.00	2,750,000	
パイオラックス	18,400	1,714.00	31,537,600	
エイチワン	13,700	627.00	8,589,900	
日本発条	118,100	895.00	105,699,500	
中央発條	7,400	704.00	5,209,600	
アドバネクス	1,600	1,061.00	1,697,600	
三浦工業	54,500	3,210.00	174,945,000	
タクマ	40,300	1,262.00	50,858,600	
テクノプロ・ホールディングス	89,200	3,900.00	347,880,000	
アトラグループ	3,200	191.00	611,200	
インターワークス	3,600	372.00	1,339,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	2,231.00	15,393,900	
ＫｅｅＰｅｒ技研	9,700	3,845.00	37,296,500	
ファーストロジック	2,000	787.00	1,574,000	
三機サービス	2,300	885.00	2,035,500	
Ｇｕｎｏｓｙ	8,100	676.00	5,475,600	
デザインワン・ジャパン	3,700	206.00	762,200	
イー・ガーディアン	5,100	2,899.00	14,784,900	
リブセンス	6,100	296.00	1,805,600	
ジャパンマテリアル	40,800	2,340.00	95,472,000	
ベクトル	20,900	1,108.00	23,157,200	
ウチヤマホールディングス	5,800	283.00	1,641,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,100	1,094.00	12,143,400	
キャリアリンク	4,900	2,768.00	13,563,200	
ＩＢＪ	8,100	981.00	7,946,100	
アサンテ	6,600	1,595.00	10,527,000	
バリューＨＲ	11,600	1,576.00	18,281,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	12,300	4,400.00	54,120,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,800	1,069.00	5,131,200	
ＥＲＩホールディングス	3,800	1,070.00	4,066,000	
アビスト	2,000	2,898.00	5,796,000	
シグマクシス・ホールディングス	20,100	1,327.00	26,672,700	
ウィルグループ	11,100	1,343.00	14,907,300	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,200	148.00	2,101,600	
メドピア	10,500	1,468.00	15,414,000	
レアジョブ	2,400	983.00	2,359,200	
リクルートホールディングス	985,100	4,853.00	4,780,690,300	
エラン	17,600	1,042.00	18,339,200	
ツガミ	29,000	1,120.00	32,480,000	
オークマ	13,000	5,010.00	65,130,000	
芝浦機械	14,400	2,708.00	38,995,200	
アマダ	208,500	1,105.00	230,392,500	
アイダエンジニアリング	26,900	793.00	21,331,700	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	3,600	1,120.00	4,032,000	
ＦＵＪＩ	56,800	2,109.00	119,791,200	

牧野フライス製作所	14,400	4,520.00	65,088,000	
オーエスジー	62,400	1,976.00	123,302,400	
ダイジェット工業	1,300	801.00	1,041,300	
旭ダイヤモンド工業	37,700	681.00	25,673,700	
ＤＭＧ森精機	79,200	1,770.00	140,184,000	
ソディック	36,000	787.00	28,332,000	
ディスコ	21,000	40,000.00	840,000,000	
日東工器	6,400	1,530.00	9,792,000	
日進工具	11,000	1,124.00	12,364,000	
パンチ工業	11,000	410.00	4,510,000	
冨士ダイス	6,200	571.00	3,540,200	
土木管理総合試験所	5,700	305.00	1,738,500	
日本郵政	1,743,600	999.30	1,742,379,480	
ベルシステム２４ホールディングス	17,900	1,329.00	23,789,100	
鎌倉新書	15,100	790.00	11,929,000	
ＳＭＮ	3,200	451.00	1,443,200	
一蔵	1,600	456.00	729,600	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,900	574.00	1,090,600	
エアトリ	8,500	2,510.00	21,335,000	
アトラエ	10,500	1,694.00	17,787,000	
ストライク	6,500	4,430.00	28,795,000	
ソラスト	36,600	869.00	31,805,400	
セラク	4,800	1,177.00	5,649,600	
インソース	16,600	3,425.00	56,855,000	
豊田自動織機	94,700	7,760.00	734,872,000	
豊和工業	7,100	866.00	6,148,600	
ニデックオーケーケー	5,300	899.00	4,764,700	
石川製作所	3,400	1,415.00	4,811,000	
東洋機械金属	9,000	526.00	4,734,000	
津田駒工業	2,400	599.00	1,437,600	
エンシュウ	2,700	745.00	2,011,500	
島精機製作所	20,800	2,030.00	42,224,000	
オプトラン	19,300	2,667.00	51,473,100	
ＮＣホールディングス	2,600	1,940.00	5,044,000	
イワキ	8,600	1,419.00	12,203,400	
フリュー	13,600	1,169.00	15,898,400	
ヤマシンフィルタ	31,100	498.00	15,487,800	
日阪製作所	12,700	839.00	10,655,300	
やまびこ	21,500	1,168.00	25,112,000	
野村マイクロ・サイエンス	4,500	3,965.00	17,842,500	
平田機工	6,200	4,540.00	28,148,000	
ペガサスミシン製造	14,300	952.00	13,613,600	
マルマエ	6,300	1,866.00	11,755,800	
タツモ	7,100	1,685.00	11,963,500	
ナブテスコ	82,000	3,250.00	266,500,000	
三井海洋開発	16,500	1,658.00	27,357,000	
レオン自動機	13,700	1,198.00	16,412,600	
ＳＭＣ	42,400	66,660.00	2,826,384,000	
ホソカワミクロン	10,100	2,740.00	27,674,000	
ユニオンツール	5,800	3,765.00	21,837,000	

オイレス工業	18,300	1,477.00	27,029,100	
日精エー・エス・ビー機械	5,900	3,930.00	23,187,000	
サトーホールディングス	18,600	1,911.00	35,544,600	
技研製作所	13,600	3,315.00	45,084,000	
日本エアーテック	6,600	1,131.00	7,464,600	
カワタ	3,800	841.00	3,195,800	
日精樹脂工業	9,800	978.00	9,584,400	
オカダアイヨン	4,100	1,488.00	6,100,800	
ワイエイシイホールディングス	5,500	1,396.00	7,678,000	
小松製作所	612,400	3,074.00	1,882,517,600	
住友重機械工業	77,300	2,938.00	227,107,400	
日立建機	52,100	3,075.00	160,207,500	
日工	19,400	615.00	11,931,000	
巴工業	5,600	2,421.00	13,557,600	
井関農機	12,200	1,244.00	15,176,800	
ＴＯＷＡ	13,300	2,025.00	26,932,500	
丸山製作所	2,200	1,480.00	3,256,000	
北川鉄工所	5,200	1,278.00	6,645,600	
シンニッタン	14,400	222.00	3,196,800	
ローツェ	6,800	8,300.00	56,440,000	
タカキタ	3,800	456.00	1,732,800	
クボタ	691,700	2,008.00	1,388,933,600	
荏原実業	6,500	2,252.00	14,638,000	
東洋エンジニアリング	16,900	584.00	9,869,600	
三菱化工機	4,300	2,124.00	9,133,200	
月島機械	17,700	996.00	17,629,200	
帝国電機製作所	10,000	2,065.00	20,650,000	
東京機械製作所	3,100	641.00	1,987,100	
新東工業	26,400	669.00	17,661,600	
澁谷工業	12,300	2,608.00	32,078,400	
アイチコーポレーション	18,500	800.00	14,800,000	
小森コーポレーション	30,300	821.00	24,876,300	
鶴見製作所	10,100	2,086.00	21,068,600	
住友精密工業	1,800	2,592.00	4,665,600	
日本ギア工業	4,400	326.00	1,434,400	
酒井重工業	2,000	3,155.00	6,310,000	
荏原製作所	53,500	5,330.00	285,155,000	
石井鐵工所	1,000	2,469.00	2,469,000	
酉島製作所	11,300	1,440.00	16,272,000	
北越工業	13,100	1,174.00	15,379,400	
ダイキン工業	156,000	23,255.00	3,627,780,000	
オルガノ	18,000	2,778.00	50,004,000	
トーヨーカネツ	5,000	2,468.00	12,340,000	
栗田工業	73,100	6,000.00	438,600,000	
椿本チエイン	18,500	3,135.00	57,997,500	
大同工業	5,300	757.00	4,012,100	
日機装	32,300	1,024.00	33,075,200	
木村化工機	10,000	682.00	6,820,000	
レイズネクスト	18,400	1,272.00	23,404,800	
アネスト岩田	22,300	923.00	20,582,900	

ダイフク	67,400	7,410.00	499,434,000	
サムコ	4,300	3,410.00	14,663,000	
加藤製作所	6,100	748.00	4,562,800	
油研工業	1,600	1,790.00	2,864,000	
タダノ	68,900	928.00	63,939,200	
フジテック	47,900	2,967.00	142,119,300	
ＣＫＤ	36,100	1,926.00	69,528,600	
平和	43,400	2,410.00	104,594,000	
理想科学工業	11,600	2,288.00	26,540,800	
ＳＡＮＫＹＯ	25,600	4,720.00	120,832,000	
日本金銭機械	14,300	788.00	11,268,400	
マースグループホールディングス	7,600	2,007.00	15,253,200	
フクシマガリレイ	9,700	4,145.00	40,206,500	
オーイズミ	5,100	405.00	2,065,500	
ダイコク電機	7,100	1,525.00	10,827,500	
竹内製作所	23,700	2,967.00	70,317,900	
アマノ	37,100	2,529.00	93,825,900	
ＪＵＫＩ	20,200	668.00	13,493,600	
サンデン	19,400	211.00	4,093,400	
ジャノメ	13,200	642.00	8,474,400	
ブラザー工業	174,700	2,244.00	392,026,800	
マックス	16,200	2,038.00	33,015,600	
モリタホールディングス	22,800	1,230.00	28,044,000	
グローリー	34,000	2,038.00	69,292,000	
新晃工業	13,100	1,571.00	20,580,100	
大和冷機工業	20,000	1,278.00	25,560,000	
セガサミーホールディングス	105,100	1,830.00	192,333,000	
日本ピストンリング	4,500	1,189.00	5,350,500	
リケン	5,200	2,233.00	11,611,600	
ＴＰＲ	15,400	1,241.00	19,111,400	
ツバキ・ナカシマ	32,100	1,208.00	38,776,800	
ホシザキ	84,100	4,515.00	379,711,500	
大豊工業	11,300	693.00	7,830,900	
日本精工	240,100	773.00	185,597,300	
ＮＴＮ	257,600	295.00	75,992,000	
ジェイテクト	116,300	1,008.00	117,230,400	
不二越	9,700	3,990.00	38,703,000	
ミネベアミツミ	227,300	2,280.00	518,244,000	
日本トムソン	31,900	546.00	17,417,400	
ＴＨＫ	75,400	2,665.00	200,941,000	
ユーシン精機	10,500	680.00	7,140,000	
前澤給装工業	9,300	926.00	8,611,800	
イーグル工業	14,400	1,129.00	16,257,600	
前澤工業	8,400	615.00	5,166,000	
日本ピラー工業	12,100	2,735.00	33,093,500	
キッツ	48,100	838.00	40,307,800	
日立製作所	656,300	7,286.00	4,781,801,800	
東芝	251,600	4,950.00	1,245,420,000	
三菱電機	1,350,900	1,358.00	1,834,522,200	
富士電機	79,400	6,080.00	482,752,000	

東洋電機製造	4,700	848.00	3,985,600	
安川電機	154,800	4,565.00	706,662,000	
シンフォニア　テクノロジー	14,300	1,424.00	20,363,200	
明電舎	19,800	2,050.00	40,590,000	
オリジン	2,800	1,314.00	3,679,200	
山洋電気	5,700	6,170.00	35,169,000	
デンヨー	10,000	1,365.00	13,650,000	
ＰＨＣホールディングス	18,200	1,702.00	30,976,400	
ベイカレント・コンサルティング	105,300	4,600.00	484,380,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,800	2,655.00	7,434,000	
アイモバイル	6,900	1,234.00	8,514,600	
キャリアインデックス	4,700	399.00	1,875,300	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,400	1,001.00	4,404,400	
船場	1,500	774.00	1,161,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,300	1,714.00	81,072,200	
フルテック	1,700	1,086.00	1,846,200	
グリーンズ	5,100	998.00	5,089,800	
ツナググループ・ホールディングス	3,800	489.00	1,858,200	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	4,100	376.00	1,541,600	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,500	608.00	912,000	
ウェルビー	9,800	923.00	9,045,400	
エル・ティー・エス	1,600	3,030.00	4,848,000	
ミダックホールディングス	8,000	3,735.00	29,880,000	
日総工産	10,000	610.00	6,100,000	
キュービーネットホールディングス	6,900	1,295.00	8,935,500	
ＲＰＡホールディングス	18,000	287.00	5,166,000	
三櫻工業	19,700	681.00	13,415,700	
マキタ	162,600	2,913.00	473,653,800	
東芝テック	19,500	3,860.00	75,270,000	
芝浦メカトロニクス	2,400	11,460.00	27,504,000	
マブチモーター	32,400	4,115.00	133,326,000	
日本電産	317,500	8,669.00	2,752,407,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,700	499.00	4,840,300	
トレックス・セミコンダクター	6,100	3,190.00	19,459,000	
東光高岳	7,800	1,800.00	14,040,000	
ダブル・スコープ	42,700	1,835.00	78,354,500	
宮越ホールディングス	5,800	882.00	5,115,600	
ダイヘン	11,800	3,980.00	46,964,000	
ヤーマン	25,400	1,111.00	28,219,400	
ＪＶＣケンウッド	119,100	333.00	39,660,300	
ミマキエンジニアリング	12,400	645.00	7,998,000	
Ｉ－ＰＥＸ	7,200	1,310.00	9,432,000	
日新電機	31,300	1,392.00	43,569,600	
大崎電気工業	31,000	512.00	15,872,000	
オムロン	119,800	7,377.00	883,764,600	
日東工業	17,600	2,213.00	38,948,800	
ＩＤＥＣ	19,300	3,080.00	59,444,000	
正興電機製作所	5,000	1,015.00	5,075,000	

不二電機工業	2,600	1,088.00	2,828,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	42,900	2,195.00	94,165,500	
サクサホールディングス	2,700	1,300.00	3,510,000	
メルコホールディングス	3,600	3,095.00	11,142,000	
テクノメディカ	3,300	1,658.00	5,471,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,000	1,229.00	4,916,000	
日本電気	184,800	4,855.00	897,204,000	
富士通	130,200	18,015.00	2,345,553,000	
沖電気工業	59,100	751.00	44,384,100	
岩崎通信機	5,800	796.00	4,616,800	
電気興業	6,100	2,409.00	14,694,900	
サンケン電気	12,100	6,330.00	76,593,000	
ナカヨ	2,100	1,080.00	2,268,000	
アイホン	7,900	1,807.00	14,275,300	
ルネサスエレクトロニクス	852,500	1,384.00	1,179,860,000	
セイコーエプソン	174,100	2,033.00	353,945,300	
ワコム	103,600	648.00	67,132,800	
アルバック	31,000	6,200.00	192,200,000	
アクセル	4,900	1,420.00	6,958,000	
ＥＩＺＯ	9,700	3,820.00	37,054,000	
ジャパンディスプレイ	502,200	48.00	24,105,600	
日本信号	29,800	994.00	29,621,200	
京三製作所	27,500	406.00	11,165,000	
能美防災	17,700	1,557.00	27,558,900	
ホーチキ	9,900	1,340.00	13,266,000	
星和電機	5,300	444.00	2,353,200	
エレコム	31,200	1,524.00	47,548,800	
パナソニック　ホールディングス	1,544,000	1,221.50	1,885,996,000	
シャープ	157,500	966.00	152,145,000	
アンリツ	92,100	1,490.00	137,229,000	
富士通ゼネラル	37,000	3,250.00	120,250,000	
ソニーグループ	915,500	11,630.00	10,647,265,000	
ＴＤＫ	207,000	5,100.00	1,055,700,000	
帝国通信工業	5,900	1,423.00	8,395,700	
タムラ製作所	56,000	718.00	40,208,000	
アルプスアルパイン	116,700	1,270.00	148,209,000	
池上通信機	4,200	528.00	2,217,600	
日本電波工業	15,700	1,664.00	26,124,800	
鈴木	7,600	887.00	6,741,200	
メイコー	14,200	3,200.00	45,440,000	
日本トリム	2,800	2,412.00	6,753,600	
ローランド　ディー．ジー．	7,300	3,005.00	21,936,500	
フォスター電機	12,100	847.00	10,248,700	
ＳＭＫ	3,200	2,618.00	8,377,600	
ヨコオ	10,400	2,412.00	25,084,800	
ティアック	20,200	114.00	2,302,800	
ホシデン	31,300	1,547.00	48,421,100	
ヒロセ電機	21,700	18,440.00	400,148,000	
日本航空電子工業	26,800	2,316.00	62,068,800	

ＴＯＡ	15,100	760.00	11,476,000	
マクセル	28,400	1,322.00	37,544,800	
古野電気	17,000	1,018.00	17,306,000	
スミダコーポレーション	12,000	1,285.00	15,420,000	
アイコム	5,100	2,545.00	12,979,500	
リオン	5,400	1,955.00	10,557,000	
横河電機	142,900	2,594.00	370,682,600	
新電元工業	5,000	3,335.00	16,675,000	
アズビル	90,400	4,170.00	376,968,000	
東亜ディーケーケー	6,100	852.00	5,197,200	
日本光電工業	59,800	3,370.00	201,526,000	
チノー	5,400	1,810.00	9,774,000	
共和電業	12,300	340.00	4,182,000	
日本電子材料	8,500	1,574.00	13,379,000	
堀場製作所	28,900	6,290.00	181,781,000	
アドバンテスト	102,000	8,910.00	908,820,000	
小野測器	5,000	378.00	1,890,000	
エスペック	10,400	1,948.00	20,259,200	
キーエンス	129,500	60,710.00	7,861,945,000	
日置電機	6,800	6,950.00	47,260,000	
シスメックス	111,600	8,526.00	951,501,600	
日本マイクロニクス	21,400	1,531.00	32,763,400	
メガチップス	10,700	2,686.00	28,740,200	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,100	3,400.00	20,740,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	10,900	761.00	8,294,900	
澤藤電機	1,500	1,156.00	1,734,000	
デンソー	266,900	7,588.00	2,025,237,200	
原田工業	5,800	777.00	4,506,600	
コーセル	17,300	859.00	14,860,700	
イリソ電子工業	11,900	5,090.00	60,571,000	
オプテックスグループ	23,700	1,959.00	46,428,300	
千代田インテグレ	5,300	2,327.00	12,333,100	
レーザーテック	63,900	27,210.00	1,738,719,000	
スタンレー電気	92,100	2,698.00	248,485,800	
岩崎電気	4,200	2,403.00	10,092,600	
ウシオ電機	67,600	1,716.00	116,001,600	
岡谷電機産業	10,100	279.00	2,817,900	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	11,900	496.00	5,902,400	
エノモト	3,400	1,769.00	6,014,600	
日本セラミック	13,100	2,598.00	34,033,800	
遠藤照明	5,800	746.00	4,326,800	
古河電池	9,600	1,033.00	9,916,800	
双信電機	5,300	415.00	2,199,500	
山一電機	11,300	1,985.00	22,430,500	
図研	11,300	3,110.00	35,143,000	
日本電子	32,300	5,860.00	189,278,000	
カシオ計算機	96,400	1,340.00	129,176,000	
ファナック	127,000	20,765.00	2,637,155,000	
日本シイエムケイ	27,600	592.00	16,339,200	
エンプラス	3,800	4,220.00	16,036,000	

大真空	15,800	987.00	15,594,600	
ローム	59,800	11,350.00	678,730,000	
浜松ホトニクス	103,900	6,880.00	714,832,000	
三井ハイテック	13,300	8,050.00	107,065,000	
新光電気工業	45,900	4,145.00	190,255,500	
京セラ	201,000	6,857.00	1,378,257,000	
協栄産業	1,200	1,742.00	2,090,400	
太陽誘電	63,000	4,525.00	285,075,000	
村田製作所	392,400	7,762.00	3,045,808,800	
双葉電子工業	24,600	609.00	14,981,400	
日東電工	94,200	8,580.00	808,236,000	
北陸電気工業	4,900	1,165.00	5,708,500	
東海理化電機製作所	36,500	1,553.00	56,684,500	
ニチコン	26,300	1,387.00	36,478,100	
日本ケミコン	12,800	1,820.00	23,296,000	
ＫＯＡ	19,500	2,192.00	42,744,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	59,100	445.00	26,299,500	
日立造船	107,200	912.00	97,766,400	
三菱重工業	228,600	5,216.00	1,192,377,600	
川崎重工業	97,500	2,861.00	278,947,500	
ＩＨＩ	82,400	3,560.00	293,344,000	
名村造船所	33,200	578.00	19,189,600	
サノヤスホールディングス	17,700	125.00	2,212,500	
スプリックス	4,600	1,036.00	4,765,600	
マネジメントソリューションズ	7,300	3,350.00	24,455,000	
プロレド・パートナーズ	3,300	529.00	1,745,700	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	3,900	386.00	1,505,400	
テノ．ホールディングス	1,600	533.00	852,800	
フロンティア・マネジメント	4,500	1,293.00	5,818,500	
ピアラ	2,000	685.00	1,370,000	
コプロ・ホールディングス	2,100	923.00	1,938,300	
ギークス	1,800	920.00	1,656,000	
カーブスホールディングス	40,900	906.00	37,055,400	
フォーラムエンジニアリング	7,700	835.00	6,429,500	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	4,600	1,547.00	7,116,200	
日本車輌製造	5,000	1,970.00	9,850,000	
三菱ロジスネクスト	20,600	846.00	17,427,600	
近畿車輌	1,500	979.00	1,468,500	
一家ホールディングス	3,100	635.00	1,968,500	
フルサト・マルカホールディングス	13,600	3,545.00	48,212,000	
ヤマエグループホールディングス	7,700	1,410.00	10,857,000	
ジャパンクラフトホールディングス	4,400	640.00	2,816,000	
ＦＰＧ	51,700	1,045.00	54,026,500	
島根銀行	4,300	424.00	1,823,200	
じもとホールディングス	8,400	405.00	3,402,000	
全国保証	33,300	4,960.00	165,168,000	
めぶきフィナンシャルグループ	632,400	289.00	182,763,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,500	1,270.00	13,335,000	

東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,400	2,171.00	35,604,400	
九州フィナンシャルグループ	224,200	385.00	86,317,000	
かんぽ生命保険	154,700	2,138.00	330,748,600	
ゆうちょ銀行	363,000	999.00	362,637,000	
あんしん保証	5,500	256.00	1,408,000	
富山第一銀行	31,700	409.00	12,965,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	702,600	450.00	316,170,000	
ジェイリース	4,300	2,970.00	12,771,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	80,700	806.00	65,044,200	
イントラスト	4,900	717.00	3,513,300	
日本モーゲージサービス	7,100	853.00	6,056,300	
ＣＡＳＡ	4,900	866.00	4,243,400	
アルヒ	26,100	1,419.00	37,035,900	
プレミアグループ	21,500	1,819.00	39,108,500	
日産自動車	1,838,300	499.50	918,230,850	
いすゞ自動車	376,300	1,760.00	662,288,000	
トヨタ自動車	7,106,300	2,001.00	14,219,706,300	
日野自動車	166,800	626.00	104,416,800	
三菱自動車工業	504,800	612.00	308,937,600	
エフテック	8,900	521.00	4,636,900	
レシップホールディングス	5,200	475.00	2,470,000	
ＧＭＢ	2,500	744.00	1,860,000	
ファルテック	2,100	611.00	1,283,100	
武蔵精密工業	31,600	1,743.00	55,078,800	
日産車体	22,900	826.00	18,915,400	
新明和工業	40,700	1,026.00	41,758,200	
極東開発工業	22,800	1,363.00	31,076,400	
トピー工業	10,500	1,697.00	17,818,500	
ティラド	3,300	2,452.00	8,091,600	
曙ブレーキ工業	79,100	162.00	12,814,200	
タチエス	20,400	1,093.00	22,297,200	
ＮＯＫ	50,200	1,308.00	65,661,600	
フタバ産業	34,700	375.00	13,012,500	
ＫＹＢ	12,400	3,460.00	42,904,000	
市光工業	18,600	416.00	7,737,600	
大同メタル工業	25,300	489.00	12,371,700	
プレス工業	57,700	415.00	23,945,500	
ミクニ	14,900	305.00	4,544,500	
太平洋工業	29,700	1,065.00	31,630,500	
河西工業	17,100	191.00	3,266,100	
アイシン	99,800	3,810.00	380,238,000	
マツダ	428,000	1,091.00	466,948,000	
今仙電機製作所	8,200	542.00	4,444,400	
本田技研工業	1,052,100	3,335.00	3,508,753,500	
スズキ	237,700	5,184.00	1,232,236,800	
ＳＵＢＡＲＵ	409,500	2,400.00	982,800,000	
安永	5,700	732.00	4,172,400	
ヤマハ発動機	203,300	3,465.00	704,434,500	

小糸製作所	155,600	2,248.00	349,788,800	
ＴＢＫ	12,900	271.00	3,495,900	
エクセディ	21,200	1,664.00	35,276,800	
ミツバ	24,200	479.00	11,591,800	
豊田合成	37,700	2,351.00	88,632,700	
愛三工業	21,500	702.00	15,093,000	
盟和産業	1,500	922.00	1,383,000	
日本プラスト	10,200	442.00	4,508,400	
ヨロズ	12,100	810.00	9,801,000	
エフ・シー・シー	23,000	1,418.00	32,614,000	
新家工業	2,800	2,217.00	6,207,600	
シマノ	53,000	24,125.00	1,278,625,000	
テイ・エス　テック	59,300	1,564.00	92,745,200	
三十三フィナンシャルグループ	11,400	1,444.00	16,461,600	
第四北越フィナンシャルグループ	19,900	2,578.00	51,302,200	
ひろぎんホールディングス	166,300	626.00	104,103,800	
マーキュリアホールディングス	7,500	619.00	4,642,500	
おきなわフィナンシャルグループ	12,100	2,038.00	24,659,800	
ダイレクトマーケティングミックス	15,300	1,692.00	25,887,600	
ポピンズ	1,900	1,618.00	3,074,200	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	10,400	2,545.00	26,468,000	
十六フィナンシャルグループ	16,600	2,449.00	40,653,400	
北國フィナンシャルホールディングス	10,800	4,280.00	46,224,000	
ネットプロテクションズホールディングス	42,100	493.00	20,755,300	
プロクレアホールディングス	15,700	2,103.00	33,017,100	
あいちフィナンシャルグループ	17,800	2,148.00	38,234,400	
ジャムコ	7,000	1,532.00	10,724,000	
小野建	12,600	1,480.00	18,648,000	
はるやまホールディングス	5,700	435.00	2,479,500	
南陽	2,600	1,812.00	4,711,200	
ノジマ	44,700	1,320.00	59,004,000	
佐鳥電機	8,500	1,308.00	11,118,000	
カッパ・クリエイト	21,600	1,363.00	29,440,800	
エコートレーディング	2,500	553.00	1,382,500	
伯東	7,800	3,480.00	27,144,000	
コンドーテック	10,600	973.00	10,313,800	
中山福	7,200	318.00	2,289,600	
ライトオン	10,400	624.00	6,489,600	
ナガイレーベン	17,300	2,045.00	35,378,500	
三菱食品	12,600	3,190.00	40,194,000	
良品計画	176,700	1,417.00	250,383,900	
パリミキホールディングス	17,300	262.00	4,532,600	
松田産業	10,500	2,270.00	23,835,000	
第一興商	26,400	4,075.00	107,580,000	
メディパルホールディングス	142,000	1,785.00	253,470,000	
アドヴァングループ	13,000	882.00	11,466,000	
ＳＰＫ	6,100	1,395.00	8,509,500	
萩原電気ホールディングス	5,300	2,447.00	12,969,100	
アルビス	4,600	2,293.00	10,547,800	

アズワン	20,000	6,220.00	124,400,000	
スズデン	4,800	2,407.00	11,553,600	
尾家産業	3,400	838.00	2,849,200	
シモジマ	9,500	989.00	9,395,500	
ドウシシャ	14,400	1,565.00	22,536,000	
小津産業	3,200	1,478.00	4,729,600	
コナカ	14,900	328.00	4,887,200	
高速	7,100	1,700.00	12,070,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,600	1,606.00	2,569,600	
Ｇ－７ホールディングス	17,100	1,502.00	25,684,200	
たけびし	5,300	1,531.00	8,114,300	
イオン北海道	20,200	1,172.00	23,674,400	
コジマ	26,300	607.00	15,964,100	
ヒマラヤ	4,400	911.00	4,008,400	
コーナン商事	18,500	3,275.00	60,587,500	
ネットワンシステムズ	48,300	3,460.00	167,118,000	
エコス	5,100	1,832.00	9,343,200	
ワタミ	16,600	958.00	15,902,800	
マルシェ	4,700	401.00	1,884,700	
リックス	2,700	2,073.00	5,597,100	
システムソフト	45,100	103.00	4,645,300	
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	307,000	2,337.00	717,459,000	
丸文	12,200	893.00	10,894,600	
西松屋チェーン	30,300	1,372.00	41,571,600	
ゼンショーホールディングス	75,000	3,270.00	245,250,000	
ハピネット	11,600	1,976.00	22,921,600	
幸楽苑ホールディングス	8,900	1,063.00	9,460,700	
ハークスレイ	4,900	559.00	2,739,100	
橋本総業ホールディングス	5,500	997.00	5,483,500	
日本ライフライン	40,200	971.00	39,034,200	
サイゼリヤ	22,800	2,802.00	63,885,600	
タカショー	11,900	690.00	8,211,000	
ＶＴホールディングス	52,100	503.00	26,206,300	
アルゴグラフィックス	11,900	3,730.00	44,387,000	
魚力	4,300	2,104.00	9,047,200	
ＩＤＯＭ	41,400	723.00	29,932,200	
日本エム・ディ・エム	7,600	1,104.00	8,390,400	
ポプラ	3,300	148.00	488,400	
フジ・コーポレーション	7,700	1,241.00	9,555,700	
ユナイテッドアローズ	14,500	1,849.00	26,810,500	
進和	9,200	1,954.00	17,976,800	
エスケイジャパン	3,400	503.00	1,710,200	
ダイトロン	5,400	2,393.00	12,922,200	
ハイデイ日高	20,200	1,860.00	37,572,000	
シークス	19,400	1,173.00	22,756,200	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	8,100	211.00	1,709,100	
コロワイド	63,100	1,723.00	108,721,300	
ピーシーデポコーポレーション	15,300	293.00	4,482,900	

