# 【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4月11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　　杉原　規之 |
| 【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】 | ＤＩＡＭ ８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ |
| 【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】

ＤＩＡＭ ８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞
（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。
なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。
※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

＜基準価額の照会方法等＞
基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※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）

## （5）【申込手数料】

ありません。

**（６）【申込単位】**

**1口以上1口単位または1円以上1円単位(当初元本1口＝1円)**

**※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。**

**（７）【申込期間】**

**継続申込期間：2023年4月12日から2023年10月11日まで**

**※ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、香港証券取引所、韓国取引所、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、香港の銀行、韓国の銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。**

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

**（８）【申込取扱場所】**

**当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。**

**※販売会社は、以下の方法でご確認ください。**

**・委託会社への照会**

**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**

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

**（１１）【振替機関に関する事項】**

**ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。**

**株式会社証券保管振替機構**

**（１２）【その他】**

**お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。**

**当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。**

**当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。**
**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、委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。**
**なお、委託会社または販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。**

**○振替受益権について**
**ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。**
**ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。**

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

# 第二部【ファンド情報】

## 第１【ファンドの状況】

### １【ファンドの性格】

#### （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

②当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

## 1 主としてマザーファンド※1への投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券※2に投資します。

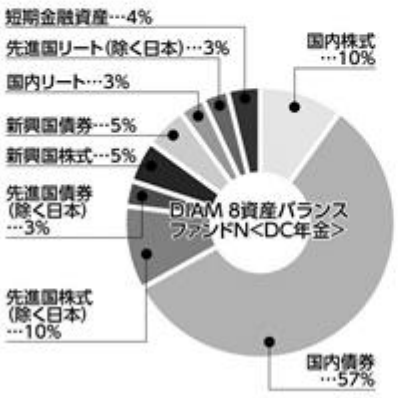
※1 当ファンドが投資するマザーファンドは下記のとおりです。(以下を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。)

| マザーファンド |
|---|
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・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 |
| 外国株式パッシブ・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 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド |
| エマージング債券パッシブ・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 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド |

※2 「不動産投資信託証券」(以下「リート(REIT)」という場合があります。)とは、不動産投資法人または不動産投資信託を総称した一般呼称です。多くの投資者から集めた資金などで、商業施設、マンション、倉庫などの様々な不動産を保有し、そこから生じる賃料収入等などが投資者に分配される商品をいいます。

## 2 次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。

<基本アロケーション>




※マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。
なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下のとおりです。

| 資産 | ベンチマーク |
|---|---|
| 国内株式 | 東証株価指数(TOPIX)(配当込み) |
| 国内債券 | NOMURA−BPI総合 |
| 先進国株式(除く日本) | 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) |
| 先進国債券(除く日本) | 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) |
| 新興国株式 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) |
| 新興国債券 | JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし) |
| 国内リート | 東証REIT指数(配当込み) |
| 先進国リート(除く日本) | 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) |
| 短期金融資産 | コール・ローン(オーバーナイト物) |

※合成ベンチマークとは、各資産ごとのベンチマークの騰落率を基本アロケーションに乗じて指数化したものです。

## 3 実質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。

## ■分配方針

年1回の決算時(毎年1月11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

**○商品分類表**

| 単位型投信<br>追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>（収益の源泉） | 補足分類 |
|---|---|---|---|
| 単位型投信<br><br>追加型投信 | 国　内<br>海　外<br>内　外 | 株　式<br>債　券<br>不動産投信<br>その他資産<br>（　　）<br>資産複合 | インデックス型<br>特　殊　型 |

（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。 |
| インデックス型 | 目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす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 | 対象インデックス |
|---|---|---|---|---|---|
| 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 | | | | 日経225 |
| 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 | | | ＴＯＰＩＸ |
| クレジット属性 | （毎月） | | | | |
| （　） | | オセアニア | | | |
| | 日々 | | | | |
| 不動産投信 | | 中南米 | ファンド・オ | なし | |
| | その他 | | ブ・ファンズ | | その他 |
| その他資産 | （　） | アフリカ | | | （合成ベンチ |
| （投資信託証券 | | | | | マーク） |
| （資産複合（株 | | 中近東 | | | |
| 式、債券、不動 | | （中東） | | | |
| 産投信）資産配 | | | | | |
| 分固定型）） | | エマージング | | | |
| | | | | | |
| 資産複合 | | | | | |
| （　　） | | | | | |
| 資産配分固定型 | | | | | |
| 資産配分変更型 | | | | | |

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

**○属性区分定義**

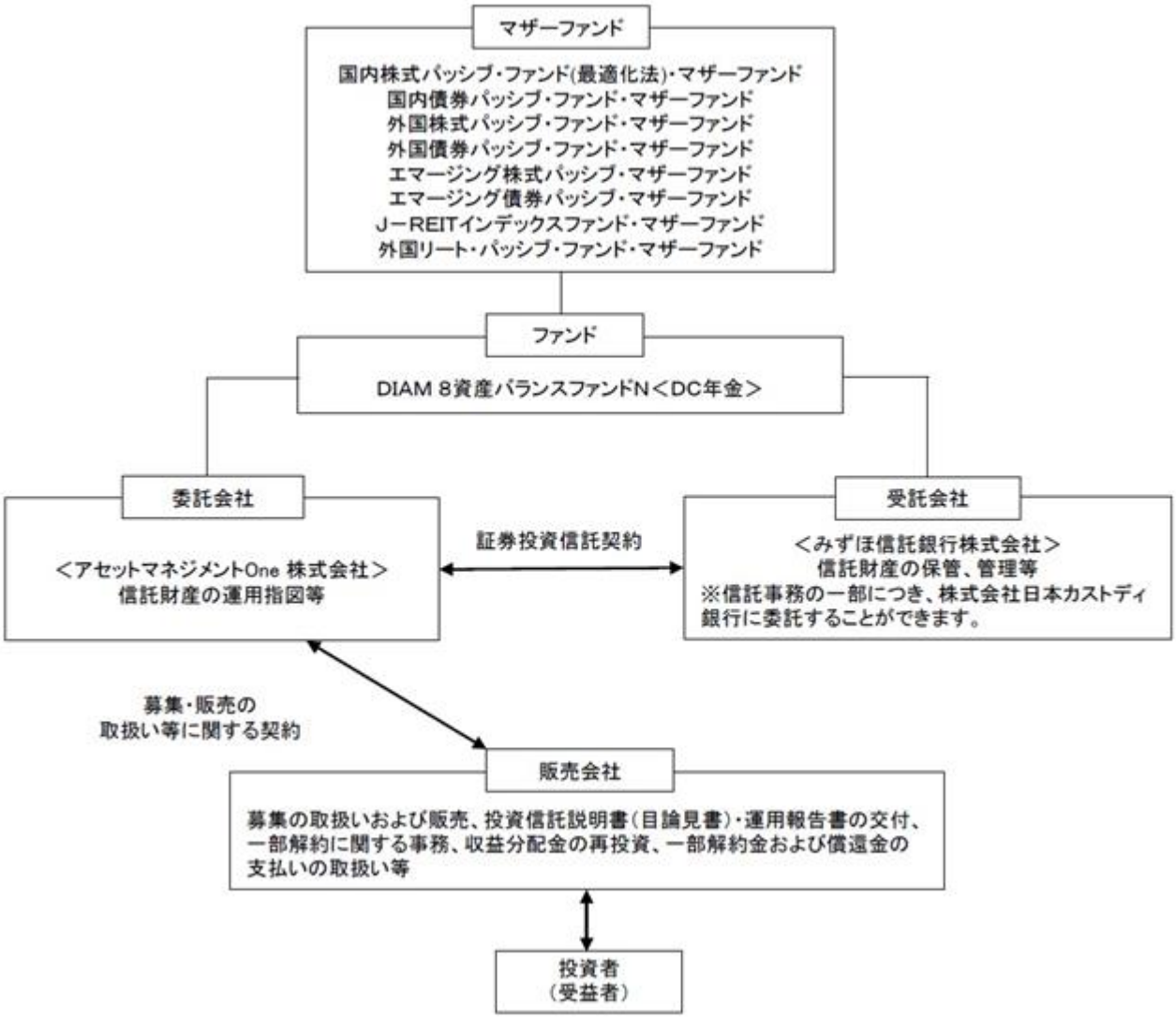
| | |
|---|---|
| その他資産<br>（投資信託証券<br>（資産複合<br>（株式、債券、<br>不動産投信）<br>資産配分固定型）） | 目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。<br>(注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型））に分類されます。 |
| 年1回 | 目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| グローバル<br>（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。 |
| その他 | 日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。 |

**※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】**

**2013年11月8日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始**

**（３）【ファンドの仕組み】**




**・「証券投資信託契約」の概要**

**委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。**

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

**・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要**

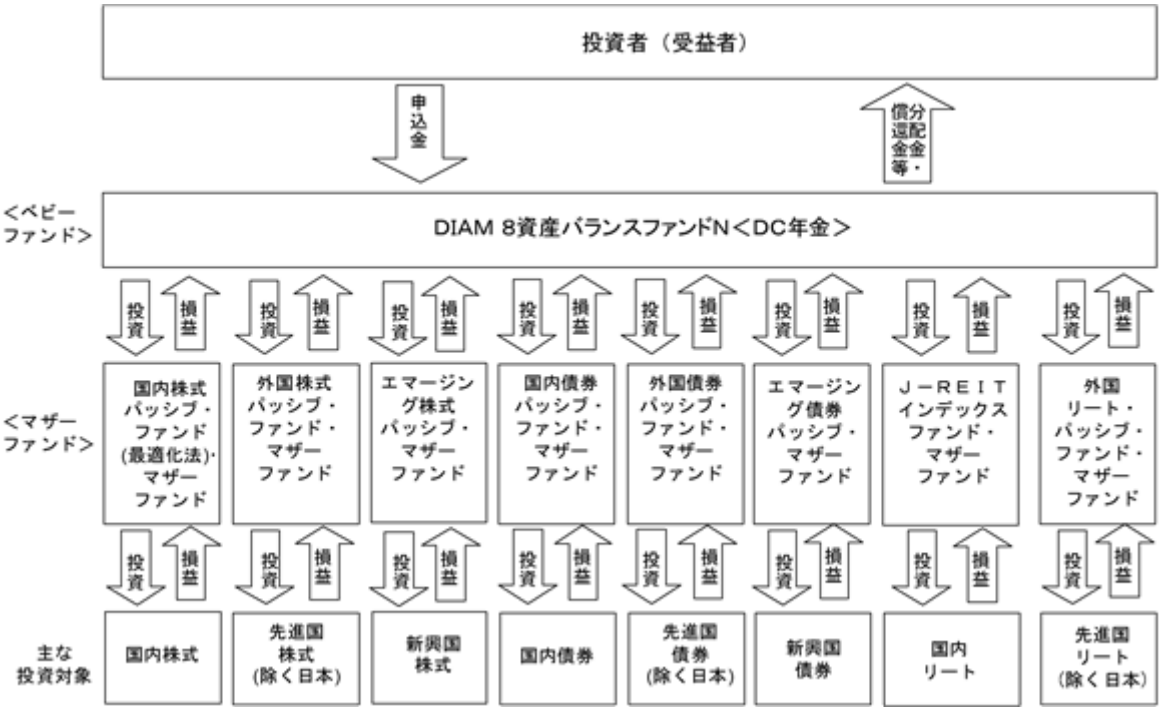
**委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結します。**

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

**●ファミリーファンド方式とは●**

**当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。**

**「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を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（2023年1月31日現在）**

**委託会社の沿革**

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

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

大株主の状況

（2023年1月31日現在）

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

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

＜投資対象＞

主として、以下のマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とします。

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.国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
3.外国株式パッシブ・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.エマージング株式パッシブ・マザーファンド
6.エマージング債券パッシブ・マザーファンド
7.Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
8.外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

＜投資態度＞

①主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。
②次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果を目指して運用を行います。

＜基本アロケーション＞

国内株式 10%+国内債券57%+先進国株式（除く日本） 10%+先進国債券（除く日本） 3%+新興国株式5%+新興国債券 5%+国内不動産投資信託証券 3%+先進国不動産投資信託証券3%+短期金融資産 4%

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下の通りです。

- 国内株式：東証株価指数(ＴＯＰＩＸ)(配当込み)
- 国内債券：ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合
- 先進国株式（除く日本）：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）
- 先進国債券（除く日本）：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）
- 新興国株式：ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）
- 新興国債券：ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）
- 国内ＲＥＩＴ：東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）
- 海外ＲＥＩＴ：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）
- 短期金融資産：コール・ローン（オーバーナイト物）

③マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。

④実質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。

⑤上記にかかわらず、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、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場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

■対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成ベンチマークに連動させるため、以下の対応を行います。

各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションとの乖離について乖離許容範囲を定めその範囲内に維持するよう運用を行うことにより、合成ベンチマークに概ね連動させます。なお、乖離距離範囲を超えた場合にはリバランスを実施いたします。

なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針　(2)投資対象　（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をご参照ください。

## （２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

**ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)**

**ハ.金銭債権**

**ニ.約束手形**

**2.次に掲げる特定資産以外の資産**

**イ.為替手形**

**②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）**

**委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・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、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・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、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド（以下それぞれを「各マザーファンド」または総称して「マザーファンド」ということがあります。）各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。**

**1．株券または新株引受権証書**

**2．国債証券**

**3．地方債証券**

**4．特別の法律により法人の発行する債券**

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

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

**7．投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。）**

**8．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。）**

**9．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。）**

**10.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。）**

**11.コマーシャル・ペーパー**

**12.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**

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

**14.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、振替受益権を含みます。)**

**15.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。）**

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

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

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

**19.外国法人が発行する譲渡性預金証書**

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

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

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

**23.外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの**

**なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。**

**③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）**

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

**1．預金**

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

**3．コール・ローン**

**4．手形割引市場において売買される手形**

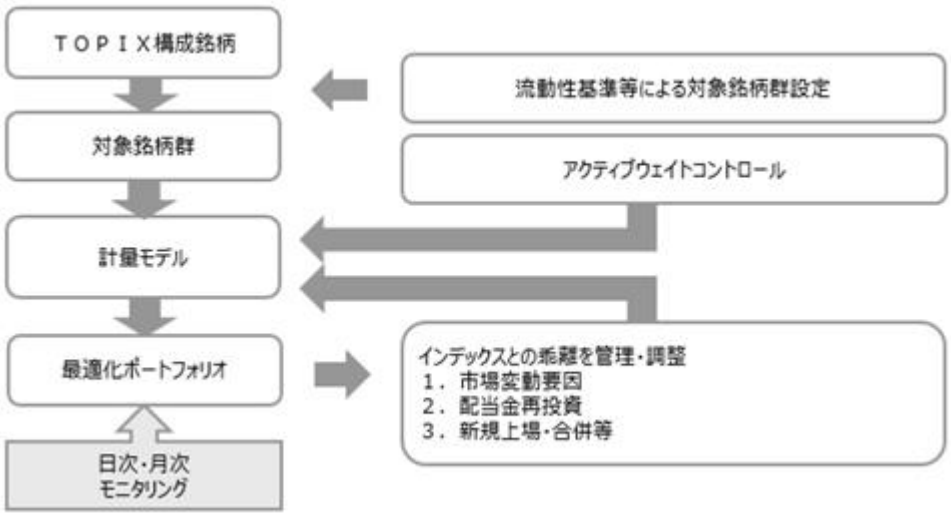
**5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの**

**6．外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの**

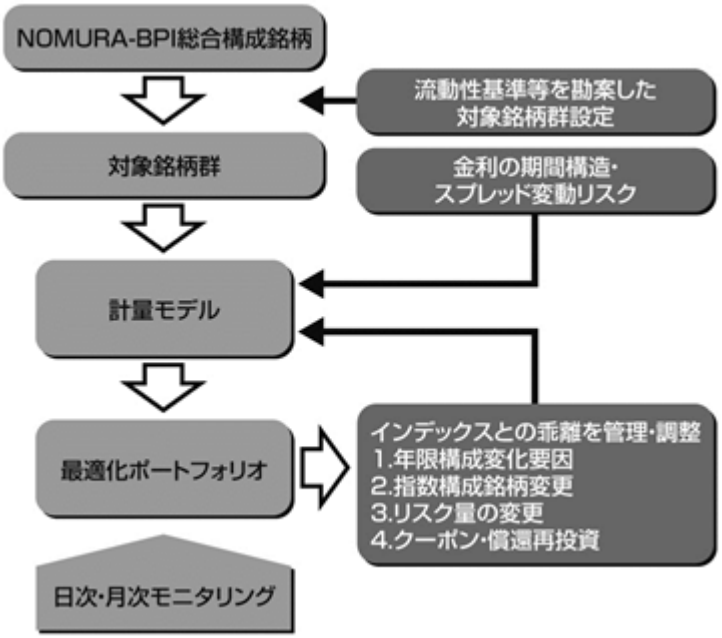
**（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要**

| | |
|---|---|
| ファンド名 | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド |
| 基本方針 | この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。 |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | 1.主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>※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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。 |

| | |
|---|---|
| 運用プロセス | 1.流動性基準等による対象銘柄群設定<br>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。<br>2.最適化法によるポートフォリオの構築<br>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。<br>3.インデックスとの乖離を管理<br>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。<br>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。<br>・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<br>・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<br>・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<br>  |
| 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。<br>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。<br>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。<br>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 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド |
| 基本方針 | この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | わが国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | 1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。<br>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。<br>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。<br>※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。 |

| | |
|---|---|
| 運用プロセス | **1.流動性基準等による対象銘柄群設定**<br>**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。**<br>**2.最適化法によるポートフォリオの構築**<br>**1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因**<br>**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**<br>**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。**<br>**3.インデックスとの乖離を管理**<br>**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。**<br>**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。**<br>**インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。**<br>**・年限構成変化要因　・指数構成銘柄変更**<br>**・リスク量の変更　・クーポン、償還再投資**<br>  |

| | |
|---|---|
| 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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。 |

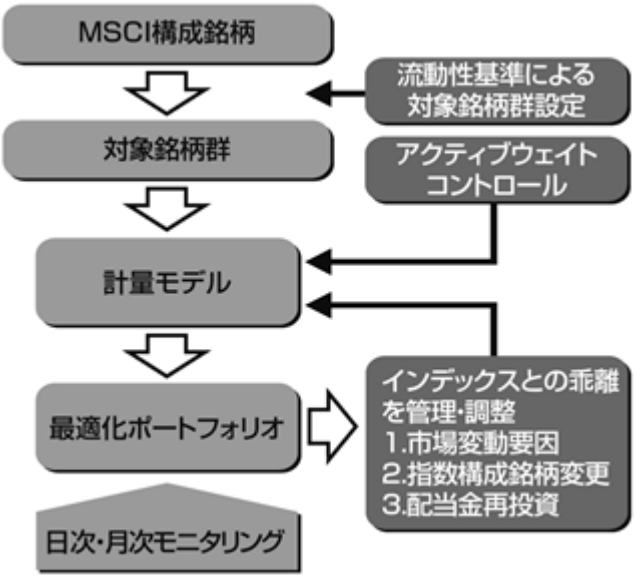
| | |
|---|---|
| ファンド名 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド |
| 基本方針 | この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 海外の株式を主要投資対象とします。 |

| | |
|---|---|
| **投資態度** | **1.主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。**<br>**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。**<br>**3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。** |

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

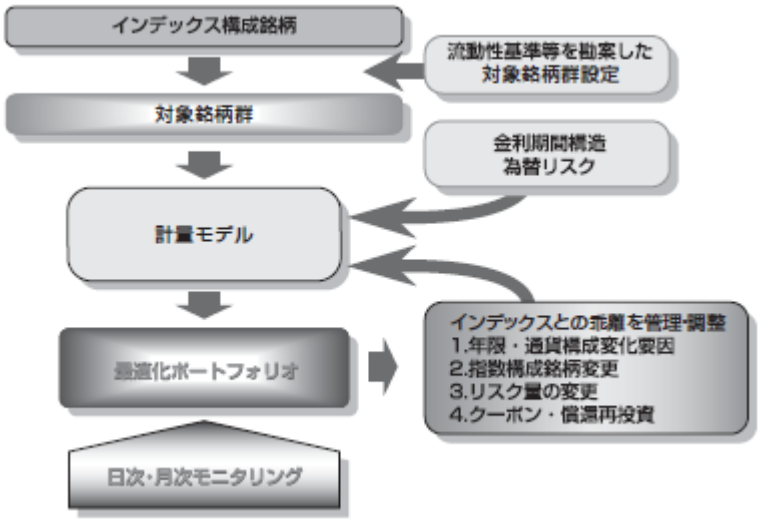
**MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。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

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

| | |
|---|---|
| | る者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。 |
| 運用プロセス | 1.流動性基準による対象銘柄群設定<br>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。<br>2.最適化法によるポートフォリオの構築<br>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。<br>3.インデックスとの乖離を管理<br>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。<br>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。<br>・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<br>・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<br>・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<br>  <br> |

| | |
|---|---|
| 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。<br>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。<br>3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド |
| 基本方針 | この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 海外の公社債を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | 1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。<br>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。<br>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。<br>※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。<br>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |

| | |
|---|---|
| 運用プロセス | 1.流動性基準等による対象銘柄群設定<br>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。<br>2.最適化法によるポートフォリオの構築<br>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。<br>3.インデックスとの乖離を管理<br>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。<br>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。<br>・年限・通貨構成変化要因<br>・指数構成銘柄変更<br>・リスク量の変更<br>・クーポン・償還再投資<br>  |

| | |
|---|---|
| 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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。 |

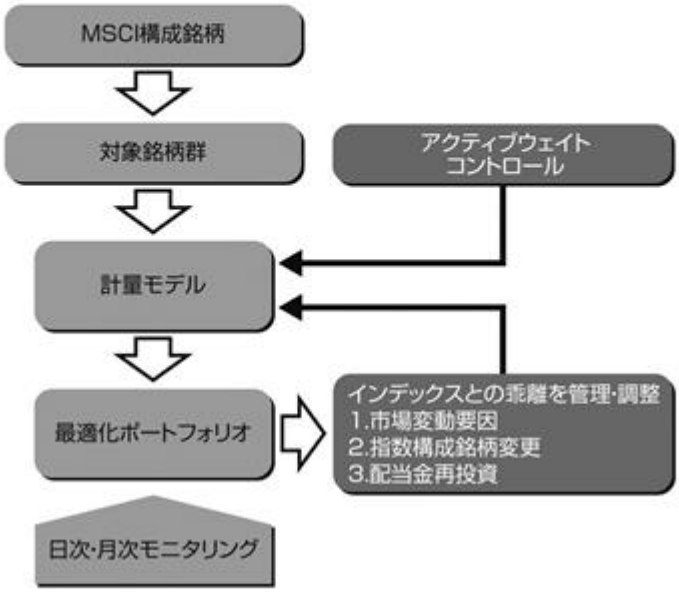
| | |
|---|---|
| ファンド名 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド |
| 基本方針 | この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。<br>（＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 |
| 主な投資対象 | 海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。 |

| | |
|---|---|
| **投資態度** | **1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。**<br>**2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。**<br>**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。** |

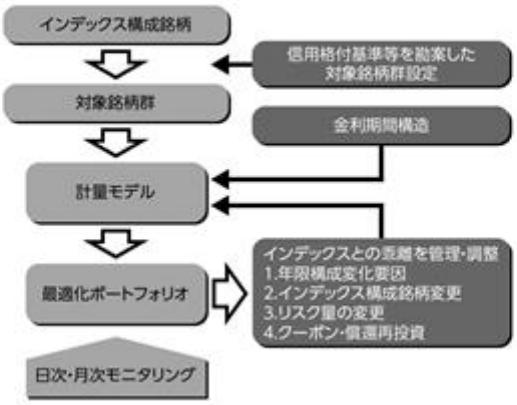
**※本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に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

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

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

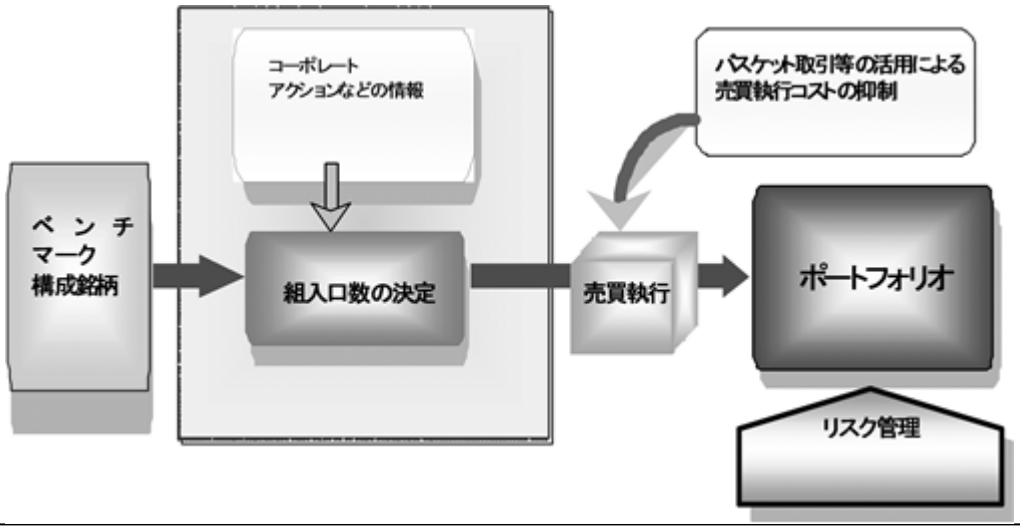
| | |
|---|---|
| | る者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。 |
| 運用プロセス | 現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。<br>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。<br>  |
| 主な投資制限 | 1.株式への投資割合には、制限を設けません。<br>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。<br>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。<br>5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。<br>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 | エマージング債券パッシブ・マザーファンド |
| 基本方針 | この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 新興国の公社債を主要投資対象とします。 |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | 1.主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。<br>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。<br>3.組入債券は、当初組入時において、Ｓ＆ＰもしくはＭｏｏｄｙ’ｓの外貨建て長期格付がＢＢ－格もしくはＢａ３格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。<br>4.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。<br>※ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス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。 |
| 運用プロセス | 信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。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。<br>  |
| 主な投資制限 | 1.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。<br>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。<br>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。<br>5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。<br>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 | 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）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 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います。<br>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。<br>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。<br>※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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。 |

| | |
|---|---|
| 運用プロセス | ・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。<br>・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。<br>・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。<br>  |
| 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。<br>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。<br>③株式への投資は行いません。<br>④外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。 |

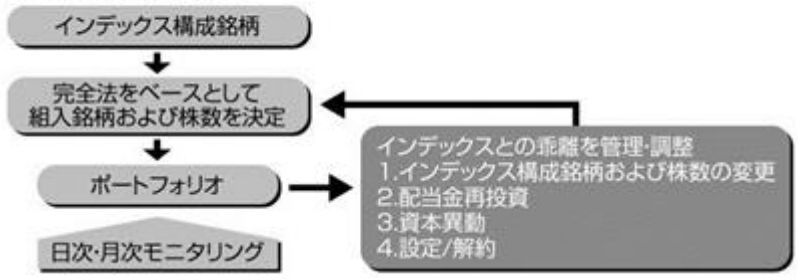
| | |
|---|---|
| ファンド名 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド |
| 基本方針 | この投資信託は、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 |

| | |
|---|---|
| **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。**<br>**＊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。**<br>**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。**<br>**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。** |

※ＳＡＰ 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。

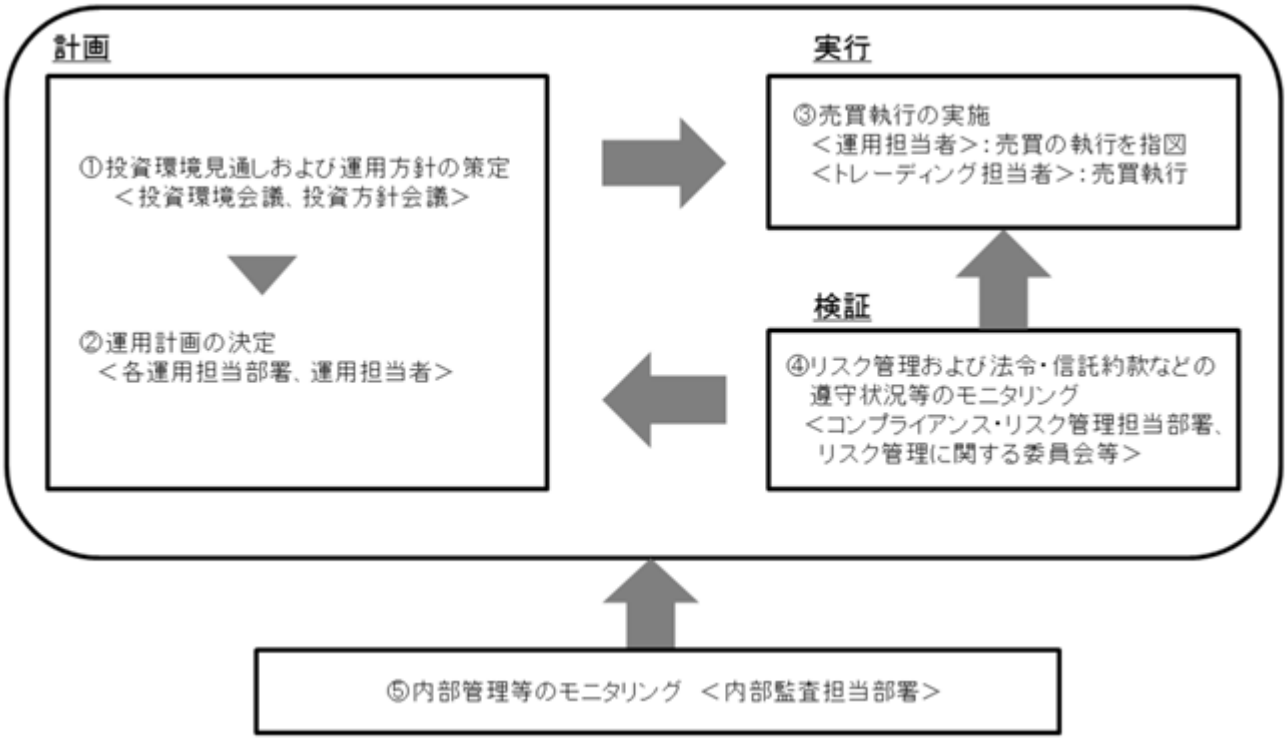
S&P Dow Jones Indicesは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはＳ＆Ｐ

| | |
|---|---|
| | 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。 |
| 運用プロセス | ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス（除く日本）」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。<br>  |
| 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。<br>2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>3.株式への直接投資は行いません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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2023年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1)分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2)分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

(3)留保益の運用方針

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

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

1)信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかか

る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、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。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

## （５）【投資制限】

①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）

②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）

③非株式への実質投資割合には制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

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実質比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、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）

⑤投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

2)上記1)の規定にかかわらず、上場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。

⑥信用取引の指図範囲（約款第21条）

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

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

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

⑦先物取引等の運用指図（約款第22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、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

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

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

⑧スワップ取引の運用指図（約款第23条）

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

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

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

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

⑨金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

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

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

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

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

⑩デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24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。

⑪有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

2)上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

⑫特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26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。

⑬外国為替予約取引の指図（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、および為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

3)上記2)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。

⑭資金の借入れ（約款第33条）

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

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

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑮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。 |

当ファンドが実質的に投資する各資産の配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、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。** |

**株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。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、金利の変動を受けて債券・リートの価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、債券・リートの価格は下落します。当ファンドは実質的に債券・リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。**

**○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。** |

**為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。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。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基準価額が下がる要因となります。**

**○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。**

**○カントリーリスク**

**投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。**

**投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合、または新たな規制が設けられた場合には、基準価額は予想外に下落する場合があります。また、実質的に投資を行う新興国の通貨や有価証券等の発行者が属する国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化などが為替市場や株式、債券市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制などの種々な規制の導入や政策の変更等の要因も為替市場や株式、債券市場に著しい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。**

**○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。**

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

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

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

**○当ファンドは、各マザーファンドへの投資を通じて合成ベンチマークに概ね連動する投資成果をめざして運用を行いますが、各マザーファンドが各対象ベンチマーク採用全銘柄を組入れないこと、資金流出入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコスト**

**や信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成ベンチマークが乖離する場合があります。**

**○当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。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。**

**○当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。**

**○資金動向、市場動向等によっては、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、信託契約を解約することが受益者のため有利と認められる場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、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。**

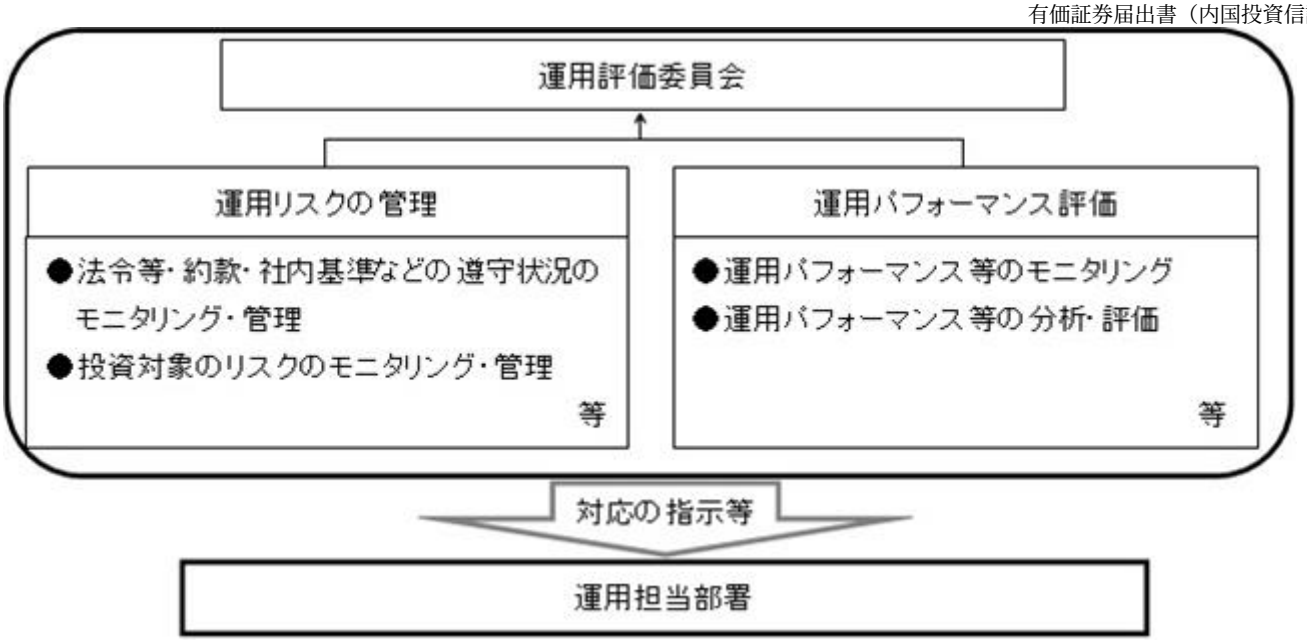
**○注意事項**

- **当ファンドは、実質的に株式、債券、不動産投資信託証券（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。**

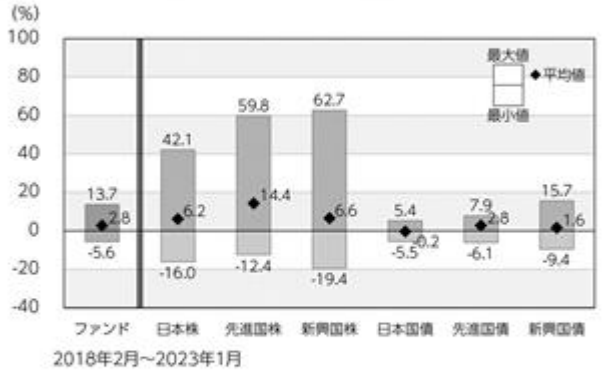
**※リスク管理体制は2023年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。**

# <参考情報>

## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較




2018年2月~2023年1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)<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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0.2695%（税抜0.245%）

| 支払先 | 内訳（税抜） | 主な役務 |
|---|---|---|
| 委託会社 | 年率0.120% | 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0.100% | 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0.025% | 運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

※信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

### （4）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

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

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に関する費用は、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。

○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。

**※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。**

**※上記は、2023年1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】

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | | 11,660,818,092 | 96.06 |
| | 内　日本 | 11,660,818,092 | 96.06 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 478,699,460 | 3.94 |
| 純資産総額 | | 12,139,517,552 | 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

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | | 375,629,740,780 | 97.67 |
| | 内　日本 | 375,629,740,780 | 97.67 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 8,951,655,112 | 2.33 |
| 純資産総額 | | 384,581,395,892 | 100.00 |

その他資産の投資状況

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引（買建） | | 8,889,750,000 | 2.31 |
| | 内　日本 | 8,889,750,000 | 2.31 |

（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

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | | 311,522,734,650 | 77.45 |
| | 内　日本 | 311,522,734,650 | 77.45 |
| 地方債証券 | | 32,681,454,691 | 8.13 |
| | 内　日本 | 32,681,454,691 | 8.13 |
| 特殊債券 | | 30,090,264,599 | 7.48 |
| | 内　日本 | 30,090,264,599 | 7.48 |
| 社債券 | | 25,454,613,260 | 6.33 |
| | 内　日本 | 24,764,906,260 | 6.16 |
| | 内　フランス | 689,707,000 | 0.17 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 2,475,703,316 | 0.62 |
| 純資産総額 | | 402,224,770,516 | 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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|

| | | | |
|---|---|---|---|
| 株式 | | 785,326,757,944 | 95.50 |
| | 内　アメリカ | 540,597,641,142 | 65.74 |
| | 内　イギリス | 35,843,798,163 | 4.36 |
| | 内　カナダ | 30,410,455,313 | 3.70 |
| | 内　フランス | 27,870,212,082 | 3.39 |
| | 内　スイス | 27,389,134,220 | 3.33 |
| | 内　ドイツ | 20,968,629,287 | 2.55 |
| | 内　オーストラリア | 18,898,014,226 | 2.30 |
| | 内　オランダ | 16,041,155,516 | 1.95 |
| | 内　アイルランド | 14,687,694,419 | 1.79 |
| | 内　スウェーデン | 7,695,442,622 | 0.94 |
| | 内　デンマーク | 7,034,184,785 | 0.86 |
| | 内　スペイン | 6,373,489,172 | 0.78 |
| | 内　香港 | 5,599,582,914 | 0.68 |
| | 内　イタリア | 4,432,445,910 | 0.54 |
| | 内　ジャージィー | 3,295,316,696 | 0.40 |
| | 内　フィンランド | 3,083,208,632 | 0.37 |
| | 内　シンガポール | 2,831,485,311 | 0.34 |
| | 内　ベルギー | 2,007,551,318 | 0.24 |
| | 内　ノルウェー | 1,739,658,099 | 0.21 |
| | 内　イスラエル | 1,681,861,648 | 0.20 |
| | 内　ケイマン諸島 | 1,624,556,806 | 0.20 |
| | 内　オランダ領キュラソー | 1,304,084,103 | 0.16 |
| | 内　バミューダ | 1,243,449,114 | 0.15 |
| | 内　ルクセンブルグ | 609,160,144 | 0.07 |
| | 内　ニュージーランド | 606,801,738 | 0.07 |
| | 内　オーストリア | 456,019,239 | 0.06 |
| | 内　ポルトガル | 411,671,855 | 0.05 |
| | 内　リベリア | 225,886,073 | 0.03 |
| | 内　パナマ | 183,646,472 | 0.02 |
| | 内　マン島 | 180,520,925 | 0.02 |
| 投資信託受益証券 | | 1,539,021,811 | 0.19 |
| | 内　オーストラリア | 1,088,996,180 | 0.13 |
| | 内　シンガポール | 450,025,631 | 0.05 |
| 投資証券 | | 17,380,761,989 | 2.11 |
| | 内　アメリカ | 16,194,194,994 | 1.97 |
| | 内　イギリス | 396,601,801 | 0.05 |
| | 内　フランス | 322,115,581 | 0.04 |
| | 内　香港 | 281,048,317 | 0.03 |
| | 内　ベルギー | 112,611,466 | 0.01 |
| | 内　カナダ | 74,189,830 | 0.01 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 18,077,732,961 | 2.20 |
| 純資産総額 | | 822,324,274,705 | 100.00 |

**その他資産の投資状況**

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引（買建） | | 18,301,678,694 | 2.23 |
| | 内　アメリカ | 13,416,067,012 | 1.63 |
| | 内　ドイツ | 2,895,618,293 | 0.35 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 内　イギリス | 851,373,358 | 0.10 |
| | 内　カナダ | 677,754,257 | 0.08 |
| | 内　オーストラリア | 460,865,774 | 0.06 |

（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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | | 184,895,229,421 | 98.80 |
| | 内　アメリカ | 92,109,182,374 | 49.22 |
| | 内　フランス | 15,918,079,760 | 8.51 |
| | 内　イタリア | 14,271,181,335 | 7.63 |
| | 内　ドイツ | 12,326,173,955 | 6.59 |
| | 内　スペイン | 9,370,342,149 | 5.01 |
| | 内　イギリス | 9,148,568,854 | 4.89 |
| | 内　中国 | 7,352,443,564 | 3.93 |
| | 内　カナダ | 3,879,497,806 | 2.07 |
| | 内　ベルギー | 3,461,701,651 | 1.85 |
| | 内　オーストラリア | 3,077,727,440 | 1.64 |
| | 内　オランダ | 2,983,693,158 | 1.59 |
| | 内　オーストリア | 2,204,371,297 | 1.18 |
| | 内　メキシコ | 1,540,741,512 | 0.82 |
| | 内　アイルランド | 1,191,398,925 | 0.64 |
| | 内　マレーシア | 1,050,626,792 | 0.56 |
| | 内　フィンランド | 956,660,356 | 0.51 |
| | 内　シンガポール | 876,330,017 | 0.47 |
| | 内　ポーランド | 830,020,502 | 0.44 |
| | 内　デンマーク | 616,463,937 | 0.33 |
| | 内　イスラエル | 605,353,766 | 0.32 |
| | 内　ニュージーランド | 388,941,049 | 0.21 |
| | 内　ノルウェー | 380,434,627 | 0.20 |
| | 内　スウェーデン | 355,294,595 | 0.19 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 2,245,997,520 | 1.20 |
| 純資産総額 | | 187,141,226,941 | 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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | | 92,596,103,831 | 91.12 |
| | 内　ケイマン諸島 | 18,311,055,506 | 18.02 |
| | 内　台湾 | 13,208,909,881 | 13.00 |
| | 内　インド | 12,066,629,975 | 11.87 |
| | 内　中国 | 11,517,337,064 | 11.33 |
| | 内　韓国 | 11,117,733,434 | 10.94 |
| | 内　ブラジル | 4,558,863,043 | 4.49 |
| | 内　サウジアラビア | 3,598,938,725 | 3.54 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 内　南アフリカ | 3,225,263,122 | 3.17 |
| | 内　タイ | 2,011,324,370 | 1.98 |
| | 内　メキシコ | 1,799,533,516 | 1.77 |
| | 内　インドネシア | 1,692,590,605 | 1.67 |
| | 内　マレーシア | 1,414,612,583 | 1.39 |
| | 内　アラブ首長国連邦 | 1,103,972,303 | 1.09 |
| | 内　香港 | 1,066,403,807 | 1.05 |
| | 内　カタール | 877,436,854 | 0.86 |
| | 内　クエート | 808,255,619 | 0.80 |
| | 内　フィリピン | 685,606,338 | 0.67 |
| | 内　ポーランド | 607,652,888 | 0.60 |
| | 内　トルコ | 540,485,977 | 0.53 |
| | 内　チリ | 517,488,411 | 0.51 |
| | 内　バミューダ | 455,689,732 | 0.45 |
| | 内　アメリカ | 424,670,239 | 0.42 |
| | 内　ギリシャ | 314,352,359 | 0.31 |
| | 内　ハンガリー | 169,462,764 | 0.17 |
| | 内　チェコ | 146,759,755 | 0.14 |
| | 内　コロンビア | 105,515,185 | 0.10 |
| | 内　エジプト | 75,889,620 | 0.07 |
| | 内　ルクセンブルグ | 67,271,991 | 0.07 |
| | 内　オランダ | 61,574,869 | 0.06 |
| | 内　シンガポール | 25,914,393 | 0.03 |
| | 内　ペルー | 18,908,903 | 0.02 |
| | 内　ロシア | 0 | 0.00 |
| | 内　キプロス | 0 | 0.00 |
| | 内　イギリス領バージン諸島 | 0 | 0.00 |
| 投資信託受益証券 | | 589,493,407 | 0.58 |
| | 内　メキシコ | 428,285,869 | 0.42 |
| | 内　ブラジル | 161,207,538 | 0.16 |
| 投資証券 | | 93,761,108 | 0.09 |
| | 内　メキシコ | 53,374,363 | 0.05 |
| | 内　南アフリカ | 40,386,745 | 0.04 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 8,339,396,078 | 8.21 |
| 純資産総額 | | 101,618,754,424 | 100.00 |

**その他資産の投資状況**

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引（買建） | | 8,309,373,360 | 8.18 |
| | 内　アメリカ | 8,309,373,360 | 8.18 |

（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。

**エマージング債券パッシブ・マザーファンド**

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | | 129,974,389,703 | 97.32 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 内　サウジアラビア | 14,746,204,040 | 11.04 |
| | 内　カタール | 12,708,541,770 | 9.52 |
| | 内　メキシコ | 12,069,427,093 | 9.04 |
| | 内　アラブ首長国連邦 | 11,853,291,477 | 8.88 |
| | 内　チリ | 8,974,517,585 | 6.72 |
| | 内　ドミニカ共和国 | 7,763,685,415 | 5.81 |
| | 内　パナマ | 7,479,129,188 | 5.60 |
| | 内　ブラジル | 7,073,297,149 | 5.30 |
| | 内　コロンビア | 7,035,486,447 | 5.27 |
| | 内　インドネシア | 6,806,266,617 | 5.10 |
| | 内　オマーン | 5,975,798,681 | 4.47 |
| | 内　南アフリカ | 5,743,915,862 | 4.30 |
| | 内　ペルー | 5,205,628,808 | 3.90 |
| | 内　フィリピン | 4,599,361,410 | 3.44 |
| | 内　ハンガリー | 4,543,730,917 | 3.40 |
| | 内　ウルグアイ | 3,647,553,403 | 2.73 |
| | 内　ルーマニア | 2,930,070,547 | 2.19 |
| | 内　中国 | 818,483,294 | 0.61 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 3,577,387,809 | 2.68 |
| 純資産総額 | | 133,551,777,512 | 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

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | | 191,404,816,950 | 97.76 |
| | 内　日本 | 191,404,816,950 | 97.76 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 4,379,006,636 | 2.24 |
| 純資産総額 | | 195,783,823,586 | 100.00 |

その他資産の投資状況

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 不動産投信指数先物取引（買建） | | 4,240,486,500 | 2.17 |
| | 内　日本 | 4,240,486,500 | 2.17 |

（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

2023年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | | 7,693,151,791 | 10.74 |
| | 内　オーストラリア | 4,937,448,030 | 6.90 |
| | 内　シンガポール | 2,687,799,067 | 3.75 |
| | 内　香港 | 67,904,694 | 0.09 |
| 投資証券 | | 63,603,631,041 | 88.83 |
| | 内　アメリカ | 54,511,940,772 | 76.13 |
| | 内　イギリス | 3,394,712,972 | 4.74 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 内　カナダ | 1,358,015,404 | 1.90 |
| | 内　フランス | 1,334,035,051 | 1.86 |
| | 内　香港 | 1,030,182,135 | 1.44 |
| | 内　ベルギー | 777,645,300 | 1.09 |
| | 内　スペイン | 299,957,137 | 0.42 |
| | 内　ニュージーランド | 280,467,189 | 0.39 |
| | 内　韓国 | 171,952,877 | 0.24 |
| | 内　ガーンジィ | 153,405,276 | 0.21 |
| | 内　オランダ | 134,324,503 | 0.19 |
| | 内　イスラエル | 87,753,927 | 0.12 |
| | 内　ドイツ | 34,141,304 | 0.05 |
| | 内　アイルランド | 27,495,357 | 0.04 |
| | 内　イタリア | 7,601,837 | 0.01 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 303,690,774 | 0.42 |
| 純資産総額 | | 71,600,473,606 | 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】

2023年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 5,545,357,902 | 1.2347<br>6,847,407,937 | 1.2341<br>6,843,526,186 | －<br>－ | 56.37 |
| 2 | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 369,360,628 | 3.2350<br>1,194,881,633 | 3.3613<br>1,241,531,878 | －<br>－ | 10.23 |
| 3 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 207,150,644 | 5.9026<br>1,222,727,393 | 5.9911<br>1,241,060,223 | －<br>－ | 10.22 |
| 4 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 442,754,940 | 1.4093<br>623,974,561 | 1.4285<br>632,475,431 | －<br>－ | 5.21 |
| 5 | エマージング債券パッシブ・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 305,966,961 | 1.9484<br>596,176,623 | 1.9630<br>600,613,144 | －<br>－ | 4.95 |
| 6 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 231,792,328 | 1.5846<br>367,321,302 | 1.6716<br>387,464,055 | －<br>－ | 3.19 |
| 7 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 180,603,325 | 2.0090<br>362,850,140 | 2.0018<br>361,531,735 | －<br>－ | 2.98 |
| 8 | Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券 | 154,914,085 | 2.3100<br>357,867,027 | 2.2762<br>352,615,440 | －<br>－ | 2.90 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