田中商事	4,100	540.00	2,214,000	
オーハシテクニカ	6,800	1,437.00	9,771,600	
壱番屋	10,900	4,570.00	49,813,000	
白銅	5,000	2,492.00	12,460,000	
トップカルチャー	4,600	202.00	929,200	
ＰＬＡＮＴ	3,300	631.00	2,082,300	
スギホールディングス	27,700	5,910.00	163,707,000	
ダイコー通産	1,500	1,055.00	1,582,500	
薬王堂ホールディングス	7,600	2,659.00	20,208,400	
島津製作所	157,700	4,235.00	667,859,500	
ＪＭＳ	12,000	514.00	6,168,000	
クボテック	3,200	221.00	707,200	
長野計器	9,500	1,088.00	10,336,000	
ブイ・テクノロジー	6,300	2,615.00	16,474,500	
スター精密	24,600	1,649.00	40,565,400	
東京計器	10,000	1,252.00	12,520,000	
愛知時計電機	5,100	1,385.00	7,063,500	
インターアクション	7,700	1,462.00	11,257,400	
オーバル	11,400	444.00	5,061,600	
東京精密	28,400	4,365.00	123,966,000	
マニー	56,900	2,176.00	123,814,400	
ニコン	201,200	1,350.00	271,620,000	
トプコン	68,100	1,652.00	112,501,200	
オリンパス	809,100	3,093.00	2,502,546,300	
理研計器	7,900	4,515.00	35,668,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	22,200	8,940.00	198,468,000	
キヤノン電子	14,300	1,573.00	22,493,900	
タムロン	9,800	3,235.00	31,703,000	
ＨＯＹＡ	279,600	14,740.00	4,121,304,000	
シード	6,600	504.00	3,326,400	
ノーリツ鋼機	12,300	2,667.00	32,804,100	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	18,800	1,030.00	19,364,000	
朝日インテック	170,900	2,517.00	430,155,300	
キヤノン	710,000	3,166.00	2,247,860,000	
リコー	339,400	1,032.00	350,260,800	
シチズン時計	142,200	606.00	86,173,200	
リズム	4,100	1,667.00	6,834,700	
大研医器	9,900	462.00	4,573,800	
メニコン	44,400	2,393.00	106,249,200	
シンシア	1,200	509.00	610,800	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	19,300	120.00	2,316,000	
中本パックス	4,000	1,516.00	6,064,000	
スノーピーク	22,200	2,003.00	44,466,600	
パラマウントベッドホールディングス	29,900	2,620.00	78,338,000	
トランザクション	10,000	1,177.00	11,770,000	
粧美堂	3,700	373.00	1,380,100	
ニホンフラッシュ	12,200	981.00	11,968,200	
前田工繊	14,000	3,035.00	42,490,000	
永大産業	14,000	218.00	3,052,000	
アートネイチャー	13,300	770.00	10,241,000	

バンダイナムコホールディングス	118,100	8,978.00	1,060,301,800	
アイフィスジャパン	3,800	610.00	2,318,000	
ＳＨＯＥＩ	13,600	5,600.00	76,160,000	
フランスベッドホールディングス	16,100	915.00	14,731,500	
マーベラス	21,100	689.00	14,537,900	
パイロットコーポレーション	20,200	4,835.00	97,667,000	
萩原工業	8,500	1,023.00	8,695,500	
エイベックス	22,100	1,581.00	34,940,100	
フジシールインターナショナル	26,100	1,795.00	46,849,500	
タカラトミー	59,800	1,212.00	72,477,600	
広済堂ホールディングス	8,600	1,742.00	14,981,200	
エステールホールディングス	3,200	613.00	1,961,600	
レック	18,500	845.00	15,632,500	
タカノ	4,900	651.00	3,189,900	
三光合成	17,800	460.00	8,188,000	
プロネクサス	10,800	953.00	10,292,400	
ホクシン	10,000	144.00	1,440,000	
ウッドワン	4,400	913.00	4,017,200	
大建工業	7,800	2,094.00	16,333,200	
きもと	19,200	232.00	4,454,400	
凸版印刷	169,300	2,163.00	366,195,900	
大日本印刷	153,500	2,903.00	445,610,500	
共同印刷	3,700	2,917.00	10,792,900	
ＮＩＳＳＨＡ	24,600	1,691.00	41,598,600	
光村印刷	600	1,165.00	699,000	
藤森工業	10,300	3,175.00	32,702,500	
ヴィア・ホールディングス	18,500	128.00	2,368,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,900	2,121.00	18,876,900	
前澤化成工業	8,300	1,384.00	11,487,200	
未来工業	4,800	1,492.00	7,161,600	
アシックス	119,500	2,502.00	298,989,000	
ツツミ	2,800	1,973.00	5,524,400	
ウェーブロックホールディングス	4,000	593.00	2,372,000	
ＪＳＰ	9,200	1,454.00	13,376,800	
ニチハ	16,300	2,869.00	46,764,700	
ローランド	9,600	4,010.00	38,496,000	
エフピコ	24,500	3,765.00	92,242,500	
小松ウオール工業	4,800	1,851.00	8,884,800	
ヤマハ	81,600	5,440.00	443,904,000	
河合楽器製作所	3,600	2,690.00	9,684,000	
クリナップ	14,500	628.00	9,106,000	
ピジョン	82,500	1,961.00	161,782,500	
天馬	11,100	2,073.00	23,010,300	
兼松サステック	600	1,538.00	922,800	
キングジム	11,600	899.00	10,428,400	
象印マホービン	38,700	1,603.00	62,036,100	
リンテック	25,900	2,240.00	58,016,000	
信越ポリマー	24,000	1,257.00	30,168,000	
東リ	29,500	204.00	6,018,000	
イトーキ	26,500	434.00	11,501,000	

任天堂	817,100	5,759.00	4,705,678,900	
三菱鉛筆	18,400	1,399.00	25,741,600	
松風	5,900	2,389.00	14,095,100	
タカラスタンダード	25,100	1,269.00	31,851,900	
コクヨ	62,300	1,855.00	115,566,500	
ナカバヤシ	14,000	517.00	7,238,000	
ニフコ	46,900	3,535.00	165,791,500	
立川ブラインド工業	6,100	1,110.00	6,771,000	
グローブライド	10,500	2,602.00	27,321,000	
オカムラ	39,000	1,449.00	56,511,000	
バルカー	10,900	2,695.00	29,375,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,000	1,912.00	1,912,000	
伊藤忠商事	843,700	4,267.00	3,600,067,900	
丸紅	1,081,000	1,466.50	1,585,286,500	
スクロール	20,200	713.00	14,402,600	
高島	2,100	2,656.00	5,577,600	
ヨンドシーホールディングス	11,800	1,713.00	20,213,400	
三陽商会	5,000	1,124.00	5,620,000	
長瀬産業	64,400	1,995.00	128,478,000	
ナイガイ	4,100	265.00	1,086,500	
蝶理	7,300	1,967.00	14,359,100	
豊田通商	119,900	5,220.00	625,878,000	
オンワードホールディングス	84,000	299.00	25,116,000	
三共生興	19,700	474.00	9,337,800	
兼松	53,200	1,504.00	80,012,800	
美津濃	12,800	2,795.00	35,776,000	
ツカモトコーポレーション	1,900	1,149.00	2,183,100	
ルックホールディングス	3,800	2,357.00	8,956,600	
三井物産	1,001,800	3,863.00	3,869,953,400	
日本紙パルプ商事	7,200	4,980.00	35,856,000	
東京エレクトロン	91,300	44,370.00	4,050,981,000	
カメイ	14,500	1,174.00	17,023,000	
東都水産	600	4,875.00	2,925,000	
ＯＵＧホールディングス	2,000	2,409.00	4,818,000	
スターゼン	10,500	2,032.00	21,336,000	
セイコーグループ	20,000	3,035.00	60,700,000	
山善	36,900	989.00	36,494,100	
椿本興業	2,100	3,795.00	7,969,500	
住友商事	847,900	2,179.00	1,847,574,100	
ＢＩＰＲＯＧＹ	47,800	3,200.00	152,960,000	
内田洋行	6,000	4,710.00	28,260,000	
三菱商事	856,100	4,340.00	3,715,474,000	
第一実業	4,900	4,235.00	20,751,500	
キヤノンマーケティングジャパン	31,700	3,155.00	100,013,500	
西華産業	5,400	1,579.00	8,526,600	
佐藤商事	9,600	1,174.00	11,270,400	
菱洋エレクトロ	11,700	2,338.00	27,354,600	
東京産業	12,600	770.00	9,702,000	
ユアサ商事	12,300	3,720.00	45,756,000	
神鋼商事	3,500	4,210.00	14,735,000	

トルク	7,400	215.00	1,591,000	
阪和興業	24,600	3,710.00	91,266,000	
正栄食品工業	9,200	4,170.00	38,364,000	
カナデン	11,100	1,095.00	12,154,500	
菱電商事	11,100	1,702.00	18,892,200	
ニプロ	107,900	1,031.00	111,244,900	
岩谷産業	31,100	5,630.00	175,093,000	
ナイス	3,800	1,402.00	5,327,600	
ニチモウ	1,500	2,517.00	3,775,500	
極東貿易	8,100	1,324.00	10,724,400	
アステナホールディングス	23,700	418.00	9,906,600	
兼松エレクトロニクス	8,300	4,570.00	37,931,000	
三愛オブリ	37,700	1,209.00	45,579,300	
稲畑産業	28,000	2,434.00	68,152,000	
ＧＳＩクレオス	7,900	1,427.00	11,273,300	
明和産業	18,200	728.00	13,249,600	
クワザワホールディングス	4,600	403.00	1,853,800	
キムラタン	76,000	22.00	1,672,000	
ゴールドウイン	23,000	8,280.00	190,440,000	
ユニ・チャーム	270,400	5,035.00	1,361,464,000	
デサント	22,400	3,360.00	75,264,000	
キング	5,700	494.00	2,815,800	
ワキタ	25,200	1,202.00	30,290,400	
ヤマトインターナショナル	10,300	238.00	2,451,400	
東邦ホールディングス	34,100	1,944.00	66,290,400	
サンゲツ	34,400	1,987.00	68,352,800	
ミツウロコグループホールディングス	17,600	1,000.00	17,600,000	
シナネンホールディングス	4,500	3,820.00	17,190,000	
伊藤忠エネクス	34,100	1,013.00	34,543,300	
サンリオ	38,800	4,275.00	165,870,000	
サンワ　テクノス	7,000	1,507.00	10,549,000	
リョーサン	14,400	2,844.00	40,953,600	
新光商事	18,400	1,071.00	19,706,400	
トーホー	5,900	1,699.00	10,024,100	
三信電気	5,500	2,148.00	11,814,000	
東陽テクニカ	15,100	1,340.00	20,234,000	
モスフードサービス	20,100	3,115.00	62,611,500	
加賀電子	11,100	4,300.00	47,730,000	
三益半導体工業	12,000	2,531.00	30,372,000	
都築電気	6,800	1,350.00	9,180,000	
ソーダニッカ	10,100	615.00	6,211,500	
立花エレテック	10,100	1,716.00	17,331,600	
木曽路	20,600	2,099.00	43,239,400	
ＳＲＳホールディングス	22,700	837.00	18,999,900	
千趣会	25,300	399.00	10,094,700	
タカキュー	9,800	80.00	784,000	
リテールパートナーズ	20,200	1,232.00	24,886,400	
ケーヨー	22,200	902.00	20,024,400	
上新電機	12,200	1,883.00	22,972,600	
日本瓦斯	73,300	2,173.00	159,280,900	

ロイヤルホールディングス	26,300	2,226.00	58,543,800	
東天紅	600	805.00	483,000	
いなげや	13,300	1,157.00	15,388,100	
チヨダ	13,100	729.00	9,549,900	
ライフコーポレーション	12,000	2,362.00	28,344,000	
リンガーハット	17,700	2,194.00	38,833,800	
ＭｒＭａｘＨＤ	19,200	664.00	12,748,800	
テンアライド	14,500	247.00	3,581,500	
ＡＯＫＩホールディングス	25,400	693.00	17,602,200	
オークワ	22,000	903.00	19,866,000	
コメリ	21,100	2,633.00	55,556,300	
青山商事	29,300	975.00	28,567,500	
しまむら	16,100	12,120.00	195,132,000	
はせがわ	6,500	348.00	2,262,000	
高島屋	103,200	1,709.00	176,368,800	
松屋	23,200	963.00	22,341,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	66,600	1,205.00	80,253,000	
近鉄百貨店	4,500	2,398.00	10,791,000	
丸井グループ	101,000	2,312.00	233,512,000	
クレディセゾン	80,800	1,639.00	132,431,200	
アクシアル　リテイリング	9,400	3,345.00	31,443,000	
井筒屋	6,600	364.00	2,402,400	
イオン	464,100	2,702.50	1,254,230,250	
イズミ	20,800	2,962.00	61,609,600	
フォーバル	5,400	893.00	4,822,200	
平和堂	22,900	1,930.00	44,197,000	
フジ	21,000	1,870.00	39,270,000	
ヤオコー	15,600	6,520.00	101,712,000	
ゼビオホールディングス	18,500	976.00	18,056,000	
ケーズホールディングス	108,900	1,106.00	120,443,400	
ＰＡＬＴＡＣ	21,600	4,200.00	90,720,000	
三谷産業	24,100	299.00	7,205,900	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,200	503.00	2,615,600	
日産東京販売ホールディングス	17,600	285.00	5,016,000	
新生銀行	37,600	2,210.00	83,096,000	
あおぞら銀行	80,100	2,591.00	207,539,100	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,356,500	710.80	5,939,800,200	
りそなホールディングス	1,626,900	568.20	924,404,580	
三井住友トラスト・ホールディングス	236,200	4,339.00	1,024,871,800	
三井住友フィナンシャルグループ	931,400	4,347.00	4,048,795,800	
千葉銀行	355,200	800.00	284,160,000	
群馬銀行	247,400	413.00	102,176,200	
武蔵野銀行	16,400	1,727.00	28,322,800	
千葉興業銀行	29,700	318.00	9,444,600	
筑波銀行	55,800	188.00	10,490,400	
七十七銀行	40,900	1,729.00	70,716,100	
秋田銀行	8,500	1,559.00	13,251,500	
山形銀行	14,100	1,037.00	14,621,700	
岩手銀行	8,600	1,800.00	15,480,000	
東邦銀行	101,000	205.00	20,705,000	

東北銀行	6,300	952.00	5,997,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	101,800	2,472.00	251,649,600	
スルガ銀行	112,300	403.00	45,256,900	
八十二銀行	261,400	474.00	123,903,600	
山梨中央銀行	13,100	1,006.00	13,178,600	
大垣共立銀行	24,300	1,731.00	42,063,300	
福井銀行	11,400	1,399.00	15,948,600	
清水銀行	5,100	1,411.00	7,196,100	
富山銀行	1,900	1,634.00	3,104,600	
滋賀銀行	21,200	2,435.00	51,622,000	
南都銀行	19,100	2,104.00	40,186,400	
百五銀行	120,000	327.00	39,240,000	
京都銀行	40,400	5,380.00	217,352,000	
紀陽銀行	45,600	1,446.00	65,937,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	81,000	879.00	71,199,000	
山陰合同銀行	79,700	709.00	56,507,300	
鳥取銀行	4,200	1,068.00	4,485,600	
百十四銀行	11,600	1,685.00	19,546,000	
四国銀行	20,200	853.00	17,230,600	
阿波銀行	18,800	1,838.00	34,554,400	
大分銀行	7,600	1,796.00	13,649,600	
宮崎銀行	8,200	2,236.00	18,335,200	
佐賀銀行	7,400	1,514.00	11,203,600	
琉球銀行	29,200	777.00	22,688,400	
セブン銀行	456,700	251.00	114,631,700	
みずほフィナンシャルグループ	1,843,400	1,630.00	3,004,742,000	
高知銀行	4,400	624.00	2,745,600	
山口フィナンシャルグループ	140,800	780.00	109,824,000	
芙蓉総合リース	11,700	8,540.00	99,918,000	
みずほリース	18,900	3,305.00	62,464,500	
東京センチュリー	23,800	4,980.00	118,524,000	
ＳＢＩホールディングス	184,400	2,685.00	495,114,000	
日本証券金融	51,100	954.00	48,749,400	
アイフル	211,100	419.00	88,450,900	
日本アジア投資	10,200	255.00	2,601,000	
長野銀行	4,000	1,153.00	4,612,000	
名古屋銀行	8,300	2,980.00	24,734,000	
北洋銀行	193,100	233.00	44,992,300	
大光銀行	3,900	1,132.00	4,414,800	
愛媛銀行	17,200	837.00	14,396,400	
トマト銀行	4,300	979.00	4,209,700	
京葉銀行	59,100	507.00	29,963,700	
栃木銀行	58,400	280.00	16,352,000	
北日本銀行	4,500	1,869.00	8,410,500	
東和銀行	23,300	522.00	12,162,600	
福島銀行	13,300	206.00	2,739,800	
大東銀行	5,000	613.00	3,065,000	
リコーリース	12,100	3,640.00	44,044,000	
イオンフィナンシャルサービス	73,200	1,429.00	104,602,800	
アコム	227,500	315.00	71,662,500	

ジャックス	13,500	3,705.00	50,017,500	
オリエントコーポレーション	33,300	1,205.00	40,126,500	
オリックス	852,500	2,149.00	1,832,022,500	
三菱ＨＣキャピタル	496,900	629.00	312,550,100	
ジャフコ　グループ	42,500	2,266.00	96,305,000	
九州リースサービス	6,000	629.00	3,774,000	
トモニホールディングス	103,000	318.00	32,754,000	
大和証券グループ本社	911,200	601.00	547,631,200	
野村ホールディングス	2,347,400	494.50	1,160,789,300	
岡三証券グループ	112,000	367.00	41,104,000	
丸三証券	42,400	408.00	17,299,200	
東洋証券	42,300	249.00	10,532,700	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	138,700	353.00	48,961,100	
光世証券	2,700	365.00	985,500	
水戸証券	34,400	220.00	7,568,000	
いちよし証券	23,500	604.00	14,194,000	
松井証券	75,400	795.00	59,943,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	218,800	6,277.00	1,373,407,600	
日本取引所グループ	358,200	2,021.50	724,101,300	
マネックスグループ	142,300	464.00	66,027,200	
極東証券	16,000	606.00	9,696,000	
岩井コスモホールディングス	14,500	1,254.00	18,183,000	
アイザワ証券グループ	18,400	659.00	12,125,600	
フィデアホールディングス	13,100	1,300.00	17,030,000	
池田泉州ホールディングス	162,900	213.00	34,697,700	
アニコム　ホールディングス	43,200	673.00	29,073,600	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	287,400	4,070.00	1,169,718,000	
マネーパートナーズグループ	13,200	275.00	3,630,000	
スパークス・グループ	14,100	1,645.00	23,194,500	
小林洋行	2,800	220.00	616,000	
第一生命ホールディングス	648,900	2,424.00	1,572,933,600	
東京海上ホールディングス	1,283,400	2,817.50	3,615,979,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,000	424.00	2,544,000	
イー・ギャランティ	20,500	2,448.00	50,184,000	
アサックス	5,900	602.00	3,551,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	6,300	2,090.00	13,167,000	
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	1,047.00	7,747,800	
三井不動産	554,000	2,683.00	1,486,382,000	
三菱地所	808,200	1,976.50	1,597,407,300	
平和不動産	20,600	3,860.00	79,516,000	
東京建物	121,500	1,893.00	229,999,500	
京阪神ビルディング	16,500	1,356.00	22,374,000	
住友不動産	230,400	3,621.00	834,278,400	
太平洋興発	4,800	740.00	3,552,000	
テーオーシー	23,100	741.00	17,117,100	
東京楽天地	1,900	4,255.00	8,084,500	
レオパレス２１	143,500	312.00	44,772,000	

スターツコーポレーション	18,300	2,835.00	51,880,500	
フジ住宅	17,900	620.00	11,098,000	
空港施設	15,600	537.00	8,377,200	
明和地所	6,500	615.00	3,997,500	
ゴールドクレスト	12,100	1,714.00	20,739,400	
リログループ	74,100	2,214.00	164,057,400	
エスリード	6,000	1,868.00	11,208,000	
日神グループホールディングス	20,400	426.00	8,690,400	
日本エスコン	28,700	812.00	23,304,400	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	64,400	385.00	24,794,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	6,400	774.00	4,953,600	
イオンモール	66,100	1,618.00	106,949,800	
毎日コムネット	4,800	678.00	3,254,400	
ファースト住建	5,200	1,011.00	5,257,200	
ランド	767,600	9.00	6,908,400	
カチタス	34,300	3,400.00	116,620,000	
東祥	9,400	1,195.00	11,233,000	
トーセイ	21,200	1,408.00	29,849,600	
穴吹興産	3,100	1,960.00	6,076,000	
サンフロンティア不動産	21,200	1,110.00	23,532,000	
ＦＪネクストホールディングス	13,400	980.00	13,132,000	
インテリックス	3,200	547.00	1,750,400	
ランドビジネス	4,800	228.00	1,094,400	
サンネクスタグループ	4,300	925.00	3,977,500	
グランディハウス	10,800	546.00	5,896,800	
東武鉄道	142,100	3,170.00	450,457,000	
相鉄ホールディングス	42,700	2,067.00	88,260,900	
東急	362,900	1,607.00	583,180,300	
京浜急行電鉄	146,800	1,399.00	205,373,200	
小田急電鉄	196,100	1,675.00	328,467,500	
京王電鉄	68,500	4,870.00	333,595,000	
京成電鉄	83,500	3,685.00	307,697,500	
富士急行	16,000	4,810.00	76,960,000	
東日本旅客鉄道	219,500	7,668.00	1,683,126,000	
西日本旅客鉄道	165,300	5,571.00	920,886,300	
東海旅客鉄道	99,700	16,210.00	1,616,137,000	
西武ホールディングス	156,500	1,285.00	201,102,500	
鴻池運輸	22,100	1,562.00	34,520,200	
西日本鉄道	34,600	2,798.00	96,810,800	
ハマキョウレックス	10,200	3,355.00	34,221,000	
サカイ引越センター	6,100	4,685.00	28,578,500	
近鉄グループホールディングス	129,200	4,695.00	606,594,000	
阪急阪神ホールディングス	172,300	4,125.00	710,737,500	
南海電気鉄道	61,700	2,831.00	174,672,700	
京阪ホールディングス	53,400	3,505.00	187,167,000	
神戸電鉄	3,600	3,210.00	11,556,000	
名古屋鉄道	142,700	2,136.00	304,807,200	
山陽電気鉄道	9,800	2,216.00	21,716,800	
アルプス物流	10,400	1,137.00	11,824,800	
トランコム	3,800	7,680.00	29,184,000	

ヤマトホールディングス	165,400	2,308.00	381,743,200	
山九	32,900	4,885.00	160,716,500	
日新	9,900	2,005.00	19,849,500	
丸運	6,400	212.00	1,356,800	
丸全昭和運輸	7,900	3,090.00	24,411,000	
センコーグループホールディングス	68,500	994.00	68,089,000	
トナミホールディングス	2,500	3,640.00	9,100,000	
ニッコンホールディングス	41,400	2,398.00	99,277,200	
日本石油輸送	800	2,189.00	1,751,200	
福山通運	10,800	3,390.00	36,612,000	
セイノーホールディングス	80,500	1,159.00	93,299,500	
エスライン	3,900	805.00	3,139,500	
神奈川中央交通	3,800	3,335.00	12,673,000	
日立物流	28,600	8,900.00	254,540,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	31,200	1,530.00	47,736,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	12,400	1,215.00	15,066,000	
日本郵船	345,700	2,728.50	943,242,450	
商船三井	227,800	3,120.00	710,736,000	
川崎汽船	110,100	2,590.00	285,159,000	
ＮＳユナイテッド海運	6,900	3,690.00	25,461,000	
明治海運	12,500	730.00	9,125,000	
飯野海運	47,500	870.00	41,325,000	
共栄タンカー	2,300	941.00	2,164,300	
九州旅客鉄道	91,300	2,842.00	259,474,600	
ＳＧホールディングス	248,000	2,027.00	502,696,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	48,200	7,630.00	367,766,000	
日本航空	317,400	2,692.00	854,440,800	
ＡＮＡホールディングス	351,600	2,841.00	998,895,600	
ビーウィズ	4,100	1,220.00	5,002,000	
パスコ	2,500	1,297.00	3,242,500	
ＴＲＥホールディングス	28,100	1,553.00	43,639,300	
人・夢・技術グループ	5,900	2,681.00	15,817,900	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,600	4,085.00	14,706,000	
シルバーライフ	3,200	1,498.00	4,793,600	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,529.00	1,834,800	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,700	3,760.00	25,192,000	
コーア商事ホールディングス	9,700	592.00	5,742,400	
ＫＰＰグループホールディングス	31,800	870.00	27,666,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,100	821.00	1,724,100	
ブックオフグループホールディングス	8,000	1,256.00	10,048,000	
ギフトホールディングス	2,800	3,600.00	10,080,000	
三菱倉庫	27,800	3,355.00	93,269,000	
三井倉庫ホールディングス	12,100	3,520.00	42,592,000	
住友倉庫	35,500	2,028.00	71,994,000	
澁澤倉庫	5,200	2,082.00	10,826,400	
ヤマタネ	6,100	1,659.00	10,119,900	
東陽倉庫	17,400	252.00	4,384,800	
乾汽船	16,500	1,926.00	31,779,000	

日本トランスシティ	26,000	495.00	12,870,000	
ケイヒン	2,300	1,528.00	3,514,400	
中央倉庫	6,300	928.00	5,846,400	
川西倉庫	2,200	996.00	2,191,200	
安田倉庫	9,000	929.00	8,361,000	
ファイズホールディングス	2,300	985.00	2,265,500	
東洋埠頭	3,800	1,259.00	4,784,200	
上組	64,300	2,842.00	182,740,600	
サンリツ	3,100	696.00	2,157,600	
キムラユニティー	6,200	800.00	4,960,000	
キユーソー流通システム	7,700	1,057.00	8,138,900	
東海運	7,700	273.00	2,102,100	
エーアイテイー	8,000	1,433.00	11,464,000	
内外トランスライン	4,700	2,076.00	9,757,200	
ショーエイコーポレーション	3,900	570.00	2,223,000	
日本コンセプト	4,100	1,879.00	7,703,900	
ＴＢＳホールディングス	66,400	1,490.00	98,936,000	
日本テレビホールディングス	114,800	1,050.00	120,540,000	
朝日放送グループホールディングス	12,200	625.00	7,625,000	
テレビ朝日ホールディングス	31,400	1,329.00	41,730,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	115,200	497.00	57,254,400	
テレビ東京ホールディングス	9,400	1,829.00	17,192,600	
日本ＢＳ放送	4,700	915.00	4,300,500	
ビジョン	17,100	1,353.00	23,136,300	
スマートバリュー	3,300	468.00	1,544,400	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	11,600	2,389.00	27,712,400	
ワイヤレスゲート	5,700	290.00	1,653,000	
コネクシオ	8,600	1,122.00	9,649,200	
日本通信	119,700	254.00	30,403,800	
クロップス	2,100	1,045.00	2,194,500	
日本電信電話	1,663,200	3,874.00	6,443,236,800	
ＫＤＤＩ	1,003,000	4,271.00	4,283,813,000	
ソフトバンク	2,085,100	1,486.00	3,098,458,600	
光通信	15,400	18,590.00	286,286,000	
エムティーアイ	11,900	510.00	6,069,000	
GMOインターネットグループ	48,200	2,628.00	126,669,600	
ファイバーゲート	6,900	975.00	6,727,500	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,100	281.00	871,100	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	68,600	2,486.00	170,539,600	
学研ホールディングス	21,700	962.00	20,875,400	
ゼンリン	22,200	854.00	18,958,800	
昭文社ホールディングス	5,600	295.00	1,652,000	
インプレスホールディングス	11,400	208.00	2,371,200	
東京電力ホールディングス	1,166,500	465.00	542,422,500	
中部電力	476,900	1,245.00	593,740,500	
関西電力	499,700	1,152.00	575,654,400	
中国電力	206,100	722.00	148,804,200	
北陸電力	122,100	494.00	60,317,400	

東北電力	316,400	627.00	198,382,800	
四国電力	110,500	738.00	81,549,000	
九州電力	298,300	734.00	218,952,200	
北海道電力	124,900	445.00	55,580,500	
沖縄電力	30,300	1,015.00	30,754,500	
電源開発	97,400	2,130.00	207,462,000	
エフオン	9,500	647.00	6,146,500	
イーレックス	23,000	2,460.00	56,580,000	
レノバ	34,500	2,794.00	96,393,000	
東京瓦斯	273,600	2,483.00	679,348,800	
大阪瓦斯	262,100	2,056.00	538,877,600	
東邦瓦斯	50,900	2,624.00	133,561,600	
北海道瓦斯	7,700	1,649.00	12,697,300	
広島ガス	27,500	341.00	9,377,500	
西部ガスホールディングス	12,100	1,633.00	19,759,300	
静岡ガス	29,500	974.00	28,733,000	
メタウォーター	16,300	1,884.00	30,709,200	
アイネット	7,800	1,320.00	10,296,000	
松竹	7,400	11,700.00	86,580,000	
東宝	81,200	5,050.00	410,060,000	
エイチ・アイ・エス	34,800	2,002.00	69,669,600	
東映	3,700	17,670.00	65,379,000	
ラックランド	4,200	2,895.00	12,159,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	407,300	2,027.00	825,597,100	
共立メンテナンス	22,800	5,690.00	129,732,000	
イチネンホールディングス	14,100	1,238.00	17,455,800	
建設技術研究所	6,800	3,025.00	20,570,000	
スペース	9,800	885.00	8,673,000	
アインホールディングス	18,800	6,370.00	119,756,000	
燦ホールディングス	5,900	1,720.00	10,148,000	
ピー・シー・エー	7,800	1,186.00	9,250,800	
スバル興業	600	8,800.00	5,280,000	
東京テアトル	5,000	1,114.00	5,570,000	
タナベコンサルティンググループ	5,300	631.00	3,344,300	
ビジネスブレイン太田昭和	5,600	1,812.00	10,147,200	
ナガワ	3,600	7,080.00	25,488,000	
東京都競馬	11,200	4,045.00	45,304,000	
常磐興産	4,700	1,142.00	5,367,400	
カナモト	24,400	2,274.00	55,485,600	
ＤＴＳ	28,600	3,590.00	102,674,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	65,300	6,660.00	434,898,000	
シーイーシー	18,200	1,534.00	27,918,800	
カプコン	129,000	4,415.00	569,535,000	
西尾レントオール	12,400	2,946.00	36,530,400	
アイ・エス・ビー	6,600	1,329.00	8,771,400	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	75,500	23.00	1,736,500	
日本空港ビルデング	45,100	5,960.00	268,796,000	
トランス・コスモス	16,600	3,170.00	52,622,000	

乃村工藝社	58,100	1,060.00	61,586,000	
ジャステック	7,900	1,270.00	10,033,000	
ＳＣＳＫ	105,900	2,183.00	231,179,700	
藤田観光	5,900	2,903.00	17,127,700	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	7,900	1,650.00	13,035,000	
日本管財	13,900	2,526.00	35,111,400	
トーカイ	11,800	1,899.00	22,408,200	
白洋舎	1,200	1,547.00	1,856,400	
セコム	135,500	8,234.00	1,115,707,000	
ＮＳＷ	5,100	2,173.00	11,082,300	
セントラル警備保障	7,100	2,537.00	18,012,700	
アイネス	9,200	1,457.00	13,404,400	
丹青社	25,700	798.00	20,508,600	
メイテック	53,100	2,572.00	136,573,200	
ＴＫＣ	23,300	3,800.00	88,540,000	
富士ソフト	14,600	8,290.00	121,034,000	
応用地質	12,900	2,202.00	28,405,800	
船井総研ホールディングス	28,000	2,767.00	77,476,000	
ＮＳＤ	46,400	2,642.00	122,588,800	
進学会ホールディングス	4,500	301.00	1,354,500	
丸紅建材リース	800	1,734.00	1,387,200	
オオバ	8,300	681.00	5,652,300	
コナミグループ	55,500	6,540.00	362,970,000	
いであ	3,100	1,672.00	5,183,200	
学究社	5,300	1,730.00	9,169,000	
ベネッセホールディングス	49,600	1,951.00	96,769,600	
イオンディライト	14,600	2,963.00	43,259,800	
ナック	6,100	933.00	5,691,300	
福井コンピュータホールディングス	9,000	3,370.00	30,330,000	
ダイセキ	27,200	4,665.00	126,888,000	
ステップ	5,500	1,888.00	10,384,000	
日鉄物産	9,500	5,200.00	49,400,000	
泉州電業	6,800	2,690.00	18,292,000	
元気寿司	4,400	3,140.00	13,816,000	
トラスコ中山	28,800	1,994.00	57,427,200	
ヤマダホールディングス	561,500	463.00	259,974,500	
オートバックスセブン	47,600	1,415.00	67,354,000	
モリト	9,900	746.00	7,385,400	
アークランズ	20,000	1,501.00	30,020,000	
ニトリホールディングス	55,300	15,490.00	856,597,000	
グルメ杵屋	11,200	1,001.00	11,211,200	
愛眼	7,400	175.00	1,295,000	
ケーユーホールディングス	8,000	1,247.00	9,976,000	
吉野家ホールディングス	53,600	2,292.00	122,851,200	
加藤産業	16,700	3,540.00	59,118,000	
北恵	3,200	755.00	2,416,000	
イノテック	8,600	1,271.00	10,930,600	
イエローハット	24,200	1,694.00	40,994,800	
松屋フーズホールディングス	6,500	3,960.00	25,740,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,600	1,841.00	17,673,600	

ＪＫホールディングス	10,800	1,036.00	11,188,800	
サガミホールディングス	22,100	1,221.00	26,984,100	
日伝	8,000	1,708.00	13,664,000	
関西フードマーケット	12,400	1,392.00	17,260,800	
ミロク情報サービス	11,800	1,428.00	16,850,400	
北沢産業	7,000	193.00	1,351,000	
杉本商事	6,100	2,040.00	12,444,000	
因幡電機産業	35,500	2,714.00	96,347,000	
王将フードサービス	9,000	5,950.00	53,550,000	
プレナス	15,100	2,635.00	39,788,500	
ミニストップ	10,100	1,410.00	14,241,000	
アークス	25,100	2,034.00	51,053,400	
バローホールディングス	26,000	1,766.00	45,916,000	
東テク	4,600	3,495.00	16,077,000	
ミスミグループ本社	206,600	3,315.00	684,879,000	
アルテック	7,700	301.00	2,317,700	
ベルク	6,800	5,510.00	37,468,000	
大　庄	7,400	1,055.00	7,807,000	
タキヒヨー	3,400	761.00	2,587,400	
ファーストリテイリング	20,500	82,190.00	1,684,895,000	
ソフトバンクグループ	750,500	6,953.00	5,218,226,500	
蔵王産業	2,200	1,727.00	3,799,400	
スズケン	49,900	3,250.00	162,175,000	
サンドラッグ	52,000	3,385.00	176,020,000	
サックスバー　ホールディングス	13,000	734.00	9,542,000	
ジェコス	9,000	810.00	7,290,000	
ヤマザワ	2,500	1,150.00	2,875,000	
やまや	2,800	2,448.00	6,854,400	
グローセル	15,000	421.00	6,315,000	
ベルーナ	32,900	693.00	22,799,700	
合計	152,321,200		369,641,938,680	

（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11月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	9,997,605,198
コール・ローン	6,222,713,846
株式	767,654,557,203
投資信託受益証券	1,305,524,222
投資証券	16,950,844,450
派生商品評価勘定	1,255,534,226
未収入金	496,488
未収配当金	743,407,077
差入委託証拠金	4,676,606,921
流動資産合計	808,807,289,631
資産合計	808,807,289,631
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	157,365,511
未払解約金	81,131,000
流動負債合計	238,496,511
負債合計	238,496,511
純資産の部	
元本等	
元本	129,749,605,564
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	678,819,187,556
元本等合計	808,568,793,120
純資産合計	808,568,793,120
負債純資産合計	808,807,289,631

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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11月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	116,054,588,763円
同期中追加設定元本額	30,907,343,605円
同期中一部解約元本額	17,212,326,804円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,390,660,316円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,939,686円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	12,531,838円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	42,353,868円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	22,097,897円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	13,515,675円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	22,634,563円
たわらノーロード　先進国株式	39,128,547,551円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	427,272,850円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,692,826,414円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	740,084,447円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	79,875,170円
たわらノーロード　バランス（標準型）	669,258,758円
たわらノーロード　バランス（積極型）	832,597,549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）	140,575,143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）	417,995,473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）	341,312,527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）	503,554,203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）	1,182,266円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	25,577,850円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,743,358円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,930,302円
たわらノーロード　全世界株式	475,998,595円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	54,600,691,624円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	2,651,112,905円
Ｏｎｅグローバルバランス	2,872,387円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	151,576,425円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	780,081,625円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,019,151,977円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	92,510,967円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	251,439,120円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	243,542,869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＞	621,612,619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）	167,056,250円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	191,366,860円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	309,355,040円
投資のソムリエ	4,735,886,429円
クルーズコントロール	129,770,636円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	327,778,655円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	194,026,459円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	208,203,308円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	129,086,685円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	587,555,135円
ワールドアセットバランス（基本コース）	140,743,631円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	72,776,027円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	14,300,058円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	7,148,287円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	873,277円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	23,076,309円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	127,589,859円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	47,895,318円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	144,069,700円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	12,811,979円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	7,349,559円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	4,758,058円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	83,058,670円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	900,462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
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
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）	450,014,163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）	40,531,629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）	1,110,172,319円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	201,440,106円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,061,006,881円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	122,631,365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）	1,748,825円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,874,916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）	2,586,389円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	1,543,325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）	26,211,424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）	50,829,922円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,974,100円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,245,392円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,291,107円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,693円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,589,761円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,520,408円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	160,865,870円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	254,478,015円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	851,855,651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）	42,544,519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）	37,506,497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）	254,551,780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）	10,545,373円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	159,891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）	100,804,498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）	8,893,863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）	29,588,668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）	45,483,012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）	102,386,587円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	8,359,934円
コア資産形成ファンド	5,545,575円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,770,995,002円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	140,867,863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）	8,854,656円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,100,924,377円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,468,567,681円
計	129,749,605,564円
２．　受益権の総数	129,749,605,564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　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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11月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△66,688,236,303
投資信託受益証券	△175,165,781
投資証券	△2,510,257,779
合計	△69,373,659,863

（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11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	23,114,608	－	22,828,078	286,530
オーストラリア・ドル	23,114,608	－	22,828,078	286,530
買建	6,532,318,010	－	6,375,699,024	△156,618,986
アメリカ・ドル	4,897,085,880	－	4,760,402,663	△136,683,217
イギリス・ポンド	294,793,515	－	293,061,962	△1,731,553
オーストラリア・ドル	130,693,739	－	129,951,548	△742,191
カナダ・ドル	243,848,409	－	240,016,475	△3,831,934
ユーロ	965,896,467	－	952,266,376	△13,630,091
合計	6,555,432,618	－	6,398,527,102	△156,332,456

（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11月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	21,767,929,272	－	23,022,430,443	1,254,501,171
合計	21,767,929,272	－	23,022,430,443	1,254,501,171

（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11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	6.2318円 (62,318円)

附属明細表
第１　有価証券明細表
（１）株式

2022年11月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,064,890	96.630	102,900,320.700	
	ABBOTT LABORATORIES	203,718	104.230	21,233,527.140	
	AES CORP	79,505	28.220	2,243,631.100	
	ABIOMED INC	5,283	372.780	1,969,396.740	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	104,412	141.230	14,746,106.760	
	ADVANCED MICRO DEVICES	189,936	68.470	13,004,917.920	
	ADOBE INC	55,212	329.950	18,217,199.400	
	CHUBB LTD	49,523	211.910	10,494,418.930	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26,039	289.590	7,540,634.010	

ALLSTATE CORP	31,078	130.190	4,046,044.820	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	78,829	214.800	16,932,469.200	
AMGEN INC	62,119	291.010	18,077,250.190	
HESS CORP	33,470	139.840	4,680,444.800	
AMERICAN EXPRESS CO	74,329	154.750	11,502,412.750	
AMERICAN ELECTRIC POWER	59,558	91.800	5,467,424.400	
AFLAC INC	68,561	69.970	4,797,213.170	
AMERICAN INTL GROUP	93,843	60.590	5,685,947.370	
AMERCO	980	52.020	50,979.600	
ANALOG DEVICES	60,232	160.370	9,659,405.840	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	79,236	66.660	5,281,871.760	
VALERO ENERGY CORP	48,490	132.450	6,422,500.500	
ANSYS INC	9,857	249.190	2,456,265.830	
APPLE INC	1,881,449	146.870	276,328,414.630	
APPLIED MATERIALS INC	102,343	104.790	10,724,522.970	
ALBEMARLE CORP	13,133	320.770	4,212,672.410	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	66,469	94.280	6,266,697.320	
AMEREN CORP	31,621	85.300	2,697,271.300	
ARROW ELECTRONICS INC	9,936	108.980	1,082,825.280	
AUTODESK INC	24,822	222.960	5,534,313.120	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	48,690	254.880	12,410,107.200	
AUTOZONE INC	2,313	2,467.660	5,707,697.580	
AVERY DENNISON CORP	9,514	182.670	1,737,922.380	
BALL CORP	36,411	53.500	1,947,988.500	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	149,168	303.200	45,227,737.600	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	90,954	44.070	4,008,342.780	
BAXTER INTERNATIONAL INC	57,988	53.730	3,115,695.240	
BECTON DICKINSON & CO	32,349	229.280	7,416,978.720	
AMETEK INC	27,428	140.680	3,858,571.040	
VERIZON COMM INC	489,273	38.520	18,846,795.960	
WR BERKLEY CORP	24,066	73.290	1,763,797.140	
BEST BUY CO INC	25,405	72.030	1,829,922.150	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	427.580	1,051,419.220	
YUM! BRANDS INC	32,015	124.130	3,974,021.950	
FIRSTENERGY CORP	61,472	38.990	2,396,793.280	
BOEING CO	64,353	177.580	11,427,805.740	
ROBERT HALF INTL INC	11,897	79.590	946,882.230	
BORGWARNER INC	27,800	40.970	1,138,966.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	163,516	43.760	7,155,460.160	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	93.930	1,361,421.420	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	19,529	98.570	1,924,973.530	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,582	1,449.150	3,741,705.300	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	248,136	79.380	19,697,035.680	
ONEOK INC	52,652	63.400	3,338,136.800	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	148.660	1,173,076.060	
UNITED RENTALS INC	8,287	344.910	2,858,269.170	
SEMPRA ENERGY	36,952	155.830	5,758,230.160	
FEDEX CORP	28,131	166.000	4,669,746.000	
VERISIGN INC	10,834	191.120	2,070,594.080	
AMPHENOL CORP	67,929	79.060	5,370,466.740	
BROWN-FORMAN CORP	35,058	69.840	2,448,450.720	
QUANTA SERVICES INC	17,560	147.060	2,582,373.600	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	6.410	652,313.650	
CSX CORP	254,377	31.220	7,941,649.940	
COTERRA ENERGY INC	91,495	27.530	2,518,857.350	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	50.550	1,363,737.900	
CONSTELLATION BRANDS INC	18,254	244.030	4,454,523.620	
CARDINAL HEALTH INC	31,857	77.930	2,482,616.010	
CARLISLE COS INC	6,119	242.640	1,484,714.160	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	9.780	1,293,805.980	
CATERPILLAR INC	62,161	232.450	14,449,324.450	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,845	130.730	1,417,766.850	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	6.450	626,120.850	
JPMORGAN CHASE & CO	341,549	135.080	46,136,438.920	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,423	74.940	2,055,079.620	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,259	107.550	1,856,205.450	
CINTAS CORP	10,530	444.510	4,680,690.300	
CISCO SYSTEMS INC	482,556	45.660	22,033,506.960	
CLEVELAND-CLIFFS INC	56,364	13.960	786,841.440	
CLOROX COMPANY	14,322	143.980	2,062,081.560	
COCA-COLA CO/THE	477,562	60.880	29,073,974.560	
COPART INC	49,880	60.460	3,015,744.800	
COGNEX CORP	20,432	49.810	1,017,717.920	
COLGATE-PALMOLIVE CO	93,331	74.970	6,997,025.070	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	31,293	157.980	4,943,668.140	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,695	329.690	2,207,274.550	
NRG ENERGY, INC.	28,364	45.090	1,278,932.760	
COMCAST CORP-CL A	521,756	32.770	17,097,944.120	
CONAGRA BRANDS INC	55,843	35.190	1,965,115.170	
CONSOLIDATED EDISON INC	41,423	90.950	3,767,421.850	
CMS ENERGY CORP	32,591	59.200	1,929,387.200	
COOPER COS INC	5,638	302.030	1,702,845.140	

MOLSON COORS BEVERAGE CO	21,281	51.450	1,094,907.450	
CORNING INC	95,758	33.900	3,246,196.200	
SEALED AIR CORP	17,610	49.470	871,166.700	
HEICO CORP-CL A	7,767	127.730	992,078.910	
CUMMINS INC	15,824	242.130	3,831,465.120	
DR HORTON INC	38,221	83.920	3,207,506.320	
DANAHER CORP	80,519	267.870	21,568,624.530	
MOODY'S CORP	19,566	294.260	5,757,491.160	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	58,780	57.290	3,367,506.200	
TARGET CORP	54,443	164.380	8,949,340.340	
DEERE & CO	33,838	407.610	13,792,707.180	
MORGAN STANLEY	152,253	88.800	13,520,066.400	
REPUBLIC SERVICES INC	24,966	134.850	3,366,665.100	
COSTAR GROUP INC	47,398	84.160	3,989,015.680	
THE WALT DISNEY CO	212,234	90.460	19,198,687.640	
DOLLAR TREE INC	25,247	163.120	4,118,290.640	
DOVER CORP	16,217	137.350	2,227,404.950	
OMNICOM GROUP	23,275	75.110	1,748,185.250	
DTE ENERGY CO	23,792	115.540	2,748,927.680	
DUKE ENERGY CORP	87,541	97.100	8,500,231.100	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	145.330	2,025,754.870	
EBAY INC	67,667	44.660	3,022,008.220	
BANK OF AMERICA CORP	844,230	38.130	32,190,489.900	
CITIGROUP INC	226,525	48.420	10,968,340.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,111	85.130	1,201,269.430	
EATON CORP PLC	45,226	162.130	7,332,491.380	
CADENCE DESIGN SYS INC	31,336	162.020	5,077,058.720	
DISH NETWORK CORP	24,416	16.060	392,120.960	
ECOLAB INC	28,945	151.630	4,388,930.350	
PERKINELMER INC	15,649	136.380	2,134,210.620	
ELECTRONIC ARTS INC	33,011	130.300	4,301,333.300	
SALESFORCE INC	116,028	156.300	18,135,176.400	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	271.370	915,059.640	
EMERSON ELECTRIC CO	69,296	94.000	6,513,824.000	
ATMOS ENERGY CORP	17,567	111.800	1,963,990.600	
ENTERGY CORP	23,769	111.040	2,639,309.760	
EOG RESOURCES INC	68,935	142.310	9,810,139.850	
EQUIFAX INC	13,970	187.810	2,623,705.700	
EQT CORP	36,492	42.900	1,565,506.800	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	27,378	218.890	5,992,770.420	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,974	108.690	2,170,974.060	
EXXON MOBIL CORP	490,461	110.500	54,195,940.500	
FMC CORP	15,534	126.450	1,964,274.300	
NEXTERA ENERGY INC	228,563	83.200	19,016,441.600	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,716	436.280	2,057,496.480	
FAIR ISAAC CORP	2,962	581.780	1,723,232.360	
ASSURANT INC	5,823	126.660	737,541.180	

FASTENAL CO	68,855	51.870	3,571,508.850	
FIFTH THIRD BANCORP	77,462	36.290	2,811,095.980	
M&T BANK CORP	20,766	170.190	3,534,165.540	
FISERV INC	71,827	101.000	7,254,527.000	
FORD MOTOR CO	465,038	14.180	6,594,238.840	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	25.610	971,028.760	
FREEPORT-MCMORAN INC	172,370	36.750	6,334,597.500	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	847.480	1,076,299.600	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,816	193.000	4,789,488.000	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	30.280	775,137.720	
GENERAL DYNAMICS CORP	27,465	253.480	6,961,828.200	
GENERAL MILLS INC	69,455	79.580	5,527,228.900	
GENUINE PARTS CO	16,139	182.200	2,940,525.800	
GILEAD SCIENCES INC	146,012	82.600	12,060,591.200	
GARTNER INC	9,036	340.900	3,080,372.400	
MCKESSON CORP	16,571	370.320	6,136,572.720	
NVIDIA CORP	291,664	157.500	45,937,080.000	
GENERAL ELECTRIC CO	128,824	85.380	10,998,993.120	
WW GRAINGER INC	5,466	608.380	3,325,405.080	
HALLIBURTON CO	104,397	37.810	3,947,250.570	
MONSTER BEVERAGE CORP	47,224	99.300	4,689,343.200	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	39,807	378.310	15,059,386.170	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	22,879	239.340	5,475,859.860	
HASBRO INC	15,437	60.390	932,240.430	
HENRY SCHEIN INC	15,048	77.320	1,163,511.360	
HEICO CORP	5,185	163.810	849,354.850	
HERSHEY FOODS CORP	17,397	226.300	3,936,941.100	
HP INC	118,420	29.300	3,469,706.000	
F5 INC	6,924	144.740	1,002,179.760	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	77.610	1,189,140.420	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	30.510	1,333,744.650	
HOLOGIC INC	28,090	75.000	2,106,750.000	
HOME DEPOT INC	119,519	311.700	37,254,072.300	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	22,880	83.320	1,906,361.600	
HORMEL FOODS CORP	34,578	47.580	1,645,221.240	
CENTERPOINT ENERGY INC	71,052	29.400	2,088,928.800	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	263.240	948,190.480	
HUMANA INC	14,894	558.300	8,315,320.200	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,171	182.470	1,673,432.370	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	163,228	15.180	2,477,801.040	
BIOGEN INC	17,603	290.700	5,117,192.100	
IDEX CORP	9,065	232.960	2,111,782.400	
ILLINOIS TOOL WORKS	36,151	224.250	8,106,861.750	
INTUIT INC	31,332	403.240	12,634,315.680	

IDEXX LABORATORIES INC	10,162	416.060	4,228,001.720	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26,475	176.770	4,679,985.750	
INTEL CORP	475,759	29.760	14,158,587.840	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	29,611	96.060	2,844,432.660	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	35.140	1,551,536.420	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	31.070	1,419,246.530	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	175.750	1,432,714.000	
INCYTE CORP	21,658	77.780	1,684,559.240	
JOHNSON & JOHNSON	305,412	174.470	53,285,231.640	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,402	74.300	2,927,568.600	
KLA CORPORATION	16,870	368.250	6,212,377.500	
DEVON ENERGY CORP	74,759	68.980	5,156,875.820	
KELLOGG CO	29,915	71.020	2,124,563.300	
KEYCORP	106,247	19.450	2,066,504.150	
KIMBERLY-CLARK CORP	39,997	127.780	5,110,816.660	
BLACKROCK INC/NEW YORK	17,327	759.810	13,165,227.870	
KROGER CO	77,870	48.110	3,746,325.700	
LAM RESEARCH CORP	16,432	485.410	7,976,257.120	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,380	421.250	2,266,325.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	125.080	1,379,507.320	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,689	92.920	1,643,661.880	
PLUG POWER INC	56,149	17.010	955,094.490	
LENNAR CORP	29,937	88.400	2,646,430.800	
ELI LILLY & CO	94,044	368.720	34,675,903.680	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	34.430	969,411.080	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	34.630	621,158.310	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	85,375	172.320	14,711,820.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	33,941	146.300	4,965,568.300	
LOCKHEED MARTIN CORP	27,932	490.770	13,708,187.640	
LOEWS CORP	23,530	56.590	1,331,562.700	
LOWE'S COS INC	74,504	204.320	15,222,657.280	
DOMINION ENERGY INC	94,726	62.370	5,908,060.620	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	35.310	1,426,559.310	
MCCORMICK & CO INC	29,367	81.860	2,403,982.620	
MCDONALD'S CORPORATION	85,649	275.880	23,628,846.120	
S&P GLOBAL INC	40,442	346.210	14,001,424.820	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	320.190	1,426,126.260	
MARKEL CORPORATION	1,512	1,284.930	1,942,814.160	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	73,886	72.550	5,360,429.300	
MARSH & MCLENNAN COS	58,212	168.390	9,802,318.680	

MASCO CORP	28,937	50.180	1,452,058.660	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,058	362.840	2,560,924.720	
METLIFE INC	76,607	74.720	5,724,075.040	
MEDTRONIC PLC	154,488	81.840	12,643,297.920	
ACTIVISION BLIZZARD INC	91,172	73.620	6,712,082.640	
CVS HEALTH CORP	152,821	99.910	15,268,346.110	
MERCK & CO.INC.	294,122	101.890	29,968,090.580	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	50,668	72.790	3,688,123.720	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,593	243.070	2,574,840.510	
MICROSOFT CORP	825,895	242.980	200,675,967.100	
MICRON TECH INC	131,009	60.270	7,895,912.430	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	62,574	73.920	4,625,470.080	
3M CO	64,586	129.150	8,341,281.900	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	102.440	646,498.840	
ENTEGRIS INC	17,709	74.720	1,323,216.480	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,578	237.700	1,325,890.600	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,762	259.610	4,870,802.820	
ILLUMINA INC	17,754	240.090	4,262,557.860	
XCEL ENERGY INC	64,922	69.110	4,486,759.420	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,061	123.220	1,239,716.420	
NETAPP INC	24,953	71.910	1,794,370.230	
NEWELL BRANDS INC	41,984	13.450	564,684.800	
NEWMONT CORP	91,771	46.410	4,259,092.110	
NVR INC	365	4,529.730	1,653,351.450	
NIKE INC-CL B	148,452	99.490	14,769,489.480	
NORDSON CORP	5,664	235.180	1,332,059.520	
NORFOLK SOUTHERN CORP	27,963	242.980	6,794,449.740	
EVERSOURCE ENERGY	40,362	79.120	3,193,441.440	
NISOURCE INC	44,573	26.090	1,162,909.570	
NORTHERN TRUST CORP	22,556	90.400	2,039,062.400	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,264	531.590	9,177,369.760	
WELLS FARGO & CO	441,665	47.950	21,177,836.750	
NUCOR CORP	31,660	139.030	4,401,689.800	
CHENIERE ENERGY INC	25,946	167.320	4,341,284.720	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,654	113.420	5,291,496.680	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	110,048	70.480	7,756,183.040	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,008	305.630	3,364,375.040	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,757	843.850	6,545,744.450	
ORACLE CORP	186,292	77.170	14,376,153.640	
PACCAR INC	40,847	101.910	4,162,717.770	
PTC INC	13,665	129.770	1,773,307.050	

EXELON CORP	116,226	39.000	4,532,814.000	
PARKER HANNIFIN CORP	14,702	303.320	4,459,410.640	
PAYCHEX INC	36,225	121.380	4,396,990.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,596	196.480	1,688,942.080	
PPL CORPORATION	88,737	27.730	2,460,677.010	
PEPSICO INC	160,382	181.700	29,141,409.400	
PENTAIR PLC	19,804	45.100	893,160.400	
PFIZER INC	653,095	47.380	30,943,641.100	
ESSENTIAL UTILITIES INC	27,796	46.410	1,290,012.360	
CONOCOPHILLIPS	151,445	129.460	19,606,069.700	
PG&E CORP	178,257	14.810	2,639,986.170	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,161	245.450	6,421,217.450	
ALTRIA GROUP INC	210,501	44.220	9,308,354.220	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	48,412	163.850	7,932,306.200	
BROWN & BROWN INC	27,138	58.690	1,592,729.220	
GARMIN LTD	17,835	91.310	1,628,513.850	
PPG INDUSTRIES INC	26,678	124.810	3,329,681.180	
COSTCO WHOLESALE CORP	51,601	513.130	26,478,021.130	
T ROWE PRICE GROUP INC	25,937	124.650	3,233,047.050	
QUEST DIAGNOSTICS	13,048	152.480	1,989,559.040	
PROCTER & GAMBLE CO	278,989	141.180	39,387,667.020	
PROGRESSIVE CORP	68,579	129.740	8,897,439.460	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56,485	59.520	3,361,987.200	
PULTE GROUP INC	29,050	43.780	1,271,809.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	31,571	102.890	3,248,340.190	
QUALCOMM INC	130,263	120.680	15,720,138.840	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	23,437	123.980	2,905,719.260	
EXACT SCIENCES CORP	18,866	43.960	829,349.360	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,661	741.080	9,382,813.880	
RESMED INC	17,366	225.180	3,910,475.880	
US BANCORP	164,969	44.870	7,402,159.030	
SEAGEN INC	16,860	131.060	2,209,671.600	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	45,851	58.400	2,677,698.400	
ROSS STORES INC	40,011	97.130	3,886,268.430	
ROLLINS INC	25,920	42.020	1,089,158.400	
ROPER TECHNOLOGIES INC	12,443	438.430	5,455,384.490	
ROCKWELL AUTOMATION INC	13,905	265.540	3,692,333.700	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	57.720	1,585,972.440	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	100.090	1,648,182.030	
ACCENTURE PLC-CL A	73,565	287.020	21,114,626.300	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	161,069	64.980	10,466,263.620	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,232	232.120	3,071,411.840	