**投資有価証券の種類別投資比率**

**2023年1月31日現在**

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 96.06 |
| 合計 | 96.06 |

**（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**

**2023年1月31日現在**

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域 | 種類<br>業種 | 数量 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | トヨタ自動車<br>日本 | 株式<br>輸送用機器 | 7,263,800 | 2,161.51<br>15,700,839,658 | 1,896.50<br>13,775,796,700 | －<br>－ | 3.58 |
| 2 | ソニーグループ<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 935,800 | 12,066.67<br>11,291,995,298 | 11,580.00<br>10,836,564,000 | －<br>－ | 2.82 |
| 3 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ<br>日本 | 株式<br>銀行業 | 8,272,200 | 757.06<br>6,262,560,665 | 952.70<br>7,880,924,940 | －<br>－ | 2.05 |
| 4 | キーエンス<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 132,300 | 54,670.60<br>7,232,921,205 | 59,280.00<br>7,842,744,000 | －<br>－ | 2.04 |
| 5 | 日本電信電話<br>日本 | 株式<br>情報・通信業 | 1,700,100 | 3,663.73<br>6,228,719,747 | 3,892.00<br>6,616,789,200 | －<br>－ | 1.72 |
| 6 | 三井住友フィナンシャルグループ<br>日本 | 株式<br>銀行業 | 952,100 | 4,275.72<br>4,070,916,553 | 5,652.00<br>5,381,269,200 | －<br>－ | 1.40 |
| 7 | 武田薬品工業<br>日本 | 株式<br>医薬品 | 1,174,100 | 3,629.74<br>4,261,685,589 | 4,090.00<br>4,802,069,000 | －<br>－ | 1.25 |
| 8 | ソフトバンクグループ<br>日本 | 株式<br>情報・通信業 | 767,100 | 5,399.08<br>4,141,638,724 | 6,144.00<br>4,713,062,400 | －<br>－ | 1.23 |
| 9 | 任天堂<br>日本 | 株式<br>その他製品 | 835,200 | 5,871.47<br>4,903,854,823 | 5,625.00<br>4,698,000,000 | －<br>－ | 1.22 |
| 10 | 第一三共<br>日本 | 株式<br>医薬品 | 1,155,800 | 3,011.06<br>3,480,190,115 | 4,064.00<br>4,697,171,200 | －<br>－ | 1.22 |
| 11 | 日立製作所<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 649,700 | 6,218.17<br>4,039,948,260 | 6,782.00<br>4,406,265,400 | －<br>－ | 1.15 |
| 12 | 信越化学工業<br>日本 | 株式<br>化学 | 223,600 | 18,049.35<br>4,035,835,084 | 19,075.00<br>4,265,170,000 | －<br>－ | 1.11 |
| 13 | 東京エレクトロン<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 93,300 | 53,419.15<br>4,984,007,072 | 45,170.00<br>4,214,361,000 | －<br>－ | 1.10 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 14 | リクルートホールディングス<br>日本 | 株式<br>サービス業 | 1,006,800 | 5,086.74<br>5,121,338,250 | 4,144.00<br>4,172,179,200 | －<br>－ | 1.08 |
| 15 | ＫＤＤＩ<br>日本 | 株式<br>情報・通信業 | 1,025,200 | 4,057.93<br>4,160,196,633 | 4,059.00<br>4,161,286,800 | －<br>－ | 1.08 |
| 16 | ＨＯＹＡ<br>日本 | 株式<br>精密機器 | 282,500 | 14,155.97<br>3,999,062,843 | 14,200.00<br>4,011,500,000 | －<br>－ | 1.04 |
| 17 | 三井物産<br>日本 | 株式<br>卸売業 | 1,024,100 | 3,107.07<br>3,181,955,948 | 3,820.00<br>3,912,062,000 | －<br>－ | 1.02 |
| 18 | みずほフィナンシャルグループ<br>日本 | 株式<br>銀行業 | 1,884,300 | 1,614.35<br>3,041,933,064 | 2,027.50<br>3,820,418,250 | －<br>－ | 0.99 |
| 19 | 三菱商事<br>日本 | 株式<br>卸売業 | 875,100 | 4,134.43<br>3,618,045,180 | 4,336.00<br>3,794,433,600 | －<br>－ | 0.99 |
| 20 | 伊藤忠商事<br>日本 | 株式<br>卸売業 | 862,500 | 3,803.29<br>3,280,339,098 | 4,183.00<br>3,607,837,500 | －<br>－ | 0.94 |
| 21 | ダイキン工業<br>日本 | 株式<br>機械 | 159,500 | 22,024.41<br>3,512,893,857 | 22,470.00<br>3,583,965,000 | －<br>－ | 0.93 |
| 22 | 東京海上ホールディングス<br>日本 | 株式<br>保険業 | 1,311,900 | 2,493.33<br>3,271,009,362 | 2,714.00<br>3,560,496,600 | －<br>－ | 0.93 |
| 23 | 本田技研工業<br>日本 | 株式<br>輸送用機器 | 1,075,300 | 3,352.20<br>3,604,627,480 | 3,207.00<br>3,448,487,100 | －<br>－ | 0.90 |
| 24 | ソフトバンク<br>日本 | 株式<br>情報・通信業 | 2,131,200 | 1,476.87<br>3,147,513,699 | 1,486.50<br>3,168,028,800 | －<br>－ | 0.82 |
| 25 | オリエンタルランド<br>日本 | 株式<br>サービス業 | 143,900 | 20,602.04<br>2,964,634,908 | 21,580.00<br>3,105,362,000 | －<br>－ | 0.81 |
| 26 | ファナック<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 129,800 | 21,744.76<br>2,822,470,921 | 22,905.00<br>2,973,069,000 | －<br>－ | 0.77 |
| 27 | 村田製作所<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 401,200 | 8,008.39<br>3,212,967,639 | 7,394.00<br>2,966,472,800 | －<br>－ | 0.77 |
| 28 | セブン&アイ・ホールディングス<br>日本 | 株式<br>小売業 | 482,400 | 5,601.32<br>2,702,076,904 | 6,127.00<br>2,955,664,800 | －<br>－ | 0.77 |
| 29 | ＳＭＣ<br>日本 | 株式<br>機械 | 43,300 | 64,079.90<br>2,774,659,804 | 65,350.00<br>2,829,655,000 | －<br>－ | 0.74 |
| 30 | 富士通<br>日本 | 株式<br>電気機器 | 133,100 | 17,216.89<br>2,291,568,444 | 18,510.00<br>2,463,681,000 | －<br>－ | 0.64 |

（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

2023年1月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 株式 | 97.67 |
| 合計 | 97.67 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年1月31日現在

| 業種 | 国内／外国 | 投資比率（%） |
|---|---|---|
| 電気機器 | 国内 | 16.98 |
| 情報・通信業 | | 8.71 |
| 輸送用機器 | | 7.24 |
| 銀行業 | | 6.42 |
| 化学 | | 6.06 |
| 卸売業 | | 5.79 |
| 医薬品 | | 5.24 |
| サービス業 | | 5.20 |
| 機械 | | 5.12 |
| 小売業 | | 4.44 |
| 食料品 | | 3.34 |
| 陸運業 | | 2.90 |
| 精密機器 | | 2.55 |
| 保険業 | | 2.36 |
| その他製品 | | 2.26 |
| 建設業 | | 1.91 |
| 不動産業 | | 1.86 |
| 電気・ガス業 | | 1.21 |
| その他金融業 | | 1.11 |
| 鉄鋼 | | 0.83 |
| 証券、商品先物取引業 | | 0.74 |
| 非鉄金属 | | 0.73 |
| ガラス・土石製品 | | 0.70 |
| ゴム製品 | | 0.69 |
| 海運業 | | 0.59 |
| 金属製品 | | 0.56 |
| 空運業 | | 0.50 |
| 石油・石炭製品 | | 0.48 |
| 繊維製品 | | 0.46 |
| 鉱業 | | 0.30 |
| パルプ・紙 | | 0.17 |
| 倉庫・運輸関連業 | | 0.14 |
| 水産・農林業 | | 0.09 |
| 合計 | | 97.67 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | ３３５回　利付国庫債券（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 4,610,000,000 | 100.86<br>4,649,682,000 | 100.86<br>4,649,876,500 | 0.5<br>2024/9/20 | 1.16 |
| 2 | ３３４回　利付国庫債券（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 4,420,000,000 | 100.94<br>4,461,956,000 | 100.87<br>4,458,763,400 | 0.6<br>2024/6/20 | 1.11 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 3 | ４３７回　利付国庫債券<br>（２年）<br>日本 | 国債証券 | 3,850,000,000 | 100.16<br>3,856,466,000 | 100.05<br>3,852,271,500 | 0.005<br>2024/6/1 | 0.96 |
| 4 | ４３８回　利付国庫債券<br>（２年）<br>日本 | 国債証券 | 3,800,000,000 | 100.17<br>3,806,808,000 | 100.05<br>3,802,128,000 | 0.005<br>2024/7/1 | 0.95 |
| 5 | ３６８回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,750,000,000 | 99.22<br>3,720,830,000 | 99.71<br>3,739,387,500 | 0.2<br>2032/9/20 | 0.93 |
| 6 | ４３５回　利付国庫債券<br>（２年）<br>日本 | 国債証券 | 3,720,000,000 | 100.11<br>3,724,426,800 | 100.06<br>3,722,343,600 | 0.005<br>2024/4/1 | 0.93 |
| 7 | ３４８回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,470,000,000 | 99.71<br>3,460,132,000 | 99.74<br>3,461,220,900 | 0.1<br>2027/9/20 | 0.86 |
| 8 | ３５０回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,460,000,000 | 99.45<br>3,441,288,000 | 99.41<br>3,439,793,600 | 0.1<br>2028/3/20 | 0.86 |
| 9 | ３４２回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,420,000,000 | 100.22<br>3,427,803,000 | 100.23<br>3,428,002,800 | 0.1<br>2026/3/20 | 0.85 |
| 10 | １５３回　利付国庫債券<br>（５年）<br>日本 | 国債証券 | 3,410,000,000 | 99.42<br>3,390,475,000 | 99.43<br>3,390,665,300 | 0.005<br>2027/6/20 | 0.84 |
| 11 | ３４５回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,380,000,000 | 99.97<br>3,379,088,000 | 100.05<br>3,381,960,400 | 0.1<br>2026/12/20 | 0.84 |
| 12 | １４８回　利付国庫債券<br>（５年）<br>日本 | 国債証券 | 3,310,000,000 | 99.84<br>3,304,760,000 | 99.88<br>3,306,061,100 | 0.005<br>2026/6/20 | 0.82 |
| 13 | ３４４回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,270,000,000 | 100.02<br>3,270,654,000 | 100.14<br>3,274,708,800 | 0.1<br>2026/9/20 | 0.81 |
| 14 | ３４７回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,230,000,000 | 99.85<br>3,225,330,000 | 99.84<br>3,225,058,100 | 0.1<br>2027/6/20 | 0.80 |
| 15 | ３６０回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,200,000,000 | 97.58<br>3,122,560,000 | 97.13<br>3,108,160,000 | 0.1<br>2030/9/20 | 0.77 |
| 16 | １４３回　利付国庫債券<br>（５年）<br>日本 | 国債証券 | 3,100,000,000 | 100.43<br>3,113,564,000 | 100.23<br>3,107,254,000 | 0.1<br>2025/3/20 | 0.77 |
| 17 | ３６５回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,230,000,000 | 97.53<br>3,150,436,000 | 96.14<br>3,105,580,400 | 0.1<br>2031/12/20 | 0.77 |
| 18 | ３４０回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,040,000,000 | 101.02<br>3,071,098,000 | 101.02<br>3,071,190,400 | 0.4<br>2025/9/20 | 0.76 |
| 19 | ３３６回　利付国庫債券<br>（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 101.38<br>3,041,400,000 | 100.98<br>3,029,640,000 | 0.5<br>2024/12/20 | 0.75 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 20 | ３６７回　利付国庫債券（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 98.77<br>2,963,100,000 | 98.90<br>2,967,210,000 | 0.2<br>2032/6/20 | 0.74 |
| 21 | ３４９回　利付国庫債券（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 2,950,000,000 | 99.72<br>2,941,950,000 | 99.58<br>2,937,846,000 | 0.1<br>2027/12/20 | 0.73 |
| 22 | １４２回　利付国庫債券（５年）<br>日本 | 国債証券 | 2,930,000,000 | 100.35<br>2,940,255,000 | 100.23<br>2,936,885,500 | 0.1<br>2024/12/20 | 0.73 |
| 23 | １４６回　利付国庫債券（５年）<br>日本 | 国債証券 | 2,900,000,000 | 100.45<br>2,913,050,000 | 100.24<br>2,907,076,000 | 0.1<br>2025/12/20 | 0.72 |
| 24 | ３６２回　利付国庫債券（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 2,960,000,000 | 97.88<br>2,897,392,000 | 96.64<br>2,860,780,800 | 0.1<br>2031/3/20 | 0.71 |
| 25 | １４１回　利付国庫債券（５年）<br>日本 | 国債証券 | 2,810,000,000 | 100.16<br>2,814,496,000 | 100.21<br>2,815,957,200 | 0.1<br>2024/9/20 | 0.70 |
| 26 | １５４回　利付国庫債券（５年）<br>日本 | 国債証券 | 2,800,000,000 | 99.65<br>2,790,444,000 | 99.74<br>2,792,916,000 | 0.1<br>2027/9/20 | 0.69 |
| 27 | １４９回　利付国庫債券（５年）<br>日本 | 国債証券 | 2,710,000,000 | 99.72<br>2,702,566,000 | 99.80<br>2,704,580,000 | 0.005<br>2026/9/20 | 0.67 |
| 28 | ３６６回　利付国庫債券（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 2,780,000,000 | 99.02<br>2,753,008,000 | 97.12<br>2,700,102,800 | 0.2<br>2032/3/20 | 0.67 |
| 29 | ３６４回　利付国庫債券（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 2,800,000,000 | 96.90<br>2,713,235,000 | 96.25<br>2,695,028,000 | 0.1<br>2031/9/20 | 0.67 |
| 30 | ３５３回　利付国庫債券（１０年）<br>日本 | 国債証券 | 2,710,000,000 | 98.98<br>2,682,435,000 | 98.90<br>2,680,217,100 | 0.1<br>2028/12/20 | 0.67 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

**投資有価証券の種類別投資比率**

2023年1月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 77.45 |
| 地方債証券 | 8.13 |
| 特殊債券 | 7.48 |
| 社債券 | 6.33 |
| 合計 | 99.38 |

（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。

**外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド**

2023年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域 | 種類<br>業種 | 数量 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | APPLE INC<br>アメリカ | 株式<br>コンピュータ・周辺機器 | 2,000,134 | 21,293.77<br>42,590,405,160 | 18,657.20<br>37,316,920,066 | －<br>－ | 4.54 |
| 2 | MICROSOFT CORP<br>アメリカ | 株式<br>ソフトウェア | 881,904 | 37,307.92<br>32,902,008,977 | 31,666.37<br>27,926,701,631 | －<br>－ | 3.40 |
| 3 | AMAZON.COM INC<br>アメリカ | 株式<br>インターネット販売・通信販売 | 1,141,595 | 18,866.44<br>21,537,839,593 | 13,118.75<br>14,976,309,109 | －<br>－ | 1.82 |
| 4 | ALPHABET INC-CL A<br>アメリカ | 株式<br>インタラクティブ・メディアおよびサービス | 744,329 | 16,792.49<br>12,499,138,375 | 12,647.76<br>9,414,095,892 | －<br>－ | 1.14 |
| 5 | ALPHABET INC-CL C<br>アメリカ | 株式<br>インタラクティブ・メディアおよびサービス | 691,660 | 16,835.90<br>11,644,722,719 | 12,779.53<br>8,839,094,215 | －<br>－ | 1.07 |
| 6 | NVIDIA CORP<br>アメリカ | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 310,242 | 29,222.65<br>9,066,094,888 | 25,000.66<br>7,756,255,194 | －<br>－ | 0.94 |
| 7 | EXXON MOBIL CORP<br>アメリカ | 株式<br>石油・ガス・消耗燃料 | 519,382 | 10,962.32<br>5,693,633,610 | 14,816.17<br>7,695,253,668 | －<br>－ | 0.94 |
| 8 | UNITEDHEALTH GROUP INC<br>アメリカ | 株式<br>ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス | 116,509 | 63,276.63<br>7,372,297,243 | 63,381.02<br>7,384,459,410 | －<br>－ | 0.90 |
| 9 | TESLA INC<br>アメリカ | 株式<br>自動車 | 331,953 | 35,661.57<br>11,837,967,740 | 21,744.13<br>7,218,029,252 | －<br>－ | 0.88 |
| 10 | JOHNSON & JOHNSON<br>アメリカ | 株式<br>医薬品 | 327,095 | 21,942.52<br>7,177,288,791 | 21,136.13<br>6,913,525,713 | －<br>－ | 0.84 |
| 11 | JPMORGAN CHASE & CO<br>アメリカ | 株式<br>銀行 | 365,043 | 18,904.43<br>6,900,932,373 | 18,152.29<br>6,626,366,800 | －<br>－ | 0.81 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 12 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B<br>アメリカ | 株式<br>各種金融サービス | 161,951 | 40,882.93<br>6,621,031,657 | 40,097.34<br>6,493,805,136 | －<br>－ | 0.79 |
| 13 | VISA INC<br>アメリカ | 株式<br>情報技術サービス | 203,526 | 28,669.27<br>5,834,943,099 | 29,890.67<br>6,083,529,927 | －<br>－ | 0.74 |
| 14 | PROCTER & GAMBLE CO<br>アメリカ | 株式<br>家庭用品 | 296,779 | 19,959.82<br>5,923,657,262 | 18,397.57<br>5,460,013,821 | －<br>－ | 0.66 |
| 15 | META PLATFORMS INC<br>アメリカ | 株式<br>インタラクティブ・メディアおよびサービス | 284,533 | 26,449.42<br>7,525,733,742 | 19,186.91<br>5,459,311,396 | －<br>－ | 0.66 |
| 16 | NESTLE SA-REGISTERED<br>スイス | 株式<br>食品 | 341,882 | 16,428.51<br>5,616,613,632 | 15,683.05<br>5,361,752,773 | －<br>－ | 0.65 |
| 17 | CHEVRON CORP<br>アメリカ | 株式<br>石油・ガス・消耗燃料 | 231,639 | 19,124.13<br>4,429,895,685 | 22,727.87<br>5,264,662,005 | －<br>－ | 0.64 |
| 18 | HOME DEPOT INC<br>アメリカ | 株式<br>専門小売り | 127,583 | 43,936.76<br>5,605,584,901 | 40,998.89<br>5,230,761,740 | －<br>－ | 0.64 |
| 19 | MASTERCARD INC<br>アメリカ | 株式<br>情報技術サービス | 107,466 | 47,372.79<br>5,090,964,884 | 48,420.02<br>5,203,506,557 | －<br>－ | 0.63 |
| 20 | ELI LILLY & CO<br>アメリカ | 株式<br>医薬品 | 100,641 | 34,048.00<br>3,426,625,108 | 44,425.03<br>4,470,979,947 | －<br>－ | 0.54 |
| 21 | MERCK & CO.INC.<br>アメリカ | 株式<br>医薬品 | 315,672 | 10,638.56<br>3,358,297,990 | 13,841.56<br>4,369,393,654 | －<br>－ | 0.53 |
| 22 | ASML HOLDING NV<br>オランダ | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 50,605 | 78,262.23<br>3,960,460,263 | 85,417.30<br>4,322,542,668 | －<br>－ | 0.53 |
| 23 | ABBVIE INC<br>アメリカ | 株式<br>バイオテクノロジー | 220,198 | 19,048.68<br>4,194,482,369 | 19,002.95<br>4,184,412,795 | －<br>－ | 0.51 |
| 24 | BANK OF AMERICA CORP<br>アメリカ | 株式<br>銀行 | 900,868 | 5,747.89<br>5,178,090,907 | 4,605.59<br>4,149,029,552 | －<br>－ | 0.50 |
| 25 | COCA-COLA CO/THE<br>アメリカ | 株式<br>飲料 | 510,854 | 7,957.23<br>4,064,983,680 | 7,911.70<br>4,041,724,000 | －<br>－ | 0.49 |
| 26 | PFIZER INC<br>アメリカ | 株式<br>医薬品 | 698,945 | 6,503.71<br>4,545,736,329 | 5,681.96<br>3,971,383,473 | －<br>－ | 0.48 |
| 27 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE<br>フランス | 株式<br>繊維・アパレル・贅沢品 | 34,454 | 93,130.21<br>3,208,708,332 | 113,078.12<br>3,895,993,822 | －<br>－ | 0.47 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 28 | BROADCOM INC<br>アメリカ | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 50,259 | 73,944.65<br>3,716,384,483 | 75,861.78<br>3,812,737,276 | －<br>－ | 0.46 |
| 29 | PEPSICO INC<br>アメリカ | 株式<br>飲料 | 171,495 | 21,876.21<br>3,751,660,892 | 22,112.05<br>3,792,106,975 | －<br>－ | 0.46 |
| 30 | NOVO NORDISK A/S-B<br>デンマーク | 株式<br>医薬品 | 206,349 | 13,155.65<br>2,714,655,304 | 18,297.34<br>3,775,638,843 | －<br>－ | 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

2023年1月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 株式 | 95.50 |
| 投資信託受益証券 | 0.19 |
| 投資証券 | 2.11 |
| 合計 | 97.80 |

（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

2023年1月31日現在

| 業種 | 国内／外国 | 投資比率（%） |
|---|---|---|
| ソフトウェア | 外国 | 6.48 |
| 銀行 | | 6.20 |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 5.35 |
| 医薬品 | | 5.27 |
| コンピュータ・周辺機器 | | 4.76 |
| 半導体・半導体製造装置 | | 4.51 |
| 情報技術サービス | | 3.72 |
| 保険 | | 3.37 |
| 資本市場 | | 3.33 |
| インタラクティブ・メディアおよびサービス | | 3.02 |
| ヘルスケア機器・用品 | | 2.36 |
| ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス | | 2.31 |
| インターネット販売・通信販売 | | 2.23 |
| 化学 | | 2.08 |
| バイオテクノロジー | | 2.06 |
| ホテル・レストラン・レジャー | | 1.95 |
| 電力 | | 1.85 |
| 機械 | | 1.83 |
| 金属・鉱業 | | 1.82 |
| 飲料 | | 1.75 |
| 食品 | | 1.69 |
| 航空宇宙・防衛 | | 1.68 |
| 専門小売り | | 1.67 |
| 自動車 | | 1.54 |
| ライフサイエンス・ツール／サービス | | 1.50 |
| 食品・生活必需品小売り | | 1.50 |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | | 1.42 |
| 娯楽 | | 1.18 |

| | |
|---|---|
| 各種電気通信サービス | 1.16 |
| 家庭用品 | 1.11 |
| 各種金融サービス | 1.07 |
| 陸運・鉄道 | 1.02 |
| コングロマリット | 0.93 |
| 電気設備 | 0.85 |
| 総合公益事業 | 0.81 |
| メディア | 0.80 |
| 専門サービス | 0.70 |
| タバコ | 0.68 |
| 通信機器 | 0.66 |
| パーソナル用品 | 0.64 |
| 建設関連製品 | 0.58 |
| 航空貨物・物流サービス | 0.55 |
| 電子装置・機器・部品 | 0.55 |
| 商業サービス・用品 | 0.48 |
| 複合小売り | 0.47 |
| 消費者金融 | 0.42 |
| 商社・流通業 | 0.38 |
| 不動産管理・開発 | 0.36 |
| エネルギー設備・サービス | 0.31 |
| 家庭用耐久財 | 0.30 |
| 無線通信サービス | 0.29 |
| 建設・土木 | 0.28 |
| 建設資材 | 0.26 |
| 容器・包装 | 0.26 |
| 自動車部品 | 0.20 |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.16 |
| ガス | 0.14 |
| 運送インフラ | 0.12 |
| 水道 | 0.12 |
| 販売 | 0.11 |
| 紙製品・林産品 | 0.11 |
| 海運業 | 0.07 |
| 旅客航空輸送業 | 0.06 |
| ヘルスケア・テクノロジー | 0.05 |
| 各種消費者サービス | 0.02 |
| レジャー用品 | 0.02 |
| 合計 | 95.50 |

（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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | US T N/B 1.625 05/15/31<br>アメリカ | 国債証券 | 1,270,777,800 | 91.32<br>1,160,586,735 | 86.66<br>1,101,307,656 | 1.625<br>2031/5/15 | 0.59 |
| 2 | US T N/B 0.25 05/15/24<br>アメリカ | 国債証券 | 978,525,000 | 95.90<br>938,466,734 | 94.49<br>924,629,672 | 0.25<br>2024/5/15 | 0.49 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 3 | US T N/B 0.875 11/15/30<br>アメリカ | 国債証券 | 1,080,291,600 | 82.57<br>892,086,015 | 82.28<br>888,877,432 | 0.875<br>2030/11/15 | 0.47 |
| 4 | US T N/B 1.25 08/15/31<br>アメリカ | 国債証券 | 1,060,721,100 | 93.90<br>996,023,028 | 83.56<br>886,406,498 | 1.25<br>2031/8/15 | 0.47 |
| 5 | US T N/B 1.375 11/15/31<br>アメリカ | 国債証券 | 1,042,455,300 | 94.94<br>989,744,929 | 83.94<br>875,051,634 | 1.375<br>2031/11/15 | 0.47 |
| 6 | US T N/B 1.125 02/15/31<br>アメリカ | 国債証券 | 1,029,408,300 | 93.51<br>962,625,088 | 83.83<br>862,973,881 | 1.125<br>2031/2/15 | 0.46 |
| 7 | US T N/B 1.875 02/15/32<br>アメリカ | 国債証券 | 949,821,600 | 92.77<br>881,161,359 | 87.35<br>829,721,102 | 1.875<br>2032/2/15 | 0.44 |
| 8 | US T N/B 2.875 05/15/32<br>アメリカ | 国債証券 | 867,625,500 | 100.61<br>872,999,963 | 94.82<br>822,719,094 | 2.875<br>2032/5/15 | 0.44 |
| 9 | US T N/B 4.0 12/15/25<br>アメリカ | 国債証券 | 801,085,800 | 100.20<br>802,719,545 | 100.07<br>801,649,058 | 4<br>2025/12/15 | 0.43 |
| 10 | US T N/B 3.875 11/30/27<br>アメリカ | 国債証券 | 782,820,000 | 100.38<br>785,818,200 | 100.80<br>789,088,673 | 3.875<br>2027/11/30 | 0.42 |
| 11 | US T N/B 2.75 08/15/32<br>アメリカ | 国債証券 | 761,944,800 | 91.34<br>695,979,902 | 93.66<br>713,638,686 | 2.75<br>2032/8/15 | 0.38 |
| 12 | US T N/B 0.625 08/15/30<br>アメリカ | 国債証券 | 827,179,800 | 82.17<br>679,750,826 | 81.05<br>670,467,994 | 0.625<br>2030/8/15 | 0.36 |
| 13 | FRANCE OAT 2.75 10/25/27<br>フランス | 国債証券 | 663,916,400 | 109.01<br>723,739,500 | 100.64<br>668,212,603 | 2.75<br>2027/10/25 | 0.36 |
| 14 | CHINA GOVERNMENT BOND<br>2.26 02/24/25<br>中国 | 国債証券 | 665,649,900 | 99.69<br>663,634,977 | 99.58<br>662,886,148 | 2.26<br>2025/2/24 | 0.35 |
| 15 | FRANCE OAT 0.75 05/25/28<br>フランス | 国債証券 | 723,371,600 | 93.96<br>679,725,905 | 90.81<br>656,942,939 | 0.75<br>2028/5/25 | 0.35 |
| 16 | US T N/B 2.5 05/15/24<br>アメリカ | 国債証券 | 665,397,000 | 102.14<br>679,648,001 | 97.26<br>647,176,552 | 2.5<br>2024/5/15 | 0.35 |
| 17 | FRANCE OAT 5.5 04/25/29<br>フランス | 国債証券 | 549,252,800 | 121.72<br>668,560,049 | 116.33<br>638,993,017 | 5.5<br>2029/4/25 | 0.34 |
| 18 | FRANCE OAT 2.5 05/25/30<br>フランス | 国債証券 | 629,942,000 | 112.04<br>705,835,021 | 99.33<br>625,738,397 | 2.5<br>2030/5/25 | 0.33 |
| 19 | US T N/B 2.875 06/15/25<br>アメリカ | 国債証券 | 641,912,400 | 97.22<br>624,118,588 | 97.21<br>624,034,131 | 2.875<br>2025/6/15 | 0.33 |
| 20 | US T N/B 2.875 05/15/28<br>アメリカ | 国債証券 | 634,084,200 | 100.20<br>635,358,936 | 96.01<br>608,819,907 | 2.875<br>2028/5/15 | 0.33 |
| 21 | US T N/B 0.5 02/28/26<br>アメリカ | 国債証券 | 674,529,900 | 93.46<br>630,470,555 | 90.11<br>607,867,369 | 0.5<br>2026/2/28 | 0.32 |
| 22 | US T N/B 2.25 03/31/24<br>アメリカ | 国債証券 | 619,732,500 | 99.49<br>616,588,405 | 97.21<br>602,447,769 | 2.25<br>2024/3/31 | 0.32 |
| 23 | US T N/B 0.625 05/15/30<br>アメリカ | 国債証券 | 737,155,500 | 84.50<br>622,952,105 | 81.46<br>600,522,577 | 0.625<br>2030/5/15 | 0.32 |
| 24 | US T N/B 1.125 01/15/25<br>アメリカ | 国債証券 | 636,693,600 | 95.23<br>606,362,925 | 94.09<br>599,113,753 | 1.125<br>2025/1/15 | 0.32 |
| 25 | US T N/B 0.125 02/15/24<br>アメリカ | 国債証券 | 626,256,000 | 97.41<br>610,059,614 | 95.34<br>597,120,415 | 0.125<br>2024/2/15 | 0.32 |
| 26 | US T N/B 2.0 04/30/24<br>アメリカ | 国債証券 | 615,818,400 | 98.14<br>604,413,443 | 96.74<br>595,756,187 | 2<br>2024/4/30 | 0.32 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 27 | US T N/B 2.375 08/15/24<br>アメリカ | 国債証券 | 601,466,700 | 101.93<br>613,100,066 | 96.81<br>582,318,441 | 2.375<br>2024/8/15 | 0.31 |
| 28 | CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27<br>中国 | 国債証券 | 580,755,420 | 99.83<br>579,810,529 | 99.02<br>575,114,635 | 2.48<br>2027/4/15 | 0.31 |
| 29 | CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25<br>中国 | 国債証券 | 578,826,000 | 99.76<br>577,462,585 | 99.28<br>574,677,878 | 2.18<br>2025/8/25 | 0.31 |
| 30 | FRANCE OAT 0.5 05/25/25<br>フランス | 国債証券 | 598,798,800 | 97.06<br>581,231,005 | 95.10<br>569,473,227 | 0.5<br>2025/5/25 | 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