THE TRAVELERS COMPANIES INC	28,285	183.300	5,184,640.500	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	71,649	64.000	4,585,536.000	
BOOKING HOLDINGS INC	4,639	1,946.510	9,029,859.890	
SCHLUMBERGER LTD	165,948	53.100	8,811,838.800	
SCHWAB (CHARLES) CORP	169,636	78.560	13,326,604.160	
POOL CORP	4,660	339.310	1,581,184.600	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24,453	112.900	2,760,743.700	
BUNGE LTD	16,302	102.190	1,665,901.380	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	59.910	867,317.070	
ELEVANCE HEALTH INC	28,117	521.880	14,673,699.960	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,104	155.000	2,961,120.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	29,468	93.620	2,758,794.160	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	28,153	239.000	6,728,567.000	
CENTENE CORP	66,823	84.430	5,641,865.890	
SVB FINANCIAL GROUP	7,330	230.950	1,692,863.500	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	59.280	880,663.680	
SNAP-ON INC	6,118	236.030	1,444,031.540	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,080	107.720	4,532,857.600	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	183.530	1,314,992.450	
EDISON INTERNATIONAL	45,008	60.290	2,713,532.320	
SOUTHERN CO	123,168	65.710	8,093,369.280	
TRUIST FINANCIAL CORP	151,927	46.040	6,994,719.080	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	38.820	764,754.000	
AT&T INC	834,227	18.840	15,716,836.680	
CHEVRON CORP	217,135	181.300	39,366,575.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	81.450	1,569,541.500	
STATE STREET CORP	43,118	79.860	3,443,403.480	
STARBUCKS CORP	133,865	96.260	12,885,844.900	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	96.340	2,209,750.580	
STRYKER CORP	39,723	218.960	8,697,748.080	
NETFLIX INC	51,986	274.970	14,294,590.420	
GEN DIGITAL INC	73,086	22.630	1,653,936.180	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	52.730	882,172.900	
SYNOPSYS INC	18,073	318.760	5,760,949.480	
SYSCO CORP	59,770	84.240	5,035,024.800	
INTUITIVE SURGICAL INC	41,255	257.860	10,638,014.300	
TELEFLEX INC	5,532	218.200	1,207,082.400	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,349	9.400	1,046,680.600	
TERADYNE INC	18,512	93.330	1,727,724.960	
TEXAS INSTRUMENTS INC	106,757	174.690	18,649,380.330	
TEXTRON INC	25,824	71.520	1,846,932.480	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	45,604	520.580	23,740,530.320	
GLOBE LIFE INC	12,153	113.850	1,383,619.050	
DAVITA INC	6,813	68.450	466,349.850	
TRACTOR SUPPLY CO	12,713	210.590	2,677,230.670	
BIO-TECHNE CORP	4,403	337.090	1,484,207.270	
TRIMBLE INC	28,676	59.160	1,696,472.160	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,300	309.710	1,641,463.000	
TYSON FOODS INC	32,395	66.460	2,152,971.700	
UGI CORP	24,160	36.690	886,430.400	
MARATHON OIL CORP	84,059	31.600	2,656,264.400	
UNION PACIFIC CORP	73,054	212.990	15,559,771.460	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	172,766	97.840	16,903,425.440	
UNITEDHEALTH GROUP INC	109,012	544.170	59,321,060.040	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	121.800	986,092.800	
VF CORP	37,887	29.930	1,133,957.910	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	16.570	1,117,928.190	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	29,265	311.030	9,102,292.950	
VULCAN MATERIALS CO	15,328	180.070	2,760,112.960	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86,056	38.490	3,312,295.440	
WALMART INC	176,225	142.360	25,087,391.000	
WASTE MANAGEMENT INC	48,739	161.220	7,857,701.580	
WATERS CORP	6,836	331.850	2,268,526.600	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	55.400	1,234,589.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,653	242.740	2,100,429.220	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	145.870	1,849,485.730	
VAIL RESORTS INC	4,389	230.260	1,010,611.140	
WESTERN DIGITAL CORP	35,421	37.750	1,337,142.750	
WABTEC CORP	20,273	100.350	2,034,395.550	
WHIRLPOOL CORP	6,832	149.650	1,022,408.800	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	93.230	1,755,800.590	
WYNN RESORTS LTD	12,757	72.000	918,504.000	
NASDAQ INC	41,596	66.210	2,754,071.160	
CME GROUP INC	40,989	174.340	7,146,022.260	
WILLIAMS COS INC	143,258	33.620	4,816,333.960	
LKQ CORP	31,504	54.120	1,704,996.480	
ALLIANT ENERGY CORP	29,066	55.520	1,613,744.320	
WEC ENERGY GROUP INC	35,483	94.150	3,340,724.450	
CARMAX INC	18,673	70.650	1,319,247.450	
TJX COMPANIES INC	136,815	74.000	10,124,310.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,958	253.420	1,509,876.360	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.110	469,974.390	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,328	47.680	826,199.040	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,121	212.450	3,000,006.450	
SIGNATURE BANK	6,557	140.940	924,143.580	
CBRE GROUP INC	37,573	77.220	2,901,387.060	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	19.120	301,694.480	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,099	23.280	2,493,264.720	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	357.820	1,472,429.300	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,852	386.870	1,877,093.240	
WESTLAKE CORP	4,187	106.150	444,450.050	
T-MOBILE US INC	73,540	150.450	11,064,093.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	38,350	41.050	1,574,267.500	
MOSAIC CO/THE	42,561	53.500	2,277,013.500	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	277.470	1,163,431.710	
CELANESE CORP	13,841	104.290	1,443,477.890	
DEXCOM INC	46,766	119.840	5,604,437.440	
EXPEDIA GROUP INC	19,186	99.040	1,900,181.440	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	108.490	2,606,689.230	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,462	331.560	4,131,900.720	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	19.990	720,319.660	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	65,267	102.540	6,692,478.180	
LIVE NATION	20,444	76.360	1,561,103.840	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,304	1,470.920	4,859,919.680	
TRANSDIGM GROUP INC	6,148	640.020	3,934,842.960	
MASTERCARD INC	100,920	337.270	34,037,288.400	
WESTERN UNION CO	46,712	13.450	628,276.400	
OWENS CORNING	10,366	91.360	947,037.760	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	107.230	1,620,030.840	
AERCAP HOLDINGS NV	17,861	58.610	1,046,833.210	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	13,610	141.240	1,922,276.400	
DELTA AIR LINES INC	15,786	35.490	560,245.140	
INSULET CORP	8,015	304.960	2,444,254.400	
DISCOVER FINANCIAL	33,236	108.320	3,600,123.520	
TE CONNECTIVITY LTD	36,520	122.150	4,460,918.000	
MASIMO CORP	5,688	121.580	691,547.040	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,211	353.850	4,674,712.350	
VMWARE INC	24,654	114.610	2,825,594.940	
MERCADOLIBRE INC	5,154	935.530	4,821,721.620	
ULTA BEAUTY INC	6,073	423.580	2,572,401.340	
INVESCO LTD	38,530	18.750	722,437.500	
MSCI INC	9,313	509.700	4,746,836.100	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	180,062	93.250	16,790,781.500	
VISA INC	191,227	205.570	39,310,534.390	
KEURIG DR PEPPER INC	92,816	37.940	3,521,439.040	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,210	147.510	3,128,687.100	
MARATHON PETROLEUM CORP	62,332	119.180	7,428,727.760	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	16,182	65.690	1,062,995.580	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	229,919	18.200	4,184,525.800	
XYLEM INC	20,869	111.740	2,331,902.060	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,975	83.960	2,516,701.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	244.170	1,150,773.210	
SPLUNK INC	18,478	81.550	1,506,880.900	
EPAM SYSTEMS INC	6,493	350.450	2,275,471.850	
HCA HEALTHCARE INC	27,835	222.500	6,193,287.500	
VERISK ANALYTICS INC	18,974	181.110	3,436,381.140	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,554	149.900	982,444.600	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	194.600	1,721,042.400	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	22,434	126.490	2,837,676.660	
NXP SEMICONDUCTOR NV	30,981	165.470	5,126,426.070	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	14,445	111.280	1,607,439.600	
TARGA RESOURCES CORP	25,830	71.590	1,849,169.700	
LEAR CORP	6,911	143.970	994,976.670	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,709	120.960	1,537,280.640	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,335	52.090	1,371,790.150	
DOLLAR GENERAL CORP	26,671	253.940	6,772,833.740	
FORTINET INC	77,005	54.390	4,188,301.950	
HORIZON PHARMA PLC	24,711	76.570	1,892,121.270	
TESLA INC	307,485	190.720	58,643,539.200	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	109.900	759,848.600	
ENPHASE ENERGY INC	15,506	309.250	4,795,230.500	
GENERAL MOTORS CO	159,031	39.740	6,319,891.940	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	28.680	1,125,116.400	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9,661	242.510	2,342,889.110	
APTIV PLC	31,921	109.320	3,489,603.720	
PHILLIPS 66	56,789	106.240	6,033,263.360	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,158	58.360	534,460.880	
META PLATFORMS INC	267,319	111.870	29,904,976.530	
IQVIA HOLDINGS INC	21,481	222.580	4,781,240.980	
DIAMONDBACK ENERGY INC	18,801	160.280	3,013,424.280	

SERVICENOW INC	23,643	404.060	9,553,190.580	
PALO ALTO NETWORKS INC	35,234	163.460	5,759,349.640	
WORKDAY INC	24,052	153.130	3,683,082.760	
ABBVIE INC	205,648	149.720	30,789,618.560	
ZOETIS INC	55,265	142.610	7,881,341.650	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	17.300	937,850.300	
CDW CORP	15,145	185.500	2,809,397.500	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	38.300	1,624,417.900	
TWILIO INC	21,090	50.710	1,069,473.900	
COUPA SOFTWARE INC	8,176	52.660	430,548.160	
SNAP INC	127,318	10.730	1,366,122.140	
TRADE DESK INC A	53,230	47.510	2,528,957.300	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,466	58.330	1,310,441.780	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	44.110	390,152.950	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	44.010	874,522.710	
OKTA INC	17,828	49.250	878,029.000	
BLACK KNIGHT INC	17,653	58.720	1,036,584.160	
BAKER HUGHES CO	117,520	30.580	3,593,761.600	
BROADCOM INC	46,844	506.570	23,729,765.080	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9,939	36.900	366,749.100	
MONGODB INC	7,891	161.000	1,270,451.000	
BURLINGTON STORES INC	7,274	146.180	1,063,313.320	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	61,321	12.260	751,795.460	
VEEVA SYSTEMS INC	15,824	187.790	2,971,588.960	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,212	44.140	1,068,717.680	
EVERGY INC	28,226	61.700	1,741,544.200	
ALLEGION PLC	10,140	113.980	1,155,757.200	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	63.260	1,158,543.640	
STERIS PLC	12,524	169.270	2,119,937.480	
DOCUSIGN INC	26,362	45.500	1,199,471.000	
WIX.COM LTD	5,855	83.690	490,004.950	
DROPBOX INC	30,479	22.450	684,253.550	
KKR & CO INC	63,201	56.380	3,563,272.380	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	42.110	212,655.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,921	82.230	2,295,943.830	
MODERNA INC	38,522	168.560	6,493,268.320	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	32,335	136.620	4,417,607.700	
ARAMARK	31,133	38.110	1,186,478.630	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	6.130	367,113.440	
CIGNA CORP	37,115	323.340	12,000,764.100	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	41.720	1,367,164.400	
DOW INC	83,570	49.960	4,175,157.200	
AMCOR PLC	172,505	11.620	2,004,508.100	
PINTEREST INC	62,041	23.170	1,437,489.970	

FOX CORP-A	36,501	29.440	1,074,589.440	
FOX CORP-B	15,511	27.700	429,654.700	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	10.000	425,860.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	23,558	135.760	3,198,234.080	
CHEWY INC	9,648	38.340	369,904.320	
AVANTOR INC	78,214	21.330	1,668,304.620	
LYFT INC	36,887	11.280	416,085.360	
DYNATRACE INC	20,512	36.750	753,816.000	
CLOUDFLARE INC	29,770	47.270	1,407,227.900	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	59.170	816,546.000	
CARRIER GLOBAL CORP	96,568	43.480	4,198,776.640	
OTIS WORLDWIDE CORP	47,395	75.600	3,583,062.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	174,585	28.850	5,036,777.250	
CORTEVA INC	82,153	67.210	5,521,503.130	
MATCH GROUP INC	31,784	48.840	1,552,330.560	
BILL.COM HOLDINGS INC	10,180	120.140	1,223,025.200	
BLACKSTONE INC	81,966	103.520	8,485,120.320	
CARLYLE GROUP INC	24,530	29.380	720,691.400	
DATADOG INC	26,832	76.520	2,053,184.640	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	53.800	1,200,170.400	
INGERSOLL RAND INC	46,398	53.880	2,499,924.240	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,733	329.750	1,890,456.750	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	32.960	1,263,752.320	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	24.810	229,914.270	
UNITY SOFTWARE INC	21,046	27.820	585,499.720	
AON PLC	24,818	296.380	7,355,558.840	
WARNER BROS DISCOVERY INC	275,379	10.800	2,974,093.200	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	736	2,685.850	1,976,785.600	
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	38.580	870,596.280	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	50.920	666,746.480	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	14.990	277,734.720	
IAC INC	9,152	47.180	431,791.360	
AIRBNB INC	44,486	102.400	4,555,366.400	
ZENDESK INC	12,612	76.700	967,340.400	
CONSTELLATION ENERGY CORP	37,045	95.140	3,524,461.300	
APPLOVIN CORP	13,206	16.280	214,993.680	
ROYALTY PHARMA PLC	37,502	43.990	1,649,712.980	
ROBLOX CORP	38,445	33.730	1,296,749.850	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	30.940	917,556.640	
VIATRIS INC	132,223	11.340	1,499,408.820	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23,146	50.620	1,171,650.520	
SNOWFLAKE INC	26,591	145.380	3,865,799.580	
DOORDASH INC	20,697	59.460	1,230,643.620	

ARISTA NETWORKS INC	27,865	126.980	3,538,297.700	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	47,354	64.230	3,041,547.420	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	181,564	7.640	1,387,148.960	
FNF GROUP	31,004	40.830	1,265,893.320	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	1.400	83,843.200	
JACOBS SOLUTIONS INC	14,561	125.710	1,830,463.310	
MARVELL TECHNOLOGY INC	101,624	42.650	4,334,263.600	
APA CORP	37,156	47.000	1,746,332.000	
LUCID GROUP INC	44,910	12.110	543,860.100	
AMERCO-NON VOTING	8,820	52.060	459,169.200	
GRAB HOLDINGS LTD	113,116	2.670	302,019.720	
CATALENT INC	20,564	44.890	923,117.960	
SYNCHRONY FINANCIAL	61,118	38.730	2,367,100.140	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	56,943	41.420	2,358,579.060	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	153.700	804,926.900	
WAYFAIR INC	7,350	36.800	270,480.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22,209	171.710	3,813,507.390	
HUBSPOT INC	5,802	303.350	1,760,036.700	
QORVO INC	11,596	94.680	1,097,909.280	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	85.920	1,317,583.200	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5,852	283.670	1,660,036.840	
GODADDY INC	17,185	71.760	1,233,195.600	
ETSY INC	13,841	110.210	1,525,416.610	
TRANSUNION	22,126	62.230	1,376,900.980	
ALCOA CORP	19,669	43.830	862,092.270	
BLOCK INC	59,110	67.400	3,984,014.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	57,674	69.650	4,016,994.100	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,409	50.900	1,140,618.100	
TELADOC HEALTH INC	20,256	30.980	627,530.880	
WESTROCK CO	27,826	36.950	1,028,170.700	
KRAFT HEINZ CO	87,780	37.870	3,324,228.600	
NOVOCURE LTD	10,423	75.600	787,978.800	
FORTIVE CORP	38,946	67.900	2,644,433.400	
WASTE CONNECTIONS INC	28,997	139.610	4,048,271.170	
ALPHABET INC-CL A	699,502	93.940	65,711,217.880	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	144,397	14.870	2,147,183.390	
PAYPAL HOLDINGS INC	128,931	86.800	11,191,210.800	
SEA LTD ADR	40,917	45.990	1,881,772.830	
EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	31.270	1,404,773.480	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	35.810	584,455.010	

	ALPHABET INC-CL C	656,175	94.170	61,791,999.750	
	ZSCALER INC	10,310	133.120	1,372,467.200	
	CABLE ONE INC	570	652.550	371,953.500	
	LINDE PLC	58,486	328.370	19,205,047.820	
	ROKU INC	12,563	55.510	697,372.130	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,524	373.160	5,046,615.840	
	VISTRA CORP	41,133	24.590	1,011,460.470	
アメリカ・ドル　小計		39,596,741		3,975,193,197.580 (563,960,658,944)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	13.515	621,189.940	
	ASHTEAD GROUP	50,699	51.780	2,625,194.220	
	SEVERN TRENT PLC	29,397	27.170	798,716.490	
	BARCLAYS PLC	1,890,510	1.570	2,968,100.700	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.123	512,060.100	
	BT GROUP PLC	756,852	1.203	910,492.950	
	BUNZL PLC	38,593	30.420	1,173,999.060	
	AVIVA PLC	348,683	4.374	1,525,139.440	
	CRODA INTERNATIONAL	16,782	70.960	1,190,850.720	
	DIAGEO PLC	265,932	37.225	9,899,318.700	
	SCHRODERS PLC	71,635	4.510	323,073.850	
	DCC PLC	11,135	46.230	514,771.050	
	NATIONAL GRID PLC	409,380	10.180	4,167,488.400	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.369	533,953.640	
	BAE SYSTEMS PLC	379,623	7.770	2,949,670.710	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	251,137	33.165	8,328,958.600	
	HALMA PLC	41,997	23.290	978,110.130	
	NEXT PLC	18,751	56.800	1,065,056.800	
	IMPERIAL BRANDS PLC	107,889	20.930	2,258,116.770	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	21.370	426,887.120	
	ANGLO AMERICAN PLC	150,601	31.320	4,716,823.320	
	COMPASS GROUP PLC	200,991	18.780	3,774,610.980	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,344,377	4.741	11,114,691.350	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	738,179	2.468	1,821,825.770	
	UNILEVER PLC	297,740	40.430	12,037,628.200	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,616	10.225	732,273.600	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	15.375	651,146.620	
	PEARSON PLC	66,974	9.612	643,754.080	
	PERSIMMON PLC	35,252	13.780	485,772.560	
	PRUDENTIAL PLC	333,971	9.296	3,104,594.410	
	RIO TINTO PLC	131,005	51.480	6,744,137.400	
	VODAFONE GROUP PLC	3,044,329	1.057	3,217,855.750	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	82,292	56.800	4,674,185.600	

RELX PLC	216,002	23.770	5,134,367.540	
RENTOKIL INITIAL PLC	279,183	5.628	1,571,241.920	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	0.859	963,732.710	
NATWEST GROUP PLC	670,464	2.400	1,609,113.600	
ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	11.535	778,012.680	
SSE PLC	131,574	16.685	2,195,312.190	
BP PLC	2,266,380	4.707	10,667,850.660	
SAGE GROUP PLC(THE)	128,893	7.594	978,813.440	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.215	838,234.420	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	118.800	1,061,596.800	
STANDARD CHARTERED PLC	294,895	5.628	1,659,669.060	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,991,045	0.433	3,460,122.480	
TAYLOR WIMPLEY PLC	359,514	1.040	373,894.560	
TESCO PLC	846,543	2.279	1,929,271.490	
3I GROUP PLC	107,283	13.000	1,394,679.000	
SMITH & NEPHEW PLC	93,066	10.565	983,242.290	
GSK PLC	463,689	14.082	6,529,668.490	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	36,657	80.720	2,958,953.040	
WPP PLC	120,328	8.440	1,015,568.320	
ASTRAZENECA PLC	180,518	111.580	20,142,198.440	
WHITBREAD PLC	25,470	25.640	653,050.800	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	40.170	936,322.530	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	19.755	1,031,783.890	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	47.410	1,031,262.320	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.128	408,782.410	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	20.850	444,626.250	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	38.260	434,633.600	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	13.345	246,281.970	
AVEVA GROUP PLC	11,702	31.450	368,027.900	
ABRDN PLC	379,583	1.881	713,995.620	
EXPERIAN PLC	106,747	29.580	3,157,576.260	
MONDI PLC	58,887	15.935	938,364.340	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.914	329,300.980	
OCADO GROUP PLC	69,766	7.132	497,571.110	
INFORMA PLC	157,970	5.580	881,472.600	
GLENCORE PLC	1,141,040	5.012	5,718,892.480	
ENTAIN PLC	61,865	13.560	838,889.400	
COCA-COLA HBC AG	21,338	20.420	435,721.960	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	5.670	488,884.410	
FERGUSON PLC	24,704	104.750	2,587,744.000	
M&G PLC	270,401	1.853	501,053.050	
JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.163	293,285.340	
HALEON PLC	567,403	2.796	1,586,458.780	
SHELL PLC	867,852	23.150	20,090,773.800	

	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.710	632,856.430	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.259	613,393.610	
イギリス・ポンド　小計		33,158,877		209,596,998.000 (34,692,495,109)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	34.700	5,090,594.100	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	34.700	6,257,902.100	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	6.340	1,824,480.820	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,553	689.900	1,761,314.700	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	142.300	1,789,280.200	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	21.160	3,447,895.040	
	ICL GROUP LTD	72,257	30.070	2,172,767.990	
	NICE LTD	7,640	708.000	5,409,120.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	135.800	2,368,352.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	262.700	1,227,334.400	
イスラエル・シュケル　小計		894,899		31,349,041.350 (1,278,116,090)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	59.060	1,284,791.240	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	340,969	24.280	8,278,727.320	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	410,671	23.610	9,695,942.310	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	194,047	16.780	3,256,108.660	
	ASX LTD	23,664	68.980	1,632,342.720	
	BHP GROUP LTD	572,913	40.560	23,237,351.280	
	AMPOL LTD	31,828	27.710	881,953.880	
	COMPUTERSHARE LT	72,081	27.070	1,951,232.670	
	CSL LIMITED	56,391	282.730	15,943,427.430	
	REA GROUP LTD	6,134	110.990	680,812.660	
	TRANSURBAN GROUP	358,707	13.570	4,867,653.990	
	COCHLEAR LTD	7,836	202.520	1,586,946.720	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	7.830	1,669,583.070	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	198,269	104.040	20,627,906.760	
	RIO TINTO LIMITED	42,295	98.300	4,157,598.500	
	APA GROUP	164,300	10.840	1,781,012.000	
	ARISTOCRAT LEISU	76,675	36.840	2,824,707.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.940	1,391,420.160	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	28.200	1,713,629.400	
	ORICA LTD	43,659	14.990	654,448.410	
	LEND LEASE CORP LTD	65,475	7.960	521,181.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	15.840	797,148.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	41,229	169.790	7,000,271.910	
	SUNCORP GROUP LTD	154,162	12.010	1,851,485.620	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	374,560	31.000	11,611,360.000	
	NEWCREST MINING LTD	98,073	19.160	1,879,078.680	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.980	673,700.820	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	12.720	2,194,034.640	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	9.900	1,342,222.200	
	REECE LTD	31,558	14.610	461,062.380	
	SANTOS LTD	359,516	7.520	2,703,560.320	
	SONIC HEALTHCARE	52,774	32.500	1,715,155.000	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	28.360	736,934.600	
	WESFARMERS LTD	130,037	46.220	6,010,310.140	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	210,573	37.980	7,997,562.540	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	136,728	33.750	4,614,570.000	
	SEEK LTD	38,405	20.420	784,230.100	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,284	56.890	357,496.760	
	MINERAL RESOURCES LTD	21,179	81.830	1,733,077.570	
	BRAMBLES LTD	170,929	11.370	1,943,462.730	
	EVOLUTION MINING LTD	224,674	2.430	545,957.820	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.710	826,769.790	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	12.740	1,009,428.420	
	XERO LTD	14,590	64.740	944,556.600	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	28.570	679,423.170	
	TELSTRA GROUP LTD	482,855	3.960	1,912,105.800	
	LOTTERY CORP LTD	227,460	4.440	1,009,922.400	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	6.990	1,121,685.300	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	2.790	833,027.040	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	3.870	2,309,205.780	
	COLES GROUP LTD	151,233	16.590	2,508,955.470	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	52.420	777,021.660	
オーストラリア・ドル　小計		8,063,607		179,523,560.440 (16,799,814,786)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	52,200	63.500	3,314,700.000	
	BARRICK GOLD CORP	200,288	21.900	4,386,307.200	
	BANK OF MONTREAL	78,537	131.420	10,321,332.540	
	BANK OF NOVA SCOTIA	139,486	69.040	9,630,113.440	
	NATIONAL BANK OF CANADA	38,087	96.430	3,672,729.410	
	BCE INC	7,697	62.460	480,754.620	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	165,389	59.560	9,850,568.840	
	BAUSCH HEALTH COS INC	30,250	9.820	297,055.000	
	SAPUTO INC	26,668	33.530	894,178.040	
	BLACKBERRY LTD	49,855	6.550	326,550.250	

ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	15.290	1,411,435.190	
CGI INC	25,261	113.840	2,875,712.240	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	60.140	984,070.820	
CAE INC	32,283	28.430	917,805.690	
CAMECO CORP	45,781	32.050	1,467,281.050	
ROGERS COMM-CL B	40,412	57.480	2,322,881.760	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	103,470	63.940	6,615,871.800	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	136,276	81.210	11,066,973.960	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	146.160	895,083.840	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	35.760	583,960.800	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	68,613	164.360	11,277,232.680	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	37.260	809,026.380	
OPEN TEXT CORP	33,217	38.850	1,290,480.450	
EMPIRE CO LTD	29,433	34.650	1,019,853.450	
KINROSS GOLD CORP	219,914	5.660	1,244,713.240	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	70.970	942,907.420	
FORTIS INC	54,416	53.820	2,928,669.120	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	64,491	32.110	2,070,806.010	
TELUS CORP	31,890	28.930	922,577.700	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	30.780	1,052,922.240	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	75.920	2,068,516.320	
ENBRIDGE INC	233,153	54.520	12,711,501.560	
IGM FINANCIAL INC	12,478	38.880	485,144.640	
MANULIFE FINANCIAL CORP	219,912	23.050	5,068,971.600	
LOBLAW CO LTD	18,620	111.900	2,083,578.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	95,432	62.820	5,995,038.240	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,328	78.730	2,545,183.440	
SUN LIFE FINANCIAL INC	69,566	61.050	4,247,004.300	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,799	726.360	2,033,081.640	
METRO INC	28,629	73.230	2,096,501.670	
EMERA INC	30,947	51.090	1,581,082.230	
ONEX CORP	10,157	71.680	728,053.760	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	19.420	375,252.660	
POWER CORP OF CANADA	65,500	32.680	2,140,540.000	
QUEBECOR INC-B	17,195	27.020	464,608.900	
ROYAL BANK OF CANADA	163,125	130.890	21,351,431.250	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	109,135	104.010	11,351,131.350	
SHAW COMM INC-B	52,487	35.980	1,888,482.260	
SUNCOR ENERGY INC	165,413	47.700	7,890,200.100	
LUNDIN MINING CORP	68,762	8.080	555,596.960	
TECK RESOURCES LTD-CL B	57,326	45.750	2,622,664.500	

	THOMSON REUTERS CORP	19,979	147.000	2,936,913.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	102.580	991,435.700	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	210,946	89.290	18,835,368.340	
	TC ENERGY CORP	115,612	63.140	7,299,741.680	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,862	110.550	648,044.100	
	WESTON (GEORGE) LTD	8,379	154.900	1,297,907.100	
	INTACT FINANCIAL CORP	20,070	199.500	4,003,965.000	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	53,414	50.580	2,701,680.120	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,335	1,994.740	4,657,717.900	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	21,662	186.070	4,030,648.340	
	TOURMALINE OIL CORP	39,298	77.630	3,050,703.740	
	KEYERA CORP	24,571	28.200	692,902.200	
	PARKLAND CORP	15,665	25.100	393,191.500	
	ALTAGAS LTD	33,833	23.140	782,895.620	
	PEMBINA PIPELINE CORP	68,179	45.860	3,126,688.940	
	DOLLARAMA INC	32,535	81.320	2,645,746.200	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	158,757	27.810	4,415,032.170	
	ARC RESOURCES LTD	74,961	18.680	1,400,271.480	
	NORTHLAND POWER INC	25,030	41.020	1,026,730.600	
	TMX GROUP LTD	7,040	135.430	953,427.200	
	BRP INC	4,307	93.360	402,101.520	
	IVANHOE MINES LTD	64,027	10.910	698,534.570	
	NUTRIEN LTD	66,177	105.500	6,981,673.500	
	TFI INTERNATIONAL INC	9,399	134.350	1,262,755.650	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	12,150	21.650	263,047.500	
	WSP GLOBAL INC	15,681	163.720	2,567,293.320	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,011	70.600	847,976.600	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	27,577	36.000	992,772.000	
	NUVEI CORP	7,929	41.970	332,780.130	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	43.770	704,828.310	
	AIR CANADA	18,814	18.120	340,909.680	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,443	82.430	2,674,276.490	
	SHOPIFY INC	133,298	48.650	6,484,947.700	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	170.430	892,541.910	
	HYDRO ONE LTD	37,626	34.350	1,292,453.100	
カナダ・ドル　小計		4,784,354		278,788,023.470 (29,643,530,536)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	3.380	487,396.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	203,210	34.540	7,018,873.400	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.670	302,198.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	8.830	881,234.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.815	620,372.290	

	KEPPEL CORP LTD	225,700	7.100	1,602,470.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	368,898	12.240	4,515,311.520	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.630	2,480,957.900	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.330	867,191.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,766	29.210	3,790,464.860	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.390	278,604.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	17.260	755,988.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,400	3.940	765,936.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.350	1,027,076.500	
シンガポール・ドル　小計		3,666,587		25,394,073.470 (2,604,162,234)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	331,797	4.089	1,356,717.930	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	56.520	1,072,919.160	
	NESTLE SA-REGISTERED	326,919	110.080	35,987,243.520	
	CIE FINANC RICHEMONT	59,444	107.100	6,366,452.400	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	82,297	330.500	27,199,158.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,208	179.800	756,598.400	
	SIKA INHABER	17,793	254.300	4,524,759.900	
	SGS SA-REG	748	2,312.000	1,729,376.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	250,451	82.300	20,612,117.300	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	139.500	791,662.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,947.000	895,620.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	16.650	350,848.800	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	501.600	1,720,989.600	
	ABB LTD	194,538	29.450	5,729,144.100	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	34.250	679,588.500	
	GEBERIT AG	4,377	477.500	2,090,017.500	
	LONZA GROUP AG-REG	9,027	516.400	4,661,542.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	10,080.000	1,179,360.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	99,900.000	1,298,700.000	
	GIVAUDAN-REG	1,043	3,215.000	3,353,245.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,530	431.800	7,569,454.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	2,595	399.400	1,036,443.000	
	HOLCIM LTD	66,607	48.340	3,219,782.380	
	TEMENOS GROUP	7,082	63.180	447,440.760	
	BACHEM HOLDING AG	2,630	83.100	218,553.000	
	SONOVA HOLDING AG	6,135	247.100	1,515,958.500	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,959	234.800	1,399,173.200	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,969	111.450	1,445,395.050	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	248.100	776,553.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,026	46.280	232,603.280	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	171.400	466,208.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,610	497.000	1,794,170.000	

	EMS-CHEMIE HOLDING	810	684.500	554,445.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	83.500	699,062.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,623	979.600	2,569,490.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	52.080	1,355,694.480	
	SWISS RE LTD	36,229	78.380	2,839,629.020	
	SIG GROUP AG	38,322	21.920	840,018.240	
	ALCON INC	57,507	59.160	3,402,114.120	
	UBS GROUP AG	403,136	16.890	6,808,967.040	
	VAT GROUP AG	3,325	279.600	929,670.000	
スイス・フラン　小計		2,064,583		162,476,886.780 (23,856,481,286)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	313,452	134.020	42,008,837.040	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	168,168	119.380	20,075,895.840	
	ERICSSON LM-B SHS	330,309	61.830	20,423,005.470	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	245.700	6,328,003.500	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	201.600	11,780,899.200	
	LUNDBERGS B	7,859	470.000	3,693,730.000	
	SKF AB-B SHS	46,594	178.150	8,300,721.100	
	SANDVIK AB	133,350	191.100	25,483,185.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	179,371	118.700	21,291,337.700	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	182.450	8,016,305.650	
	SWEDBANK AB	112,296	164.200	18,439,003.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,211	139.300	9,780,392.300	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	103.900	16,835,540.400	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	203.800	4,931,552.400	
	VOLVO AB-B SHS	168,857	193.500	32,673,829.500	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	407.500	4,132,865.000	
	SWEDISH MATCH AB	186,902	116.200	21,718,012.400	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	92.380	5,950,750.080	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	266.300	4,072,259.600	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	264.900	5,648,992.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	146.960	3,954,252.720	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	91.820	6,986,124.700	
	INVESTOR AB-B SHS	204,473	193.540	39,573,704.420	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	120.520	9,917,229.240	
	ASSA ABLOY AB-B	124,612	241.500	30,093,798.000	
	TELIA CO AB	344,810	29.520	10,178,791.200	
	BOLIDEN AB	29,779	363.750	10,832,111.250	
	ALFA LAVAL AB	35,313	300.000	10,593,900.000	
	KINNEVIK AB-B	22,633	163.550	3,701,627.150	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	49.000	3,574,158.000	
	INDUTRADE AB	29,769	216.900	6,456,896.100	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	76.160	3,638,087.040	
	NIBE INDUSTRIER AB	162,506	97.300	15,811,833.800	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	208.500	3,832,230.000	
	HEXAGON AB-B SHS	223,124	123.900	27,645,063.600	
	SAGAX AB	19,038	234.800	4,470,122.400	
	EPIROC AB-A	84,563	191.000	16,151,533.000	
	EPIROC AB-B	41,205	165.450	6,817,367.250	
	ESSITY AB-B	66,425	242.700	16,121,347.500	
	EQT AB	31,718	249.300	7,907,297.400	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	58.350	4,655,804.850	
	VOLVO CAR AB	63,710	53.660	3,418,678.600	
	LIFCO AB	26,835	181.600	4,873,236.000	
	EVOLUTION AB	22,326	1,041.800	23,259,226.800	
	NORDEA BANK ABP	403,793	106.240	42,898,968.320	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	217.100	3,373,516.900	
スウェーデン・クローナ　小計		4,499,239		612,322,024.120 (8,174,499,022)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,908	915.400	9,985,183.200	
	A P MOLLER A/S	557	15,400.000	8,577,800.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	14,980.000	5,377,820.000	
	DANSKE BANK A/S	72,887	120.650	8,793,816.550	
	GENMAB A/S	7,409	3,124.000	23,145,716.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	418.900	9,994,535.100	
	ROCKWOOL AS	873	1,663.000	1,451,799.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	193,450	836.700	161,859,615.000	
	GN STORE NORD A/S	15,343	179.300	2,750,999.900	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	114,856	187.260	21,507,934.560	
	COLOPLAST-B	15,343	899.200	13,796,425.600	
	DSV A/S	22,074	1,106.000	24,413,844.000	
	DEMANT A/S	11,367	201.400	2,289,313.800	
	TRYG A/S	44,887	168.750	7,574,681.250	
	PANDORA A/S	9,912	499.400	4,950,052.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	450.700	5,650,876.600	
	ORSTED A/S	20,956	687.800	14,413,536.800	
デンマーク・クローネ　小計		577,578		326,533,950.160 (6,338,023,973)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.600	1,248,991.600	
	FISHER & PAYKEL	60,887	19.310	1,175,727.970	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.140	1,125,855.320	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.375	337,732.750	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	4.535	599,331.990	
ニュージーランド・ドル　小計		639,257		4,487,639.630 (382,077,638)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	156.150	7,105,449.600	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	69.740	11,365,597.540	
	TELENOR ASA	85,954	97.480	8,378,795.920	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	383.600	4,290,566.000	
	ORKLA ASA	116,068	67.740	7,862,446.320	
	EQUINOR ASA	110,053	362.950	39,943,736.350	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	464.200	9,206,942.800	
	AKER BP ASA	33,719	349.300	11,778,046.700	
	SALMAR ASA	7,248	332.000	2,406,336.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	194.400	5,000,162.400	
	ADEVINTA ASA	24,382	78.350	1,910,329.700	
	DNB BANK ASA	105,251	184.250	19,392,496.750	
ノルウェー・クローネ　小計		747,890		128,640,906.080 (1,802,259,094)	
ユーロ	CRH PLC	85,408	37.845	3,232,265.760	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19,953	133.950	2,672,704.350	
	KERRY GROUP PLC-A	18,268	93.540	1,708,788.720	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	59.680	1,041,475.680	
	UMICORE	24,290	35.320	857,922.800	
	AIR LIQUIDE	61,364	137.440	8,433,868.160	
	AIRBUS SE	67,715	113.140	7,661,275.100	
	AXA SA	216,175	26.620	5,754,578.500	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	83,720	24.170	2,023,512.400	
	ADIDAS AG	20,476	128.000	2,620,928.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	133,912	16.660	2,230,973.920	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	144.800	451,776.000	
	DANONE	74,107	49.530	3,670,519.710	
	SAFRAN SA	38,630	112.200	4,334,286.000	
	INTESA SANPAOLO	2,050,973	2.177	4,464,968.220	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	39,262	82.850	3,252,856.700	
	ACCOR SA	18,305	24.740	452,865.700	
	BOUYGUES	29,123	30.290	882,135.670	
	BNP PARIBAS	128,203	50.850	6,519,122.550	
	THALES SA	12,886	122.850	1,583,045.100	
	CAPGEMINI SA	19,839	175.100	3,473,808.900	
	UNICREDIT SPA	241,149	13.034	3,143,136.060	
	D'IETEREN TRDG	2,736	171.900	470,318.400	
	KONINKLIJKE DSM NV	20,425	128.350	2,621,548.750	
	COMMERZBANK AG	112,781	7.708	869,315.940	
	EIFFAGE	8,993	92.660	833,291.380	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	24.040	1,176,709.920	
	UNITED INTERNET	10,010	19.515	195,345.150	
	PUBLICIS GROUPE	26,472	62.280	1,648,676.160	
	IBERDROLA SA	701,074	10.515	7,371,793.110	
	ENI SPA	278,442	14.070	3,917,678.940	
	JERONIMO MARTINS	34,644	20.840	721,980.960	
	KESKO OYJ-B	35,252	21.490	757,565.480	
	KBC GROUPE	28,279	50.000	1,413,950.000	
	HANNOVER RUECK SE	7,105	172.600	1,226,323.000	

WARTSILA OYJ	50,956	7.714	393,074.580	
L'OREAL	28,260	338.550	9,567,423.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	32,383	686.800	22,240,644.400	
GEA GROUP AG	17,490	39.820	696,451.800	
BOLLORE	114,808	5.155	591,835.240	
MEDIOBANCA SPA	60,688	9.814	595,592.030	
MICHELIN(CGDE)-B	77,776	26.520	2,062,619.520	
CONTINENTAL AG	12,921	59.760	772,158.960	
DEUTSCHE POST AG-REG	118,731	38.230	4,539,086.130	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	18.000	401,238.000	
OMV AG	17,258	48.160	831,145.280	
VERBUND AG	7,320	85.350	624,762.000	
PERNOD-RICARD	24,888	186.600	4,644,100.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	16,854	58.660	988,655.640	
RENAULT SA	27,902	31.135	868,728.770	
REPSOL SA	161,783	13.650	2,208,337.950	
REMY COINTREAU	2,866	164.600	471,743.600	
MERCK KGAA	15,234	177.950	2,710,890.300	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	56,977	44.355	2,527,214.830	
RWE AG	77,853	40.600	3,160,831.800	
SEB SA	2,596	73.550	190,935.800	
SOCIETE GENERALE-A	90,814	23.575	2,140,940.050	
VINCI S.A.	61,180	95.890	5,866,550.200	
SODEXO	9,822	89.240	876,515.280	
SOFINA	1,449	225.000	326,025.000	
SOLVAY SA	9,070	98.460	893,032.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	63,972	140.580	8,993,183.760	
VIVENDI SE	76,073	8.554	650,728.440	
SAP SE	119,009	105.020	12,498,325.180	
TELEFONICA S.A	614,947	3.624	2,228,567.920	
TOTALENERGIES SE	288,377	56.520	16,299,068.040	
VALEO	26,570	18.605	494,334.850	
E.ON SE	256,515	8.840	2,267,592.600	
VOEST-ALPINE AG	10,593	25.100	265,884.300	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	61.600	823,961.600	
SIEMENS AG-REG	89,533	120.700	10,806,633.100	
UPM-KYMMENE OYJ	62,233	34.940	2,174,421.020	
ING GROEP NV-CVA	454,638	11.024	5,011,929.310	
PUMA AG	10,980	47.910	526,051.800	
BAYER AG	113,431	51.410	5,831,487.710	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	14.210	831,782.350	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	66.080	1,298,075.520	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	95,638	63.340	6,057,710.920	
BASF SE	104,334	48.905	5,102,454.270	

BEIERSDORF AG	10,944	100.550	1,100,419.200	
HEIDELBERGCEMENT AG	20,809	50.720	1,055,432.480	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	28.970	691,079.350	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	255.750	1,326,831.000	
ORANGE	228,746	9.755	2,231,417.230	
SAMPO OYJ-A SHS	58,396	47.390	2,767,386.440	
RANDSTAD NV	11,897	54.120	643,865.640	
ALLIANZ SE	47,164	200.050	9,435,158.200	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.527	1,439,386.810	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	125,884	28.435	3,579,511.540	
HERMES INTL	3,764	1,434.000	5,397,576.000	
ENDESA S.A.	37,701	17.995	678,429.490	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.233	523,249.680	
ERSTE GROUP BANK AG	38,446	28.090	1,079,948.140	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,818	288.500	4,563,493.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	57,374	24.660	1,414,842.840	
DASSAULT SYSTEMES SA	75,193	36.430	2,739,280.990	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	26.270	619,210.170	
RHEINMETALL STAMM	4,693	167.100	784,200.300	
HEINEKEN NV	29,630	86.060	2,549,957.800	
AKZO NOBEL	19,812	68.360	1,354,348.320	
ASML HOLDING NV	47,485	544.200	25,841,337.000	
AEGON NV	196,332	4.680	918,833.760	
VOLKSWAGEN AG	3,315	184.300	610,954.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	20,739	139.000	2,882,721.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	770,046	5.306	4,085,864.070	
KERING	8,881	532.000	4,724,692.000	
ACCIONA S.A.	2,642	190.000	501,980.000	
FORTUM OYJ	54,194	14.380	779,309.720	
AGEAS	18,136	36.700	665,591.200	
UCB SA	16,732	78.260	1,309,446.320	
NEMETSCHEK SE	9,878	47.500	469,205.000	
CARREFOUR SA	64,831	16.365	1,060,959.310	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.200	463,137.400	
NOKIA OYJ	592,026	4.563	2,701,414.630	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	101,426	13.750	1,394,607.500	
WOLTERS KLUWER-CVA	29,952	103.550	3,101,529.600	
SANOFI	133,151	86.970	11,580,142.470	
STMICROELECTRONICS NV	80,161	35.770	2,867,358.970	
ELISA OYJ	20,242	50.020	1,012,504.840	
BANCO SANTANDER SA	2,066,857	2.553	5,276,685.920	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	17.195	842,744.140	
QIAGEN N.V.	27,412	45.590	1,249,713.080	

DEUTSCHE BANK AG-REG	253,716	9.964	2,528,026.220	
BMW VORZUG	7,821	78.850	616,685.850	
ENEL SPA	958,960	5.010	4,804,389.600	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	383,429	19.408	7,441,590.030	
SARTORIUS AG	2,847	400.400	1,139,938.800	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	26.770	295,326.640	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	159,023	29.685	4,720,597.750	
RATIONAL AG	516	584.500	301,602.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	129.250	628,930.500	
BECHTLE AG	8,139	37.740	307,165.860	
KONINKLIJKE KPN NV	475,739	2.851	1,356,331.880	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	70.380	1,040,146.020	
TELEPERFORMANCE	6,746	175.950	1,186,958.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	21,263	163.300	3,472,247.900	
EURAZEO	5,673	60.250	341,798.250	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	78.500	888,463.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	70.150	761,337.950	
INDITEX	126,694	24.460	3,098,935.240	
ESSILORLUXOTTICA	32,904	172.250	5,667,714.000	
SNAM SPA	210,122	4.825	1,013,838.650	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	9.458	1,359,303.760	
ENAGAS	24,864	17.075	424,552.800	
WENDEL	2,354	86.500	203,621.000	
TENARIS SA	55,855	15.665	874,968.570	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.245	222,530.070	
ATLANTIA SPA	55,336	22.730	1,257,787.280	
PROXIMUS	14,640	11.130	162,943.200	
TERNA SPA	166,064	7.316	1,214,924.220	
BIOMERIEUX	4,870	100.450	489,191.500	
GRIFOLS SA	31,982	9.812	313,807.380	
FERROVIAL SA	55,374	24.400	1,351,125.600	
NESTE OYJ	45,715	46.100	2,107,461.500	
RECORDATI SPA	10,908	41.530	453,009.240	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.642	557,066.550	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	179.900	1,080,839.200	
KONE OYJ	39,178	47.730	1,869,965.940	
ELIA GROUP	4,078	136.800	557,870.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	347.100	1,079,133.900	
ENGIE	206,708	13.900	2,873,241.200	
ALSTOM	37,007	24.000	888,168.000	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	11.910	774,292.920	
IPSEN SA	3,873	107.200	415,185.600	
ARKEMA SA	6,392	88.200	563,774.400	
LEGRAND SA	30,081	78.900	2,373,390.900	
AMPLIFON SPA	12,300	28.150	346,245.000	
ADP	3,975	142.050	564,648.750	
ORION OYJ	13,559	49.100	665,746.900	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.980	652,277.880	
SYMRISE AG	15,064	109.600	1,651,014.400	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	35.910	1,164,274.020	
PRYSMIAN SPA	30,728	34.150	1,049,361.200	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	136.750	332,165.750	
CAIXABANK	498,058	3.187	1,587,310.840	
BUREAU VERITAS SA	31,295	26.710	835,889.450	
GETLINK	63,509	16.405	1,041,865.140	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	22.780	673,399.580	
AMADEUS IT GROUP SA	51,056	52.260	2,668,186.560	
BRENNTAG SE	17,934	67.200	1,205,164.800	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	18.680	461,153.160	
EDENRED	31,091	53.820	1,673,317.620	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.364	249,340.530	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	64.500	529,480.500	
KION GROUP AG	7,874	27.060	213,070.440	
VONOVIA SE	85,937	24.570	2,111,472.090	
KNORR-BREMSE AG	7,195	53.700	386,371.500	
OCI NV	12,329	36.800	453,707.200	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	30,120	51.700	1,557,204.000	
FERRARI NV	15,435	209.200	3,229,002.000	
CNH INDUSTRIAL NV	112,387	14.355	1,613,315.380	
AROUNDTOWN SA	113,225	2.354	266,531.650	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	35.550	614,766.150	
MONCLER SPA	25,014	49.570	1,239,943.980	
NEXI SPA	58,847	9.768	574,817.490	
PROSUS NV	98,305	51.690	5,081,385.450	
DR ING HC F PORSCHE AG	12,500	101.400	1,267,500.000	
FERROVIAL SA-RTS	55,374	0.436	24,143.060	
JDE PEET'S BV	7,893	29.300	231,264.900	
EXOR NV	14,142	70.720	1,000,122.240	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	14.000	651,112.000	
EURONEXT NV	10,081	68.420	689,742.020	
IMCD NV	6,823	141.500	965,454.500	
WORLDLINE SA	29,916	46.820	1,400,667.120	
NN GROUP NV	31,214	43.730	1,364,988.220	
FINECOBANK SPA	75,180	14.365	1,079,960.700	
ARGENX SE	6,753	368.200	2,486,454.600	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	82,533	20.805	1,717,099.060	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	56,693	28.705	1,627,372.560	
ZALANDO SE	24,405	29.450	718,727.250	
STELLANTIS NV	245,839	14.158	3,480,588.560	
AENA SME SA	8,494	122.950	1,044,337.300	
CELLNEX TELECOM SAU	64,293	36.160	2,324,834.880	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	22.590	512,115.300	
ABN AMRO BANK NV	52,835	10.965	579,335.770	

	SCOUT24 SE	10,048	55.900	561,683.200	
	COVESTRO AG	27,558	35.630	981,891.540	
	HELLOFRESH SE	17,856	24.780	442,471.680	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	97,316	52.900	5,148,016.400	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.754	574,403.300	
	AMUNDI SA	6,292	53.500	336,622.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.930	415,858.470	
	ADYEN NV	2,458	1,512.200	3,716,987.600	
	DELIVERY HERO SE	17,246	41.310	712,432.260	
ユーロ　小計		21,312,402		503,188,589.960 (72,665,464,276)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	11.140	2,862,980.000	
	CLP HOLDINGS LTD	197,296	54.250	10,703,308.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	57,314	37.350	2,140,677.900	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	138,691	255.800	35,477,157.800	
	MTR CORP	192,441	35.650	6,860,521.650	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	114.100	10,850,453.600	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	21.550	3,684,446.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	37.600	5,689,632.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,245,406	6.160	7,671,700.960	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	42.250	11,023,194.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	25.300	10,625,873.500	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	16.740	2,897,124.840	
	SINO LAND CO	411,200	8.940	3,676,128.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	161,065	85.850	13,827,430.250	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	55.950	2,966,469.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	159,156	79.500	12,652,902.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	12.400	2,207,200.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	233,000	15.220	3,546,260.000	
	AIA GROUP LTD	1,416,316	67.150	95,105,619.400	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	8.880	4,112,647.680	
	SANDS CHINA LTD	260,600	16.800	4,378,080.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	13.840	1,937,600.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	114,400	16.300	1,864,720.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	33.500	6,570,522.500	
	ESR GROUP LTD	216,400	14.560	3,150,784.000	

	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	5.440	1,340,960.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	19.100	5,061,500.000	
	WH GROUP LTD	931,500	4.270	3,977,505.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	40.850	12,681,678.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	45.500	12,111,872.500	
香港・ドル　小計		9,381,569		301,656,949.430 (5,456,974,215)	
合計		129,387,583		767,654,557,203 (767,654,557,203)	

（２）株式以外の有価証券

2022年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,259,435.520	
		GOODMAN GROUP	214,602.000	3,697,592.460	
		GPT GROUP	219,223.000	942,658.900	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	913,212.220	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,876,871.300	
		STOCKLAND	259,328.000	925,800.960	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	755,732.620	
	オーストラリア・ドル　小計		2,323,705.000	10,371,303.980 (970,546,626)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	568,831.000	1,080,778.900	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,145,762.800	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	715,891.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	206,400.000	324,048.000	
	シンガポール・ドル　小計		1,690,009.000	3,266,480.700 (334,977,596)	
投資信託受益証券　合計			4,013,714	1,305,524,222 (1,305,524,222)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,835.000	2,892,679.300	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	34,348.000	1,116,310.000	
		AMERICAN TOWER CORP	53,284.000	11,770,435.600	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	45,448.000	957,589.360	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,932.000	2,909,256.240	
		BOSTON PROPERTIES INC	18,531.000	1,398,719.880	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,279.000	1,310,619.800	
		CROWN CASTLE INC	50,735.000	7,034,915.100	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	32,050.000	3,480,309.500	

	EQUINIX INC	10,743.000	6,961,464.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,348,798.240	
	EQUITY RESIDENTIAL	41,364.000	2,646,055.080	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,316.000	1,598,984.960	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,919.000	2,433,139.710	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30,095.000	1,545,679.200	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42,371.000	877,503.410	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62,566.000	1,586,048.100	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,427,102.950	
	INVITATION HOMES INC	69,205.000	2,234,629.450	
	IRON MOUNTAIN INC	34,514.000	1,814,400.980	
	KIMCO REALTY	71,517.000	1,595,544.270	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	873,710.160	
	MID AMERICA	13,578.000	2,224,483.740	
	PROLOGIS INC	107,773.000	12,753,856.820	
	PUBLIC STORAGE	18,529.000	5,610,766.490	
	REALTY INCOME CORP	69,294.000	4,529,748.780	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,279,546.860	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,240.000	3,633,688.800	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,061.000	4,448,802.440	
	SUN COMMUNITIES INC	14,694.000	2,097,862.380	
	UDR INC	41,516.000	1,689,286.040	
	VENTAS INC	48,092.000	2,157,407.120	
	VICI PROPERTIES INC	105,199.000	3,431,591.380	
	VORNADO REALTY TRUST	16,223.000	407,035.070	
	WELLTOWER INC	54,422.000	3,812,805.320	
	WEYERHAEUSER CO	83,741.000	2,751,729.260	
	WP CAREY INC	21,266.000	1,697,664.780	
アメリカ・ドル　小計		1,500,519.000	112,340,170.570 (15,937,699,999)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	482,637.770	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	487,838.170	
	SEGRO PLC	139,569.000	1,197,222.880	
イギリス・ポンド　小計		335,772.000	2,167,698.820 (358,797,509)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	379,058.120	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	303,625.200	
カナダ・ドル　小計		23,146.000	682,683.320 (72,589,717)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	303,453.400	
	GECINA SA	5,045.000	489,869.500	
	KLEPIERRE	25,279.000	564,732.860	

		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	708,963.300	
		WAREHOUSES DE PAUW	16,790.000	470,455.800	
	ユーロ　小計		65,715.000	2,537,474.860 (366,436,745)	
	香港・ドル	LINK REIT	233,616.000	11,902,735.200	
	香港・ドル　小計		233,616.000	11,902,735.200 (215,320,480)	
投資証券　合計			2,158,768	16,950,844,450 (16,950,844,450)	
合計				18,256,368,672 (18,256,368,672)	

（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	599銘柄	69.75	－	－	73.79
	投資証券	37銘柄	－	－	1.97	
イギリス・ポンド	株式	79銘柄	4.29	－	－	4.46
	投資証券	3銘柄	－	－	0.04	
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	2.08	－	－	2.26
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.12	－	
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.67	－	－	3.78
	投資証券	2銘柄	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.32	－	－	0.37
	投資信託受益証券	4銘柄	－	0.04	－	
スイス・フラン	株式	41銘柄	2.95	－	－	3.04
スウェーデン・クローナ	株式	46銘柄	1.01	－	－	1.04
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.78	－	－	0.81
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	0.22	－	－	0.23
ユーロ	株式	224銘柄	8.99	－	－	9.29
	投資証券	5銘柄	－	－	0.05	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.67	－	－	0.72
	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11月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,003,843,305
国債証券	677,101,432,750
地方債証券	34,259,207,370
特殊債券	31,629,909,197
社債券	27,814,299,380
未収利息	923,646,786
前払費用	191,842,113
流動資産合計	773,924,180,901
資産合計	773,924,180,901
負債の部	
流動負債	
未払解約金	717,805,000
流動負債合計	717,805,000
負債合計	717,805,000
純資産の部	
元本等	
元本	613,180,832,594
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	160,025,543,307
元本等合計	773,206,375,901
純資産合計	773,206,375,901
負債純資産合計	773,924,180,901

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年11月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	515,463,932,533円
同期中追加設定元本額	467,736,837,950円
同期中一部解約元本額	370,019,937,889円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	25,485,096,993円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	61,432,879円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	132,398,059円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	86,818,398円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	703,377,405円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	142,396,712円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	46,191,975円
たわらノーロード　国内債券	17,499,996,860円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,448,956,760円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,126,375,084円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,968,885,662円
たわらノーロード　バランス（積極型）	250,831,559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）	99,221,387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）	1,500,814,586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）	1,601,879,955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）	464,180,469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）	82,318,349円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	23,181,865円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	18,249,486円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	151,666,549円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,141,460円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	967,743円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	13,898,026,452円
Ｏｎｅグローバルバランス	13,250,056円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	9,581,344,338円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	13,419,659,263円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	5,666,339,687円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,336,811,555円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,429,128,250円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	408,928,359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＞	3,518,184,671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）	4,559,819,892円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,915,127,849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	187,814,134,546円
クルーズコントロール	1,193,222,354円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	12,998,975,909円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	5,331,866,139円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,169,324,185円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	15,519,181,071円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	70,630,389,939円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	353,778,402円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	177,099,998円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	105,921,351円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,637,774,005円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,241,997,806円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,820,445,183円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,299,704,427円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	495,547,354円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	181,446,295円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	117,980,951円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,002,685,926円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	22,449,182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）	1,936,412,451円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	1,983,750,885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）	1,534,939,024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）	1,212,396,456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）	1,915,225,338円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	4,956,308,630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）	1,912,948,779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）	1,727,724,857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）	1,968,944,827円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	9,127,429,359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）	3,011,414,270円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	4,861,516,897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）	584,037,946円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	265,452,445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）	6,140,208,541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）	6,151,545,840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）	6,108,102,717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）	3,284,048,841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）	102,570,764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）	1,076,896,904円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	185,998,680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）	158,193,329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）	102,185,167円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,174,353円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	96,778,708円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,497,715円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	326,885円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,081,860円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	108,229,468円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,238,226,803円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,194,293,080円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,283,760,394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）	64,279,569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）	154,922,143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）	1,913,233,941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）	159,562,268円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	523,838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）	2,028,313,339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）	44,723,242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）	297,704,048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）	457,531,011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）	858,489,695円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	280,765,252円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	96,664,950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＞	368,008,299円
コア資産形成ファンド	245,201,651円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	47,583,413,592円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	48,429,352,276円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	10,989,555,843円
ＭＨＡＭ動的パッケージ４資産ファンド［適格機関投資家限定］	1,705,511,104円
計	613,180,832,594円
２．　受益権の総数	613,180,832,594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　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 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11月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△9,747,748,400
地方債証券	△469,492,914
特殊債券	△742,850,542
社債券	△461,889,660
合計	△11,421,981,516

（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11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月11日現在
1口当たり純資産額	1.2610円

（1万口当たり純資産額）	(12,610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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４３２回　利付国庫債券（２年）	2,800,000,000	2,803,164,000	
	４３３回　利付国庫債券（２年）	3,400,000,000	3,403,706,000	
	４３４回　利付国庫債券（２年）	3,500,000,000	3,503,850,000	
	４３５回　利付国庫債券（２年）	3,720,000,000	3,724,092,000	
	４３６回　利付国庫債券（２年）	6,700,000,000	6,707,772,000	
	４３７回　利付国庫債券（２年）	3,850,000,000	3,854,466,000	
	４３８回　利付国庫債券（２年）	3,800,000,000	3,804,332,000	
	４３９回　利付国庫債券（２年）	3,100,000,000	3,103,689,000	
	４４０回　利付国庫債券（２年）	4,300,000,000	4,304,988,000	
	４４１回　利付国庫債券（２年）	2,700,000,000	2,704,050,000	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	5,900,000,000	5,912,921,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	9,350,000,000	9,371,972,500	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	6,190,000,000	6,206,279,700	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	6,410,000,000	6,428,973,600	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	5,230,000,000	5,247,572,800	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	3,100,000,000	3,111,625,000	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	6,700,000,000	6,727,872,000	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	7,050,000,000	7,082,148,000	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	6,000,000,000	6,029,760,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	7,580,000,000	7,596,448,600	

１４８回　利付国庫債券（５年）	6,790,000,000	6,803,444,200	
１４９回　利付国庫債券（５年）	6,950,000,000	6,959,313,000	
１５０回　利付国庫債券（５年）	6,940,000,000	6,944,233,400	
１５１回　利付国庫債券（５年）	5,140,000,000	5,140,000,000	
１５２回　利付国庫債券（５年）	3,430,000,000	3,444,131,600	
１５３回　利付国庫債券（５年）	7,200,000,000	7,193,376,000	
１５４回　利付国庫債券（５年）	3,300,000,000	3,308,778,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	136,448,400	
２回　利付国庫債券（４０年）	630,000,000	750,096,900	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	643,885,200	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	854,215,200	
５回　利付国庫債券（４０年）	1,010,000,000	1,152,824,100	
６回　利付国庫債券（４０年）	1,720,000,000	1,909,251,600	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,690,000,000	1,792,633,700	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,850,000,000	1,821,602,500	
９回　利付国庫債券（４０年）	2,830,000,000	2,036,213,300	
１０回　利付国庫債券（４０年）	2,530,000,000	2,142,201,600	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,820,000,000	1,482,899,600	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,910,000,000	1,385,762,300	
１３回　利付国庫債券（４０年）	2,680,000,000	1,929,921,600	
１４回　利付国庫債券（４０年）	2,770,000,000	2,131,930,500	
１５回　利付国庫債券（４０年）	1,600,000,000	1,348,656,000	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	6,330,000,000	6,387,476,400	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	6,520,000,000	6,589,307,600	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	7,910,000,000	7,991,947,600	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,035,280,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	4,800,000,000	4,836,288,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	4,630,000,000	4,680,004,000	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	5,580,000,000	5,646,736,800	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	7,540,000,000	7,638,924,800	

３４１回　利付国庫債券（１０年）	6,720,000,000	6,795,062,400	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	7,880,000,000	7,922,236,800	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	7,850,000,000	7,892,390,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	7,830,000,000	7,869,150,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	5,990,000,000	6,017,014,900	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	7,570,000,000	7,601,188,400	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	7,110,000,000	7,136,093,700	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	6,590,000,000	6,607,529,400	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	6,230,000,000	6,244,204,400	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	8,660,000,000	8,676,107,600	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	7,400,000,000	7,412,358,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	6,990,000,000	6,998,108,400	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	7,240,000,000	7,244,344,000	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	6,760,000,000	6,760,000,000	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	6,910,000,000	6,905,439,400	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	6,840,000,000	6,830,697,600	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	7,410,000,000	7,389,103,800	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	6,250,000,000	6,222,750,000	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	8,300,000,000	8,250,200,000	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	8,340,000,000	8,281,870,200	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	6,500,000,000	6,448,195,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	7,840,000,000	7,772,419,200	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	7,500,000,000	7,430,325,000	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	7,600,000,000	7,524,076,000	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	6,340,000,000	6,280,530,800	

３６６回　利付国庫債券（１０年）	6,300,000,000	6,308,631,000	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	6,790,000,000	6,770,852,200	
３６８回　利付国庫債券（１０年）	1,400,000,000	1,395,282,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	130,114,600	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	116,219,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	242,988,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	238,968,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	229,970,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	285,360,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	272,354,500	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	176,158,500	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	414,470,200	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	320,335,600	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	296,011,200	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	330,409,800	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	485,128,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	339,928,400	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	409,437,600	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	377,204,900	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	360,528,000	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	435,515,500	
２４回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	336,239,100	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	402,398,700	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	764,373,200	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	773,753,800	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	961,383,500	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,061,007,800	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,071,576,000	

３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	865,166,400	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,180,819,800	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,377,496,600	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,441,080,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,705,061,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	2,068,634,400	
３７回　利付国庫債券（３０年）	2,660,000,000	3,061,553,600	
３８回　利付国庫債券（３０年）	1,850,000,000	2,094,884,500	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,980,000,000	2,278,504,800	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,620,000,000	1,832,511,600	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,880,000,000	2,089,244,000	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,960,000,000	2,176,442,800	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,720,000,000	1,908,408,800	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,850,000,000	2,050,947,000	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,540,000,000	1,645,120,400	
４６回　利付国庫債券（３０年）	2,690,000,000	2,870,122,400	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,760,000,000	1,910,620,800	
４８回　利付国庫債券（３０年）	2,340,000,000	2,443,638,600	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,810,000,000	1,887,413,700	
５０回　利付国庫債券（３０年）	2,260,000,000	2,076,194,200	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,950,000,000	1,586,403,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	2,110,000,000	1,796,158,600	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,870,000,000	1,623,833,200	
５４回　利付国庫債券（３０年）	2,050,000,000	1,860,436,500	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,720,000,000	1,555,361,600	

５６回　利付国庫債券（３０年）	1,680,000,000	1,513,696,800	
５７回　利付国庫債券（３０年）	2,070,000,000	1,858,301,100	
５８回　利付国庫債券（３０年）	2,370,000,000	2,121,837,300	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,870,000,000	1,626,376,400	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,470,000,000	1,338,111,600	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,540,000,000	1,328,850,600	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	1,441,204,800	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,810,000,000	1,426,044,700	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,670,000,000	1,310,849,800	
６５回　利付国庫債券（３０年）	1,250,000,000	981,287,500	
６６回　利付国庫債券（３０年）	1,630,000,000	1,277,349,500	
６７回　利付国庫債券（３０年）	2,250,000,000	1,845,742,500	
６８回　利付国庫債券（３０年）	2,210,000,000	1,805,105,900	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,970,000,000	1,651,923,800	
７０回　利付国庫債券（３０年）	2,290,000,000	1,914,211,000	
７１回　利付国庫債券（３０年）	2,240,000,000	1,868,272,000	
７２回　利付国庫債券（３０年）	2,300,000,000	1,914,083,000	
７３回　利付国庫債券（３０年）	2,250,000,000	1,872,090,000	
７４回　利付国庫債券（３０年）	2,180,000,000	1,965,902,200	
７５回　利付国庫債券（３０年）	2,150,000,000	2,089,692,500	
７６回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	893,412,000	
６７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,329,500	
７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,970,500	
７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,448,400	
７２回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	478,390,800	

７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	396,446,400	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,815,200	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	189,129,600	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	73,222,100	
７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,934,800	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	262,745,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,679,000	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	95,056,200	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	423,516,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	148,631,000	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	74,693,500	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	180,871,500	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	632,609,800	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	129,492,000	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	129,090,000	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	639,849,100	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,808,800	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	510,387,100	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	119,876,900	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,260,351,600	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	402,064,200	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	730,976,700	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	607,453,000	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	131,433,600	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	728,818,200	