2023年1月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 98.80 |
| 合計 | 98.80 |

（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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域 | 種類<br>業種 | 数量 | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円) | 評価単価<br>評価金額<br>(円) | 利率<br>(%)<br>償還日 | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | TAIWAN SEMICONDUCTOR<br>台湾 | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 2,555,294 | 2,302.77<br>5,884,257,768 | 2,354.23<br>6,015,751,837 | －<br>－ | 5.92 |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD<br>ケイマン諸島 | 株式<br>インタラクティブ・メディアおよびサービス | 648,100 | 5,484.22<br>3,554,328,695 | 6,446.88<br>4,178,222,928 | －<br>－ | 4.11 |
| 3 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD<br>韓国 | 株式<br>コンピュータ・周辺機器 | 495,712 | 6,750.24<br>3,346,177,210 | 6,716.12<br>3,329,266,234 | －<br>－ | 3.28 |
| 4 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD<br>ケイマン諸島 | 株式<br>インターネット販売・通信販売 | 1,538,668 | 1,560.23<br>2,400,690,676 | 1,814.84<br>2,792,451,619 | －<br>－ | 2.75 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5 | MEITUAN<br>ケイマン諸島 | 株式<br>インターネット販売・通信販売 | 526,110 | 2,822.91<br>1,485,161,900 | 2,888.77<br>1,519,813,415 | －<br>－ | 1.50 |
| 6 | RELIANCE INDUSTRIES LTD<br>インド | 株式<br>石油・ガス・消耗燃料 | 316,568 | 4,177.29<br>1,322,398,672 | 3,799.19<br>1,202,704,354 | －<br>－ | 1.18 |
| 7 | VALE SA<br>ブラジル | 株式<br>金属・鉱業 | 396,789 | 2,125.47<br>843,365,606 | 2,418.50<br>959,635,876 | －<br>－ | 0.94 |
| 8 | JD.COM INC<br>ケイマン諸島 | 株式<br>インターネット販売・通信販売 | 223,735 | 3,851.50<br>861,715,568 | 3,952.70<br>884,359,571 | －<br>－ | 0.87 |
| 9 | INFOSYS LTD<br>インド | 株式<br>情報技術サービス | 350,646 | 2,653.53<br>930,450,583 | 2,477.46<br>868,714,244 | －<br>－ | 0.85 |
| 10 | CHINA CONSTRUCTION BANK<br>中国 | 株式<br>銀行 | 9,981,530 | 90.07<br>899,065,269 | 85.58<br>854,229,318 | －<br>－ | 0.84 |
| 11 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP<br>インド | 株式<br>各種金融サービス | 179,804 | 3,889.50<br>699,348,636 | 4,263.60<br>766,612,694 | －<br>－ | 0.75 |
| 12 | ICICI BANK LTD<br>インド | 株式<br>銀行 | 536,948 | 1,300.53<br>698,322,086 | 1,325.83<br>711,904,451 | －<br>－ | 0.70 |
| 13 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H<br>中国 | 株式<br>保険 | 659,000 | 871.39<br>574,249,106 | 1,013.98<br>668,216,115 | －<br>－ | 0.66 |
| 14 | PINDUODUO INC ADR<br>ケイマン諸島 | 株式<br>インターネット販売・通信販売 | 52,294 | 7,137.36<br>373,241,576 | 12,675.16<br>662,834,843 | －<br>－ | 0.65 |
| 15 | AL RAJHI BANK<br>サウジアラビア | 株式<br>銀行 | 204,748 | 3,457.46<br>707,909,597 | 2,850.93<br>583,724,058 | －<br>－ | 0.57 |
| 16 | NASPERS LTD<br>南アフリカ | 株式<br>インターネット販売・通信販売 | 22,668 | 14,565.65<br>330,174,254 | 25,194.62<br>571,111,716 | －<br>－ | 0.56 |
| 17 | HON HAI PRECISION INDUSTRY<br>台湾 | 株式<br>電子装置・機器・部品 | 1,303,150 | 454.77<br>592,641,884 | 425.32<br>554,258,833 | －<br>－ | 0.55 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 18 | SK HYNIX INC<br>韓国 | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 56,210 | 10,723.73<br>602,781,410 | 9,623.26<br>540,924,006 | －<br>－ | 0.53 |
| 19 | TATA CONSULTANCY SERVICES LTD<br>インド | 株式<br>情報技術サービス | 95,636 | 5,626.72<br>538,117,664 | 5,528.17<br>528,692,687 | －<br>－ | 0.52 |
| 20 | SAMSUNG ELECTRONICS-PFD<br>韓国 | 株式<br>コンピュータ・周辺機器 | 86,098 | 6,126.72<br>527,498,704 | 6,079.52<br>523,435,373 | －<br>－ | 0.52 |
| 21 | BAIDU INC<br>ケイマン諸島 | 株式<br>インタラクティブ・メディアおよびサービス | 229,350 | 2,314.50<br>530,831,399 | 2,266.06<br>519,722,007 | －<br>－ | 0.51 |
| 22 | MEDIATEK INC<br>台湾 | 株式<br>半導体・半導体製造装置 | 158,073 | 3,311.01<br>523,382,195 | 3,204.00<br>506,467,219 | －<br>－ | 0.50 |
| 23 | NETEASE INC<br>ケイマン諸島 | 株式<br>娯楽 | 202,700 | 2,427.00<br>491,952,978 | 2,342.65<br>474,856,168 | －<br>－ | 0.47 |
| 24 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT<br>インドネシア | 株式<br>銀行 | 5,808,900 | 68.88<br>400,123,186 | 75.69<br>439,675,641 | －<br>－ | 0.43 |
| 25 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC<br>ケイマン諸島 | 株式<br>ライフサイエンス・ツール／サービス | 376,500 | 1,057.84<br>398,276,966 | 1,115.55<br>420,004,575 | －<br>－ | 0.41 |
| 26 | BANK OF CHINA LTD<br>中国 | 株式<br>銀行 | 8,265,200 | 49.41<br>408,399,569 | 50.11<br>414,222,895 | －<br>－ | 0.41 |
| 27 | SAMSUNG SDI CO LTD<br>韓国 | 株式<br>電子装置・機器・部品 | 5,633 | 64,422.01<br>362,889,211 | 72,890.69<br>410,593,313 | －<br>－ | 0.40 |
| 28 | IND & COMM BK OF CHINA - H<br>中国 | 株式<br>銀行 | 5,857,235 | 73.53<br>430,696,948 | 69.92<br>409,596,443 | －<br>－ | 0.40 |
| 29 | AMERICA MOVIL SAB DE CV<br>メキシコ | 株式<br>無線通信サービス | 2,871,978 | 138.04<br>396,453,503 | 138.36<br>397,391,365 | －<br>－ | 0.39 |
| 30 | THE SAUDI NATIONAL BANK<br>サウジアラビア | 株式<br>銀行 | 229,007 | 2,449.70<br>560,999,650 | 1,643.03<br>376,265,829 | －<br>－ | 0.37 |

（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

2023年1月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 株式 | 91.12 |
| 投資信託受益証券 | 0.58 |
| 投資証券 | 0.09 |
| 合計 | 91.79 |

（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。

投資株式の業種別投資比率

2023年1月31日現在

| 業種 | 国内／外国 | 投資比率（%） |
|---|---|---|
| 銀行 | 外国 | 13.89 |
| 半導体・半導体製造装置 | | 8.51 |
| インターネット販売・通信販売 | | 6.69 |
| インタラクティブ・メディアおよびサービス | | 5.52 |
| コンピュータ・周辺機器 | | 4.79 |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 4.16 |
| 金属・鉱業 | | 4.01 |
| 化学 | | 2.93 |
| 保険 | | 2.55 |
| 電子装置・機器・部品 | | 2.51 |
| 自動車 | | 2.49 |
| 情報技術サービス | | 2.07 |
| 食品 | | 1.71 |
| 不動産管理・開発 | | 1.68 |
| 無線通信サービス | | 1.52 |
| 各種金融サービス | | 1.46 |
| 飲料 | | 1.32 |
| 食品・生活必需品小売り | | 1.28 |
| 各種電気通信サービス | | 1.21 |
| 医薬品 | | 1.17 |
| ホテル・レストラン・レジャー | | 1.16 |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | | 1.10 |
| コングロマリット | | 1.09 |
| 電気設備 | | 1.00 |
| 娯楽 | | 0.98 |
| 電力 | | 0.95 |
| 資本市場 | | 0.88 |
| ライフサイエンス・ツール／サービス | | 0.85 |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | | 0.82 |
| 建設資材 | | 0.78 |
| 専門小売り | | 0.76 |
| ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス | | 0.73 |
| パーソナル用品 | | 0.71 |
| バイオテクノロジー | | 0.68 |
| 運送インフラ | | 0.65 |
| ガス | | 0.54 |
| 建設・土木 | | 0.54 |
| 消費者金融 | | 0.53 |
| 自動車部品 | | 0.51 |
| 機械 | | 0.46 |

| | |
|---|---|
| 海運業 | 0.36 |
| 家庭用耐久財 | 0.35 |
| タバコ | 0.31 |
| 旅客航空輸送業 | 0.28 |
| 航空貨物・物流サービス | 0.28 |
| ソフトウェア | 0.26 |
| 陸運・鉄道 | 0.25 |
| ヘルスケア機器・用品 | 0.24 |
| 商社・流通業 | 0.18 |
| 複合小売り | 0.18 |
| 各種消費者サービス | 0.17 |
| 航空宇宙・防衛 | 0.16 |
| 紙製品・林産品 | 0.16 |
| 通信機器 | 0.14 |
| メディア | 0.13 |
| 水道 | 0.12 |
| 家庭用品 | 0.09 |
| エネルギー設備・サービス | 0.07 |
| 商業サービス・用品 | 0.07 |
| 建設関連製品 | 0.04 |
| 容器・包装 | 0.04 |
| 総合公益事業 | 0.03 |
| レジャー用品 | 0.03 |
| 合計 | 91.12 |

（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。

**エマージング債券パッシブ・マザーファンド**

2023年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33<br>ドミニカ共和国 | 国債証券 | 3,679,254,000 | 86.76<br>3,192,488,173 | 92.73<br>3,412,060,135 | 6<br>2033/2/22 | 2.55 |
| 2 | SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29<br>サウジアラビア | 国債証券 | 2,348,460,000 | 99.93<br>2,346,976,556 | 100.23<br>2,353,861,458 | 4.375<br>2029/4/16 | 1.76 |
| 3 | DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29<br>ドミニカ共和国 | 国債証券 | 2,478,930,000 | 90.30<br>2,238,639,486 | 94.36<br>2,339,199,037 | 5.5<br>2029/2/22 | 1.75 |
| 4 | STATE OF QATAR 5.103 04/23/48<br>カタール | 国債証券 | 2,087,520,000 | 100.67<br>2,101,587,275 | 103.51<br>2,160,791,952 | 5.103<br>2048/4/23 | 1.62 |
| 5 | STATE OF QATAR 4.817 03/14/49<br>カタール | 国債証券 | 2,087,520,000 | 99.80<br>2,083,388,015 | 100.18<br>2,091,421,574 | 4.817<br>2049/3/14 | 1.57 |
| 6 | DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60<br>ドミニカ共和国 | 国債証券 | 2,609,400,000 | 70.96<br>1,851,745,053 | 77.12<br>2,012,426,243 | 5.875<br>2060/1/30 | 1.51 |
| 7 | PERU 2.783 01/23/31<br>ペルー | 国債証券 | 2,348,460,000 | 83.89<br>1,970,309,666 | 84.88<br>1,993,548,841 | 2.783<br>2031/1/23 | 1.49 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 8 | OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28<br>オマーン | 国債証券 | 1,826,580,000 | 98.24<br>1,794,588,756 | 100.79<br>1,841,009,982 | 5.625<br>2028/1/17 | 1.38 |
| 9 | REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31<br>ウルグアイ | 国債証券 | 1,826,580,000 | 100.23<br>1,830,788,962 | 99.94<br>1,825,656,718 | 4.375<br>2031/1/23 | 1.37 |
| 10 | REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55<br>ウルグアイ | 国債証券 | 1,826,580,000 | 95.67<br>1,747,620,860 | 99.74<br>1,821,896,685 | 4.975<br>2055/4/20 | 1.36 |
| 11 | STATE OF QATAR 3.75 04/16/30<br>カタール | 国債証券 | 1,826,580,000 | 96.56<br>1,763,927,001 | 98.17<br>1,793,199,250 | 3.75<br>2030/4/16 | 1.34 |
| 12 | STATE OF QATAR 4.4 04/16/50<br>カタール | 国債証券 | 1,826,580,000 | 92.98<br>1,698,406,272 | 94.46<br>1,725,387,468 | 4.4<br>2050/4/16 | 1.29 |
| 13 | SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49<br>南アフリカ | 国債証券 | 2,217,990,000 | 72.71<br>1,612,867,530 | 76.92<br>1,706,277,527 | 5.75<br>2049/9/30 | 1.28 |
| 14 | SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25<br>サウジアラビア | 国債証券 | 1,696,110,000 | 100.32<br>1,701,653,670 | 99.34<br>1,684,915,674 | 4<br>2025/4/17 | 1.26 |
| 15 | OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29<br>オマーン | 国債証券 | 1,565,640,000 | 98.78<br>1,546,656,615 | 102.81<br>1,609,650,140 | 6<br>2029/8/1 | 1.21 |
| 16 | SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30<br>サウジアラビア | 国債証券 | 1,565,640,000 | 98.81<br>1,547,093,689 | 100.40<br>1,571,991,801 | 4.5<br>2030/4/17 | 1.18 |
| 17 | STATE OF QATAR 4.0 03/14/29<br>カタール | 国債証券 | 1,565,640,000 | 98.95<br>1,549,211,217 | 99.79<br>1,562,352,156 | 4<br>2029/3/14 | 1.17 |
| 18 | SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52<br>南アフリカ | 国債証券 | 1,696,110,000 | 86.51<br>1,467,401,308 | 91.01<br>1,543,782,360 | 7.3<br>2052/4/20 | 1.16 |
| 19 | SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32<br>サウジアラビア | 国債証券 | 1,435,170,000 | 104.52<br>1,500,180,591 | 107.13<br>1,537,497,621 | 5.5<br>2032/10/25 | 1.15 |
| 20 | BRAZIL 4.75 01/14/50<br>ブラジル | 国債証券 | 2,087,520,000 | 71.42<br>1,491,095,965 | 73.51<br>1,534,565,239 | 4.75<br>2050/1/14 | 1.15 |
| 21 | HUNGARY 2.125 09/22/31<br>ハンガリー | 国債証券 | 1,957,050,000 | 73.97<br>1,447,791,667 | 77.45<br>1,515,917,230 | 2.125<br>2031/9/22 | 1.14 |
| 22 | ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25<br>アラブ首長国連邦 | 国債証券 | 1,565,640,000 | 96.70<br>1,513,997,364 | 96.25<br>1,506,928,500 | 2.5<br>2025/4/16 | 1.13 |
| 23 | BRAZIL 3.875 06/12/30<br>ブラジル | 国債証券 | 1,696,110,000 | 86.15<br>1,461,217,030 | 88.70<br>1,504,494,940 | 3.875<br>2030/6/12 | 1.13 |
| 24 | OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31<br>オマーン | 国債証券 | 1,435,170,000 | 99.14<br>1,422,931,914 | 103.94<br>1,491,816,159 | 6.25<br>2031/1/25 | 1.12 |
| 25 | SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29<br>南アフリカ | 国債証券 | 1,565,640,000 | 86.20<br>1,349,733,025 | 91.54<br>1,433,294,885 | 4.85<br>2029/9/30 | 1.07 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 26 | PANAMA 2.252 09/29/32<br>パナマ | 国債証券 | 1,826,580,000 | 74.44<br>1,359,878,372 | 76.96<br>1,405,861,490 | 2.252<br>2032/9/29 | 1.05 |
| 27 | PERU 3.0 01/15/34<br>ペルー | 国債証券 | 1,696,110,000 | 77.87<br>1,320,807,826 | 81.53<br>1,382,875,203 | 3<br>2034/1/15 | 1.04 |
| 28 | SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25<br>サウジアラビア | 国債証券 | 1,435,170,000 | 96.72<br>1,388,213,847 | 96.29<br>1,381,925,193 | 2.9<br>2025/10/22 | 1.03 |
| 29 | ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24<br>アラブ首長国連邦 | 国債証券 | 1,435,170,000 | 96.73<br>1,388,337,793 | 96.15<br>1,380,022,157 | 2.125<br>2024/9/30 | 1.03 |
| 30 | STATE OF QATAR 4.5 04/23/28<br>カタール | 国債証券 | 1,304,700,000 | 100.61<br>1,312,669,107 | 102.13<br>1,332,490,110 | 4.5<br>2028/4/23 | 1.00 |

（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

2023年1月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 97.32 |
| 合計 | 97.32 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 日本ビルファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 21,821 | 691,456.43<br>15,088,270,918 | 567,000.00<br>12,372,507,000 | －<br>－ | 6.32 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人<br>日本 | 投資証券 | 18,706 | 632,458.25<br>11,830,764,210 | 557,000.00<br>10,419,242,000 | －<br>－ | 5.32 |
| 3 | 日本都市ファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 94,380 | 106,632.50<br>10,063,975,517 | 100,300.00<br>9,466,314,000 | －<br>－ | 4.84 |
| 4 | 日本プロロジスリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 31,530 | 337,418.93<br>10,638,819,126 | 294,300.00<br>9,279,279,000 | －<br>－ | 4.74 |
| 5 | 野村不動産マスターファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 60,490 | 167,861.43<br>10,153,938,161 | 151,900.00<br>9,188,431,000 | －<br>－ | 4.69 |
| 6 | ＧＬＰ投資法人<br>日本 | 投資証券 | 60,374 | 164,052.09<br>9,904,481,227 | 146,700.00<br>8,856,865,800 | －<br>－ | 4.52 |
| 7 | 大和ハウスリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 28,196 | 311,577.86<br>8,785,249,601 | 282,800.00<br>7,973,828,800 | －<br>－ | 4.07 |
| 8 | オリックス不動産投資法人<br>日本 | 投資証券 | 37,271 | 186,085.48<br>6,935,592,235 | 178,700.00<br>6,660,327,700 | －<br>－ | 3.40 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 9 | ユナイテッド・アーバン投資法人<br>日本 | 投資証券 | 41,843 | 147,684.62<br>6,179,567,726 | 147,800.00<br>6,184,395,400 | －<br>－ | 3.16 |
| 10 | アドバンス・レジデンス投資法人<br>日本 | 投資証券 | 18,703 | 355,527.34<br>6,649,427,845 | 317,500.00<br>5,938,202,500 | －<br>－ | 3.03 |
| 11 | ジャパン・ホテル・リート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 60,322 | 69,196.15<br>4,174,050,230 | 82,200.00<br>4,958,468,400 | －<br>－ | 2.53 |
| 12 | インヴィンシブル投資法人<br>日本 | 投資証券 | 82,331 | 43,316.94<br>3,566,327,004 | 55,300.00<br>4,552,904,300 | －<br>－ | 2.33 |
| 13 | 日本プライムリアルティ投資法人<br>日本 | 投資証券 | 12,792 | 406,054.15<br>5,194,244,800 | 352,000.00<br>4,502,784,000 | －<br>－ | 2.30 |
| 14 | 産業ファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 27,953 | 178,792.92<br>4,997,798,605 | 143,900.00<br>4,022,436,700 | －<br>－ | 2.05 |
| 15 | 積水ハウス・リート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 56,209 | 79,815.13<br>4,486,328,949 | 71,000.00<br>3,990,839,000 | －<br>－ | 2.04 |
| 16 | アクティビア・プロパティーズ投資法人<br>日本 | 投資証券 | 9,875 | 416,714.02<br>4,115,050,992 | 389,000.00<br>3,841,375,000 | －<br>－ | 1.96 |
| 17 | 日本アコモデーションファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 6,459 | 659,426.25<br>4,259,234,208 | 583,000.00<br>3,765,597,000 | －<br>－ | 1.92 |
| 18 | 日本ロジスティクスファンド投資法人<br>日本 | 投資証券 | 12,613 | 323,671.86<br>4,082,473,210 | 296,100.00<br>3,734,709,300 | －<br>－ | 1.91 |
| 19 | ラサールロジポート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 22,899 | 172,743.20<br>3,955,646,619 | 157,300.00<br>3,602,012,700 | －<br>－ | 1.84 |
| 20 | フロンティア不動産投資法人<br>日本 | 投資証券 | 6,940 | 527,272.72<br>3,659,272,746 | 501,000.00<br>3,476,940,000 | －<br>－ | 1.78 |
| 21 | ケネディクス・オフィス投資法人<br>日本 | 投資証券 | 10,884 | 333,103.30<br>3,625,496,413 | 308,500.00<br>3,357,714,000 | －<br>－ | 1.72 |
| 22 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人<br>日本 | 投資証券 | 7,389 | 531,903.76<br>3,930,236,911 | 453,500.00<br>3,350,911,500 | －<br>－ | 1.71 |
| 23 | 森ヒルズリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 21,996 | 153,836.86<br>3,383,795,678 | 147,600.00<br>3,246,609,600 | －<br>－ | 1.66 |
| 24 | イオンリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 20,706 | 154,450.67<br>3,198,055,745 | 143,600.00<br>2,973,381,600 | －<br>－ | 1.52 |
| 25 | 大和証券リビング投資法人<br>日本 | 投資証券 | 25,921 | 116,251.57<br>3,013,357,019 | 108,700.00<br>2,817,612,700 | －<br>－ | 1.44 |
| 26 | ヒューリックリート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 17,501 | 163,771.46<br>2,866,164,386 | 155,200.00<br>2,716,155,200 | －<br>－ | 1.39 |
| 27 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人<br>日本 | 投資証券 | 13,718 | 213,924.60<br>2,934,617,798 | 193,600.00<br>2,655,804,800 | －<br>－ | 1.36 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 28 | 三菱地所物流リート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 6,426 | 454,875.26<br>2,923,028,483 | 408,500.00<br>2,625,021,000 | －<br>－ | 1.34 |
| 29 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人<br>日本 | 投資証券 | 8,702 | 330,113.24<br>2,872,645,478 | 288,900.00<br>2,514,007,800 | －<br>－ | 1.28 |
| 30 | 東急リアル・エステート投資法人<br>日本 | 投資証券 | 12,541 | 196,924.85<br>2,469,634,610 | 195,800.00<br>2,455,527,800 | －<br>－ | 1.25 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年1月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 97.76 |
| 合計 | 97.76 |