９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	175,908,800	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	827,977,500	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	924,636,600	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	258,674,100	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	565,110,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	179,942,400	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	122,483,900	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	715,475,200	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	561,875,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	673,350,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	765,975,900	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	389,844,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	495,638,000	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	523,139,600	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	836,718,000	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,170,000,000	1,328,277,600	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	820,000,000	933,619,200	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	412,412,400	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	608,932,900	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,221,586,900	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	631,173,750	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	527,457,500	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	741,857,500	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	895,164,800	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	641,466,600	

１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,210,429,500	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	686,892,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	699,072,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	585,831,900	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	615,853,800	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,567,499,200	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	863,139,600	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,036,599,200	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	893,039,700	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	940,829,900	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,176,733,800	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,030,203,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	840,284,800	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	405,489,600	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	880,000,000	1,001,466,400	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	920,000,000	1,029,710,000	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	1,000,000,000	1,128,640,000	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	2,790,000,000	3,178,870,200	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	2,780,000,000	3,169,227,800	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	1,710,000,000	1,966,226,400	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	3,220,000,000	3,639,984,600	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	1,750,000,000	1,960,700,000	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	3,550,000,000	4,052,112,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	3,980,000,000	4,543,966,000	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	4,090,000,000	4,626,280,800	

１４８回　利付国庫債券（２０年）	3,900,000,000	4,365,543,000	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	3,460,000,000	3,871,082,600	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	4,250,000,000	4,704,155,000	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	3,360,000,000	3,638,678,400	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	3,540,000,000	3,828,120,600	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	4,220,000,000	4,609,126,200	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	3,990,000,000	4,306,407,000	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	4,060,000,000	4,275,383,000	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	3,700,000,000	3,604,096,000	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	3,230,000,000	3,052,220,800	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	3,490,000,000	3,423,480,600	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	3,480,000,000	3,448,610,400	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	3,100,000,000	3,104,030,000	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	3,190,000,000	3,141,480,100	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	3,230,000,000	3,169,469,800	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,970,000,000	2,903,650,200	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	3,930,000,000	3,771,424,500	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	3,190,000,000	3,048,810,600	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	2,940,000,000	2,886,462,600	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	3,470,000,000	3,288,692,500	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	3,070,000,000	2,851,262,500	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	2,700,000,000	2,455,407,000	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	2,520,000,000	2,280,423,600	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	2,340,000,000	2,108,503,800	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	2,460,000,000	2,246,791,800	

	１７３回　利付国庫債券（２０年）	3,620,000,000	3,292,498,600	
	１７４回　利付国庫債券（２０年）	3,490,000,000	3,160,858,100	
	１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,930,000,000	2,693,080,200	
	１７６回　利付国庫債券（２０年）	3,280,000,000	3,004,808,000	
	１７７回　利付国庫債券（２０年）	3,330,000,000	2,986,244,100	
	１７８回　利付国庫債券（２０年）	3,400,000,000	3,096,006,000	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	3,460,000,000	3,144,724,800	
	１８０回　利付国庫債券（２０年）	3,300,000,000	3,164,799,000	
	１８１回　利付国庫債券（２０年）	2,900,000,000	2,826,978,000	
	１８２回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	907,389,000	
国債証券　合計		674,885,000,000	677,101,432,750	
地方債証券	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	403,112,000	
	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,827,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	110,152,900	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	197,174,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	395,408,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	296,181,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	235,158,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	115,856,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	104,812,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	105,981,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	217,030,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	325,791,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	112,473,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	113,415,000	
	３１回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	214,386,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,886,000	
	３０年度８回　北海道公募公債	400,000,000	400,896,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	399,288,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	98,425,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	246,182,500	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	302,367,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	101,112,000	

２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	198,978,000	
２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	197,624,000	
２５８回　神奈川県公募公債　１０年	300,000,000	295,719,000	
３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	124,162,000	
１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	112,095,000	
１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	341,964,000	
１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	112,710,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,649,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	100,213,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	195,714,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	197,100,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	196,442,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	195,430,000	
４７４回　大阪府公募公債　１０年	300,000,000	293,049,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	223,910,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	106,138,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	96,870,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	298,476,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	353,059,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	109,416,370	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	395,372,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	197,872,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	201,830,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	197,208,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	98,601,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	120,505,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	211,694,000	

１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	305,058,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	318,291,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	105,076,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	102,480,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	197,310,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	98,587,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	196,666,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	105,759,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	106,343,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	207,658,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	106,023,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	336,819,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	341,466,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	116,891,000	
２６年度４回　愛知県公募公債　２０年	200,000,000	221,360,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	158,871,000	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	101,250,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	198,608,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	227,814,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	100,286,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	197,868,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	87,912,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	90,109,000	
２５年度８回　埼玉県公募公債	100,000,000	100,758,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	403,736,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	197,986,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	184,098,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	233,766,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	113,652,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	111,381,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	332,298,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	106,171,000	

２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	201,688,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	100,506,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	199,762,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	197,248,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	98,479,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	105,773,000	
令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	154,590,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	111,019,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	113,930,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	333,387,000	
２７年度４回　千葉県公募公債	200,000,000	202,920,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	100,120,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	195,776,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	106,639,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	105,737,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	95,410,000	
２５年度２回　新潟県公募公債	100,000,000	100,817,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	197,456,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	110,495,000	
１３２回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,833,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,075,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	403,876,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	607,464,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,640,000	
１５０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,861,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,277,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,063,600	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,964,000	
１６０回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,445,000	

１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,295,000	
１６９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,585,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,044,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,879,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,258,000	
１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,440,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,942,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,573,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	493,895,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,638,000	
２２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	492,905,000	
２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	490,505,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	99,820,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	100,920,000	
令和元年度１回　島根県公募公債	200,000,000	187,400,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	196,886,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	100,916,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	100,604,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	199,806,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	296,175,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	223,966,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	454,446,000	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	196,906,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	110,441,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	106,426,000	
５回　京都市公募公債　３０年定時償還	200,000,000	184,320,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	109,288,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	228,558,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	224,558,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	100,910,000	

	３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	300,852,000	
	令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	162,846,000	
	令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	394,428,000	
	２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	121,637,000	
	１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	111,140,000	
	２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	110,495,000	
	２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	116,240,000	
	２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	100,771,000	
	２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	289,446,000	
	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	199,770,000	
	６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	225,382,000	
	５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	116,523,000	
	６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	110,865,000	
	１１回　北九州市公募公債　２０年	300,000,000	342,693,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	110,384,000	
	２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	119,155,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	192,874,000	
	２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	89,020,000	
	２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	100,843,000	
	２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	193,756,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	300,708,000	
	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	96,823,000	
	令和３年度３回　仙台市公募公債　５年	300,000,000	298,530,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	197,774,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	196,886,000	
	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	100,860,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	100,838,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	199,048,000	
地方債証券　合計		33,739,330,000	34,259,207,370	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	210,278,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	208,830,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	300,543,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	443,420,000	

１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,869,000	
１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	80,055,000	
１５６回　日本政策投資銀行債券	400,000,000	394,280,000	
３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,006,000	
１回　高速道路機構債	300,000,000	390,615,000	
１９回　高速道路機構債	150,000,000	188,227,500	
２６回　高速道路機構債	200,000,000	247,354,000	
３６回　高速道路機構債	300,000,000	381,585,000	
５０回　高速道路機構債	300,000,000	276,636,000	
７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,125,000	
１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,155,000	
１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,760,000	
１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,905,000	
１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,312,000	
１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,762,000	
１６９回　高速道路機構債	100,000,000	95,841,000	
１７２回　高速道路機構債	200,000,000	186,992,000	
２１０回　高速道路機構債	100,000,000	95,539,000	
９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,225,000	
１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,962,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	559,720,000	
１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,129,000	
１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,826,000	
２１１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,857,000	
２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,993,000	
２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,032,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,620,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	505,120,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,788,000	

２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,157,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,412,000	
第２６２回　政保道路債	500,000,000	527,335,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,304,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	300,006,000	
２８６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	189,356,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,156,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	801,496,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	195,670,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	96,578,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	233,217,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	150,872,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	161,024,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	163,282,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	618,270,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	221,546,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	338,601,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	339,231,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	113,887,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,191,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	225,074,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	111,491,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	223,302,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,724,000	
Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	340,275,000	
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	546,899,680	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	110,541,000	

６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,832,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	544,580,000	
４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	311,712,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,909,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	214,042,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,816,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	399,936,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,061,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	97,460,000	
９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,535,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,209,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,101,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,325,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	260,700,000	
１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	229,878,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,930,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	223,430,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,018,540	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	106,160,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	105,082,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	207,950,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	160,442,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	108,275,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	101,007,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	224,538,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,356,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	398,160,000	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,591,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,716,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,044,000	

１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	280,255,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,907,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,210,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,950,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,628,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,156,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,809,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,700,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,700,000	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	30,306,000	30,524,809	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,180,000	47,086,051	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,329,000	10,406,777	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,670,000	50,051,961	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,457,000	29,641,989	
４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,067,000	10,133,140	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,661,000	17,494,883	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,850,000	110,064,384	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,568,000	165,375,494	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,045,000	23,077,808	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,925,000	19,794,414	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,212,000	23,157,564	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,289,000	24,283,207	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,898,000	30,098,422	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,500,000	73,071,135	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,067,000	33,290,676	

８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,171,000	39,303,915	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,621,000	39,790,830	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,442,000	43,694,463	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,211,000	45,222,547	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,607,000	49,902,657	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,832,000	56,571,215	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,845,000	58,983,389	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	216,789,000	213,480,799	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,576,000	72,893,214	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,375,000	72,771,123	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,384,000	72,718,407	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	229,212,000	226,174,941	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	229,515,000	226,327,036	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,682,000	153,451,076	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,544,000	229,709,207	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,466,000	229,639,492	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	402,315,000	397,278,015	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,559,000	79,469,842	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,873,000	80,921,340	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	265,509,000	258,234,053	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	354,496,000	345,956,191	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,841,000	266,429,236	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	279,948,000	273,783,545	
１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	849,681,000	827,759,230	
６回　沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	420,328,000	

	２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,393,000	
	い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,047,000	
	い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,956,000	
	い第８５１号　利付商工債	300,000,000	299,436,000	
	い第８５４号　利付商工債	300,000,000	299,115,000	
	い第８５５号　利付商工債	200,000,000	199,322,000	
	３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	399,320,000	
	３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	299,127,000	
	７回　広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	100,730,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	111,906,000	
	７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,592,000	
	７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	297,135,000	
	８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	299,205,000	
	８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	398,612,000	
	７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	100,887,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,124,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	196,286,000	
特殊債券　合計		31,000,518,000	31,629,909,197	
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	295,413,000	
	2回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,673,000	
	6回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	201,108,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	98,708,000	
	２５回　首都高速道路社債	100,000,000	99,833,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	398,652,000	
	１６回　成田国際空港社債	100,000,000	100,811,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	87,524,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	99,731,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	197,654,000	
	７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	298,551,000	
	８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	199,034,000	
	５６回　中日本高速道路社債	100,000,000	100,755,000	
	９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	198,968,000	
	９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	496,850,000	
	２５回　西日本高速道路社債	200,000,000	201,676,000	
	２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	101,217,000	
	３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	300,423,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	200,744,000	
	６１回　西日本高速道路債券	500,000,000	497,405,000	
	６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	496,845,000	

２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	199,430,000	
１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	101,029,000	
３回　ダイドーグループＨＤ社債	300,000,000	296,910,000	
９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	97,633,000	
１２回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,462,000	
１４回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,762,000	
３０回　東レ社債	300,000,000	300,138,000	
４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	199,652,000	
４９回　住友化学社債	100,000,000	101,128,000	
２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	195,634,000	
４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,574,000	
１７回　ダイセル社債	300,000,000	297,918,000	
１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	484,885,000	
４回　住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,666,000	
４回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債	300,000,000	299,433,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	299,793,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	298,617,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	100,729,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	98,894,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	196,832,000	
２９回　三菱重工業社債	100,000,000	100,861,000	
５８回　川崎重工業社債	300,000,000	293,352,000	
５回　三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	99,289,000	
１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	201,510,000	
２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	199,604,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	96,082,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	395,856,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	398,780,000	
１３回　新生銀行社債	200,000,000	199,294,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	108,726,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,355,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	297,699,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	201,306,000	
１１回　セブン銀行社債	200,000,000	201,432,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,339,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	299,370,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	397,252,000	

６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,869,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,830,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,831,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	195,700,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	293,448,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	98,821,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	198,584,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,350,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	196,088,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	299,451,000	
３回　野村ホールディングス社債	300,000,000	296,490,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	103,942,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	100,558,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	200,442,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	104,601,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	93,111,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,262,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	210,746,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	111,888,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	110,928,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	225,300,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	100,743,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	93,046,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,408,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,461,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	75,204,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,071,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	179,270,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	162,404,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,537,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	196,674,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	83,157,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	75,958,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,694,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	178,846,000	
１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	204,084,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,707,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,316,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	129,009,600	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	76,062,000	

	７回　ニッコンＨＤ社債	300,000,000	294,249,000	
	６回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	196,498,000	
	１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	392,560,000	
	３０回　光通信社債	200,000,000	190,002,000	
	５２７回　中部電力社債	100,000,000	94,673,000	
	５３２回　中部電力社債	200,000,000	194,100,000	
	４９７回　関西電力社債	100,000,000	101,657,000	
	５０８回　関西電力社債	300,000,000	298,917,000	
	５３０回　関西電力社債	400,000,000	390,212,000	
	５３１回　関西電力社債	200,000,000	178,272,000	
	５４１回　関西電力社債	300,000,000	285,930,000	
	３９６回　中国電力社債	200,000,000	193,528,000	
	４２５回　中国電力社債	100,000,000	96,993,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	102,409,000	
	３１１回　北陸電力社債	100,000,000	101,529,000	
	４７１回　東北電力社債	400,000,000	404,392,000	
	４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,379,000	
	５２１回　東北電力社債	400,000,000	390,096,000	
	５２５回　東北電力社債	200,000,000	196,678,000	
	５３６回　東北電力社債	300,000,000	285,333,000	
	３２０回　四国電力社債	300,000,000	288,402,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	404,348,000	
	４２８回　九州電力社債	100,000,000	101,154,000	
	４６３回　九州電力社債	100,000,000	92,505,000	
	４６６回　九州電力社債	100,000,000	91,194,000	
	４９１回　九州電力社債	300,000,000	287,160,000	
	４９２回　九州電力社債	100,000,000	86,046,000	
	４９３回　九州電力社債	200,000,000	197,910,000	
	５０７回　九州電力社債	200,000,000	193,592,000	
	３２１回　北海道電力社債	261,000,000	264,387,780	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	299,700,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	185,232,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	209,066,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	302,700,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	99,112,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	192,548,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	191,304,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	90,707,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	87,076,000	
	５７回　東京瓦斯社債	300,000,000	215,616,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	200,438,000	
	８回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	191,002,000	
社債券　合計		28,281,000,000	27,814,299,380	
合計			770,804,848,697	

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11月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	492,787,760
コール・ローン	7,114,275,951
国債証券	180,473,238,873
派生商品評価勘定	64,644,403
未収入金	2,858,789,749
未収利息	1,108,766,128
前払費用	135,376,539
流動資産合計	192,247,879,403
資産合計	192,247,879,403
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	154,539,796
未払金	6,420,665,232
未払解約金	3,206,292,000
流動負債合計	9,781,497,028
負債合計	9,781,497,028
純資産の部	
元本等	
元本	87,311,980,753
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	95,154,401,622
元本等合計	182,466,382,375
純資産合計	182,466,382,375
負債純資産合計	192,247,879,403

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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11月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	82,363,858,493円
同期中追加設定元本額	30,781,534,783円
同期中一部解約元本額	25,833,412,523円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	7,924,575,177円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	4,756,089円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	30,524,017円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	78,099,492円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	54,410,677円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	32,727,502円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	41,537,286円
たわらノーロード　先進国債券	15,962,474,106円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	231,345,976円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,138,528,636円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	55,066,797円
たわらノーロード　バランス（標準型）	279,575,954円
たわらノーロード　バランス（積極型）	58,420,882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）	11,666,103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）	543,997,794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）	751,427,851円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	286,558,366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）	196,174,506円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,006,200円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	6,979,293円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	86,246,678円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,722,407円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,490,076円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,528,477,562円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	716,748,925円

Ｏｎｅグローバルバランス	8,324,750円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	700,724,699円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,228,204,502円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,469,443,216円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	398,172,361円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	818,450,608円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	707,191,027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＞	505,977,740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）	225,192,884円
クルーズコントロール	1,090,374,353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＞	503,758,575円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	553,043,700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＞	240,526,486円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,123,735,235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）	136,533,897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）	139,673,246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）	138,711,115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）	85,326,848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）	134,738,327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）	167,902,339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）	231,817,862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）	121,239,663円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	320,033,637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）	5,125,551,829円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	2,608,992,370円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,556,863,967円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,285,278,115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）	85,461,348円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	47,494,535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）	231,420,018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）	372,104,330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）	240,420,339円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,625,905円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	37,916,419円

ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,643,314円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	47,933円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,918,120円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,401,749円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,665,378,178円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,397,283,333円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,517,878,721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）	62,985,565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）	127,692,707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）	1,506,300,576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）	341,805,704円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	154,610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）	297,945,361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）	268,932,055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）	403,641,070円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,481,462円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	59,528,316円
コア資産形成ファンド	39,772,192円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	730,185,630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）	280,550,275円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	7,802,340,042円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,322,875,478円
計	87,311,980,753円
２．　受益権の総数	87,311,980,753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　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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11月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△20,431,155,324
合計	△20,431,155,324

（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11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	2,999,999,000	－	2,935,354,597	64,644,403
アメリカ・ドル	1,621,009,000	－	1,577,663,806	43,345,194
イギリス・ポンド	136,766,000	－	134,666,728	2,099,272
オーストラリア・ドル	55,028,000	－	54,345,871	682,129
カナダ・ドル	61,329,000	－	60,125,384	1,203,616
シンガポール・ドル	34,223,000	－	33,695,498	527,502
スウェーデン・クローナ	33,484,000	－	33,006,999	477,001
ユーロ	1,058,160,000	－	1,041,850,311	16,309,689
買建	6,700,000,000	－	6,545,460,204	△154,539,796
アメリカ・ドル	3,563,796,000	－	3,453,806,355	△109,989,645
イギリス・ポンド	305,957,000	－	304,256,994	△1,700,006
オーストラリア・ドル	103,552,000	－	102,958,510	△593,490

オフショア・人民元	128,561,000	－	126,281,241	△2,279,759
カナダ・ドル	140,974,000	－	138,566,423	△2,407,577
シンガポール・ドル	31,037,000	－	30,478,693	△558,307
メキシコ・ペソ	49,091,000	－	48,175,066	△915,934
ユーロ	2,377,032,000	－	2,340,936,922	△36,095,078
合計	9,699,999,000	－	9,480,814,801	△89,895,393

（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11月11日現在
1口当たり純資産額	2.0898円
（1万口当たり純資産額）	(20,898円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	1,660,000.000	1,574,925.000	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,800,000.000	4,542,750.000	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,160,000.000	2,060,353.100	
		US T N/B 0.25 03/15/24	3,910,000.000	3,692,200.750	
		US T N/B 0.25 05/15/24	7,500,000.000	7,036,816.350	
		US T N/B 0.25 05/31/25	3,890,000.000	3,518,018.750	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,534,890.620	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,161,757.790	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,418,812.500	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,220,622.630	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,330,853.100	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,566,875.000	
		US T N/B 0.25 11/15/23	800,000.000	766,250.000	

		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,281,292.930	
		US T N/B 0.375 04/15/24	4,140,000.000	3,904,860.910	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,332,199.980	
		US T N/B 0.375 07/15/24	4,000,000.000	3,737,500.000	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,202,368.750	
		US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,819,085.910	
		US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,859,531.240	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,310,000.000	2,787,123.430	
		US T N/B 0.375 11/30/25	3,190,000.000	2,845,828.880	
		US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,671,171.860	
		US T N/B 0.5 02/28/26	3,370,000.000	2,994,034.370	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,621,927.320	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,035,561.520	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,695,065.620	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,374,293.750	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,597,533.570	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,091,270.290	
		US T N/B 0.5 11/30/23	3,000,000.000	2,875,312.500	
		US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,904,417.960	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,481,045.890	
		US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,434,437.500	
		US T N/B 0.625 08/15/30	6,340,000.000	4,991,511.660	
		US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,726,874.990	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,305,554.660	
		US T N/B 0.625 12/31/27	3,320,000.000	2,810,911.720	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,720,946.860	
		US T N/B 0.75 03/31/26	3,220,000.000	2,879,007.010	
		US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,299,937.500	
		US T N/B 0.75 05/31/26	3,630,000.000	3,229,282.000	
		US T N/B 0.75 08/31/26	2,950,000.000	2,603,835.930	
		US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,429,746.870	
		US T N/B 0.75 12/31/23	1,990,000.000	1,907,679.290	
		US T N/B 0.875 01/31/24	200,000.000	191,296.870	
		US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	2,950,813.250	
		US T N/B 0.875 09/30/26	3,110,000.000	2,752,714.420	
		US T N/B 0.875 11/15/30	7,180,000.000	5,750,731.250	
		US T N/B 1.0 07/31/28	3,770,000.000	3,201,849.190	
		US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,305,307.800	
		US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,557,462.500	
		US T N/B 1.125 02/15/31	7,890,000.000	6,423,569.480	
		US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,775,823.420	
		US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	976,378.900	
		US T N/B 1.125 02/29/28	3,860,000.000	3,339,201.540	
		US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,031,562.500	
		US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	1,924,390.600	
		US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,184,050.380	
		US T N/B 1.125 10/31/26	3,390,000.000	3,025,045.310	
		US T N/B 1.25 03/31/28	3,610,000.000	3,135,905.440	
		US T N/B 1.25 04/30/28	4,010,000.000	3,476,012.070	

		US T N/B 1.25 05/15/50	4,370,000.000	2,315,587.850	
		US T N/B 1.25 05/31/28	3,000,000.000	2,595,234.350	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,204,802.320	
		US T N/B 1.25 08/15/31	8,130,000.000	6,586,887.840	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,712,374.200	
		US T N/B 1.25 09/30/28	3,980,000.000	3,415,803.870	
		US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,313,523.410	
		US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,478,510.930	
		US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	704,296.870	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	2,655,671.870	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	995,156.250	
		US T N/B 1.375 10/31/28	3,210,000.000	2,770,255.060	
		US T N/B 1.375 11/15/31	7,990,000.000	6,501,862.500	
		US T N/B 1.375 11/15/40	3,190,000.000	2,031,631.250	
		US T N/B 1.375 12/31/28	3,500,000.000	3,015,468.750	
		US T N/B 1.5 01/31/27	5,940,000.000	5,358,529.640	
		US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,273,800.750	
		US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,182,156.250	
		US T N/B 1.5 02/29/24	4,000,000.000	3,843,125.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,393,425.750	
		US T N/B 1.5 09/30/24	4,310,000.000	4,086,587.090	
		US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,613,375.000	
		US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,472,187.480	
		US T N/B 1.625 02/15/26	2,890,000.000	2,666,250.760	
		US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,372,099.190	
		US T N/B 1.625 05/15/31	9,740,000.000	8,199,862.500	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,432,515.600	
		US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,415,949.200	
		US T N/B 1.625 10/31/23	2,800,000.000	2,722,125.000	
		US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,557,168.750	
		US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	2,797,793.750	
		US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,646,534.370	
		US T N/B 1.75 01/31/29	3,000,000.000	2,634,960.930	
		US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,773,750.000	
		US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,281,793.750	
		US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,900,760.930	
		US T N/B 1.75 08/15/41	4,930,000.000	3,300,018.750	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,791,427.700	
		US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,887,857.010	
		US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,927,188.260	
		US T N/B 1.875 02/15/32	7,280,000.000	6,168,662.480	
		US T N/B 1.875 02/15/41	4,700,000.000	3,270,906.240	
		US T N/B 1.875 02/15/51	4,920,000.000	3,081,150.000	
		US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,305,970.300	
		US T N/B 1.875 02/28/29	2,500,000.000	2,211,132.800	
		US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,739,000.000	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,846,562.500	
		US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	783,580.460	
		US T N/B 1.875 11/15/51	5,070,000.000	3,159,243.750	

		US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,941,028.110	
		US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,421,487.490	
		US T N/B 2.0 04/30/24	4,720,000.000	4,550,375.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	800,000.000	769,250.000	
		US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	278,535.930	
		US T N/B 2.0 08/15/25	7,660,000.000	7,216,557.760	
		US T N/B 2.0 08/15/51	5,110,000.000	3,289,562.500	
		US T N/B 2.0 11/15/26	2,830,000.000	2,614,212.500	
		US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	2,968,359.370	
		US T N/B 2.125 02/29/24	1,650,000.000	1,598,953.120	
		US T N/B 2.125 03/31/24	3,340,000.000	3,232,493.750	
		US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,750,031.250	
		US T N/B 2.125 05/31/26	1,550,000.000	1,447,554.680	
		US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	365,289.840	
		US T N/B 2.125 09/30/24	590,000.000	565,846.870	
		US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	1,949,921.860	
		US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,702,403.120	
		US T N/B 2.25 01/31/24	710,000.000	690,530.460	
		US T N/B 2.25 02/15/27	2,580,000.000	2,400,105.440	
		US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	2,945,500.000	
		US T N/B 2.25 03/31/24	4,750,000.000	4,605,087.850	
		US T N/B 2.25 03/31/26	1,300,000.000	1,224,285.140	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,195,070.290	
		US T N/B 2.25 05/15/41	3,420,000.000	2,528,662.500	
		US T N/B 2.25 08/15/27	5,240,000.000	4,846,795.260	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,070,000.000	1,433,717.550	
		US T N/B 2.25 08/15/49	3,040,000.000	2,110,900.000	
		US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,257,927.720	
		US T N/B 2.25 11/15/24	3,080,000.000	2,957,521.850	
		US T N/B 2.25 11/15/25	2,920,000.000	2,760,540.600	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,014,531.250	
		US T N/B 2.25 12/31/23	280,000.000	272,759.370	
		US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,873,671.860	
		US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,697,628.880	
		US T N/B 2.375 03/31/29	3,000,000.000	2,732,460.930	
		US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,661,824.990	
		US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,134,781.990	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,470,000.000	3,156,615.620	
		US T N/B 2.375 05/15/51	4,760,000.000	3,369,187.500	
		US T N/B 2.375 08/15/24	4,610,000.000	4,445,408.570	
		US T N/B 2.375 11/15/49	3,260,000.000	2,326,825.000	
		US T N/B 2.5 01/31/24	2,550,000.000	2,486,050.760	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,703,264.050	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,295,695.300	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,165,821.850	
		US T N/B 2.5 03/31/27	2,650,000.000	2,489,033.190	
		US T N/B 2.5 04/30/24	4,010,000.000	3,893,772.630	
		US T N/B 2.5 05/15/24	5,100,000.000	4,949,390.620	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,230,000.000	1,633,910.540	

		US T N/B 2.5 05/31/24	4,180,000.000	4,053,293.750	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,346,513.260	
		US T N/B 2.625 02/15/29	4,330,000.000	4,007,787.060	
		US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,725,532.010	
		US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,884,804.680	
		US T N/B 2.625 05/31/27	3,410,000.000	3,218,453.880	
		US T N/B 2.625 07/31/29	2,570,000.000	2,371,628.120	
		US T N/B 2.625 12/31/23	3,530,000.000	3,453,608.570	
		US T N/B 2.75 02/15/24	2,090,000.000	2,044,117.950	
		US T N/B 2.75 02/15/28	3,370,000.000	3,173,197.240	
		US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,894,156.240	
		US T N/B 2.75 04/30/27	3,000,000.000	2,845,312.500	
		US T N/B 2.75 05/15/25	4,000,000.000	3,855,312.480	
		US T N/B 2.75 05/31/29	2,500,000.000	2,326,855.450	
		US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,002,056.230	
		US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,618,107.000	
		US T N/B 2.75 08/15/32	1,840,000.000	1,675,909.360	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,540,000.000	1,221,412.500	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,709,347.230	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,758,944.510	
		US T N/B 2.75 11/15/23	6,360,000.000	6,247,706.250	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,228,145.920	
		US T N/B 2.75 11/15/47	1,550,000.000	1,188,232.410	
		US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,935,625.000	
		US T N/B 2.875 04/30/29	3,000,000.000	2,815,078.100	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,090,000.000	3,868,564.810	
		US T N/B 2.875 05/15/32	6,650,000.000	6,134,105.430	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,837,725.000	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,300,000.000	2,619,632.790	
		US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,564,309.370	
		US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,517,748.430	
		US T N/B 2.875 06/15/25	1,000,000.000	966,875.000	
		US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,124,203.100	
		US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,270,940.620	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,393,875.000	
		US T N/B 2.875 10/31/23	1,490,000.000	1,466,311.310	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	849,825.000	
		US T N/B 2.875 11/30/25	2,360,000.000	2,272,237.500	
		US T N/B 3.0 02/15/47	1,960,000.000	1,575,350.000	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,133,974.570	
		US T N/B 3.0 02/15/49	3,310,000.000	2,692,219.500	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	896,821.860	
		US T N/B 3.0 05/15/45	400,000.000	322,875.000	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,302,581.240	
		US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,100,624.980	
		US T N/B 3.0 07/31/24	5,020,000.000	4,899,794.490	
		US T N/B 3.0 08/15/48	2,810,000.000	2,273,904.670	
		US T N/B 3.0 08/15/52	680,000.000	553,562.500	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,693,125.000	

	US T N/B 3.0 10/31/25	1,270,000.000	1,227,832.020	
	US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,263,600.000	
	US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	693,106.240	
	US T N/B 3.125 02/15/42	860,000.000	732,545.300	
	US T N/B 3.125 02/15/43	390,000.000	327,082.020	
	US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,338,287.500	
	US T N/B 3.125 08/15/25	2,030,000.000	1,972,826.930	
	US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,732,740.620	
	US T N/B 3.125 08/31/27	1,730,000.000	1,667,692.960	
	US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,960,695.670	
	US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,180,162.500	
	US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	868,035.930	
	US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	3,248,874.990	
	US T N/B 3.25 06/30/27	3,500,000.000	3,390,078.120	
	US T N/B 3.25 06/30/29	2,000,000.000	1,918,515.620	
	US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,238,290.620	
	US T N/B 3.375 08/15/42	1,500,000.000	1,322,578.120	
	US T N/B 3.375 11/15/48	3,200,000.000	2,785,499.990	
	US T N/B 3.5 02/15/39	500,000.000	466,406.250	
	US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,944,804.680	
	US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,471,584.370	
	US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,334,484.370	
	US T N/B 3.75 08/15/41	820,000.000	769,006.240	
	US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,257,150.000	
	US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,242,834.370	
	US T N/B 3.875 09/30/29	1,050,000.000	1,048,195.310	
	US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	970,484.370	
	US T N/B 4.25 10/15/25	800,000.000	801,187.500	
	US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	625,875.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	939,006.250	
	US T N/B 4.375 05/15/41	230,000.000	235,821.870	
	US T N/B 4.375 10/31/24	2,070,000.000	2,071,819.340	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,034,687.500	
	US T N/B 4.5 02/15/36	1,020,000.000	1,086,937.500	
	US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	634,312.500	
	US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,032,062.500	
	US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	948,684.370	
	US T N/B 4.75 02/15/41	830,000.000	893,546.870	
	US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	617,784.370	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	904,718.750	
	US T N/B 5.375 02/15/31	860,000.000	950,232.790	
	US T N/B 6.0 02/15/26	1,100,000.000	1,160,585.930	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	985,148.430	
	US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	873,265.060	
アメリカ・ドル　小計		737,120,000.000 (104,575,214,400)	647,295,451.660 (91,831,805,727)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	950,000.000	863,645.000	

		UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,736,190.720	
		UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,040,000.000	882,339.460	
		UK TREASURY 0.25 01/31/25	1,350,000.000	1,262,960.100	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,470,000.000	1,131,753.000	
		UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,390,000.000	1,242,536.000	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	973,331.120	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	680,000.000	570,683.200	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	700,000.000	299,243.000	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	860,000.000	807,841.000	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,350,000.000	951,750.000	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	450,000.000	227,186.630	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	870,000.000	509,994.000	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	700,000.000	541,233.000	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	960,000.000	817,920.000	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,170,000.000	1,767,045.750	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	950,000.000	922,070.750	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	760,000.000	530,397.310	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	395,988.800	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,600,000.000	1,458,720.000	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,330,000.000	809,571.000	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,300,000.000	886,878.710	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,100,000.000	1,035,063.920	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	672,112.000	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	350,000.000	226,016.840	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	847,484.820	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	870,000.000	582,151.800	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	549,435.100	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	446,884.200	

		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	793,099.540	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	1,097,594.040	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,190,000.000	1,155,553.070	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,100,000.000	948,200.000	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	810,000.000	803,865.870	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,270,000.000	1,208,867.020	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,150,000.000	1,139,137.100	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	930,000.000	1,020,210.000	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	1,032,935.920	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	1,061,145.000	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,800,000.000	1,938,819.600	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,170,000.000	1,261,807.560	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,000,000.000	1,076,456.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	910,000.000	946,061.480	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,157,879.100	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,080,000.000	1,201,240.800	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	1,151,500.280	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,435,541.280	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	993,115.080	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,265,000.000	1,429,384.970	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,095,000.000	1,212,559.200	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	980,000.000	1,116,095.330	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,095,000.000	1,139,809.360	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	775,089.970	
イギリス・ポンド　小計			56,464,000.000 (9,345,921,280)	51,044,394.800 (8,448,868,227)	
イスラエル・シュケル		ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	290,000.000	274,678.430	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	260,000.000	237,456.960	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,766,579.220	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,430,488.060	

	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,450,000.000	1,143,960.100	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,300,000.000	2,207,636.600	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,230,000.000	2,112,082.060	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,460,000.000	1,375,711.280	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	1,630,000.000	1,641,537.140	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,250,000.000	1,308,872.500	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,190,000.000	1,525,739.460	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	220,000.000	244,013.880	
イスラエル・シュケル　小計		17,030,000.000 (694,321,615)	16,268,755.690 (663,285,304)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,590,000.000	1,499,823.900	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,160,000.000	1,060,349.590	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,510,000.000	1,356,055.820	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,870,000.000	1,486,345.620	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,361,705.720	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,890,000.000	1,520,886.720	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,610,000.000	1,353,453.130	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,200,000.000	734,880.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,470,000.000	1,229,695.940	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	880,000.000	832,744.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,679,355.650	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	970,000.000	965,124.330	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	900,000.000	737,786.240	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	577,287.040	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,230,000.000	1,199,434.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	960,000.000	921,528.250	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,550,000.000	1,482,730.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	880,000.000	725,267.930	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,620,000.000	1,509,892.840	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,380,000.000	1,381,757.980	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,100,000.000	1,082,916.560	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	520,000.000	467,860.140	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	808,918.190	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,200,000.000	1,237,151.270	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,030,000.000	1,099,249.570	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,440,000.000	1,521,349.050	
オーストラリア・ドル　小計		32,920,000.000 (3,080,653,600)	29,833,549.980 (2,791,823,607)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	10,000,000.000	9,975,600.000	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	4,200,000.000	4,205,911.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	25,500,000.000	25,422,352.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,482,079.330	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	23,500,000.000	23,522,870.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	12,000,000.000	12,043,560.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	3,000,000.000	2,992,560.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,405,185.970	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	30,100,000.000	30,087,773.980	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	14,410,000.000	14,412,233.550	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	5,300,000.000	5,253,943.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	3,000,000.000	2,983,395.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,573,882.340	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,861,166.780	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	6,000,000.000	5,981,837.100	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,000,000.000	19,965,100.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	17,000,000.000	17,059,156.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	3,000,000.000	3,003,435.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,079,365.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 11/05/23	730,000.000	737,272.180	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,145,551.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	15,600,000.000	15,863,404.440	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	1,000,000.000	1,022,352.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,635,457.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	10,320,000.000	10,668,351.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	18,950,000.000	20,240,210.750	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,279,871.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,308,087.950	
オフショア・人民元　小計		306,300,000.000 (6,063,269,760)	309,211,967.170 (6,120,912,733)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,010,000.000	907,063.830	
	CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,427,839.500	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,910,000.000	1,747,650.000	
	CANADA 0.5 11/01/23	620,000.000	599,391.200	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,463,949.000	
	CANADA 0.75 02/01/24	1,200,000.000	1,155,020.400	
	CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	765,632.250	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	497,726.900	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,159,525.240	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	661,553.900	
	CANADA 1.25 03/01/27	970,000.000	888,016.570	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,850,000.000	1,617,003.600	
	CANADA 1.5 04/01/25	1,300,000.000	1,233,202.100	
	CANADA 1.5 05/01/24	940,000.000	908,184.760	
	CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	654,697.400	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,070,000.000	1,815,390.000	
	CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	422,591.400	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,700,000.000	1,480,936.300	
	CANADA 1.75 12/01/53	1,770,000.000	1,248,088.950	
	CANADA 2.0 06/01/28	470,000.000	442,180.700	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,940,000.000	1,757,795.200	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,940,000.000	2,235,040.920	
	CANADA 2.25 03/01/24	420,000.000	411,261.900	
	CANADA 2.25 06/01/25	800,000.000	772,632.800	
	CANADA 2.25 06/01/29	430,000.000	407,684.720	
	CANADA 2.25 12/01/29	500,000.000	472,763.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	970,000.000	950,575.750	
	CANADA 2.5 12/01/32	500,000.000	472,410.500	
	CANADA 2.75 08/01/24	590,000.000	579,293.270	
	CANADA 2.75 09/01/27	850,000.000	829,095.100	
	CANADA 2.75 12/01/48	630,000.000	569,119.950	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	344,031.480	
	CANADA 3.0 11/01/24	860,000.000	846,703.540	
	CANADA 3.5 03/01/28	480,000.000	484,872.960	
	CANADA 3.5 12/01/45	700,000.000	717,303.300	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	619,654.410	
	CANADA 5.0 06/01/37	340,000.000	404,198.120	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,090,000.000	1,255,657.110	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	746,617.430	
カナダ・ドル　小計		39,190,000.000 (4,167,072,700)	35,972,355.460 (3,824,940,556)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	380,000.000	351,652.000	

	SINGAPORE 1.25 11/01/26	410,000.000	379,988.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	350,000.000	302,366.220	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	370,440.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	430,000.000	326,853.750	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	275,492.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	370,000.000	356,791.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	510,751.200	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	730,000.000	716,860.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	140,000.000	120,330.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	420,000.000	404,208.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	500,000.000	458,500.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	340,000.000	310,166.700	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	480,000.000	463,440.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	594,890.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	110,000.000	106,380.860	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	807,651.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	330,000.000	326,865.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	806,560.000	
シンガポール・ドル　小計		8,580,000.000 (879,879,000)	7,990,185.730 (819,393,547)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	3,040,000.000	2,593,382.080	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	2,890,000.000	2,688,470.000	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,010,000.000	2,751,651.090	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	6,210,000.000	5,932,072.610	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	5,780,000.000	5,738,139.100	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,300,000.000	3,385,354.500	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,160,000.000	6,187,788.370	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,420,000.000	4,175,771.090	
スウェーデン・クローナ　小計		33,810,000.000 (451,363,500)	33,452,628.840 (446,592,595)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,050,000.000	1,967,077.500	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,180,000.000	3,420,965.840	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,280,000.000	1,338,775.670	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,350,000.000	5,870,116.520	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,750,000.000	5,123,778.420	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,540,000.000	5,484,129.100	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,810,000.000	10,122,228.600	
デンマーク・クローネ　小計		33,960,000.000 (659,163,600)	33,327,071.650 (646,878,461)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	350,000.000	280,020.160	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/24	450,000.000	424,110.660	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	360,000.000	314,210.360	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	350,000.000	280,000.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	253,519.600	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	350,000.000	285,472.370	

	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	450,000.000	432,347.050	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	330,000.000	265,632.330	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	440,000.000	306,086.010	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	350,000.000	323,312.670	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	350,000.000	323,410.370	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	350,000.000	351,231.370	
ニュージーランド・ドル　小計		4,530,000.000 (385,684,200)	3,839,352.950 (326,882,510)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,243,490.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,758,794.100	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,480,000.000	4,226,920.320	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,252,460.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	5,200,000.000	5,009,820.400	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,300,000.000	2,995,660.800	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,921,788.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,100,000.000	1,000,580.900	
	NORWAY 3.0 03/14/24	2,770,000.000	2,754,615.680	
ノルウェー・クローネ　小計		28,280,000.000 (396,202,800)	26,164,130.200 (366,559,464)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,446,378.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	3,370,000.000	2,922,969.500	
	POLAND 07/25/24	1,710,000.000	1,515,402.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	3,930,000.000	2,530,527.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	1,660,000.000	1,055,677.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,150,000.000	1,965,745.000	
	POLAND 2.5 04/25/24	780,000.000	733,902.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,364,525.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	1,918,208.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,480,000.000	2,778,954.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	710,000.000	541,339.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,780,000.000	2,515,205.000	
	POLAND 3.75 05/25/27	450,000.000	387,387.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,334,016.000	
ポーランド・ズロチ　小計		29,490,000.000 (910,082,043)	24,010,235.000 (740,972,659)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	869,552.540	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	1,000,101.500	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,301,054.100	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,935,485.280	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,300,000.000	1,118,739.780	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,677,138.580	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,544,599.010	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	300,000.000	299,601.170	

	MALAYSIA 3.885 08/15/29	400,000.000	385,337.750	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	600,000.000	591,900.060	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,430,000.000	1,405,005.740	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,641,579.830	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	320,000.000	317,260.590	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,400,000.000	2,398,378.240	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	907,115.940	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	400,000.000	342,995.870	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,030,000.000	1,041,083.520	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	480,000.000	467,104.110	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,059,500.920	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,199,565.780	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	300,000.000	301,484.490	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	497,423.100	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	680,000.000	661,611.360	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	289,785.590	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,710,864.700	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	620,000.000	620,495.810	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	1,963,654.330	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,595,808.120	
マレーシア・リンギット　小計		30,040,000.000 (917,794,096)	29,144,227.810 (890,426,106)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	7,880,000.000	6,794,155.300	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	6,780,000.000	6,084,894.180	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	2,500,000.000	2,101,031.550	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	5,696,636.410	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	15,502,000.000	15,506,051.440	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	28,522,000.000	25,505,108.250	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	21,546,000.000	20,068,038.110	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,648,000.000	27,813,023.510	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	15,977,000.000	13,381,451.810	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	4,835,000.000	4,267,449.950	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,070,000.000	21,337,276.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	16,161,000.000	13,663,100.220	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	15,151,000.000	14,775,255.200	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	19,282,976.530	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,276,830.680	
メキシコ・ペソ　小計		228,858,000.000	210,553,279.140	

		(1,681,991,871)	(1,547,461,325)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	850,000.000	711,513.750	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	710,000.000	575,977.560	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	580,000.000	550,690.280	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	450,000.000	390,585.600	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	250,000.000	151,925.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	380,000.000	269,572.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	920,000.000	818,602.200	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,070,000.000	990,408.050	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	210,000.000	103,913.460	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	770,268.290	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	710,000.000	440,844.680	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,070,000.000	1,011,609.030	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	300,000.000	146,637.760	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	400,000.000	343,502.400	
	AUSTRIA 07/15/24	700,000.000	676,763.500	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,190,000.000	1,157,563.260	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	640,000.000	500,792.320	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	180,000.000	117,360.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	670,000.000	664,735.410	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	280,000.000	235,770.080	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	160,000.000	158,802.490	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	315,673.800	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	620,000.000	601,032.960	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	540,000.000	575,243.100	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	259,029.960	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	940,000.000	1,090,964.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	610,000.000	663,372.560	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	415,000.000	487,263.950	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	520,326.120	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	756,444.320	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	677,040.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	600,000.000	488,160.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	450,000.000	294,650.550	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	750,000.000	728,632.500	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	520,000.000	244,302.760	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,980,000.000	1,917,881.460	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	1,110,000.000	1,043,078.100	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	1,010,000.000	925,968.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,180,000.000	1,077,823.800	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,030,000.000	991,427.530	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,070,000.000	955,743.260	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	715,692.510	
	BELGIUM 1.4 06/22/53	610,000.000	424,900.990	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	380,000.000	315,721.100	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	780,000.000	598,695.240	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	980,000.000	752,804.640	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	535,185.330	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	370,485.000	

		BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	341,278.470	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	840,000.000	847,419.290	
		BELGIUM 2.75 04/22/39	220,000.000	215,176.720	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	1,180,000.000	1,210,262.280	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	560,000.000	628,537.840	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	630,000.000	706,206.690	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,070,000.000	1,263,550.160	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	730,000.000	787,887.540	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,320,000.000	1,623,087.840	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,390,000.000	1,624,538.870	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	2,110,000.000	1,982,450.500	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,518,656.700	
		BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,360,000.000	1,250,623.360	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,360,000.000	1,263,045.600	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,750,000.000	1,657,267.500	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	650,000.000	616,843.500	
		BUNDESOBL 04/05/24	1,260,000.000	1,225,356.300	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	550,000.000	534,748.500	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,840,000.000	2,762,240.800	
		BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,531,254.270	
		BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,500,000.000	1,460,805.000	
		BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	60,000.000	58,685.400	
		BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	1,250,000.000	1,215,912.500	
		BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	900,000.000	875,232.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,820,000.000	1,584,564.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,540,000.000	1,314,051.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,580,000.000	1,317,770.560	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,660,000.000	1,273,502.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,580,000.000	1,187,954.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,630,000.000	2,267,954.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	590,000.000	509,004.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,890,000.000	1,597,333.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	676,612.710	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,230,000.000	1,296,974.690	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	710,000.000	413,773.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,040,000.000	585,780.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,477,456.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,060,000.000	1,840,793.340	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,983,641.600	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,080,000.000	1,879,275.840	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,570,000.000	1,429,642.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,840,891.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,840,000.000	1,761,855.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,440,000.000	1,339,732.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,910,000.000	1,793,923.570	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	1,980,000.000	1,847,205.830	

		DEUTSCHLAND 08/15/29	1,990,000.000	1,750,304.500	
		DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	350,000.000	296,184.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,820,000.000	1,790,916.400	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,362,041.000	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,040,000.000	1,730,660.520	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,520,000.000	1,509,481.600	
		DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,130,000.000	1,099,614.300	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,430,000.000	1,424,974.980	
		DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	400,000.000	377,716.000	
		DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	800,000.000	807,128.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,810,000.000	1,940,392.400	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,170,000.000	2,349,552.310	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,565,848.900	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,830,000.000	2,243,645.880	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,900,000.000	2,439,866.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	160,000.000	183,494.400	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,320,000.000	1,685,758.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	1,935,831.300	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,520,000.000	1,921,188.800	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,539,354.800	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	910,000.000	953,143.100	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	1,002,424.800	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	1,019,354.000	
		FINLAND 0.0 09/15/24	270,000.000	260,592.930	
		FINLAND 0.0 09/15/26	460,000.000	422,303.000	
		FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	173,229.420	
		FINLAND 0.125 04/15/36	290,000.000	204,875.760	
		FINLAND 0.125 04/15/52	280,000.000	142,082.360	
		FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	243,663.600	
		FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	187,170.640	
		FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	435,379.420	
		FINLAND 0.5 04/15/43	290,000.000	188,541.310	
		FINLAND 0.5 09/15/27	420,000.000	384,823.480	
		FINLAND 0.5 09/15/28	540,000.000	484,666.620	
		FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	262,753.200	
		FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	173,755.400	
		FINLAND 0.875 09/15/25	330,000.000	318,749.310	
		FINLAND 1.125 04/15/34	580,000.000	489,225.810	
		FINLAND 1.375 04/15/27	90,000.000	86,459.850	

		FINLAND 1.375 04/15/47	310,000.000	241,529.370	
		FINLAND 2.0 04/15/24	370,000.000	370,375.920	
		FINLAND 2.625 07/04/42	440,000.000	428,527.880	
		FINLAND 2.75 07/04/28	540,000.000	550,265.940	
		FINLAND 4.0 07/04/25	310,000.000	325,330.380	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,620,000.000	1,576,323.180	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,990,000.000	1,893,701.910	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,910,000.000	2,713,417.860	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,450,000.000	2,234,814.050	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,290,000.000	2,615,879.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,890,000.000	2,471,845.900	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,480,000.000	2,897,907.360	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,646,345.600	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,620,000.000	2,428,855.280	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,430,000.000	2,332,606.370	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,260,000.000	3,077,593.220	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,218,560.650	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,650,000.000	1,124,060.850	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	346,106.900	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,150,000.000	726,898.900	
		FRANCE OAT 0.75 02/25/28	1,620,000.000	1,500,768.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	6,110,000.000	5,646,251.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,040,000.000	1,217,196.600	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,050,000.000	1,198,868.700	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,400,000.000	3,119,357.200	
		FRANCE OAT 03/25/24	3,020,000.000	2,933,984.360	
		FRANCE OAT 03/25/25	3,320,000.000	3,155,412.660	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,360,000.000	2,242,146.320	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,650,196.500	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,860,000.000	2,461,933.760	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,490,000.000	2,071,431.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,780,000.000	3,555,570.060	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,970,000.000	1,479,962.500	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	746,917.520	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,070,000.000	1,797,277.500	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,380,000.000	2,362,214.260	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,651,850.850	
		FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,300,000.000	1,242,859.800	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,503,204.240	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,050,000.000	3,108,190.950	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,490,000.000	3,586,380.520	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,030,000.000	2,161,462.800	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,000,000.000	3,136,200.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,140,000.000	1,406,418.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,170,000.000	1,462,998.300	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,225,533.080	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,257,160.720	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,980,000.000	2,396,231.640	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,360,000.000	2,810,868.560	

		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,229,988.480	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,408,832.370	
		IRISH 0.0 10/18/31	770,000.000	622,623.920	
		IRISH 0.2 05/15/27	520,000.000	476,704.280	
		IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	465,772.450	
		IRISH 0.35 10/18/32	400,000.000	325,858.400	
		IRISH 0.4 05/15/35	390,000.000	296,449.140	
		IRISH 0.55 04/22/41	140,000.000	93,681.420	
		IRISH 0.9 05/15/28	570,000.000	528,040.590	
		IRISH 1.0 05/15/26	800,000.000	770,947.200	
		IRISH 1.1 05/15/29	790,000.000	733,627.180	
		IRISH 1.3 05/15/33	390,000.000	344,976.640	
		IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	334,805.760	
		IRISH 1.5 05/15/50	470,000.000	353,896.370	
		IRISH 1.7 05/15/37	400,000.000	348,111.790	
		IRISH 2.0 02/18/45	740,000.000	638,406.880	
		IRISH 2.4 05/15/30	590,000.000	594,067.460	
		IRISH 3.4 03/18/24	390,000.000	396,564.870	
		IRISH 5.4 03/13/25	720,000.000	773,184.960	
		ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	971,390.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	850,000.000	767,550.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,400,000.000	1,352,120.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,250,000.000	1,115,875.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,460,000.000	1,396,271.000	
		ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,290,300.000	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,237,496.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,800,000.000	1,711,589.990	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,200,000.000	995,460.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,487,226.230	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	936,650.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,020,000.000	779,873.430	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,310,000.000	1,195,178.500	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	910,000.000	724,457.370	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,080,000.000	723,276.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,380,000.000	1,063,566.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,102,410.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,180,000.000	1,061,174.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	1,015,430.000	
		ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,006,610.000	
		ITALY BTPS 1.2 08/15/25	360,000.000	343,836.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,530,000.000	1,425,020.580	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,750,000.000	1,493,308.250	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	823,648.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,491,066.500	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,019,272.700	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	503,820.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,460,000.000	1,413,827.950	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,350,000.000	1,287,090.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,690,000.000	1,405,509.810	

		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,492,547.640	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,020,000.000	626,925.660	
		ITALY BTPS 1.75 05/30/24	360,000.000	355,640.400	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,185,296.400	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	803,275.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	980,991.000	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,400,000.000	1,364,860.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,350,000.000	1,265,287.500	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,200,000.000	1,168,896.000	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	3,000,000.000	2,849,028.000	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	890,000.000	861,279.840	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	222,264.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	340,221.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,290,000.000	1,238,529.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	860,000.000	694,880.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,143,907.060	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	837,545.000	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,350,000.000	1,335,881.700	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,634,428.270	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	840,000.000	739,006.800	
		ITALY BTPS 2.65 12/01/27	220,000.000	212,542.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,080,000.000	851,904.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	515,200.000	
		ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,144,680.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,040,000.000	1,974,230.400	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,360,000.000	1,957,620.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,560,407.170	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,580,000.000	1,365,767.800	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	534,540.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	1,026,448.960	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,020,000.000	939,547.500	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,066,949.240	
		ITALY BTPS 3.5 01/15/26	300,000.000	303,630.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,870,000.000	1,862,966.360	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,654,207.920	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	850,000.000	808,752.900	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,140,000.000	1,127,574.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,710,000.000	1,752,378.930	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,910,000.000	2,003,399.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,799,187.600	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,194,745.380	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	560,000.000	588,894.320	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,799,108.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	830,000.000	906,028.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,550,000.000	1,694,925.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,740,000.000	1,932,270.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,460,000.000	1,674,620.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,893,912.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,510,000.000	1,740,275.000	

		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	406,105.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,270,000.000	1,347,800.200	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/26	640,000.000	599,984.070	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,084,770.460	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	910,000.000	797,355.650	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	383,246.600	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,000,000.000	534,779.000	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	595,077.000	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	700,000.000	582,001.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,260,000.000	1,203,948.070	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	860,000.000	759,703.360	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,210,000.000	891,278.740	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,160,000.000	1,099,100.000	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/32	200,000.000	169,413.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,093,971.640	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,240,000.000	1,152,096.400	
		NETHERLANDS 01/15/24	890,000.000	869,654.600	
		NETHERLANDS 2.0 01/15/54	270,000.000	254,562.750	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,440,000.000	1,440,912.960	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,131,109.980	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,430,000.000	1,554,392.840	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,280,000.000	1,545,180.910	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,190,000.000	1,417,409.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	780,000.000	897,312.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,334,270.000	
		SPAIN 0.0 01/31/26	1,470,000.000	1,364,565.720	
		SPAIN 0.0 01/31/27	1,430,000.000	1,290,932.500	
		SPAIN 0.0 01/31/28	1,160,000.000	1,005,488.000	
		SPAIN 0.0 05/31/24	1,260,000.000	1,217,865.600	
		SPAIN 0.0 05/31/25	670,000.000	632,168.450	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,080,000.000	861,300.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	1,080,000.000	1,045,712.160	
		SPAIN 0.5 04/30/30	1,500,000.000	1,278,736.500	
		SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,335,755.400	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,332,792.180	
		SPAIN 0.7 04/30/32	1,550,000.000	1,269,140.000	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,750,000.000	1,602,562.500	
		SPAIN 0.8 07/30/29	700,000.000	610,260.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	730,000.000	521,164.520	
		SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	362,556.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,240,000.000	712,198.960	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	894,838.140	
		SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,563,800.000	

		SPAIN 1.3 10/31/26	1,730,000.000	1,663,021.320	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,170,000.000	1,100,843.640	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,070,000.000	1,003,660.000	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,400,000.000	1,303,296.400	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,560,000.000	1,484,196.480	
		SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	216,375.450	
		SPAIN 1.5 04/30/27	2,210,000.000	2,126,351.500	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,606,637.210	
		SPAIN 1.85 07/30/35	1,640,000.000	1,418,919.800	
		SPAIN 1.9 10/31/52	670,000.000	473,957.330	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,330,000.000	1,313,555.880	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,673,124.360	
		SPAIN 2.15 10/31/25	1,710,000.000	1,706,901.480	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,470,000.000	1,382,535.000	
		SPAIN 2.55 10/31/32	1,020,000.000	979,330.560	
		SPAIN 2.7 10/31/48	1,190,000.000	1,049,043.310	
		SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,557,067.820	
		SPAIN 2.9 10/31/46	1,180,000.000	1,097,246.600	
		SPAIN 3.45 07/30/43	250,000.000	250,197.500	
		SPAIN 3.45 07/30/66	880,000.000	871,436.720	
		SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,502,190.790	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,500,000.000	1,672,006.500	
		SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,133,069.130	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,135,000.000	1,207,728.530	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,630,000.000	1,951,762.000	
		SPAIN 4.8 01/31/24	1,300,000.000	1,339,683.800	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,290,000.000	1,573,155.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	2,570,000.000	2,894,334.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	870,000.000	1,115,062.470	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,615,000.000	2,011,443.740	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,839,637.560	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,460,000.000	1,750,613.870	
	ユーロ　小計		447,987,000.000 (64,693,802,670)	422,452,988.380 (61,006,436,052)	
国債証券　合計			198,902,417,135 (198,902,417,135)	180,473,238,873 (180,473,238,873)	
合計				180,473,238,873 (180,473,238,873)	

（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	253銘柄	50.33	50.88
イギリス・ポンド	国債証券	53銘柄	4.63	4.68
イスラエル・シュケル	国債証券	12銘柄	0.36	0.37

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	28銘柄	3.35	3.39
カナダ・ドル	国債証券	39銘柄	2.10	2.12
シンガポール・ドル	国債証券	19銘柄	0.45	0.45
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.24	0.25
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.35	0.36
ニュージーランド・ドル	国債証券	12銘柄	0.18	0.18
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	0.41	0.41
マレーシア・リンギット	国債証券	28銘柄	0.49	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.85	0.86
ユーロ	国債証券	355銘柄	33.43	33.80

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,573,862,542
投資証券	207,970,081,150
未収入金	519,394,187
未収配当金	1,874,185,801
前払金	166,628,100
差入委託証拠金	266,418,000
流動資産合計	213,370,569,780
資産合計	213,370,569,780
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	90,932,670
未払解約金	38,760,000
流動負債合計	129,692,670
負債合計	129,692,670
純資産の部	
元本等	
元本	87,353,406,924
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	125,887,470,186
元本等合計	213,240,877,110
純資産合計	213,240,877,110
負債純資産合計	213,370,569,780

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年11月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	74,422,264,176円
同期中追加設定元本額	47,209,153,042円
同期中一部解約元本額	34,278,010,294円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	193,421円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	1,246,203円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	4,228,222円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	2,207,583円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	1,349,739円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	2,279,210円
たわらノーロード　国内リート	5,227,291,865円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	1,178,906,629円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,910,708,314円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	33,127,532円
たわらノーロード　バランス（標準型）	627,397,754円
たわらノーロード　バランス（積極型）	694,709,106円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	140,948,641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）	378,610,214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）	227,333,339円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	288,881,954円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,301,931円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	38,019,549円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,233,452円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,011,782円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,475,526円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	439,818,465円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,270,803円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	125,636,380円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	192,208,080円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	346,056,332円
投資のソムリエ	13,373,726,138円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	925,811,977円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	144,964,707円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	835,802,652円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,803,911,929円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	30,653,676円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	15,347,586円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,704,697円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	139,458,280円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	224,059,883円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	109,689,684円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	40,458,648円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	15,738,616円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	10,226,054円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,947,882円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	59,980,569円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１２１２（適格機関投資家限定）	78,312,971円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１４０１（適格機関投資家限定）	708,261,061円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	760,808円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）２０－０４（適格機関投資家限定）	43,663,130円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	708,067円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	31,251,187円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	551,421円
固定比率マルチアセット戦略ファンド（米ドル建日本政府保証債活用型）（適格機関投資家限定）	178,193,287円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	34,420,595円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）２１－０３（適格機関投資家限定）	187,533,873円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	527,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	2,869,206円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０５（適格機関投資家限定）	75,670,901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）	124,733,821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）	87,478,489円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	34,362,622円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	588,327円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０９（適格機関投資家限定）	87,230,616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）	125,377,020円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	53,295,408円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,508,954,808円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	346,550,232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）	40,425,243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）	582,062,507円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,014,158円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	7,309,127円
日米資産配分戦略ファンド（ＴＩＰＳ活用型）（為替ヘッジ比率調整型）（適格機関投資家限定）	84,699,539円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	10,037,521円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,316,034,226円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,809,013,690円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	37,420,490,581円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,640,571,344円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ファンドラップ）	98,482,890円
計	87,353,406,924円
２．　受益権の総数	87,353,406,924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　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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11月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△1,889,618,909
合計	△1,889,618,909

（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6月7日から2022年11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2022年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	4,701,576,600	－	4,610,901,000	△90,675,600
合計	4,701,576,600	－	4,610,901,000	△90,675,600

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4411円 (24,411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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	7,287	1,499,664,600	
	ＧＬＰ投資法人	60,731	9,504,401,500	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	18,087	2,633,467,200	
	Ｏｎｅリート投資法人	3,282	817,218,000	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	8,796	1,243,754,400	
	いちごオフィスリート投資法人	15,417	1,348,987,500	
	いちごホテルリート投資法人	3,117	326,349,900	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	9,934	4,346,125,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	18,813	6,462,265,500	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	8,202	1,209,795,000	
	イオンリート投資法人	20,828	3,372,053,200	
	インヴィンシブル投資法人	82,815	3,834,334,500	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,825	444,465,000	
	オリックス不動産投資法人	37,490	7,141,845,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	12,890	1,469,460,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	10,948	3,755,164,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	13,495	2,900,075,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	8,180	2,213,508,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	8,753	2,774,701,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,891	584,963,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	6,027	565,332,600	
	ザイマックス・リート投資法人	3,052	371,733,600	