（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

2023年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価<br>簿価金額<br>（円） | 評価単価<br>評価金額<br>（円） | 利率<br>（%）<br>償還日 | 投資比率<br>（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | PROLOGIS INC<br>アメリカ | 投資証券 | 371,047 | 14,784.17<br>5,485,624,052 | 16,672.76<br>6,186,378,062 | －<br>－ | 8.64 |
| 2 | EQUINIX INC<br>アメリカ | 投資証券 | 37,205 | 82,599.84<br>3,073,127,351 | 94,572.48<br>3,518,569,274 | －<br>－ | 4.91 |
| 3 | PUBLIC STORAGE<br>アメリカ | 投資証券 | 63,568 | 39,417.27<br>2,505,677,068 | 38,996.17<br>2,478,909,062 | －<br>－ | 3.46 |
| 4 | REALTY INCOME CORP<br>アメリカ | 投資証券 | 252,224 | 8,483.15<br>2,139,656,269 | 8,841.95<br>2,230,152,476 | －<br>－ | 3.11 |
| 5 | SIMON PROPERTY GROUP INC<br>アメリカ | 投資証券 | 131,492 | 13,284.91<br>1,746,859,612 | 16,432.69<br>2,160,768,128 | －<br>－ | 3.02 |
| 6 | WELLTOWER INC<br>アメリカ | 投資証券 | 190,068 | 9,690.86<br>1,841,923,038 | 9,722.62<br>1,847,959,774 | －<br>－ | 2.58 |
| 7 | VICI PROPERTIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 387,425 | 4,000.60<br>1,549,935,430 | 4,420.32<br>1,712,543,870 | －<br>－ | 2.39 |
| 8 | DIGITAL REALTY TRUST INC<br>アメリカ | 投資証券 | 115,666 | 15,667.73<br>1,812,224,025 | 14,486.08<br>1,675,547,403 | －<br>－ | 2.34 |
| 9 | GOODMAN GROUP<br>オーストラリア | 投資信託受益証券 | 688,653 | 1,626.77<br>1,120,283,008 | 1,851.47<br>1,275,020,507 | －<br>－ | 1.78 |
| 10 | AVALONBAY COMMUNITIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 56,297 | 24,360.40<br>1,371,417,875 | 22,606.53<br>1,272,680,207 | －<br>－ | 1.78 |
| 11 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT<br>アメリカ | 投資証券 | 60,091 | 18,073.03<br>1,086,026,667 | 20,533.36<br>1,233,870,652 | －<br>－ | 1.72 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 12 | EQUITY RESIDENTIAL<br>アメリカ | 投資証券 | 136,900 | 9,006.96<br>1,233,053,919 | 8,096.96<br>1,108,474,946 | －<br>－ | 1.55 |
| 13 | VENTAS INC<br>アメリカ | 投資証券 | 160,896 | 6,111.07<br>983,246,817 | 6,690.50<br>1,076,474,945 | －<br>－ | 1.50 |
| 14 | EXTRA SPACE STORAGE INC<br>アメリカ | 投資証券 | 53,904 | 21,527.43<br>1,160,414,656 | 19,961.90<br>1,076,026,796 | －<br>－ | 1.50 |
| 15 | MID AMERICA<br>アメリカ | 投資証券 | 46,489 | 21,229.28<br>986,928,446 | 21,103.52<br>981,081,657 | －<br>－ | 1.37 |
| 16 | INVITATION HOMES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 233,836 | 4,408.51<br>1,030,868,885 | 4,148.94<br>970,172,936 | －<br>－ | 1.35 |
| 17 | SUN COMMUNITIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 49,877 | 19,515.36<br>973,368,051 | 19,262.59<br>960,760,241 | －<br>－ | 1.34 |
| 18 | WP CAREY INC<br>アメリカ | 投資証券 | 83,759 | 10,655.20<br>892,469,135 | 11,058.63<br>926,260,393 | －<br>－ | 1.29 |
| 19 | LINK REIT<br>香港 | 投資証券 | 848,620 | 1,010.62<br>857,632,528 | 1,070.59<br>908,528,328 | －<br>－ | 1.27 |
| 20 | IRON MOUNTAIN INC<br>アメリカ | 投資証券 | 117,078 | 6,365.81<br>745,296,928 | 7,105.39<br>831,885,576 | －<br>－ | 1.16 |
| 21 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 216,512 | 3,243.19<br>702,190,290 | 3,540.95<br>766,659,422 | －<br>－ | 1.07 |
| 22 | ESSEX PROPERTY TRUST INC<br>アメリカ | 投資証券 | 26,084 | 32,298.61<br>842,477,085 | 28,643.38<br>747,134,023 | －<br>－ | 1.04 |
| 23 | KIMCO REALTY<br>アメリカ | 投資証券 | 249,147 | 2,591.24<br>645,601,503 | 2,884.69<br>718,712,282 | －<br>－ | 1.00 |
| 24 | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC<br>アメリカ | 投資証券 | 103,742 | 6,149.78<br>637,991,319 | 6,865.33<br>712,223,210 | －<br>－ | 0.99 |
| 25 | HOST HOTELS & RESORTS INC<br>アメリカ | 投資証券 | 288,079 | 2,197.05<br>632,926,146 | 2,417.60<br>696,462,411 | －<br>－ | 0.97 |
| 26 | CAMDEN PROPERTY TRUST<br>アメリカ | 投資証券 | 42,922 | 16,492.27<br>707,881,248 | 15,627.69<br>670,771,993 | －<br>－ | 0.94 |
| 27 | UDR INC<br>アメリカ | 投資証券 | 123,303 | 5,625.70<br>693,665,855 | 5,396.23<br>665,372,482 | －<br>－ | 0.93 |
| 28 | SEGRO PLC<br>イギリス | 投資証券 | 487,318 | 1,499.57<br>730,769,205 | 1,354.02<br>659,839,740 | －<br>－ | 0.92 |
| 29 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES<br>アメリカ | 投資証券 | 70,501 | 8,863.65<br>624,896,531 | 8,826.29<br>622,262,659 | －<br>－ | 0.87 |
| 30 | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC<br>アメリカ | 投資証券 | 73,957 | 7,375.00<br>545,433,352 | 8,124.36<br>600,853,802 | －<br>－ | 0.84 |

（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**

2023年1月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資信託受益証券 | 10.74 |
| 投資証券 | 88.83 |
| 合計 | 99.58 |

（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。**

**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。**

**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。**

**エマージング株式パッシブ・マザーファンド**
**該当事項はありません。**

**エマージング債券パッシブ・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**

**2023年1月31日現在**

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価金額（円） | 評価金額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | ＴＯＰＩＸ先物　０５０３月 | 買建 | 450 | 8,560,603,500 | 8,889,750,000 | 2.31 |

**（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。**

**外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド**

**2023年1月31日現在**

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価金額（円） | 評価金額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | シカゴ商品取引所 | S&P500 EMINI FUT Mar23 | 買建 | 510 | 13,152,940,009 | 13,416,067,012 | 1.63 |
| | ＥＵＲＥＸ取引所 | DJ EURO STOXX 50 Mar23 | 買建 | 491 | 2,831,587,874 | 2,895,618,293 | 0.35 |
| | ＩＣＥ－ＥＵ | FTSE 100 INDEX FUTURE Mar23 | 買建 | 68 | 843,616,271 | 851,373,358 | 0.10 |
| | モントリオール取引所 | S&P/TSE 60 IX FUT Mar23 | 買建 | 28 | 660,386,385 | 677,754,257 | 0.08 |
| | シドニー先物取引所 | SPI 200 FUTURES Mar23 | 買建 | 27 | 446,099,518 | 460,865,774 | 0.06 |

（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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年1月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価金額（円） | 評価金額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | ＩＣＥ－ＵＳ | MINI MSCI EMG MKT Mar23 | 買建 | 1,216 | 7,879,038,287 | 8,309,373,360 | 8.18 |

（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。

エマージング債券パッシブ・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

2023年1月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価金額（円） | 評価金額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 不動産投信指数先物取引 | 大阪取引所 | ＴＲＥＩＴ先物　０５０３月 | 買建 | 2,337 | 4,474,887,600 | 4,240,486,500 | 2.17 |

（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（2023年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額（分配落）（百万円） | 純資産総額（分配付）（百万円） | １口当たりの純資産額（分配落）（円） | １口当たりの純資産額（分配付）（円） |
|---|---|---|---|---|

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末<br>(2014年1月14日) | 10 | 10 | 1.0217 | 1.0217 |
| 第2計算期間末<br>(2015年1月13日) | 625 | 625 | 1.1240 | 1.1240 |
| 第3計算期間末<br>(2016年1月12日) | 1,480 | 1,480 | 1.1046 | 1.1046 |
| 第4計算期間末<br>(2017年1月11日) | 2,532 | 2,532 | 1.1738 | 1.1738 |
| 第5計算期間末<br>(2018年1月11日) | 4,033 | 4,033 | 1.2395 | 1.2395 |
| 第6計算期間末<br>(2019年1月11日) | 5,223 | 5,223 | 1.2011 | 1.2011 |
| 第7計算期間末<br>(2020年1月14日) | 6,963 | 6,963 | 1.2978 | 1.2978 |
| 第8計算期間末<br>(2021年1月12日) | 8,276 | 8,276 | 1.3282 | 1.3282 |
| 第9計算期間末<br>(2022年1月11日) | 10,371 | 10,371 | 1.4048 | 1.4048 |
| 第10計算期間末<br>(2023年1月11日) | 12,077 | 12,077 | 1.3425 | 1.3425 |
| 2022年1月末日 | 10,446 | － | 1.3821 | － |
| 2月末日 | 10,416 | － | 1.3693 | － |
| 3月末日 | 10,825 | － | 1.3988 | － |
| 4月末日 | 10,699 | － | 1.3833 | － |
| 5月末日 | 10,739 | － | 1.3802 | － |
| 6月末日 | 11,546 | － | 1.3672 | － |
| 7月末日 | 11,706 | － | 1.3864 | － |
| 8月末日 | 11,748 | － | 1.3889 | － |
| 9月末日 | 11,577 | － | 1.3511 | － |
| 10月末日 | 11,759 | － | 1.3759 | － |
| 11月末日 | 11,792 | － | 1.3731 | － |
| 12月末日 | 12,025 | － | 1.3362 | － |
| 2023年1月末日 | 12,139 | － | 1.3521 | － |

### ②【分配の推移】

| | １口当たりの分配金（円） |
|---|---|
| 第1計算期間 | 0.0000 |
| 第2計算期間 | 0.0000 |
| 第3計算期間 | 0.0000 |
| 第4計算期間 | 0.0000 |
| 第5計算期間 | 0.0000 |
| 第6計算期間 | 0.0000 |
| 第7計算期間 | 0.0000 |
| 第8計算期間 | 0.0000 |
| 第9計算期間 | 0.0000 |
| 第10計算期間 | 0.0000 |

### ③【収益率の推移】

| | 収益率（%） |
|---|---|
| 第1計算期間 | 2.2 |
| 第2計算期間 | 10.0 |
| 第3計算期間 | △1.7 |
| 第4計算期間 | 6.3 |
| 第5計算期間 | 5.6 |
| 第6計算期間 | △3.1 |
| 第7計算期間 | 8.1 |
| 第8計算期間 | 2.3 |
| 第9計算期間 | 5.8 |
| 第10計算期間 | △4.4 |

（注）収益率は期間騰落率です。

## （４）【設定及び解約の実績】

| | 設定口数 | 解約口数 |
|---|---|---|
| 第1計算期間 | 10,000,000 | 0 |
| 第2計算期間 | 559,142,709 | 12,674,655 |
| 第3計算期間 | 804,196,031 | 20,449,035 |
| 第4計算期間 | 864,393,144 | 47,536,729 |
| 第5計算期間 | 1,198,404,787 | 101,758,125 |
| 第6計算期間 | 1,267,492,933 | 172,525,310 |
| 第7計算期間 | 1,268,926,494 | 252,278,216 |
| 第8計算期間 | 1,243,268,765 | 377,079,219 |
| 第9計算期間 | 1,571,812,018 | 420,724,034 |
| 第10計算期間 | 2,162,356,090 | 548,959,942 |

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2023年1月31日

## 基準価額・純資産の推移 《2013年11月8日～2023年1月31日》

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2013年11月8日)

## 分配の推移(税引前)

| | |
|---|---|
| 2019年 1月 | 0円 |
| 2020年 1月 | 0円 |
| 2021年 1月 | 0円 |
| 2022年 1月 | 0円 |
| 2023年 1月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

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

| 順位 | 銘柄名 | 比率(%) |
|---|---|---|
| 1 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 56.37 |
| 2 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 10.23 |
| 3 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 10.22 |
| 4 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 5.21 |
| 5 | エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 4.95 |
| 6 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 3.19 |
| 7 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 2.98 |
| 8 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド | 2.90 |

### ■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 | 3.58 |
| 2 | ソニーグループ | 株式 | 日本 | 電気機器 | 2.82 |
| 3 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 株式 | 日本 | 銀行業 | 2.05 |
| 4 | キーエンス | 株式 | 日本 | 電気機器 | 2.04 |
| 5 | 日本電信電話 | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.72 |

○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:2023年1月31日

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国/地域 | 利率(%) | 償還日 | 比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 335回　利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 0.5 | 2024/9/20 | 1.16 |
| 2 | 334回　利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 0.6 | 2024/6/20 | 1.11 |
| 3 | 437回　利付国庫債券(2年) | 国債証券 | 日本 | 0.005 | 2024/6/1 | 0.96 |
| 4 | 438回　利付国庫債券(2年) | 国債証券 | 日本 | 0.005 | 2024/7/1 | 0.95 |
| 5 | 368回　利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 0.2 | 2032/9/20 | 0.93 |

■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 | 4.54 |
| 2 | MICROSOFT CORP | 株式 | アメリカ | ソフトウェア | 3.40 |
| 3 | AMAZON.COM INC | 株式 | アメリカ | インターネット販売・通信販売 | 1.82 |
| 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 | 1.14 |
| 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 | 1.07 |

■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 | 0.59 |
| 2 | US T N/B 0.25 05/15/24 | 国債証券 | アメリカ | 0.25 | 2024/5/15 | 0.49 |
| 3 | US T N/B 0.875 11/15/30 | 国債証券 | アメリカ | 0.875 | 2030/11/15 | 0.47 |
| 4 | US T N/B 1.25 08/15/31 | 国債証券 | アメリカ | 1.25 | 2031/8/15 | 0.47 |
| 5 | US T N/B 1.375 11/15/31 | 国債証券 | アメリカ | 1.375 | 2031/11/15 | 0.47 |

■エマージング株式パッシブ・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 | TAIWAN SEMICONDUCTOR | 株式 | 台湾 | 半導体・半導体製造装置 | 5.92 |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD | 株式 | ケイマン諸島 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 4.11 |
| 3 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 株式 | 韓国 | コンピュータ・周辺機器 | 3.28 |
| 4 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 株式 | ケイマン諸島 | インターネット販売・通信販売 | 2.75 |
| 5 | MEITUAN | 株式 | ケイマン諸島 | インターネット販売・通信販売 | 1.50 |

○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:2023年1月31日

■エマージング債券パッシブ・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 | DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 | 国債証券 | ドミニカ共和国 | 6 | 2033/2/22 | 2.55 |
| 2 | SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 | 国債証券 | サウジアラビア | 4.375 | 2029/4/16 | 1.76 |
| 3 | DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 | 国債証券 | ドミニカ共和国 | 5.5 | 2029/2/22 | 1.75 |
| 4 | STATE OF QATAR 5.103 04/23/48 | 国債証券 | カタール | 5.103 | 2048/4/23 | 1.62 |
| 5 | STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 | 国債証券 | カタール | 4.817 | 2049/3/14 | 1.57 |

■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 | 6.32 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 投資証券 | 日本 | 5.32 |
| 3 | 日本都市ファンド投資法人 | 投資証券 | 日本 | 4.84 |
| 4 | 日本プロロジスリート投資法人 | 投資証券 | 日本 | 4.74 |
| 5 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 投資証券 | 日本 | 4.69 |

■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 | 8.64 |
| 2 | EQUINIX INC | 投資証券 | アメリカ | 4.91 |
| 3 | PUBLIC STORAGE | 投資証券 | アメリカ | 3.46 |
| 4 | REALTY INCOME CORP | 投資証券 | アメリカ | 3.11 |
| 5 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 投資証券 | アメリカ | 3.02 |

## 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。
※2023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。

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

# 第２【管理及び運営】

## １【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

**ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/**
**コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）**

**・お申込単位**
**1口以上1口単位または1円以上1円単位(当初元本1口＝1円)**
**※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。**

**・お申込手数料**
**ありません。**

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

**2【換金（解約）手続等】**

**・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。**
**解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。**
**※海外休業日には、解約の受付を行いません。**
**※解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。**
**なお、受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。**
**※委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。**

**・解約価額**
**解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。**
**解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。**
**※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。**
**・販売会社へのお問い合わせ**
**・委託会社への照会**

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

**・解約単位**

**1口単位とします。**

**・解約代金の受渡日**

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

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

**基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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<br>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<br>・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）<br>・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。）<br>・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。**

**・販売会社へのお問い合わせ**

**・委託会社への照会**

**ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/**

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

### （2）【保管】

**該当事項はありません。**

**（３）【信託期間】**

信託期間は、2013年11月8日（設定日）から原則として無期限です。

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

**（４）【計算期間】**

a.計算期間は、原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

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

**（５）【その他】**

イ.償還規定

a.委託会社は、信託期間中において、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

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

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

e.上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

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

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

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

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

ロ.信託約款の変更等

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

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

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

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

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

**ハ.関係法人との契約の更改**

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

**ニ.公告**

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

**（URL　http://www.am-one.co.jp/）**

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

**ホ.運用報告書**

- **委託会社は、毎年1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**

**収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。**

**販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、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。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。**

**(2)償還金請求権**

**受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。**

**受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、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）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間（2022年1月12日から2023年1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】

## 【ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞】

### （１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第9期<br>2022年1月11日現在 | 第10期<br>2023年1月11日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 440,129,761 | 507,218,560 |
| 親投資信託受益証券 | 9,952,659,250 | 11,597,501,768 |
| 未収入金 | 2,276,000 | 1,325,000 |
| 流動資産合計 | 10,395,065,011 | 12,106,045,328 |
| 資産合計 | 10,395,065,011 | 12,106,045,328 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 10,210,363 | 12,411,772 |
| 未払受託者報酬 | 1,359,836 | 1,631,072 |
| 未払委託者報酬 | 11,966,834 | 14,353,832 |
| その他未払費用 | 193,560 | 232,181 |
| 流動負債合計 | 23,730,593 | 28,628,857 |
| 負債合計 | 23,730,593 | 28,628,857 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 7,382,611,558 | 8,996,007,706 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,988,722,860 | 3,081,408,765 |
| （分配準備積立金） | 1,220,655,087 | 1,273,514,614 |
| 元本等合計 | 10,371,334,418 | 12,077,416,471 |
| 純資産合計 | 10,371,334,418 | 12,077,416,471 |
| 負債純資産合計 | 10,395,065,011 | 12,106,045,328 |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第9期<br>自　2021年1月13日<br>至　2022年1月11日 | 第10期<br>自　2022年1月12日<br>至　2023年1月11日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 1,298 | 3,278 |
| 有価証券売買等損益 | 531,185,538 | △468,045,482 |
| 営業収益合計 | 531,186,836 | △468,042,204 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 82,891 | 172,838 |
| 受託者報酬 | 2,557,273 | 3,084,107 |
| 委託者報酬 | 22,504,665 | 27,140,893 |
| その他費用 | 363,984 | 439,006 |
| 営業費用合計 | 25,508,813 | 30,836,844 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 505,678,023 | △498,879,048 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 505,678,023 | △498,879,048 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 505,678,023 | △498,879,048 |
| 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（△） | 22,016,118 | △14,100,231 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 2,045,137,984 | 2,988,722,860 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 599,878,863 | 797,747,741 |
| 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 | 599,878,863 | 797,747,741 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 139,955,892 | 220,283,019 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 139,955,892 | 220,283,019 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,988,722,860 | 3,081,408,765 |

## （３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 項目 | 第10期<br>自　2022年1月12日<br>至　2023年1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<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | 第9期<br>2022年1月11日現在 | 第10期<br>2023年1月11日現在 |
|---|---|---|
| １．　期首元本額 | 6,231,523,574円 | 7,382,611,558円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,571,812,018円 | 2,162,356,090円 |
| 期中一部解約元本額 | 420,724,034円 | 548,959,942円 |
| ２．　受益権の総数 | 7,382,611,558口 | 8,996,007,706口 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項目 | 第9期<br>自　2021年1月13日<br>至　2022年1月11日 | 第10期<br>自　2022年1月12日<br>至　2023年1月11日 |
|---|---|---|
| １．　分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（115,889,365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（367,772,540円）、信託約款に規定される収益調整金（1,768,067,773円）及び分配準備積立金（736,993,182円）より分配対象収益は2,988,722,860円（1万口当たり4,048.32円）でありますが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（132,235,135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（1,944,158,881円）及び分配準備積立金（1,141,279,479円）より分配対象収益は3,217,673,495円（1万口当たり3,576.77円）でありますが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第9期<br>自　2021年1月13日<br>至　2022年1月11日 | 第10期<br>自　2022年1月12日<br>至　2023年1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 | 第9期<br>2022年1月11日現在 | 第10期<br>2023年1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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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 | 第9期<br>2022年1月11日現在 | 第10期<br>2023年1月11日現在 |
|---|---|---|
| | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 488,100,459 | △470,969,172 |
| 合計 | 488,100,459 | △470,969,172 |

**（デリバティブ取引等に関する注記）**

該当事項はありません。

**（関連当事者との取引に関する注記）**

該当事項はありません。

**（1口当たり情報に関する注記）**

| | 第9期<br>2022年1月11日現在 | 第10期<br>2023年1月11日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.4048円<br>(14,048円) | 1.3425円<br>(13,425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**

2023年1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 | 371,916,647 | 1,203,150,353 | |
| | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 5,545,357,902 | 6,847,407,937 | |
| | Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド | 154,914,085 | 357,867,027 | |
| | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 208,870,039 | 1,232,876,292 | |
| | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 180,603,325 | 362,850,140 | |
| | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 231,792,328 | 367,321,302 | |
| | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 446,925,491 | 629,852,094 | |
| | エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 305,966,961 | 596,176,623 | |
| 親投資信託受益証券　合計 | | 7,446,346,778 | 11,597,501,768 | |
| 合計 | | | 11,597,501,768 | |

（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、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・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、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 12,030,245,593 |
| 株式 | 353,679,998,270 |
| 派生商品評価勘定 | 31,691,230 |
| 未収配当金 | 605,141,059 |
| 前払金 | 258,565,000 |
| 差入委託証拠金 | 506,220,000 |
| 流動資産合計 | 367,111,861,152 |
| 資産合計 | 367,111,861,152 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 163,940,810 |
| 未払解約金 | 898,304,000 |
| 流動負債合計 | 1,062,244,810 |
| 負債合計 | 1,062,244,810 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 113,153,180,874 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 252,896,435,468 |
| 元本等合計 | 366,049,616,342 |
| 純資産合計 | 366,049,616,342 |
| 負債純資産合計 | 367,111,861,152 |

**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1月12日<br>至　2023年1月11日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br>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<br>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<br>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 | 2023年1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 | 140,692,906,135円 |
| 同期中追加設定元本額 | 126,890,517,939円 |
| 同期中一部解約元本額 | 154,430,243,200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 | 2,646,476,823円 |
| MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ） | 4,049,495,093円 |
| Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド | 24,547,694,881円 |
| ＤＩAM国内株式パッシブ・ファンド | 4,902,547,555円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型） | 2,104,079円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型） | 16,922,410円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型） | 44,353,151円 |
| グローバル８資産ラップファンド（安定型） | 26,541,745円 |
| グローバル８資産ラップファンド（中立型） | 23,505,480円 |
| グローバル８資産ラップファンド（積極型） | 28,002,416円 |
| たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ | 1,707,918,547円 |
| たわらノーロード　バランス（８資産均等型） | 1,439,950,089円 |
| たわらノーロード　バランス（堅実型） | 52,388,240円 |
| たわらノーロード　バランス（標準型） | 346,773,204円 |
| たわらノーロード　バランス（積極型） | 543,071,139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） | 4,367,064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） | 193,888,523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） | 469,423,866円 |
| たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型） | 327,070,843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） | 459,325,287円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（保守型） | 410,901円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定型） | 1,749,277円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型） | 33,093,014円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（成長型） | 4,215,832円 |

| | |
|---|---|
| たわらノーロード　最適化バランス（積極型） | 12,566,600円 |
| ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞ | 33,744,062,427円 |
| Ｏｎｅグローバルバランス | 7,018,835円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型 | 1,076,599,868円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型 | 3,606,198,196円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型 | 3,964,822,453円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド | 343,582,135円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド | 1,077,764,148円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド | 1,129,817,863円 |
| マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞ | 31,667,873円 |
| マネックス資産設計ファンド＜育成型＞ | 1,150,216,258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） | 306,201,964円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０） | 356,000,978円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０） | 576,024,312円 |
| 投資のソムリエ | 5,743,698,687円 |
| クルーズコントロール | 69,192,978円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞ | 415,188,129円 |
| ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ | 371,916,647円 |
| ４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞ | 877,958,248円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型 | 324,548,775円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド | 1,409,352,556円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５） | 30,810,443円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５） | 15,446,613円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ） | 2,231,146円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５） | 50,981,785円 |
| ４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 497,025,127円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 115,999,581円 |
| ９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 276,065,472円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０） | 21,858,666円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０） | 16,535,911円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０） | 10,207,719円 |
| ４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞ | 366,281,074円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５） | 2,140,049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） | 20,273,145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） | 20,796,102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） | 14,888,210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） | 12,721,954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） | 20,102,661円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定） | 47,431,579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） | 181,854,539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） | 17,957,278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） | 114,572,400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） | 515,358,737円 |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定） | 152,825,216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） | 9,586,119円 |
| ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 30,257,311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） | 294,994,531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） | 34,611,881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） | 3,027,914円 |
| しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定） | 3,768,730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） | 46,249,953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） | 90,479,527円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 3,440,855円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 20,890,766円 |
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 4,584,891円 |
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 92,241円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 5,991,744円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 26,778,118円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 437,275,013円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 533,483,788円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 1,565,625,264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） | 16,123,588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） | 22,544,617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） | 230,745,406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） | 56,367,147円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 67,452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） | 283,402,510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） | 16,362,589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） | 55,466,457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） | 127,280,342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） | 178,296,635円 |
| ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 32,164,906円 |
| ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 15,753,322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） | 11,309,625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＞ | 24,646,311円 |
| コア資産形成ファンド | 16,525,883円 |
| ＭＨＡＭトピックスファンド | 776,349,832円 |
| ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用） | 50,742,120円 |

| | |
|---|---|
| MHAM動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］ | 3,198,759,908円 |
| MHAM日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］ | 1,497,351,931円 |
| 計 | 113,153,180,874円 |
| ２．　受益権の総数 | 113,153,180,874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1月12日<br>至　2023年1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。<br>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 | 2023年1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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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 | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| | 当期の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式 | △3,037,199,780 |
| 合計 | △3,037,199,780 |

（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2023年1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 | 2023年1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<br>先物取引<br>買建 | 13,918,750,000 | － | 13,786,740,000 | △132,010,000 |
| 合計 | 13,918,750,000 | － | 13,786,740,000 | △132,010,000 |

（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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 3.2350円 |
| （1万口当たり純資産額） | (32,350円) |

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年1月11日現在

| 銘柄 | 株式数 | 評価額（円） | | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| | | 単価 | 金額 | |
| 極洋 | 6,900 | 3,725.00 | 25,702,500 | |
| ニッスイ | 181,100 | 522.00 | 94,534,200 | |
| マルハニチロ | 26,800 | 2,418.00 | 64,802,400 | |
| 雪国まいたけ | 15,400 | 993.00 | 15,292,200 | |
| カネコ種苗 | 5,900 | 1,453.00 | 8,572,700 | |
| サカタのタネ | 22,900 | 4,145.00 | 94,920,500 | |
| ホクト | 16,200 | 1,859.00 | 30,115,800 | |
| ホクリヨウ | 2,500 | 743.00 | 1,857,500 | |
| ショーボンドホールディングス | 24,600 | 5,410.00 | 133,086,000 | |
| ミライト・ワン | 62,700 | 1,514.00 | 94,927,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| タマホーム | 12,700 | 2,483.00 | 31,534,100 | |
| サンヨーホームズ | 2,100 | 707.00 | 1,484,700 | |
| 日本アクア | 7,600 | 818.00 | 6,216,800 | |
| ファーストコーポレーション | 4,800 | 702.00 | 3,369,600 | |
| ベステラ | 4,000 | 944.00 | 3,776,000 | |
| Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ | 30,800 | 164.00 | 5,051,200 | |
| キャンディル | 2,700 | 500.00 | 1,350,000 | |
| 住石ホールディングス | 28,200 | 392.00 | 11,054,400 | |
| 日鉄鉱業 | 7,200 | 3,270.00 | 23,544,000 | |
| 三井松島ホールディングス | 8,000 | 3,100.00 | 24,800,000 | |
| ＩＮＰＥＸ | 669,900 | 1,378.00 | 923,122,200 | |
| 石油資源開発 | 20,900 | 3,825.00 | 79,942,500 | |
| Ｋ＆Ｏエナジーグループ | 8,100 | 1,999.00 | 16,191,900 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 3,800 | 944.00 | 3,587,200 | |
| 第一カッター興業 | 4,700 | 1,022.00 | 4,803,400 | |
| 明豊ファシリティワークス | 6,600 | 714.00 | 4,712,400 | |
| 安藤・間 | 104,800 | 843.00 | 88,346,400 | |
| 東急建設 | 51,600 | 632.00 | 32,611,200 | |
| コムシスホールディングス | 61,300 | 2,332.00 | 142,951,600 | |
| ビーアールホールディングス | 28,800 | 329.00 | 9,475,200 | |
| 高松コンストラクショングループ | 11,700 | 1,912.00 | 22,370,400 | |
| 東建コーポレーション | 5,800 | 7,500.00 | 43,500,000 | |
| ソネック | 1,900 | 939.00 | 1,784,100 | |
| ヤマウラ | 9,300 | 1,008.00 | 9,374,400 | |
| オリエンタル白石 | 65,300 | 285.00 | 18,610,500 | |
| 大成建設 | 126,100 | 4,090.00 | 515,749,000 | |
| 大林組 | 453,100 | 955.00 | 432,710,500 | |
| 清水建設 | 381,000 | 684.00 | 260,604,000 | |
| 飛島建設 | 14,000 | 1,006.00 | 14,084,000 | |
| 長谷工コーポレーション | 130,700 | 1,456.00 | 190,299,200 | |
| 松井建設 | 11,800 | 548.00 | 6,466,400 | |
| 錢高組 | 1,500 | 2,632.00 | 3,948,000 | |
| 鹿島建設 | 281,000 | 1,491.00 | 418,971,000 | |
| 不動テトラ | 8,600 | 1,478.00 | 12,710,800 | |
| 大末建設 | 4,700 | 1,148.00 | 5,395,600 | |
| 鉄建建設 | 9,200 | 1,758.00 | 16,173,600 | |
| 西松建設 | 21,500 | 3,880.00 | 83,420,000 | |
| 三井住友建設 | 102,200 | 410.00 | 41,902,000 | |
| 大豊建設 | 5,200 | 4,015.00 | 20,878,000 | |
| 佐田建設 | 8,100 | 439.00 | 3,555,900 | |
| ナカノフドー建設 | 9,200 | 320.00 | 2,944,000 | |
| 奥村組 | 20,500 | 2,945.00 | 60,372,500 | |
| 東鉄工業 | 17,500 | 2,566.00 | 44,905,000 | |
| イチケン | 2,700 | 1,781.00 | 4,808,700 | |
| 富士ピー・エス | 5,900 | 438.00 | 2,584,200 | |
| 淺沼組 | 10,100 | 3,000.00 | 30,300,000 | |
| 戸田建設 | 155,900 | 695.00 | 108,350,500 | |
| 熊谷組 | 21,900 | 2,551.00 | 55,866,900 | |
| 北野建設 | 2,200 | 2,459.00 | 5,409,800 | |
| 植木組 | 3,700 | 1,325.00 | 4,902,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 矢作建設工業 | 17,400 | 763.00 | 13,276,200 | |
| ピーエス三菱 | 16,100 | 606.00 | 9,756,600 | |
| 日本ハウスホールディングス | 25,000 | 365.00 | 9,125,000 | |
| 大東建託 | 46,600 | 13,640.00 | 635,624,000 | |
| 新日本建設 | 17,800 | 754.00 | 13,421,200 | |
| 東亜道路工業 | 2,200 | 5,760.00 | 12,672,000 | |
| 日本道路 | 2,400 | 5,770.00 | 13,848,000 | |
| 東亜建設工業 | 10,900 | 2,325.00 | 25,342,500 | |
| 日本国土開発 | 38,000 | 552.00 | 20,976,000 | |
| 若築建設 | 5,600 | 2,743.00 | 15,360,800 | |
| 東洋建設 | 41,100 | 844.00 | 34,688,400 | |
| 五洋建設 | 179,600 | 611.00 | 109,735,600 | |
| 世紀東急工業 | 16,800 | 790.00 | 13,272,000 | |
| 福田組 | 4,400 | 4,455.00 | 19,602,000 | |
| 日本ドライケミカル | 3,200 | 1,470.00 | 4,704,000 | |
| 住友林業 | 97,100 | 2,343.00 | 227,505,300 | |
| 日本基礎技術 | 8,000 | 508.00 | 4,064,000 | |
| 巴コーポレーション | 14,200 | 396.00 | 5,623,200 | |
| 大和ハウス工業 | 354,100 | 3,009.00 | 1,065,486,900 | |
| ライト工業 | 24,100 | 1,834.00 | 44,199,400 | |
| 積水ハウス | 396,900 | 2,385.00 | 946,606,500 | |
| 日特建設 | 12,100 | 911.00 | 11,023,100 | |
| 北陸電気工事 | 8,600 | 660.00 | 5,676,000 | |
| ユアテック | 28,000 | 724.00 | 20,272,000 | |
| 日本リーテック | 8,200 | 898.00 | 7,363,600 | |
| 四電工 | 5,300 | 1,732.00 | 9,179,600 | |
| 中電工 | 19,600 | 2,055.00 | 40,278,000 | |
| 関電工 | 69,500 | 840.00 | 58,380,000 | |
| きんでん | 89,300 | 1,393.00 | 124,394,900 | |
| 東京エネシス | 12,500 | 928.00 | 11,600,000 | |
| トーエネック | 4,300 | 3,450.00 | 14,835,000 | |
| 住友電設 | 12,000 | 2,342.00 | 28,104,000 | |
| 日本電設工業 | 20,900 | 1,545.00 | 32,290,500 | |
| エクシオグループ | 58,400 | 2,229.00 | 130,173,600 | |
| 新日本空調 | 7,000 | 1,848.00 | 12,936,000 | |
| 日本工営 | 9,500 | 3,300.00 | 31,350,000 | |
| 九電工 | 30,800 | 3,175.00 | 97,790,000 | |
| 三機工業 | 28,200 | 1,520.00 | 42,864,000 | |
| 日揮ホールディングス | 125,300 | 1,660.00 | 207,998,000 | |
| 中外炉工業 | 4,200 | 1,614.00 | 6,778,800 | |
| ヤマト | 10,700 | 688.00 | 7,361,600 | |
| 太平電業 | 7,800 | 3,305.00 | 25,779,000 | |
| 高砂熱学工業 | 30,500 | 1,733.00 | 52,856,500 | |
| 三晃金属工業 | 1,500 | 3,075.00 | 4,612,500 | |
| ＮＥＣネッツエスアイ | 43,200 | 1,671.00 | 72,187,200 | |
| 朝日工業社 | 5,200 | 1,975.00 | 10,270,000 | |
| 明星工業 | 21,900 | 796.00 | 17,432,400 | |
| 大氣社 | 15,300 | 3,320.00 | 50,796,000 | |
| ダイダン | 8,200 | 2,137.00 | 17,523,400 | |
| 日比谷総合設備 | 11,000 | 1,893.00 | 20,823,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ニップン | 34,400 | 1,578.00 | 54,283,200 | |
| 日清製粉グループ本社 | 117,500 | 1,602.00 | 188,235,000 | |
| 日東富士製粉 | 2,100 | 4,260.00 | 8,946,000 | |
| 昭和産業 | 11,200 | 2,435.00 | 27,272,000 | |
| 鳥越製粉 | 10,300 | 582.00 | 5,994,600 | |
| 中部飼料 | 17,700 | 1,022.00 | 18,089,400 | |
| フィード・ワン | 18,500 | 710.00 | 13,135,000 | |
| 東洋精糖 | 1,600 | 853.00 | 1,364,800 | |
| 日本甜菜製糖 | 7,500 | 1,634.00 | 12,255,000 | |
| ＤＭ三井製糖ホールディングス | 12,600 | 1,967.00 | 24,784,200 | |
| 塩水港精糖 | 15,700 | 196.00 | 3,077,200 | |
| ウェルネオシュガー | 6,500 | 1,765.00 | 11,472,500 | |
| ＬＩＦＵＬＬ | 45,300 | 219.00 | 9,920,700 | |
| ＭＩＸＩ | 30,200 | 2,481.00 | 74,926,200 | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 11,900 | 2,315.00 | 27,548,500 | |
| 日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス | 227,700 | 1,721.00 | 391,871,700 | |
| メンバーズ | 4,000 | 1,997.00 | 7,988,000 | |
| 中広 | 1,000 | 373.00 | 373,000 | |
| ＵＴグループ | 19,400 | 2,445.00 | 47,433,000 | |
| アイティメディア | 5,000 | 1,586.00 | 7,930,000 | |
| Ｅ・Ｊホールディングス | 8,400 | 1,350.00 | 11,340,000 | |
| オープンアップグループ | 48,500 | 1,689.00 | 81,916,500 | |
| コシダカホールディングス | 39,800 | 1,000.00 | 39,800,000 | |
| アルトナー | 3,200 | 1,029.00 | 3,292,800 | |
| パソナグループ | 16,100 | 1,906.00 | 30,686,600 | |
| ＣＤＳ | 3,300 | 1,752.00 | 5,781,600 | |
| リンクアンドモチベーション | 38,100 | 640.00 | 24,384,000 | |
| エス・エム・エス | 50,400 | 3,350.00 | 168,840,000 | |
| サニーサイドアップグループ | 4,700 | 518.00 | 2,434,600 | |
| パーソルホールディングス | 148,600 | 2,774.00 | 412,216,400 | |
| リニカル | 7,500 | 658.00 | 4,935,000 | |
| クックパッド | 36,400 | 198.00 | 7,207,200 | |
| エスクリ | 5,300 | 318.00 | 1,685,400 | |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス | 6,500 | 643.00 | 4,179,500 | |
| 森永製菓 | 23,500 | 3,740.00 | 87,890,000 | |
| 中村屋 | 2,700 | 3,065.00 | 8,275,500 | |
| 江崎グリコ | 36,400 | 3,500.00 | 127,400,000 | |
| 名糖産業 | 5,000 | 1,637.00 | 8,185,000 | |
| 井村屋グループ | 7,000 | 2,230.00 | 15,610,000 | |
| 不二家 | 8,600 | 2,497.00 | 21,474,200 | |
| 山崎製パン | 85,200 | 1,496.00 | 127,459,200 | |
| 第一屋製パン | 2,400 | 377.00 | 904,800 | |
| モロゾフ | 4,200 | 3,385.00 | 14,217,000 | |
| 亀田製菓 | 8,000 | 4,290.00 | 34,320,000 | |
| 寿スピリッツ | 13,400 | 7,810.00 | 104,654,000 | |
| カルビー | 58,300 | 2,901.00 | 169,128,300 | |
| 森永乳業 | 23,100 | 4,700.00 | 108,570,000 | |
| 六甲バター | 9,400 | 1,245.00 | 11,703,000 | |
| ヤクルト本社 | 90,800 | 8,900.00 | 808,120,000 | |
| 明治ホールディングス | 78,900 | 6,470.00 | 510,483,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 雪印メグミルク | 30,700 | 1,702.00 | 52,251,400 | |
| プリマハム | 17,200 | 2,083.00 | 35,827,600 | |
| 日本ハム | 49,700 | 3,575.00 | 177,677,500 | |
| 林兼産業 | 3,800 | 468.00 | 1,778,400 | |
| 丸大食品 | 12,800 | 1,406.00 | 17,996,800 | |
| Ｓ　Ｆｏｏｄｓ | 14,000 | 2,885.00 | 40,390,000 | |
| 柿安本店 | 4,900 | 2,050.00 | 10,045,000 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 99,000 | 680.00 | 67,320,000 | |
| 学情 | 5,900 | 1,297.00 | 7,652,300 | |
| スタジオアリス | 6,600 | 2,160.00 | 14,256,000 | |
| クロスキャット | 7,400 | 1,377.00 | 10,189,800 | |
| シミックホールディングス | 7,300 | 1,778.00 | 12,979,400 | |
| エプコ | 2,700 | 683.00 | 1,844,100 | |
| システナ | 217,900 | 401.00 | 87,377,900 | |
| ＮＪＳ | 2,500 | 2,054.00 | 5,135,000 | |
| デジタルアーツ | 8,000 | 5,600.00 | 44,800,000 | |
| 日鉄ソリューションズ | 22,100 | 3,215.00 | 71,051,500 | |
| 綜合警備保障 | 49,200 | 3,400.00 | 167,280,000 | |
| キューブシステム | 7,700 | 1,029.00 | 7,923,300 | |
| いちご | 146,500 | 280.00 | 41,020,000 | |
| 日本駐車場開発 | 151,500 | 281.00 | 42,571,500 | |
| コア | 5,700 | 1,445.00 | 8,236,500 | |
| カカクコム | 99,100 | 2,076.00 | 205,731,600 | |
| アイロムグループ | 4,800 | 2,380.00 | 11,424,000 | |
| セントケア・ホールディング | 8,300 | 811.00 | 6,731,300 | |
| サイネックス | 2,100 | 558.00 | 1,171,800 | |
| ルネサンス | 9,300 | 876.00 | 8,146,800 | |
| ディップ | 23,200 | 3,690.00 | 85,608,000 | |
| ＳＢＳホールディングス | 11,500 | 2,749.00 | 31,613,500 | |
| デジタルホールディングス | 10,400 | 1,242.00 | 12,916,800 | |
| 新日本科学 | 14,000 | 2,456.00 | 34,384,000 | |
| キャリアデザインセンター | 2,600 | 1,498.00 | 3,894,800 | |
| ベネフィット・ワン | 61,500 | 1,975.00 | 121,462,500 | |
| エムスリー | 262,400 | 3,640.00 | 955,136,000 | |
| ツカダ・グローバルホールディング | 8,500 | 365.00 | 3,102,500 | |
| ブラス | 1,600 | 1,016.00 | 1,625,600 | |
| アウトソーシング | 79,000 | 948.00 | 74,892,000 | |
| ウェルネット | 11,800 | 613.00 | 7,233,400 | |
| ワールドホールディングス | 5,900 | 2,463.00 | 14,531,700 | |
| ディー・エヌ・エー | 56,500 | 1,764.00 | 99,666,000 | |
| 博報堂ＤＹホールディングス | 169,300 | 1,342.00 | 227,200,600 | |
| ぐるなび | 24,300 | 382.00 | 9,282,600 | |
| タカミヤ | 18,000 | 362.00 | 6,516,000 | |
| ジャパンベストレスキューシステム | 8,100 | 832.00 | 6,739,200 | |
| ファンコミュニケーションズ | 26,000 | 407.00 | 10,582,000 | |
| ライク | 4,900 | 2,060.00 | 10,094,000 | |
| ビジネス・ブレークスルー | 5,000 | 376.00 | 1,880,000 | |
| エスプール | 38,100 | 638.00 | 24,307,800 | |
| ＷＤＢホールディングス | 6,700 | 2,117.00 | 14,183,900 | |
| 手間いらず | 2,000 | 5,020.00 | 10,040,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ティア | 8,000 | 417.00 | 3,336,000 | |
| ＣＤＧ | 1,500 | 1,047.00 | 1,570,500 | |
| アドウェイズ | 18,200 | 498.00 | 9,063,600 | |
| バリューコマース | 10,000 | 1,868.00 | 18,680,000 | |
| インフォマート | 137,800 | 366.00 | 50,434,800 | |
| サッポロホールディングス | 41,900 | 3,130.00 | 131,147,000 | |
| アサヒグループホールディングス | 293,900 | 4,089.00 | 1,201,757,100 | |
| キリンホールディングス | 574,000 | 1,939.50 | 1,113,273,000 | |
| 宝ホールディングス | 86,800 | 1,010.00 | 87,668,000 | |
| オエノンホールディングス | 38,000 | 244.00 | 9,272,000 | |
| 養命酒製造 | 4,300 | 1,787.00 | 7,684,100 | |
| コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス | 99,600 | 1,349.00 | 134,360,400 | |
| サントリー食品インターナショナル | 89,500 | 4,360.00 | 390,220,000 | |
| ダイドーグループホールディングス | 7,200 | 4,625.00 | 33,300,000 | |
| 伊藤園 | 47,300 | 4,380.00 | 207,174,000 | |
| キーコーヒー | 14,200 | 2,058.00 | 29,223,600 | |
| ユニカフェ | 4,400 | 901.00 | 3,964,400 | |
| ジャパンフーズ | 1,500 | 1,072.00 | 1,608,000 | |
| 日清オイリオグループ | 17,900 | 3,095.00 | 55,400,500 | |
| 不二製油グループ本社 | 29,600 | 1,971.00 | 58,341,600 | |
| かどや製油 | 1,200 | 3,485.00 | 4,182,000 | |
| Ｊ－オイルミルズ | 12,900 | 1,494.00 | 19,272,600 | |
| ローソン | 33,800 | 5,000.00 | 169,000,000 | |
| サンエー | 10,500 | 4,030.00 | 42,315,000 | |
| カワチ薬品 | 10,700 | 2,218.00 | 23,732,600 | |
| エービーシー・マート | 19,800 | 7,140.00 | 141,372,000 | |
| ハードオフコーポレーション | 5,400 | 1,298.00 | 7,009,200 | |
| 高千穂交易 | 4,800 | 2,214.00 | 10,627,200 | |
| アスクル | 32,900 | 1,669.00 | 54,910,100 | |
| ゲオホールディングス | 14,300 | 1,987.00 | 28,414,100 | |
| アダストリア | 16,500 | 2,227.00 | 36,745,500 | |
| ジーフット | 7,100 | 293.00 | 2,080,300 | |
| シー・ヴイ・エス・ベイエリア | 1,800 | 405.00 | 729,000 | |
| オルバヘルスケアホールディングス | 2,100 | 1,558.00 | 3,271,800 | |
| 伊藤忠食品 | 2,600 | 4,825.00 | 12,545,000 | |
| くら寿司 | 16,000 | 3,120.00 | 49,920,000 | |
| キャンドゥ | 4,800 | 2,218.00 | 10,646,400 | |
| エレマテック | 12,200 | 1,560.00 | 19,032,000 | |
| ＩＫホールディングス | 4,500 | 390.00 | 1,755,000 | |
| パルグループホールディングス | 13,300 | 2,524.00 | 33,569,200 | |
| エディオン | 54,000 | 1,260.00 | 68,040,000 | |
| あらた | 10,500 | 4,030.00 | 42,315,000 | |
| サーラコーポレーション | 28,700 | 715.00 | 20,520,500 | |
| ワッツ | 6,600 | 711.00 | 4,692,600 | |
| トーメンデバイス | 1,800 | 5,650.00 | 10,170,000 | |
| ハローズ | 6,100 | 3,055.00 | 18,635,500 | |
| ＪＰホールディングス | 38,100 | 322.00 | 12,268,200 | |
| フジオフードグループ本社 | 11,400 | 1,384.00 | 15,777,600 | |
| あみやき亭 | 3,300 | 2,871.00 | 9,474,300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 東京エレクトロン　デバイス | 5,000 | 7,010.00 | 35,050,000 | |
| ひらまつ | 29,200 | 188.00 | 5,489,600 | |
| 円谷フィールズホールディングス | 11,700 | 2,397.00 | 28,044,900 | |
| 双日 | 145,100 | 2,469.00 | 358,251,900 | |
| アルフレッサ　ホールディングス | 137,100 | 1,591.00 | 218,126,100 | |
| 大黒天物産 | 4,800 | 5,150.00 | 24,720,000 | |
| ハニーズホールディングス | 12,100 | 1,452.00 | 17,569,200 | |
| ファーマライズホールディングス | 3,000 | 612.00 | 1,836,000 | |
| キッコーマン | 84,200 | 6,790.00 | 571,718,000 | |
| 味の素 | 311,300 | 3,917.00 | 1,219,362,100 | |
| ブルドックソース | 5,000 | 1,809.00 | 9,045,000 | |
| キユーピー | 68,400 | 2,163.00 | 147,949,200 | |
| ハウス食品グループ本社 | 38,900 | 2,642.00 | 102,773,800 | |
| カゴメ | 59,300 | 2,913.00 | 172,740,900 | |
| 焼津水産化学工業 | 5,700 | 822.00 | 4,685,400 | |
| アリアケジャパン | 11,100 | 4,330.00 | 48,063,000 | |
| ピエトロ | 1,600 | 1,803.00 | 2,884,800 | |
| エバラ食品工業 | 3,200 | 3,005.00 | 9,616,000 | |
| やまみ | 1,100 | 1,379.00 | 1,516,900 | |
| ニチレイ | 58,400 | 2,693.00 | 157,271,200 | |
| 横浜冷凍 | 37,200 | 1,064.00 | 39,580,800 | |
| 東洋水産 | 64,300 | 4,910.00 | 315,713,000 | |
| イートアンドホールディングス | 5,300 | 2,246.00 | 11,903,800 | |
| 大冷 | 1,600 | 1,885.00 | 3,016,000 | |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 8,000 | 645.00 | 5,160,000 | |
| 日清食品ホールディングス | 44,700 | 10,230.00 | 457,281,000 | |
| 永谷園ホールディングス | 6,200 | 2,003.00 | 12,418,600 | |
| 一正蒲鉾 | 5,400 | 716.00 | 3,866,400 | |
| フジッコ | 13,000 | 1,862.00 | 24,206,000 | |
| ロック・フィールド | 15,600 | 1,482.00 | 23,119,200 | |
| 日本たばこ産業 | 837,600 | 2,584.00 | 2,164,358,400 | |
| ケンコーマヨネーズ | 8,600 | 1,328.00 | 11,420,800 | |
| わらべや日洋ホールディングス | 9,400 | 1,973.00 | 18,546,200 | |
| なとり | 8,000 | 2,044.00 | 16,352,000 | |
| イフジ産業 | 2,100 | 918.00 | 1,927,800 | |
| ファーマフーズ | 19,500 | 1,249.00 | 24,355,500 | |
| 北の達人コーポレーション | 54,500 | 302.00 | 16,459,000 | |
| ユーグレナ | 81,900 | 954.00 | 78,132,600 | |
| 紀文食品 | 9,900 | 939.00 | 9,296,100 | |
| ピックルスホールディングス | 7,400 | 1,125.00 | 8,325,000 | |
| スター・マイカ・ホールディングス | 11,500 | 725.00 | 8,337,500 | |
| ＳＲＥホールディングス | 6,100 | 3,590.00 | 21,899,000 | |
| ＡＤワークスグループ | 31,700 | 143.00 | 4,533,100 | |
| 片倉工業 | 11,800 | 1,689.00 | 19,930,200 | |
| グンゼ | 9,700 | 4,125.00 | 40,012,500 | |
| ヒューリック | 296,800 | 1,036.00 | 307,484,800 | |
| 神栄 | 1,700 | 786.00 | 1,336,200 | |
| ラサ商事 | 6,200 | 1,166.00 | 7,229,200 | |
| アルペン | 11,200 | 1,955.00 | 21,896,000 | |
| ハブ | 4,500 | 620.00 | 2,790,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ラクーンホールディングス | 12,800 | 1,102.00 | 14,105,600 | |
| クオールホールディングス | 18,700 | 1,142.00 | 21,355,400 | |
| アルコニックス | 17,900 | 1,325.00 | 23,717,500 | |
| 神戸物産 | 105,700 | 3,665.00 | 387,390,500 | |
| ソリトンシステムズ | 6,600 | 1,090.00 | 7,194,000 | |
| ジンズホールディングス | 8,000 | 4,000.00 | 32,000,000 | |
| ビックカメラ | 90,800 | 1,196.00 | 108,596,800 | |
| ＤＣＭホールディングス | 83,400 | 1,171.00 | 97,661,400 | |
| ペッパーフードサービス | 28,500 | 175.00 | 4,987,500 | |
| ハイパー | 2,100 | 443.00 | 930,300 | |
| ＭｏｎｏｔａＲＯ | 193,700 | 1,911.00 | 370,160,700 | |
| 東京一番フーズ | 3,200 | 477.00 | 1,526,400 | |
| ＤＤホールディングス | 8,600 | 695.00 | 5,977,000 | |
| あい　ホールディングス | 21,900 | 2,106.00 | 46,121,400 | |
| ディーブイエックス | 3,900 | 1,048.00 | 4,087,200 | |
| きちりホールディングス | 3,800 | 572.00 | 2,173,600 | |
| アークランドサービスホールディングス | 11,200 | 2,152.00 | 24,102,400 | |