	ジャパン・ホテル・リート投資法人	60,677	4,550,775,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	17,261	2,368,209,200	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	18,816	11,590,656,000	
	スターアジア不動産投資法人	23,493	1,317,957,300	
	スターツプロシード投資法人	3,261	775,139,700	
	タカラレーベン不動産投資法人	8,241	834,813,300	
	トーセイ・リート投資法人	4,174	565,159,600	
	ヒューリックリート投資法人	17,604	3,054,294,000	
	フロンティア不動産投資法人	6,981	3,658,044,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	4,639	893,935,300	
	マリモ地方創生リート投資法人	2,350	321,950,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	42,357	6,611,927,700	
	ラサールロジポート投資法人	23,034	3,802,913,400	
	阪急阪神リート投資法人	8,499	1,309,695,900	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7,433	3,761,098,000	
	三菱地所物流リート投資法人	6,464	2,970,208,000	
	産業ファンド投資法人	28,118	4,512,939,000	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	4,415	628,254,500	
	森トラスト総合リート投資法人	13,447	1,992,845,400	
	森ヒルズリート投資法人	22,126	3,571,136,400	
	星野リゾート・リート投資法人	3,291	2,300,409,000	
	積水ハウス・リート投資法人	57,180	4,608,708,000	
	大江戸温泉リート投資法人	3,037	205,604,900	
	大和ハウスリート投資法人	28,362	8,749,677,000	
	大和証券オフィス投資法人	3,933	2,682,306,000	
	大和証券リビング投資法人	26,073	3,084,435,900	
	投資法人みらい	22,859	1,093,803,150	
	東海道リート投資法人	2,281	277,597,700	
	東急リアル・エステート投資法人	12,615	2,665,549,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人	6,497	4,086,613,000	
	日本ビルファンド投資法人	21,950	14,443,100,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	12,868	5,076,426,000	
	日本プロロジスリート投資法人	30,831	10,020,075,000	
	日本リート投資法人	6,112	2,249,216,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	12,687	4,154,992,500	
	日本都市ファンド投資法人	94,935	10,309,941,000	
	福岡リート投資法人	9,731	1,669,839,600	
	平和不動産リート投資法人	12,859	2,030,436,100	
	野村不動産マスターファンド投資法人	60,845	10,349,734,500	
投資証券　合計		1,119,196	207,970,081,150	

合計		207,970,081,150	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	91,659,470
コール・ローン	131,379,214
投資信託受益証券	6,622,105,697
投資証券	61,509,025,010
未収入金	1,532,507
未収配当金	73,358,692
流動資産合計	68,429,060,590
資産合計	68,429,060,590
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,074,433
未払金	40,077,320
未払解約金	6,207,000
流動負債合計	47,358,753
負債合計	47,358,753
純資産の部	
元本等	
元本	39,946,447,436
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	28,435,254,401
元本等合計	68,381,701,837
純資産合計	68,381,701,837
負債純資産合計	68,429,060,590

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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11月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	33,426,474,476円
同期中追加設定元本額	39,902,696,456円
同期中一部解約元本額	33,382,723,496円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	75,892,592円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	32,526,684円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,178,961円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	20,611,085円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	70,921,474円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	36,365,657円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	22,226,109円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	37,254,409円
たわらノーロード　先進国リート	14,498,662,120円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,774,874,722円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	292,660,057円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,760,018,526円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	23,687,212円

たわらノーロード　バランス（標準型）	447,241,259円
たわらノーロード　バランス（積極型）	915,991,632円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	2,849,915円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	202,243,692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）	217,486,563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）	370,204,154円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	126,975円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	20,309,202円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,619,003円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	14,260,284円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	1,483,680,658円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	14,409,019円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	508,628,309円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	42,883,778円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	180,444,921円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	277,205,835円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	510,611,336円
投資のソムリエ	7,972,053,914円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	551,356,685円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	211,167,541円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	489,016,603円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,241,865,276円
ワールドアセットバランス（基本コース）	340,900,854円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	177,581,303円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	17,663,397円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	8,826,299円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,331,254円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	86,656,991円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	169,200,023円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	159,550,838円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	21,087,815円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	9,078,922円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	5,878,277円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,112,283円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	259,405,069円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	276,738,773円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	983,915円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	656,048円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	459,027円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	583,400円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	826,526円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	692,408円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	206,175,617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）	5,711,696円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,380,735円

リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	4,351,968円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	5,876,951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）	78,345,476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）	186,651,533円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,376,965,572円
ＤＩＡＭ海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	213,238,304円
計	39,946,447,436円
２．　受益権の総数	39,946,447,436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　2022年5月12日 至　2022年11月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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11月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	△253,000,609
投資証券	△365,659,356
合計	△618,659,965

（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6月23日から2022年11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	41,226,680	－	40,152,247	△1,074,433
アメリカ・ドル	36,430,000	－	35,455,875	△974,125
ユーロ	2,932,380	－	2,887,852	△44,528
香港・ドル	1,864,300	－	1,808,520	△55,780
合計	41,226,680	－	40,152,247	△1,074,433

（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11月11日現在

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7118円 (17,118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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	96,300.000	56,817.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	309,900.000	164,247.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	645,800.000	232,488.000	
		PRIME US REIT	238,000.000	111,860.000	
	アメリカ・ドル　小計		1,362,700.000	565,412.000 (80,215,000)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	149,481.000	402,103.890	
		ARENA REIT	125,752.000	487,917.760	
		BWP TRUST	184,333.000	735,488.670	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	269,403.000	457,985.100	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	195,918.000	574,039.740	
		CENTURIA OFFICE REIT	170,806.000	263,041.240	
		CHARTER HALL GROUP	176,176.000	2,300,858.560	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	244,528.000	1,044,134.560	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	197,672.000	786,734.560	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	122,555.000	406,882.600	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	516,778.000	366,912.380	
		DEXUS	399,704.000	3,069,726.720	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	78,918.000	217,813.680	
		GDI PROPERTY GROUP	210,436.000	162,035.720	
		GOODMAN GROUP	636,039.000	10,958,951.970	
		GPT GROUP	711,997.000	3,061,587.100	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	114,912.000	371,165.760	
		HEALTHCO REIT	92,113.000	129,879.330	
		HOME CONSORTIUM LTD	75,942.000	359,965.080	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	593,199.000	744,464.740	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,699.000	229,203.890	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	132,240.000	515,736.000	
		MIRVAC GROUP	1,466,840.000	3,095,032.400	

		NATIONAL STORAGE REIT	404,675.000	987,407.000	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	140,343.000	103,152.100	
		RURAL FUNDS GROUP	141,590.000	346,895.500	
		SCENTRE GROUP	1,944,791.000	5,639,893.900	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	419,075.000	1,106,358.000	
		STOCKLAND	887,085.000	3,166,893.450	
		VICINITY CENTRES	1,438,828.000	2,812,908.740	
		WAYPOINT REIT LTD	263,507.000	727,279.320	
オーストラリア・ドル　小計			12,579,335.000	45,632,449.460 (4,270,284,619)	
シンガポール・ドル		AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	201,395.000	245,701.900	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	754,316.000	716,600.200	
		CAPITALAND CHINA TRUST	423,480.000	419,245.200	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,869,009.000	3,551,117.100	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	1,247,860.000	3,244,436.000	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	307,200.000	365,568.000	
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	224,800.000	133,756.000	
		EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	49,456.000	
		ESR LOGOS REIT	2,141,040.000	749,364.000	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	393,900.000	238,309.500	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	520,200.000	130,050.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	399,900.000	775,806.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,079,464.000	1,219,794.320	
		KEPPEL DC REIT	497,700.000	890,883.000	
		KEPPEL REIT	756,800.000	662,200.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	673,000.000	457,640.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	742,320.000	1,618,257.600	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,199,520.000	1,811,275.200	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	860,400.000	1,350,828.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	910,555.000	295,930.370	
		PARKWAY LIFE REIT	138,900.000	558,378.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	207,400.000	147,254.000	
		SPH REIT	394,200.000	339,012.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	553,000.000	282,030.000	

		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	840,390.000	1,109,314.800	
	シンガポール・ドル　小計		17,449,149.000	21,362,207.190 (2,190,694,347)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	133,740.000	211,309.200	
	ユーロ　小計		133,740.000	211,309.200 (30,515,162)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	542,000.000	2,785,880.000	
	香港・ドル　小計		542,000.000	2,785,880.000 (50,396,569)	
投資信託受益証券　合計			32,066,924	6,622,105,697 (6,622,105,697)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	35,926.000	545,715.940	
		AGREE REALTY CORP	29,664.000	2,089,235.520	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	27,741.000	570,909.780	
		ALEXANDER'S INC.	801.000	191,334.870	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	55,538.000	8,529,526.040	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,698.000	86,819.040	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	19,859.000	574,123.690	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	113,354.000	3,684,005.000	
		AMERICOLD REALTY TRUST	100,618.000	2,977,286.620	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	57,270.000	2,189,432.100	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	54,917.000	427,254.260	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	79,318.000	1,296,056.120	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	25,069.000	303,585.590	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	78,923.640	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	52,293.000	8,984,983.260	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,188.000	27,074.520	
		BOSTON PROPERTIES INC	53,430.000	4,032,896.400	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20,173.000	80,288.540	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	61,450.000	417,245.500	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	111,263.000	2,526,782.730	
		BROADSTONE NET LEASE INC	64,619.000	1,137,294.400	
		BRT APARTMENTS CORP	4,220.000	91,025.400	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	39,888.000	4,634,985.600	
		CARETRUST REIT INC	36,853.000	734,480.290	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	9,033.000	261,324.690	

CENTERSPACE	5,510.000	360,354.000	
CHATHAM LODGING TRUST	19,111.000	246,149.680	
CITY OFFICE REIT INC	15,657.000	153,908.310	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	35,958.020	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,646.000	301,053.720	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	41,972.000	1,165,562.440	
COUSINS PROPERTIES INC	56,428.000	1,435,528.320	
CTO REALTY GROUTH INC	5,120.000	103,577.600	
CUBESMART	84,107.000	3,517,354.740	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	80,005.000	715,244.700	
DIGITAL REALTY TRUST INC	107,462.000	11,669,298.580	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80,900.000	107,597.000	
DOUGLAS EMMETT INC	65,601.000	1,129,649.220	
EAST GROUP	16,170.000	2,645,735.400	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	34,578.000	557,743.140	
ELME COMMUNITIES	33,244.000	642,938.960	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	47,956.000	364,945.160	
EPR PROPERTIES	28,010.000	1,121,800.500	
EQUINIX INC	34,037.000	22,055,976.000	
EQUITY COMMONWEALTH	41,536.000	1,103,196.160	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	65,510.000	4,313,178.400	
EQUITY RESIDENTIAL	126,615.000	8,099,561.550	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	52,709.000	1,176,991.970	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24,375.000	5,327,400.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	50,081.000	8,167,710.290	
FARMLAND PARTNERS INC	17,744.000	248,948.320	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	27,326.000	2,925,794.820	
FIRST INDUSTRIAL RT	49,037.000	2,478,329.980	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	30,872.000	844,657.920	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,176.000	100,855.040	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	95,650.000	4,912,584.000	
GETTY REALTY CORP	15,326.000	506,064.520	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14,534.000	273,529.880	
GLADSTONE LAND CORP	11,727.000	257,876.730	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	22,924.000	220,528.880	
GLOBAL NET LEASE INC	37,405.000	483,646.650	

		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	142,812.000	2,957,636.520	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	202,017.000	5,121,130.950	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,525.000	134,032.750	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	39,267.000	1,176,046.650	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	267,621.000	4,851,968.730	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	49,184.000	567,091.520	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	82,641.000	1,463,572.110	
		INDUS REALTY TRUST INC	1,612.000	89,611.080	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	119,351.640	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,445.000	1,200,548.300	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	25,638.000	669,408.180	
		INVITATION HOMES INC	216,934.000	7,004,798.860	
		IRON MOUNTAIN INC	108,800.000	5,719,616.000	
		ISTAR INC	31,134.000	360,220.380	
		JBG SMITH PROPERTIES	37,752.000	750,509.760	
		KILROY REALTY CORP	39,130.000	1,708,415.800	
		KIMCO REALTY	231,540.000	5,165,657.400	
		KITE REALTY GROUP TRUST	81,547.000	1,772,831.780	
		LIFE STORAGE INC	31,621.000	3,453,013.200	
		LTC PROPERTIES INC	15,425.000	611,447.000	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	104,582.000	1,127,393.960	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	222,308.000	2,685,480.640	
		MID AMERICA	43,189.000	7,075,653.870	
		NATIONAL HEALTH INVS INC	16,699.000	961,528.420	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	66,458.000	3,021,180.680	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	31,798.000	1,303,400.020	
		NETSTREIT CORP	18,304.000	344,298.240	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,208.000	390,044.160	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17,765.000	277,666.950	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	87,868.000	2,810,897.320	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,609.000	136,018.250	
		ORION OFFICE REIT INC	21,073.000	206,515.400	
		PARAMOUNT GROUP INC	60,451.000	406,230.720	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	83,950.000	1,035,943.000	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	49,811.000	784,025.140	
PHILLIPS EDISON & CO INC	43,499.000	1,378,483.310	
PHYSICIANS REALTY TRUST	84,372.000	1,249,549.320	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	47,250.000	505,102.500	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,446.000	277,659.900	
POSTAL REALTY TRUST INC	5,420.000	86,178.000	
PROLOGIS INC	344,939.000	40,820,081.260	
PUBLIC STORAGE	59,046.000	17,879,719.260	
REALTY INCOME CORP	230,851.000	15,090,729.870	
REGENCY CENTERS CORP	57,710.000	3,823,864.600	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	47,307.000	729,473.940	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	64,101.000	3,719,781.030	
RLJ LODGING TRUST	61,727.000	732,699.490	
RPT REALTY	31,140.000	337,246.200	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	20,507.000	1,834,556.220	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	86,169.000	1,125,367.140	
SAFEHOLD INC	6,511.000	212,388.820	
SAUL CENTERS INC	4,804.000	205,419.040	
SERVICE PROPERTIES TRUST	62,996.000	486,329.120	
SIMON PROPERTY GROUP INC	122,372.000	14,689,534.880	
SITE CENTERS CORP	69,723.000	916,160.220	
SL GREEN	24,047.000	975,586.790	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	50,674.000	2,035,067.840	
STAG INDUSTRIAL INC	66,578.000	2,251,667.960	
STORE CAPITAL CORP	99,609.000	3,159,597.480	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38,921.000	323,822.720	
SUN COMMUNITIES INC	46,147.000	6,588,407.190	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	79,465.000	850,275.500	
TANGER FACTORY OUTLET	39,618.000	769,381.560	
TERRENO REALTY CORP	24,763.000	1,477,608.210	
THE MACERICH COMPANY	80,390.000	1,029,795.900	
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	46,893.000	308,555.940	
UDR INC	114,366.000	4,653,552.540	
UMH PROPERTIES INC	18,532.000	338,950.280	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,699.000	235,137.960	
URBAN EDGE PROPERTIES	44,675.000	671,465.250	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,191.000	210,614.620	

	VENTAS INC	149,586.000	6,710,427.960	
	VERIS RESIDENTIAL INC	30,360.000	459,954.000	
	VICI PROPERTIES INC	360,076.000	11,745,679.120	
	VORNADO REALTY TRUST	60,000.000	1,505,400.000	
	WELLTOWER INC	173,258.000	12,138,455.480	
	WHITESTONE REIT	16,382.000	154,154.620	
	WP CAREY INC	77,670.000	6,200,396.100	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	43,381.000	670,670.260	
アメリカ・ドル　小計		8,216,022.000	375,271,954.920 (53,239,832,245)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	162,134.000	85,768.880	
	AEW UK REIT PLC	58,660.000	53,908.540	
	ASSURA PLC	1,111,014.000	651,054.200	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	289,303.000	273,969.940	
	BIG YELLOW GROUP PLC	65,470.000	783,021.200	
	BRITISH LAND CO PLC	349,260.000	1,415,201.520	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	305,868.000	346,548.440	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	232,446.000	149,462.770	
	CUSTODIAN REIT PLC	149,817.000	134,985.110	
	DERWENT LONDON PLC	41,944.000	1,035,177.920	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	74,836.000	48,643.400	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	221,510.000	201,131.080	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	96,753.000	537,462.910	
	HAMMERSON PLC	1,294,519.000	310,684.560	
	HOME REIT PLC	286,621.000	246,494.060	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	160,660.000	169,335.640	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	279,312.000	1,767,486.330	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	367,573.000	724,853.950	
	LXI REIT PLC	641,403.000	810,733.390	
	NEWRIVER REIT PLC	124,025.000	90,414.220	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	213,675.000	190,170.750	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	503,577.000	604,795.970	
	PRS REIT PLC/THE	206,206.000	175,893.710	
	REGIONAL REIT LTD	168,230.000	107,667.200	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	78,966.000	759,258.090	

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	206,528.000	98,100.800	
	SEGRO PLC	452,866.000	3,884,684.540	
	SHAFTESBURY PLC	110,375.000	440,175.500	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	472,477.000	505,550.390	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	153,569.000	104,426.920	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	697,471.000	1,058,063.500	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	316,742.000	210,633.430	
	UNITE GROUP PLC	148,925.000	1,437,870.870	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	171,713.000	257,569.500	
	WAREHOUSE REIT PLC	156,027.000	190,352.940	
	WORKSPACE GROUP PLC	50,876.000	237,997.920	
イギリス・ポンド　小計		10,652,391.000	20,099,550.090 (3,326,877,531)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,208.000	431,244.140	
	REIT 1 LTD	66,499.000	1,242,201.320	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	85,547.000	780,188.640	
イスラエル・シュケル　小計		389,254.000	2,453,634.100 (100,035,889)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	24,008.000	624,208.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,633.000	176,454.510	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,337.000	100,961.070	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,165.000	419,109.450	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,285.000	136,958.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	55,214.340	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	31,697.000	1,377,551.620	
	CHOICE PROPERTIES REIT	60,510.000	850,165.500	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,845.000	299,447.050	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,186.000	310,813.200	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	44,860.000	536,525.600	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	9,013.000	144,208.000	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,876.000	55,773.120	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,195.000	689,344.250	

	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,076.000	926,470.720	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	46,816.000	561,323.840	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	16,854.090	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	25,307.000	315,325.220	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,565.000	347,137.200	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,096.000	117,715.840	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,458.000	104,102.960	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,304.000	123,409.120	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	42,192.000	477,191.520	
	PRIMARIS REIT	18,329.000	281,900.020	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,243.000	63,506.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	55,723.000	1,172,969.150	
	SLATE GROCERY REIT	11,204.000	172,765.680	
	SLATE OFFICE REIT	17,818.000	82,319.160	
	SMARTCENTRES REIT	26,752.000	762,699.520	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	35,658.000	789,824.700	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	14,758.000	90,171.380	
カナダ・ドル　小計		692,975.000	12,182,420.430 (1,295,356,764)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	329,282.000	383,613.530	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	398,171.000	808,287.130	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	568,732.000	491,953.180	
	PRECINCT PROPERTIES	485,406.000	587,341.260	
	STRIDE STAPLED GROUP	200,290.000	308,446.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	181,050.000	420,036.000	
ニュージーランド・ドル　小計		2,162,931.000	2,999,677.700 (255,392,559)	
ユーロ	AEDIFICA	14,873.000	1,227,766.150	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3,939.000	32,674.000	
	ALTAREA	1,836.000	244,555.200	
	CARE PROPERTY INVEST NV	10,525.000	176,609.500	
	CARMILA SA	20,795.000	292,377.700	
	COFINIMMO SA	11,221.000	1,023,355.200	
	COVIVIO	17,363.000	1,040,043.700	

	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,373.000	356,346.140	
	GECINA SA	20,215.000	1,962,876.500	
	HAMBORNER REIT AG	25,669.000	195,854.470	
	ICADE	12,266.000	491,621.280	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	19,492.000	61,887.100	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	110,515.000	644,302.450	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,821.000	194,062.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	149,598.000	171,140.110	
	KLEPIERRE	72,636.000	1,622,688.240	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	22,349.000	89,507.740	
	MERCIALYS	28,373.000	266,138.740	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	124,572.000	1,144,816.680	
	MONTEA SCA	4,768.000	331,852.800	
	NSI NV	6,797.000	180,120.500	
	RETAIL ESTATES	4,131.000	254,056.500	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	40,038.000	2,097,190.440	
	VASTNED RETAIL	6,847.000	145,841.100	
	WAREHOUSES DE PAUW	52,550.000	1,472,451.000	
	WERELDHAVE NV	15,800.000	207,928.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	7,591.000	238,357.400	
ユーロ　小計		828,953.000	16,166,420.640 (2,334,592,805)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,294.000	52,222,270.000	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	11,135.000	57,902,000.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	60,102.000	220,874,850.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,032.000	48,540,800.000	
	JR REIT XXVII	55,330.000	229,066,200.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	14,110.000	66,246,450.000	
	LOTTE REIT CO LTD	46,445.000	164,647,525.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	38,762.000	155,048,000.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	10,401.000	31,879,065.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,249.000	163,905,450.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9,851.000	35,562,110.000	
	SK REITS CO LTD	29,445.000	134,121,975.000	
韓国・ウォン　小計		326,156.000	1,360,016,695.000 (143,481,761)	

	香港・ドル	CHAMPION REIT	696,070.000	1,691,450.100	
		LINK REIT	790,720.000	40,287,184.000	
		PROSPERITY REIT	506,000.000	809,600.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	346,000.000	937,660.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	806,000.000	1,241,240.000	
	香港・ドル　小計		3,144,790.000	44,967,134.100 (813,455,456)	
投資証券　合計			26,413,472	61,509,025,010 (61,509,025,010)	
合計				68,131,130,707 (68,131,130,707)	

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

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券　5銘柄 投資証券　140銘柄	0.12 －	－ 77.86	78.26
イギリス・ポンド	投資証券　37銘柄	－	4.87	4.88
イスラエル・シュケル	投資証券　3銘柄	－	0.15	0.15
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券　31銘柄	6.24	－	6.27
カナダ・ドル	投資証券　31銘柄	－	1.89	1.90
シンガポール・ドル	投資信託受益証券　25銘柄	3.20	－	3.22
ニュージーランド・ドル	投資証券　6銘柄	－	0.37	0.37
ユーロ	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　27銘柄	0.04 －	－ 3.41	3.47
韓国・ウォン	投資証券　12銘柄	－	0.21	0.21
香港・ドル	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　5銘柄	0.07 －	－ 1.19	1.27

（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11月30日現在

Ⅰ　資産総額	432,674,821円
Ⅱ　負債総額	1,013,247円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	431,661,574円
Ⅳ　発行済数量	333,706,110口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2935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11月30日現在

Ⅰ　資産総額	380,051,320,278円
Ⅱ　負債総額	364,386,376円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	379,686,933,902円
Ⅳ　発行済数量	112,565,730,623口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3730円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	806,151,805,313円
Ⅱ　負債総額	111,633,456円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	806,040,171,857円
Ⅳ　発行済数量	131,081,515,784口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	6.1492円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	598,841,273,531円
Ⅱ　負債総額	10,422,250,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	588,419,023,531円
Ⅳ　発行済数量	469,322,917,415口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2538円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	186,145,623,224円
Ⅱ　負債総額	1,729,085,497円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	184,416,537,727円
Ⅳ　発行済数量	88,654,737,890口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0802円

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	213,659,770,699円
Ⅱ　負債総額	828,070,590円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	212,831,700,109円
Ⅳ　発行済数量	87,323,433,949口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4373円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年11月30日現在

Ⅰ　資産総額	**67,328,988,681円**
Ⅱ　負債総額	**246,372,714円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**67,082,615,967円**
Ⅳ　発行済数量	**40,159,266,084口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.6704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11月30日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2022年11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11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,412,515,586,826
追加型株式投資信託	802	14,533,579,135,759
単位型公社債投資信託	25	48,203,973,629
単位型株式投資信託	218	1,119,360,076,721
合計	1,071	17,113,658,772,935

３【委託会社等の経理状況】

１．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

２．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

３．委託会社は、第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、第38期中間会計期間（自2022年4月1日至2022年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：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。

(1) 中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第38期中間会計期間末 （2022年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		27,934
金銭の信託		29,712
未収委託者報酬		17,398
未収運用受託報酬		3,150
未収投資助言報酬		291
未収収益		16
前払費用		939
その他		2,564
流動資産計		82,009
固定資産		
有形固定資産		1,202
建物	※1	1,055
器具備品	※1	138
リース資産	※1	8
無形固定資産		4,948
ソフトウエア		3,151
ソフトウエア仮勘定		1,794
電話加入権		2
投資その他の資産		10,147
投資有価証券		182
関係会社株式		5,810
長期差入保証金		779
繰延税金資産		2,962
その他		411
固定資産計		16,298
資産合計		98,307

（単位：百万円）

	第38期中間会計期間末 （2022年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	959
リース債務	1
未払金	7,709
未払収益分配金	0
未払手数料	7,486
その他未払金	221
未払費用	9,245
未払法人税等	2,605
未払消費税等	719
契約負債	20
賞与引当金	866
役員賞与引当金	26
流動負債計	22,155
固定負債	
リース債務	7
退職給付引当金	2,600
時効後支払損引当金	108
固定負債計	2,716
負債合計	24,871
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	51,882
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,759
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,079
株主資本計	73,435
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△0
評価・換算差額等計	△0
純資産合計	73,435
負債・純資産合計	98,307

(2) 中間損益計算書

（単位：百万円）

		第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
営業収益			
委託者報酬		48,925	
運用受託報酬		7,371	
投資助言報酬		1,029	
その他営業収益		11	
営業収益計			57,336
営業費用			
支払手数料		20,939	
広告宣伝費		102	
公告費		0	
調査費		16,544	
調査費		5,756	
委託調査費		10,787	
委託計算費		277	
営業雑経費		371	
通信費		17	
印刷費		249	
協会費		34	
諸会費		20	
支払販売手数料		49	
営業費用計			38,235
一般管理費			
給料		4,691	
役員報酬		81	
給料・手当		4,561	
賞与		49	
交際費		4	
寄付金		4	
旅費交通費		48	
租税公課		243	
不動産賃借料		504	
退職給付費用		235	
固定資産減価償却費	※1	655	
福利厚生費		26	
修繕費		0	
賞与引当金繰入額		866	
役員賞与引当金繰入額		26	
機器リース料		0	
事務委託費		2,103	
事務用消耗品費		18	
器具備品費		0	
諸経費		159	
一般管理費計			9,590
営業利益			9,510

（単位：百万円）

	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	6	
受取配当金	2,400	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	25	
為替差益	28	
雑収入	2	
営業外収益計		2,463
営業外費用		
金銭の信託運用損	530	
早期割増退職金	3	
雑損失	28	
営業外費用計		561
経常利益		11,411
特別利益		
投資有価証券売却益	4	
特別利益計		4
特別損失		
固定資産除却損	12	
投資有価証券売却損	9	
関係会社株式評価損	584	
特別損失計		605
税引前中間純利益		10,809
法人税、住民税及び事業税		2,457
法人税等調整額		129
法人税等合計		2,587
中間純利益		8,222

(3) 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	
						別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216
当中間期変動額							
剰余金の配当							△ 12,360
中間純利益							8,222
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額合計	－	－	－	－	－	－	△ 4,137
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	56,020	77,573	△0	△0	77,573
当中間期変動額					
剰余金の配当	△ 12,360	△ 12,360			△ 12,360
中間純利益	8,222	8,222			8,222
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)		－	△0	△0	△0
当中間期変動額合計	△ 4,137	△ 4,137	△0	△0	△ 4,137
当中間期末残高	51,882	73,435	△0	△0	73,435

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 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 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(リース資産を除く) 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物　…　8～18年 器具備品　…　2～20年 (2) 無形固定資産(リース資産を除く) 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）に基づく定額法によっております。 (3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする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、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 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中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
6. 重要な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2回又は4回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。 (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。

（会計方針の変更）

「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　2021年６月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27－２項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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しております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当中間財務諸表への影響はありません。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第38期中間会計期間末 （2022年9月30日現在）
※1.有形固定資産の減価償却累計額	建物　…　469百万円 器具備品　…　975百万円 リース資産　…　0百万円

（中間損益計算書関係）

項目	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）
※1.減価償却実施額	有形固定資産　…　74百万円 無形固定資産　…　580百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第38期中間会計期間末（2022年9月30日現在）

1.金融商品の時価等に関する事項

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額（百万円）	時価（百万円）	差額（百万円）
（1）金銭の信託	29,712	29,712	－
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	－
資産計	29,714	29,714	－

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

2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	－	29,712	－	29,712
投資有価証券	－	－	－	－
その他有価証券	－	1	－	1
資産計	－	29,714	－	29,714

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

区分	中間貸借対照表計上額 （百万円）
投資有価証券（その他有価証券）	
非上場株式	180
関係会社株式	
非上場株式	5,810

（有価証券関係）

第38期中間会計期間末
（2022年9月30日現在）

1.子会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額5,810百万円）で市場価格のあるものはありません。

2.その他有価証券

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

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額180百万円）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。

（持分法損益等）

当社は2022年８月１日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載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) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2022年4月1日から2022年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a.発生したのれんの金額	**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**

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

流動資産	－百万円
固定資産	72,873百万円
資産合計	72,873百万円
流動負債	－百万円
固定負債	4,223百万円
負債合計	4,223百万円
純資産	68,650百万円

（注）固定資産及び資産合計には、のれんの金額53,357百万円及び顧客関連資産の金額23,061百万円が含まれております。

（2）損益計算書項目

営業収益	－百万円
営業利益	△4,019百万円
経常利益	△4,019百万円
税引前中間純利益	△4,019百万円
中間純利益	△3,372百万円
1株当たり中間純利益	△84,308円98銭

（注）営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,114百万円が含まれております。

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1．収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）
委託者報酬	48,925百万円
運用受託報酬	7,338百万円
投資助言報酬	1,029百万円
成功報酬（注）	32百万円
その他営業収益	11百万円
合計	57,336百万円

（注）成功報酬は、中間損益計算書において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.重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

（セグメント情報等）

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

（１）サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

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。

（1株当たり情報）

第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,835,889円89銭
1株当たり中間純利益金額	205,562円11銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）
中間純利益金額	8,222百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	―
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,222百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)

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

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

(3) 通常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「販売会社一覧表」の通りです。

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

（注）資本金の額は2022年3月末日現在

(3) 投資顧問会社

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

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(6)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【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

２０２３年1月１３日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　　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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の２０２２年５月１２日から２０２２年１１月１１日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の２０２２年１１月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

独立監査人の中間監査報告書

２０２２年１１月２４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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	稲葉　宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の２０２２年４月１日から２０２３年３月３１日までの第３８期事業年度の中間会計期間（２０２２年４月１日から２０２２年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の２０２２年９月３０日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（２０２２年４月１日から２０２２年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

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

利害関係

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

以　上

（注１）上記の中間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データは中間監査の対象には含まれておりません。