| Ｊ．フロント　リテイリング | 169,900 | 1,130.00 | 191,987,000 | |
| ドトール・日レスホールディングス | 24,200 | 1,672.00 | 40,462,400 | |
| マツキヨココカラ＆カンパニー | 82,900 | 6,460.00 | 535,534,000 | |
| ブロンコビリー | 7,300 | 2,418.00 | 17,651,400 | |
| ＺＯＺＯ | 90,300 | 3,225.00 | 291,217,500 | |
| トレジャー・ファクトリー | 4,100 | 2,484.00 | 10,184,400 | |
| 物語コーポレーション | 7,600 | 6,460.00 | 49,096,000 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 230,100 | 1,335.00 | 307,183,500 | |
| 東洋紡 | 55,800 | 996.00 | 55,576,800 | |
| ユニチカ | 39,000 | 241.00 | 9,399,000 | |
| 富士紡ホールディングス | 5,000 | 3,190.00 | 15,950,000 | |
| 日清紡ホールディングス | 106,100 | 955.00 | 101,325,500 | |
| 倉敷紡績 | 9,700 | 2,113.00 | 20,496,100 | |
| ダイワボウホールディングス | 55,800 | 1,918.00 | 107,024,400 | |
| シキボウ | 7,200 | 952.00 | 6,854,400 | |
| 日東紡績 | 15,400 | 1,929.00 | 29,706,600 | |
| トヨタ紡織 | 54,300 | 1,800.00 | 97,740,000 | |
| マクニカホールディングス | 33,500 | 3,255.00 | 109,042,500 | |
| Ｈａｍｅｅ | 5,400 | 712.00 | 3,844,800 | |
| マーケットエンタープライズ | 1,300 | 967.00 | 1,257,100 | |
| ラクト・ジャパン | 5,200 | 2,184.00 | 11,356,800 | |
| ウエルシアホールディングス | 70,900 | 3,045.00 | 215,890,500 | |
| クリエイトＳＤホールディングス | 22,600 | 3,210.00 | 72,546,000 | |
| グリムス | 5,600 | 2,173.00 | 12,168,800 | |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 19,800 | 815.00 | 16,137,000 | |
| 八洲電機 | 11,100 | 1,058.00 | 11,743,800 | |
| メディアスホールディングス | 8,600 | 688.00 | 5,916,800 | |
| レスターホールディングス | 13,000 | 2,049.00 | 26,637,000 | |
| ジューテックホールディングス | 2,600 | 1,177.00 | 3,060,200 | |
| 丸善ＣＨＩホールディングス | 16,300 | 329.00 | 5,362,700 | |
| 大光 | 5,900 | 659.00 | 3,888,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＯＣＨＩホールディングス | 3,200 | 1,239.00 | 3,964,800 | |
| ＴＯＫＡＩホールディングス | 67,400 | 842.00 | 56,750,800 | |
| 黒谷 | 3,900 | 600.00 | 2,340,000 | |
| ミサワ | 2,300 | 648.00 | 1,490,400 | |
| ティーライフ | 1,600 | 1,293.00 | 2,068,800 | |
| Ｃｏｍｉｎｉｘ | 2,300 | 732.00 | 1,683,600 | |
| エー・ピーホールディングス | 1,800 | 455.00 | 819,000 | |
| 三洋貿易 | 14,000 | 1,093.00 | 15,302,000 | |
| チムニー | 4,300 | 1,121.00 | 4,820,300 | |
| シュッピン | 10,100 | 1,229.00 | 12,412,900 | |
| ビューティガレージ | 2,300 | 3,490.00 | 8,027,000 | |
| オイシックス・ラ・大地 | 18,300 | 2,420.00 | 44,286,000 | |
| ウイン・パートナーズ | 10,000 | 991.00 | 9,910,000 | |
| ネクステージ | 31,100 | 2,576.00 | 80,113,600 | |
| ジョイフル本田 | 43,800 | 1,909.00 | 83,614,200 | |
| 鳥貴族ホールディングス | 5,000 | 2,078.00 | 10,390,000 | |
| ホットランド | 10,500 | 1,454.00 | 15,267,000 | |
| すかいらーくホールディングス | 186,800 | 1,537.00 | 287,111,600 | |
| ＳＦＰホールディングス | 7,500 | 1,797.00 | 13,477,500 | |
| 綿半ホールディングス | 10,700 | 1,327.00 | 14,198,900 | |
| 日本毛織 | 34,100 | 941.00 | 32,088,100 | |
| ダイトウボウ | 21,500 | 81.00 | 1,741,500 | |
| トーア紡コーポレーション | 4,100 | 342.00 | 1,402,200 | |
| ダイドーリミテッド | 19,700 | 270.00 | 5,319,000 | |
| ヨシックスホールディングス | 2,500 | 2,157.00 | 5,392,500 | |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 44,600 | 1,110.00 | 49,506,000 | |
| 三栄建築設計 | 6,100 | 1,474.00 | 8,991,400 | |
| 野村不動産ホールディングス | 79,400 | 2,837.00 | 225,257,800 | |
| 三重交通グループホールディングス | 27,300 | 477.00 | 13,022,100 | |
| サムティ | 20,100 | 2,125.00 | 42,712,500 | |
| ディア・ライフ | 19,100 | 602.00 | 11,498,200 | |
| コーセーアールイー | 4,200 | 814.00 | 3,418,800 | |
| 地主 | 9,700 | 1,798.00 | 17,440,600 | |
| プレサンスコーポレーション | 16,700 | 1,531.00 | 25,567,700 | |
| フィル・カンパニー | 2,100 | 992.00 | 2,083,200 | |
| ＴＨＥグローバル社 | 7,500 | 210.00 | 1,575,000 | |
| ハウスコム | 1,900 | 1,096.00 | 2,082,400 | |
| ＪＰＭＣ | 6,400 | 998.00 | 6,387,200 | |
| サンセイランディック | 3,900 | 821.00 | 3,201,900 | |
| エストラスト | 1,500 | 580.00 | 870,000 | |
| フージャースホールディングス | 19,500 | 749.00 | 14,605,500 | |
| オープンハウスグループ | 46,600 | 5,050.00 | 235,330,000 | |
| 東急不動産ホールディングス | 382,500 | 637.00 | 243,652,500 | |
| 飯田グループホールディングス | 111,300 | 2,044.00 | 227,497,200 | |
| イーグランド | 1,800 | 1,474.00 | 2,653,200 | |
| ムゲンエステート | 8,400 | 477.00 | 4,006,800 | |
| 帝国繊維 | 14,500 | 1,523.00 | 22,083,500 | |
| 日本コークス工業 | 116,900 | 88.00 | 10,287,200 | |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 6,100 | 1,505.00 | 9,180,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ミタチ産業 | 3,600 | 1,035.00 | 3,726,000 | |
| ＢＥＥＮＯＳ | 7,700 | 2,027.00 | 15,607,900 | |
| あさひ | 11,400 | 1,347.00 | 15,355,800 | |
| 日本調剤 | 9,300 | 1,152.00 | 10,713,600 | |
| コスモス薬品 | 15,500 | 13,410.00 | 207,855,000 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 49,100 | 2,566.00 | 125,990,600 | |
| トーエル | 6,000 | 755.00 | 4,530,000 | |
| ソフトクリエイトホールディングス | 5,300 | 3,225.00 | 17,092,500 | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 471,100 | 5,749.00 | 2,708,353,900 | |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 102,800 | 931.00 | 95,706,800 | |
| 明治電機工業 | 5,000 | 1,060.00 | 5,300,000 | |
| ツルハホールディングス | 33,500 | 9,660.00 | 323,610,000 | |
| デリカフーズホールディングス | 5,500 | 505.00 | 2,777,500 | |
| スターティアホールディングス | 2,500 | 950.00 | 2,375,000 | |
| サンマルクホールディングス | 11,100 | 1,691.00 | 18,770,100 | |
| フェリシモ | 3,100 | 1,003.00 | 3,109,300 | |
| トリドールホールディングス | 33,900 | 2,701.00 | 91,563,900 | |
| 帝人 | 124,200 | 1,276.00 | 158,479,200 | |
| 東レ | 867,000 | 742.10 | 643,400,700 | |
| クラレ | 205,800 | 1,038.00 | 213,620,400 | |
| 旭化成 | 808,200 | 933.50 | 754,454,700 | |
| ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ | 14,000 | 297.00 | 4,158,000 | |
| 稲葉製作所 | 7,800 | 1,385.00 | 10,803,000 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 3,800 | 3,525.00 | 13,395,000 | |
| トーカロ | 36,600 | 1,168.00 | 42,748,800 | |
| アルファ | 4,900 | 924.00 | 4,527,600 | |
| ＳＵＭＣＯ | 253,700 | 1,869.00 | 474,165,300 | |
| 川田テクノロジーズ | 3,200 | 3,300.00 | 10,560,000 | |
| ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ | 8,800 | 3,750.00 | 33,000,000 | |
| ジェイテックコーポレーション | 1,600 | 3,085.00 | 4,936,000 | |
| 信和 | 7,300 | 790.00 | 5,767,000 | |
| ビーロット | 8,500 | 533.00 | 4,530,500 | |
| ファーストブラザーズ | 2,400 | 894.00 | 2,145,600 | |
| Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス | 7,500 | 800.00 | 6,000,000 | |
| シーアールイー | 5,700 | 1,125.00 | 6,412,500 | |
| プロパティエージェント | 1,500 | 1,173.00 | 1,759,500 | |
| ケイアイスター不動産 | 6,000 | 4,850.00 | 29,100,000 | |
| アグレ都市デザイン | 2,100 | 1,569.00 | 3,294,900 | |
| グッドコムアセット | 11,700 | 784.00 | 9,172,800 | |
| ジェイ・エス・ビー | 3,100 | 4,250.00 | 13,175,000 | |
| ロードスターキャピタル | 5,400 | 1,640.00 | 8,856,000 | |
| テンポイノベーション | 4,000 | 1,065.00 | 4,260,000 | |
| グローバル・リンク・マネジメント | 2,300 | 1,104.00 | 2,539,200 | |
| フェイスネットワーク | 1,600 | 1,386.00 | 2,217,600 | |
| 住江織物 | 2,200 | 1,838.00 | 4,043,600 | |
| 日本フエルト | 7,300 | 400.00 | 2,920,000 | |
| イチカワ | 1,500 | 1,309.00 | 1,963,500 | |
| エコナックホールディングス | 23,000 | 87.00 | 2,001,000 | |
| 日東製網 | 1,500 | 1,403.00 | 2,104,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 芦森工業 | 2,200 | 1,277.00 | 2,809,400 | |
| アツギ | 7,400 | 397.00 | 2,937,800 | |
| ウイルプラスホールディングス | 2,400 | 1,106.00 | 2,654,400 | |
| ＪＭホールディングス | 11,500 | 1,659.00 | 19,078,500 | |
| コメダホールディングス | 33,500 | 2,412.00 | 80,802,000 | |
| サツドラホールディングス | 6,100 | 757.00 | 4,617,700 | |
| アレンザホールディングス | 10,300 | 1,007.00 | 10,372,100 | |
| 串カツ田中ホールディングス | 3,700 | 1,711.00 | 6,330,700 | |
| バロックジャパンリミテッド | 8,800 | 840.00 | 7,392,000 | |
| クスリのアオキホールディングス | 13,700 | 7,600.00 | 104,120,000 | |
| ダイニック | 3,300 | 616.00 | 2,032,800 | |
| 共和レザー | 7,500 | 498.00 | 3,735,000 | |
| ピーバンドットコム | 1,600 | 513.00 | 820,800 | |
| 力の源ホールディングス | 7,500 | 1,016.00 | 7,620,000 | |
| ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ | 78,500 | 2,923.00 | 229,455,500 | |
| アセンテック | 4,600 | 449.00 | 2,065,400 | |
| セーレン | 24,900 | 2,357.00 | 58,689,300 | |
| ソトー | 4,200 | 814.00 | 3,418,800 | |
| 東海染工 | 1,300 | 1,121.00 | 1,457,300 | |
| 小松マテーレ | 18,700 | 764.00 | 14,286,800 | |
| ワコールホールディングス | 24,800 | 2,371.00 | 58,800,800 | |
| ホギメディカル | 17,400 | 3,350.00 | 58,290,000 | |
| クラウディアホールディングス | 3,000 | 395.00 | 1,185,000 | |
| ＴＳＩホールディングス | 46,300 | 430.00 | 19,909,000 | |
| マツオカコーポレーション | 3,600 | 1,068.00 | 3,844,800 | |
| ワールド | 16,600 | 1,296.00 | 21,513,600 | |
| ＴＩＳ | 145,600 | 3,515.00 | 511,784,000 | |
| ＪＮＳホールディングス | 5,700 | 314.00 | 1,789,800 | |
| グリー | 69,400 | 709.00 | 49,204,600 | |
| ＧＭＯペパボ | 1,700 | 1,951.00 | 3,316,700 | |
| コーエーテクモホールディングス | 81,100 | 2,345.00 | 190,179,500 | |
| 三菱総合研究所 | 6,300 | 4,745.00 | 29,893,500 | |
| ボルテージ | 3,800 | 316.00 | 1,200,800 | |
| 電算 | 800 | 1,531.00 | 1,224,800 | |
| ＡＧＳ | 5,400 | 686.00 | 3,704,400 | |
| ファインデックス | 10,400 | 514.00 | 5,345,600 | |
| ブレインパッド | 12,800 | 763.00 | 9,766,400 | |
| ＫＬａｂ | 25,400 | 458.00 | 11,633,200 | |
| ポールトゥウィンホールディングス | 22,100 | 842.00 | 18,608,200 | |
| ネクソン | 334,800 | 3,035.00 | 1,016,118,000 | |
| アイスタイル | 41,400 | 513.00 | 21,238,200 | |
| エムアップホールディングス | 15,900 | 1,378.00 | 21,910,200 | |
| エイチーム | 9,600 | 719.00 | 6,902,400 | |
| エニグモ | 16,400 | 641.00 | 10,512,400 | |
| テクノスジャパン | 10,700 | 469.00 | 5,018,300 | |
| ｅｎｉｓｈ | 9,700 | 364.00 | 3,530,800 | |
| コロプラ | 50,200 | 633.00 | 31,776,600 | |
| オルトプラス | 9,800 | 203.00 | 1,989,400 | |
| ブロードリーフ | 75,600 | 438.00 | 33,112,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| クロス・マーケティンググループ | 5,100 | 760.00 | 3,876,000 | |
| デジタルハーツホールディングス | 8,000 | 1,785.00 | 14,280,000 | |
| システム情報 | 11,400 | 835.00 | 9,519,000 | |
| メディアドゥ | 5,200 | 1,714.00 | 8,912,800 | |
| じげん | 37,600 | 376.00 | 14,137,600 | |
| ブイキューブ | 15,500 | 747.00 | 11,578,500 | |
| エンカレッジ・テクノロジ | 3,100 | 493.00 | 1,528,300 | |
| サイバーリンクス | 4,200 | 981.00 | 4,120,200 | |
| ディー・エル・イー | 9,300 | 260.00 | 2,418,000 | |
| フィックスターズ | 14,500 | 1,203.00 | 17,443,500 | |
| ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 6,100 | 1,604.00 | 9,784,400 | |
| オプティム | 10,700 | 1,053.00 | 11,267,100 | |
| セレス | 5,100 | 976.00 | 4,977,600 | |
| ＳＨＩＦＴ | 9,500 | 24,650.00 | 234,175,000 | |
| 特種東海製紙 | 6,400 | 2,797.00 | 17,900,800 | |
| ティーガイア | 13,400 | 1,608.00 | 21,547,200 | |
| セック | 1,600 | 2,742.00 | 4,387,200 | |
| テクマトリックス | 23,600 | 1,779.00 | 41,984,400 | |
| プロシップ | 5,600 | 1,480.00 | 8,288,000 | |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 39,700 | 2,126.00 | 84,402,200 | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 29,600 | 11,420.00 | 338,032,000 | |
| ザッパラス | 4,800 | 371.00 | 1,780,800 | |
| システムリサーチ | 4,100 | 2,151.00 | 8,819,100 | |
| インターネットイニシアティブ | 72,300 | 2,380.00 | 172,074,000 | |
| さくらインターネット | 14,500 | 490.00 | 7,105,000 | |
| ヴィンクス | 3,900 | 1,477.00 | 5,760,300 | |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 4,000 | 4,135.00 | 16,540,000 | |
| ＳＲＡホールディングス | 6,500 | 2,982.00 | 19,383,000 | |
| システムインテグレータ | 4,000 | 433.00 | 1,732,000 | |
| 朝日ネット | 13,900 | 581.00 | 8,075,900 | |
| ｅＢＡＳＥ | 18,100 | 572.00 | 10,353,200 | |
| アバントグループ | 16,300 | 1,368.00 | 22,298,400 | |
| アドソル日進 | 5,400 | 1,327.00 | 7,165,800 | |
| ＯＤＫソリューションズ | 2,700 | 601.00 | 1,622,700 | |
| フリービット | 7,900 | 997.00 | 7,876,300 | |
| コムチュア | 17,200 | 2,356.00 | 40,523,200 | |
| サイバーコム | 1,900 | 1,485.00 | 2,821,500 | |
| アステリア | 10,100 | 768.00 | 7,756,800 | |
| アイル | 7,200 | 1,766.00 | 12,715,200 | |
| 王子ホールディングス | 539,200 | 517.00 | 278,766,400 | |
| 日本製紙 | 67,200 | 927.00 | 62,294,400 | |
| 三菱製紙 | 15,600 | 280.00 | 4,368,000 | |
| 北越コーポレーション | 81,800 | 785.00 | 64,213,000 | |
| 中越パルプ工業 | 5,100 | 987.00 | 5,033,700 | |
| 巴川製紙所 | 4,100 | 676.00 | 2,771,600 | |
| 大王製紙 | 57,100 | 974.00 | 55,615,400 | |
| 阿波製紙 | 3,200 | 371.00 | 1,187,200 | |
| マークラインズ | 7,000 | 2,551.00 | 17,857,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| メディカル・データ・ビジョン | 19,200 | 905.00 | 17,376,000 | |
| ｇｕｍｉ | 21,100 | 976.00 | 20,593,600 | |
| ショーケース | 3,100 | 310.00 | 961,000 | |
| モバイルファクトリー | 2,500 | 902.00 | 2,255,000 | |
| テラスカイ | 5,500 | 2,347.00 | 12,908,500 | |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 6,600 | 1,783.00 | 11,767,800 | |
| ＰＣＩホールディングス | 5,300 | 1,029.00 | 5,453,700 | |
| アイビーシー | 1,800 | 400.00 | 720,000 | |
| ネオジャパン | 4,400 | 1,018.00 | 4,479,200 | |
| ＰＲ　ＴＩＭＥＳ | 3,300 | 2,458.00 | 8,111,400 | |
| ラクス | 61,100 | 1,659.00 | 101,364,900 | |
| ランドコンピュータ | 3,200 | 925.00 | 2,960,000 | |
| ダブルスタンダード | 5,200 | 2,275.00 | 11,830,000 | |
| オープンドア | 9,100 | 1,778.00 | 16,179,800 | |
| マイネット | 4,200 | 370.00 | 1,554,000 | |
| アカツキ | 6,000 | 2,217.00 | 13,302,000 | |
| ベネフィットジャパン | 800 | 1,207.00 | 965,600 | |
| Ｕｂｉｃｏｍホールディングス | 4,100 | 2,185.00 | 8,958,500 | |
| カナミックネットワーク | 18,600 | 540.00 | 10,044,000 | |
| ノムラシステムコーポレーション | 12,300 | 114.00 | 1,402,200 | |
| レンゴー | 117,700 | 882.00 | 103,811,400 | |
| トーモク | 7,500 | 1,620.00 | 12,150,000 | |
| ザ・パック | 9,600 | 2,436.00 | 23,385,600 | |
| チェンジ | 31,600 | 2,100.00 | 66,360,000 | |
| シンクロ・フード | 8,000 | 457.00 | 3,656,000 | |
| オークネット | 6,600 | 1,783.00 | 11,767,800 | |
| キャピタル・アセット・プランニング | 2,400 | 572.00 | 1,372,800 | |
| セグエグループ | 3,600 | 829.00 | 2,984,400 | |
| エイトレッド | 1,800 | 1,430.00 | 2,574,000 | |
| マクロミル | 29,300 | 1,108.00 | 32,464,400 | |
| ビーグリー | 2,000 | 1,166.00 | 2,332,000 | |
| オロ | 4,000 | 1,950.00 | 7,800,000 | |
| ユーザーローカル | 4,700 | 1,308.00 | 6,147,600 | |
| テモナ | 2,400 | 263.00 | 631,200 | |
| ニーズウェル | 4,100 | 751.00 | 3,079,100 | |
| マネーフォワード | 31,100 | 4,370.00 | 135,907,000 | |
| サインポスト | 4,900 | 645.00 | 3,160,500 | |
| レゾナック・ホールディングス | 125,000 | 2,120.00 | 265,000,000 | |
| 住友化学 | 960,100 | 473.00 | 454,127,300 | |
| 住友精化 | 5,300 | 4,005.00 | 21,226,500 | |
| 日産化学 | 61,400 | 5,890.00 | 361,646,000 | |
| ラサ工業 | 4,900 | 1,901.00 | 9,314,900 | |
| クレハ | 11,100 | 8,290.00 | 92,019,000 | |
| 多木化学 | 5,000 | 4,485.00 | 22,425,000 | |
| テイカ | 8,500 | 1,168.00 | 9,928,000 | |
| 石原産業 | 23,400 | 1,061.00 | 24,827,400 | |
| 片倉コープアグリ | 2,500 | 1,594.00 | 3,985,000 | |
| 日本曹達 | 13,900 | 4,120.00 | 57,268,000 | |
| 東ソー | 172,600 | 1,584.00 | 273,398,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| トクヤマ | 41,800 | 1,783.00 | 74,529,400 | |
| セントラル硝子 | 20,800 | 2,770.00 | 57,616,000 | |
| 東亞合成 | 66,400 | 1,116.00 | 74,102,400 | |
| 大阪ソーダ | 7,700 | 3,940.00 | 30,338,000 | |
| 関東電化工業 | 24,900 | 933.00 | 23,231,700 | |
| デンカ | 47,000 | 3,030.00 | 142,410,000 | |
| イビデン | 74,900 | 5,170.00 | 387,233,000 | |
| 信越化学工業 | 218,400 | 16,650.00 | 3,636,360,000 | |
| 日本カーバイド工業 | 4,900 | 1,290.00 | 6,321,000 | |
| 電算システムホールディングス | 6,200 | 2,129.00 | 13,199,800 | |
| 堺化学工業 | 9,800 | 1,771.00 | 17,355,800 | |
| 第一稀元素化学工業 | 11,700 | 1,042.00 | 12,191,400 | |
| エア・ウォーター | 122,000 | 1,540.00 | 187,880,000 | |
| 日本酸素ホールディングス | 125,500 | 2,024.00 | 254,012,000 | |
| 日本化学工業 | 4,400 | 1,706.00 | 7,506,400 | |
| 東邦アセチレン | 2,600 | 1,131.00 | 2,940,600 | |
| 日本パーカライジング | 64,100 | 923.00 | 59,164,300 | |
| 高圧ガス工業 | 18,800 | 657.00 | 12,351,600 | |
| チタン工業 | 1,500 | 1,470.00 | 2,205,000 | |
| 四国化成ホールディングス | 15,400 | 1,299.00 | 20,004,600 | |
| 戸田工業 | 2,700 | 2,515.00 | 6,790,500 | |
| ステラ　ケミファ | 7,600 | 2,517.00 | 19,129,200 | |
| 保土谷化学工業 | 3,700 | 2,853.00 | 10,556,100 | |
| 日本触媒 | 19,600 | 5,280.00 | 103,488,000 | |
| 大日精化工業 | 8,900 | 1,686.00 | 15,005,400 | |
| カネカ | 29,500 | 3,275.00 | 96,612,500 | |
| 協和キリン | 156,600 | 2,941.00 | 460,560,600 | |
| 三菱瓦斯化学 | 96,600 | 1,824.00 | 176,198,400 | |
| 三井化学 | 108,700 | 3,040.00 | 330,448,000 | |
| ＪＳＲ | 120,700 | 2,796.00 | 337,477,200 | |
| 東京応化工業 | 22,600 | 6,250.00 | 141,250,000 | |
| 大阪有機化学工業 | 9,700 | 1,999.00 | 19,390,300 | |
| 三菱ケミカルグループ | 873,200 | 686.80 | 599,713,760 | |
| ＫＨネオケム | 21,500 | 2,712.00 | 58,308,000 | |
| ダイセル | 190,100 | 946.00 | 179,834,600 | |
| 住友ベークライト | 19,100 | 3,985.00 | 76,113,500 | |
| 積水化学工業 | 264,600 | 1,869.00 | 494,537,400 | |
| 日本ゼオン | 77,600 | 1,343.00 | 104,216,800 | |
| アイカ工業 | 32,600 | 2,988.00 | 97,408,800 | |
| ＵＢＥ | 66,600 | 1,932.00 | 128,671,200 | |
| 積水樹脂 | 18,800 | 1,827.00 | 34,347,600 | |
| タキロンシーアイ | 28,400 | 512.00 | 14,540,800 | |
| 旭有機材 | 8,400 | 2,760.00 | 23,184,000 | |
| ニチバン | 8,000 | 1,833.00 | 14,664,000 | |
| リケンテクノス | 27,900 | 481.00 | 13,419,900 | |
| 大倉工業 | 5,900 | 1,810.00 | 10,679,000 | |
| 積水化成品工業 | 18,100 | 380.00 | 6,878,000 | |
| 群栄化学工業 | 2,600 | 2,367.00 | 6,154,200 | |
| タイガースポリマー | 6,000 | 400.00 | 2,400,000 | |
| ミライアル | 4,000 | 1,459.00 | 5,836,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ダイキアクシス | 4,800 | 655.00 | 3,144,000 | |
| ダイキョーニシカワ | 28,500 | 552.00 | 15,732,000 | |
| 竹本容器 | 4,500 | 733.00 | 3,298,500 | |
| 森六ホールディングス | 6,500 | 1,716.00 | 11,154,000 | |
| 恵和 | 8,600 | 1,574.00 | 13,536,400 | |
| 日本化薬 | 98,800 | 1,138.00 | 112,434,400 | |
| カーリットホールディングス | 11,600 | 766.00 | 8,885,600 | |
| ソルクシーズ | 10,600 | 352.00 | 3,731,200 | |
| ＣＬホールディングス | 3,800 | 786.00 | 2,986,800 | |
| プレステージ・インターナショナル | 55,800 | 688.00 | 38,390,400 | |
| フェイス | 3,800 | 510.00 | 1,938,000 | |
| プロトコーポレーション | 16,200 | 1,178.00 | 19,083,600 | |
| ハイマックス | 4,100 | 1,438.00 | 5,895,800 | |
| アミューズ | 7,200 | 1,705.00 | 12,276,000 | |
| 野村総合研究所 | 265,800 | 3,170.00 | 842,586,000 | |
| ドリームインキュベータ | 4,100 | 2,505.00 | 10,270,500 | |
| サイバネットシステム | 10,900 | 985.00 | 10,736,500 | |
| クイック | 10,100 | 2,068.00 | 20,886,800 | |
| ＴＡＣ | 6,600 | 202.00 | 1,333,200 | |
| ＣＥホールディングス | 6,600 | 501.00 | 3,306,600 | |
| 日本システム技術 | 5,300 | 1,647.00 | 8,729,100 | |
| 電通グループ | 130,500 | 4,170.00 | 544,185,000 | |
| インテージホールディングス | 17,600 | 1,390.00 | 24,464,000 | |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 4,600 | 1,446.00 | 6,651,600 | |
| 東邦システムサイエンス | 3,800 | 1,002.00 | 3,807,600 | |
| ぴあ | 4,500 | 3,100.00 | 13,950,000 | |
| イオンファンタジー | 5,700 | 2,760.00 | 15,732,000 | |
| ソースネクスト | 65,900 | 304.00 | 20,033,600 | |
| シーティーエス | 14,700 | 785.00 | 11,539,500 | |
| ネクシィーズグループ | 4,200 | 644.00 | 2,704,800 | |
| インフォコム | 16,700 | 2,096.00 | 35,003,200 | |
| メディカルシステムネットワーク | 11,800 | 414.00 | 4,885,200 | |
| 日本精化 | 7,300 | 2,257.00 | 16,476,100 | |
| 扶桑化学工業 | 11,900 | 3,500.00 | 41,650,000 | |
| トリケミカル研究所 | 17,300 | 2,156.00 | 37,298,800 | |
| シンプレクス・ホールディングス | 21,700 | 2,144.00 | 46,524,800 | |
| ＨＥＲＯＺ | 4,400 | 995.00 | 4,378,000 | |
| ラクスル | 18,200 | 3,350.00 | 60,970,000 | |
| メルカリ | 58,300 | 2,792.00 | 162,773,600 | |
| ＩＰＳ | 4,300 | 2,738.00 | 11,773,400 | |
| ＦＩＧ | 14,900 | 384.00 | 5,721,600 | |
| システムサポート | 5,500 | 1,411.00 | 7,760,500 | |
| ＡＤＥＫＡ | 45,100 | 2,162.00 | 97,506,200 | |
| 日油 | 40,100 | 5,210.00 | 208,921,000 | |
| ミヨシ油脂 | 4,600 | 915.00 | 4,209,000 | |
| 新日本理化 | 17,800 | 245.00 | 4,361,000 | |
| ハリマ化成グループ | 9,100 | 810.00 | 7,371,000 | |
| イーソル | 8,100 | 779.00 | 6,309,900 | |
| アルテリア・ネットワークス | 12,000 | 1,243.00 | 14,916,000 | |
| 東海ソフト | 2,000 | 931.00 | 1,862,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ウイングアーク１ｓｔ | 13,200 | 2,071.00 | 27,337,200 | |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 3,600 | 1,480.00 | 5,328,000 | |
| サーバーワークス | 2,400 | 2,480.00 | 5,952,000 | |
| 東名 | 900 | 1,696.00 | 1,526,400 | |
| ヴィッツ | 1,200 | 933.00 | 1,119,600 | |
| トビラシステムズ | 3,200 | 816.00 | 2,611,200 | |
| Ｓａｎｓａｎ | 48,300 | 1,303.00 | 62,934,900 | |
| Ｌｉｎｋ－Ｕ | 2,300 | 976.00 | 2,244,800 | |
| ギフティ | 13,900 | 1,807.00 | 25,117,300 | |
| 花王 | 315,100 | 5,103.00 | 1,607,955,300 | |
| 第一工業製薬 | 4,700 | 1,962.00 | 9,221,400 | |
| 石原ケミカル | 5,800 | 1,221.00 | 7,081,800 | |
| 日華化学 | 5,200 | 809.00 | 4,206,800 | |
| ニイタカ | 2,400 | 1,962.00 | 4,708,800 | |
| 三洋化成工業 | 7,900 | 4,020.00 | 31,758,000 | |
| メドレー | 13,000 | 4,080.00 | 53,040,000 | |
| ベース | 4,500 | 3,670.00 | 16,515,000 | |
| ＪＭＤＣ | 21,300 | 3,965.00 | 84,454,500 | |
| 武田薬品工業 | 1,146,600 | 4,099.00 | 4,699,913,400 | |
| アステラス製薬 | 1,241,700 | 1,914.50 | 2,377,234,650 | |
| 住友ファーマ | 96,100 | 904.00 | 86,874,400 | |
| 塩野義製薬 | 165,600 | 6,295.00 | 1,042,452,000 | |
| わかもと製薬 | 12,000 | 218.00 | 2,616,000 | |
| 日本新薬 | 30,500 | 7,070.00 | 215,635,000 | |
| 中外製薬 | 405,700 | 3,301.00 | 1,339,215,700 | |
| 科研製薬 | 22,200 | 3,660.00 | 81,252,000 | |
| エーザイ | 157,600 | 8,329.00 | 1,312,650,400 | |
| 理研ビタミン | 11,100 | 1,839.00 | 20,412,900 | |
| ロート製薬 | 125,400 | 2,183.00 | 273,748,200 | |
| 小野薬品工業 | 249,900 | 2,904.00 | 725,709,600 | |
| 久光製薬 | 28,800 | 3,665.00 | 105,552,000 | |
| 有機合成薬品工業 | 9,700 | 290.00 | 2,813,000 | |
| 持田製薬 | 15,500 | 3,250.00 | 50,375,000 | |
| 参天製薬 | 243,700 | 1,041.00 | 253,691,700 | |
| 扶桑薬品工業 | 4,200 | 1,965.00 | 8,253,000 | |
| 日本ケミファ | 1,300 | 1,681.00 | 2,185,300 | |
| ツムラ | 40,700 | 2,707.00 | 110,174,900 | |
| テルモ | 403,600 | 3,651.00 | 1,473,543,600 | |
| Ｈ．Ｕ．グループホールディングス | 38,800 | 2,810.00 | 109,028,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 19,900 | 2,459.00 | 48,934,100 | |
| 生化学工業 | 24,600 | 829.00 | 20,393,400 | |
| 栄研化学 | 21,000 | 1,643.00 | 34,503,000 | |
| 鳥居薬品 | 6,900 | 2,879.00 | 19,865,100 | |
| ＪＣＲファーマ | 43,700 | 1,535.00 | 67,079,500 | |
| 東和薬品 | 19,800 | 2,014.00 | 39,877,200 | |
| 富士製薬工業 | 8,200 | 1,022.00 | 8,380,400 | |
| ゼリア新薬工業 | 17,900 | 2,094.00 | 37,482,600 | |
| 第一三共 | 1,128,700 | 3,952.00 | 4,460,622,400 | |
| キョーリン製薬ホールディングス | 28,100 | 1,657.00 | 46,561,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 大幸薬品 | 23,400 | 373.00 | 8,728,200 | |
| ダイト | 9,700 | 2,428.00 | 23,551,600 | |
| 大塚ホールディングス | 296,500 | 4,087.00 | 1,211,795,500 | |
| 大正製薬ホールディングス | 28,800 | 5,320.00 | 153,216,000 | |
| ペプチドリーム | 62,700 | 2,050.00 | 128,535,000 | |
| 大日本塗料 | 15,900 | 766.00 | 12,179,400 | |
| 日本ペイントホールディングス | 572,600 | 1,152.00 | 659,635,200 | |
| 関西ペイント | 118,400 | 1,633.00 | 193,347,200 | |
| 神東塗料 | 11,400 | 130.00 | 1,482,000 | |
| 中国塗料 | 24,000 | 966.00 | 23,184,000 | |
| 日本特殊塗料 | 8,100 | 860.00 | 6,966,000 | |
| 藤倉化成 | 17,600 | 422.00 | 7,427,200 | |
| 太陽ホールディングス | 19,600 | 2,272.00 | 44,531,200 | |
| ＤＩＣ | 50,500 | 2,345.00 | 118,422,500 | |
| サカタインクス | 28,800 | 1,030.00 | 29,664,000 | |
| 東洋インキＳＣホールディングス | 25,300 | 1,787.00 | 45,211,100 | |
| Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ | 11,400 | 1,264.00 | 14,409,600 | |
| アルプス技研 | 11,500 | 2,064.00 | 23,736,000 | |
| サニックス | 21,300 | 209.00 | 4,451,700 | |
| 日本空調サービス | 14,300 | 685.00 | 9,795,500 | |
| オリエンタルランド | 140,500 | 19,085.00 | 2,681,442,500 | |
| フォーカスシステムズ | 9,500 | 1,009.00 | 9,585,500 | |
| ダスキン | 29,500 | 2,950.00 | 87,025,000 | |
| パーク２４ | 99,100 | 2,121.00 | 210,191,100 | |
| 明光ネットワークジャパン | 17,500 | 605.00 | 10,587,500 | |
| ファルコホールディングス | 5,900 | 1,707.00 | 10,071,300 | |
| クレスコ | 10,000 | 1,709.00 | 17,090,000 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 124,300 | 1,052.00 | 130,763,600 | |
| 秀英予備校 | 3,000 | 432.00 | 1,296,000 | |
| 田谷 | 1,600 | 532.00 | 851,200 | |
| ラウンドワン | 111,000 | 489.00 | 54,279,000 | |
| リゾートトラスト | 52,500 | 2,292.00 | 120,330,000 | |
| オービック | 43,200 | 19,730.00 | 852,336,000 | |
| ジャストシステム | 18,500 | 2,940.00 | 54,390,000 | |
| ＴＤＣソフト | 11,000 | 1,450.00 | 15,950,000 | |
| Ｚホールディングス | 1,843,900 | 341.00 | 628,769,900 | |
| ビー・エム・エル | 16,400 | 3,250.00 | 53,300,000 | |
| トレンドマイクロ | 74,900 | 6,110.00 | 457,639,000 | |
| りらいあコミュニケーションズ | 21,900 | 969.00 | 21,221,100 | |
| ＩＤホールディングス | 8,600 | 908.00 | 7,808,800 | |
| リソー教育 | 60,300 | 350.00 | 21,105,000 | |
| 日本オラクル | 24,700 | 8,410.00 | 207,727,000 | |
| 早稲田アカデミー | 7,400 | 1,131.00 | 8,369,400 | |
| アルファシステムズ | 4,200 | 3,905.00 | 16,401,000 | |
| フューチャー | 32,100 | 1,587.00 | 50,942,700 | |
| ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 8,000 | 1,415.00 | 11,320,000 | |
| ＳＢテクノロジー | 5,400 | 1,873.00 | 10,114,200 | |
| トーセ | 3,500 | 766.00 | 2,681,000 | |
| ユー・エス・エス | 136,600 | 2,017.00 | 275,522,200 | |
| オービックビジネスコンサルタント | 25,400 | 4,280.00 | 108,712,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 69,500 | 3,055.00 | 212,322,500 | |
| アイティフォー | 17,100 | 828.00 | 14,158,800 | |
| 東京個別指導学院 | 15,800 | 514.00 | 8,121,200 | |
| 東計電算 | 1,600 | 5,150.00 | 8,240,000 | |
| サイバーエージェント | 317,700 | 1,188.00 | 377,427,600 | |
| 楽天グループ | 614,100 | 618.00 | 379,513,800 | |
| エックスネット | 1,700 | 998.00 | 1,696,600 | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 7,700 | 1,970.00 | 15,169,000 | |
| モーニングスター | 21,700 | 460.00 | 9,982,000 | |
| テー・オー・ダブリュー | 28,500 | 286.00 | 8,151,000 | |
| 大塚商会 | 73,300 | 4,180.00 | 306,394,000 | |
| サイボウズ | 17,800 | 2,377.00 | 42,310,600 | |
| 山田コンサルティンググループ | 6,600 | 1,153.00 | 7,609,800 | |
| セントラルスポーツ | 5,000 | 2,390.00 | 11,950,000 | |
| パラカ | 4,600 | 1,863.00 | 8,569,800 | |
| 電通国際情報サービス | 15,800 | 3,980.00 | 62,884,000 | |
| ＡＣＣＥＳＳ | 15,400 | 882.00 | 13,582,800 | |
| デジタルガレージ | 23,000 | 4,300.00 | 98,900,000 | |
| イーエムシステムズ | 21,600 | 864.00 | 18,662,400 | |
| ウェザーニューズ | 4,600 | 6,890.00 | 31,694,000 | |
| ＣＩＪ | 11,800 | 879.00 | 10,372,200 | |
| ビジネスエンジニアリング | 2,600 | 2,375.00 | 6,175,000 | |
| 日本エンタープライズ | 13,700 | 124.00 | 1,698,800 | |
| WOWOW | 7,300 | 1,261.00 | 9,205,300 | |
| スカラ | 12,700 | 710.00 | 9,017,000 | |
| インテリジェント　ウェイブ | 6,900 | 735.00 | 5,071,500 | |
| フルキャストホールディングス | 12,600 | 2,690.00 | 33,894,000 | |
| エン・ジャパン | 24,100 | 2,322.00 | 55,960,200 | |
| あすか製薬ホールディングス | 13,200 | 1,288.00 | 17,001,600 | |
| サワイグループホールディングス | 29,600 | 3,925.00 | 116,180,000 | |
| 富士フイルムホールディングス | 248,700 | 6,718.00 | 1,670,766,600 | |
| コニカミノルタ | 291,300 | 519.00 | 151,184,700 | |
| 資生堂 | 270,500 | 6,548.00 | 1,771,234,000 | |
| ライオン | 155,500 | 1,439.00 | 223,764,500 | |
| 高砂香料工業 | 8,600 | 2,518.00 | 21,654,800 | |
| マンダム | 28,000 | 1,391.00 | 38,948,000 | |
| ミルボン | 19,100 | 5,610.00 | 107,151,000 | |
| ファンケル | 56,600 | 2,605.00 | 147,443,000 | |
| コーセー | 26,200 | 13,510.00 | 353,962,000 | |
| コタ | 10,900 | 1,666.00 | 18,159,400 | |
| シーボン | 1,500 | 1,562.00 | 2,343,000 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 66,300 | 1,781.00 | 118,080,300 | |
| ノエビアホールディングス | 11,500 | 5,420.00 | 62,330,000 | |
| アジュバンホールディングス | 3,200 | 965.00 | 3,088,000 | |
| 新日本製薬 | 7,400 | 1,372.00 | 10,152,800 | |
| エステー | 10,000 | 1,500.00 | 15,000,000 | |
| アグロ　カネショウ | 4,800 | 1,553.00 | 7,454,400 | |
| コニシ | 21,700 | 1,727.00 | 37,475,900 | |
| 長谷川香料 | 26,800 | 2,836.00 | 76,004,800 | |
| 星光ＰＭＣ | 6,500 | 531.00 | 3,451,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 小林製薬 | 37,700 | 8,630.00 | 325,351,000 | |
| 荒川化学工業 | 11,100 | 946.00 | 10,500,600 | |
| メック | 10,700 | 2,305.00 | 24,663,500 | |
| 日本高純度化学 | 3,500 | 2,384.00 | 8,344,000 | |
| タカラバイオ | 34,900 | 1,705.00 | 59,504,500 | |
| ＪＣＵ | 14,500 | 3,190.00 | 46,255,000 | |
| 新田ゼラチン | 7,900 | 841.00 | 6,643,900 | |
| ＯＡＴアグリオ | 5,200 | 1,467.00 | 7,628,400 | |
| デクセリアルズ | 37,200 | 2,661.00 | 98,989,200 | |
| アース製薬 | 11,700 | 4,855.00 | 56,803,500 | |
| 北興化学工業 | 12,900 | 804.00 | 10,371,600 | |
| 大成ラミック | 4,200 | 2,959.00 | 12,427,800 | |
| クミアイ化学工業 | 51,500 | 847.00 | 43,620,500 | |
| 日本農薬 | 23,700 | 703.00 | 16,661,100 | |
| 富士興産 | 3,100 | 1,194.00 | 3,701,400 | |
| ニチレキ | 15,400 | 1,294.00 | 19,927,600 | |
| ユシロ化学工業 | 6,600 | 773.00 | 5,101,800 | |
| ビーピー・カストロール | 5,000 | 863.00 | 4,315,000 | |
| 富士石油 | 26,300 | 256.00 | 6,732,800 | |
| ＭＯＲＥＳＣＯ | 4,300 | 1,178.00 | 5,065,400 | |
| 出光興産 | 143,800 | 3,015.00 | 433,557,000 | |
| ＥＮＥＯＳホールディングス | 2,340,900 | 453.40 | 1,061,364,060 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 51,200 | 3,600.00 | 184,320,000 | |
| テスホールディングス | 13,500 | 1,101.00 | 14,863,500 | |
| インフロニア・ホールディングス | 132,800 | 1,009.00 | 133,995,200 | |
| 横浜ゴム | 73,600 | 2,020.00 | 148,672,000 | |
| ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ | 74,400 | 1,492.00 | 111,004,800 | |
| ブリヂストン | 413,700 | 4,748.00 | 1,964,247,600 | |
| 住友ゴム工業 | 127,100 | 1,115.00 | 141,716,500 | |
| 藤倉コンポジット | 9,200 | 830.00 | 7,636,000 | |
| オカモト | 7,200 | 3,680.00 | 26,496,000 | |
| ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ　ＧＲＯＵＰ | 2,100 | 1,096.00 | 2,301,600 | |
| アキレス | 8,300 | 1,240.00 | 10,292,000 | |
| フコク | 6,700 | 1,024.00 | 6,860,800 | |
| ニッタ | 13,100 | 2,796.00 | 36,627,600 | |
| クリエートメディック | 4,400 | 869.00 | 3,823,600 | |
| 住友理工 | 25,100 | 618.00 | 15,511,800 | |
| 三ツ星ベルト | 18,800 | 3,485.00 | 65,518,000 | |
| バンドー化学 | 20,500 | 950.00 | 19,475,000 | |
| ＡＧＣ | 131,800 | 4,545.00 | 599,031,000 | |
| 日本板硝子 | 66,000 | 649.00 | 42,834,000 | |
| 石塚硝子 | 1,900 | 1,435.00 | 2,726,500 | |
| 有沢製作所 | 21,100 | 1,301.00 | 27,451,100 | |
| 日本山村硝子 | 4,800 | 526.00 | 2,524,800 | |
| 日本電気硝子 | 52,900 | 2,397.00 | 126,801,300 | |
| オハラ | 6,100 | 1,126.00 | 6,868,600 | |
| 住友大阪セメント | 18,200 | 3,130.00 | 56,966,000 | |
| 太平洋セメント | 82,500 | 2,023.00 | 166,897,500 | |
| リソルホールディングス | 1,200 | 4,595.00 | 5,514,000 | |
| 日本ヒューム | 11,500 | 636.00 | 7,314,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本コンクリート工業 | 25,300 | 223.00 | 5,641,900 | |
| 三谷セキサン | 5,400 | 3,900.00 | 21,060,000 | |
| アジアパイルホールディングス | 20,300 | 559.00 | 11,347,700 | |
| 東海カーボン | 108,500 | 1,096.00 | 118,916,000 | |
| 日本カーボン | 7,400 | 4,285.00 | 31,709,000 | |
| 東洋炭素 | 8,000 | 3,880.00 | 31,040,000 | |
| ノリタケカンパニーリミテド | 6,400 | 3,985.00 | 25,504,000 | |
| ＴＯＴＯ | 85,400 | 5,010.00 | 427,854,000 | |
| 日本碍子 | 153,300 | 1,701.00 | 260,763,300 | |
| 日本特殊陶業 | 98,500 | 2,470.00 | 243,295,000 | |
| ダントーホールディングス | 9,200 | 208.00 | 1,913,600 | |
| ＭＡＲＵＷＡ | 4,800 | 16,670.00 | 80,016,000 | |
| 品川リフラクトリーズ | 3,700 | 3,895.00 | 14,411,500 | |
| 黒崎播磨 | 2,500 | 5,440.00 | 13,600,000 | |
| ヨータイ | 8,500 | 1,382.00 | 11,747,000 | |
| 東京窯業 | 11,800 | 269.00 | 3,174,200 | |
| ニッカトー | 5,700 | 490.00 | 2,793,000 | |
| フジミインコーポレーテッド | 10,400 | 6,610.00 | 68,744,000 | |
| クニミネ工業 | 3,900 | 825.00 | 3,217,500 | |
| エーアンドエーマテリアル | 2,300 | 873.00 | 2,007,900 | |
| ニチアス | 32,700 | 2,363.00 | 77,270,100 | |
| 日本製鉄 | 596,900 | 2,455.00 | 1,465,389,500 | |
| 神戸製鋼所 | 268,000 | 653.00 | 175,004,000 | |
| 中山製鋼所 | 27,500 | 849.00 | 23,347,500 | |
| 合同製鐵 | 6,500 | 2,224.00 | 14,456,000 | |
| ＪＦＥホールディングス | 356,200 | 1,563.00 | 556,740,600 | |
| 東京製鐵 | 37,300 | 1,234.00 | 46,028,200 | |
| 共英製鋼 | 15,200 | 1,282.00 | 19,486,400 | |
| 大和工業 | 22,000 | 4,645.00 | 102,190,000 | |
| 東京鐵鋼 | 6,300 | 1,531.00 | 9,645,300 | |
| 大阪製鐵 | 6,100 | 1,142.00 | 6,966,200 | |
| 淀川製鋼所 | 15,200 | 2,527.00 | 38,410,400 | |
| 丸一鋼管 | 40,500 | 2,728.00 | 110,484,000 | |
| モリ工業 | 3,100 | 2,761.00 | 8,559,100 | |
| 大同特殊鋼 | 16,800 | 4,395.00 | 73,836,000 | |
| 日本高周波鋼業 | 4,100 | 310.00 | 1,271,000 | |
| 日本冶金工業 | 9,700 | 4,310.00 | 41,807,000 | |
| 山陽特殊製鋼 | 13,100 | 2,112.00 | 27,667,200 | |
| 愛知製鋼 | 7,700 | 2,179.00 | 16,778,300 | |
| 日本金属 | 2,700 | 901.00 | 2,432,700 | |
| 大平洋金属 | 9,500 | 1,905.00 | 18,097,500 | |
| 新日本電工 | 85,300 | 374.00 | 31,902,200 | |
| 栗本鐵工所 | 6,300 | 1,724.00 | 10,861,200 | |
| 虹　技 | 1,600 | 912.00 | 1,459,200 | |
| 日本鋳鉄管 | 1,400 | 946.00 | 1,324,400 | |
| 日本製鋼所 | 35,900 | 2,638.00 | 94,704,200 | |
| 三菱製鋼 | 8,200 | 1,022.00 | 8,380,400 | |
| 日亜鋼業 | 13,900 | 247.00 | 3,433,300 | |
| 日本精線 | 1,700 | 4,265.00 | 7,250,500 | |
| エンビプロ・ホールディングス | 9,200 | 720.00 | 6,624,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 大紀アルミニウム工業所 | 18,900 | 1,299.00 | 24,551,100 | |
| 日本軽金属ホールディングス | 36,000 | 1,551.00 | 55,836,000 | |
| 三井金属鉱業 | 38,800 | 3,175.00 | 123,190,000 | |
| 東邦亜鉛 | 7,800 | 2,101.00 | 16,387,800 | |
| 三菱マテリアル | 89,000 | 2,133.00 | 189,837,000 | |
| 住友金属鉱山 | 154,500 | 4,930.00 | 761,685,000 | |
| ＤＯＷＡホールディングス | 29,900 | 4,205.00 | 125,729,500 | |
| 古河機械金属 | 19,500 | 1,260.00 | 24,570,000 | |
| エス・サイエンス | 80,700 | 26.00 | 2,098,200 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 19,400 | 3,900.00 | 75,660,000 | |
| 東邦チタニウム | 24,100 | 2,652.00 | 63,913,200 | |
| ＵＡＣＪ | 18,600 | 2,336.00 | 43,449,600 | |
| ＣＫサンエツ | 2,500 | 4,005.00 | 10,012,500 | |
| 古河電気工業 | 44,400 | 2,439.00 | 108,291,600 | |
| 住友電気工業 | 460,300 | 1,502.00 | 691,370,600 | |
| フジクラ | 142,800 | 979.00 | 139,801,200 | |
| 昭和電線ホールディングス | 14,800 | 1,761.00 | 26,062,800 | |
| タツタ電線 | 27,300 | 717.00 | 19,574,100 | |
| カナレ電気 | 2,000 | 1,391.00 | 2,782,000 | |
| 平河ヒューテック | 7,700 | 1,124.00 | 8,654,800 | |
| いよぎんホールディングス | 151,500 | 695.00 | 105,292,500 | |
| しずおかフィナンシャルグループ | 287,600 | 1,041.00 | 299,391,600 | |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 107,200 | 928.00 | 99,481,600 | |
| リョービ | 14,100 | 1,165.00 | 16,426,500 | |
| アーレスティ | 14,500 | 440.00 | 6,380,000 | |
| アサヒホールディングス | 53,800 | 1,950.00 | 104,910,000 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 88,100 | 1,574.00 | 138,669,400 | |
| ホッカンホールディングス | 7,200 | 1,370.00 | 9,864,000 | |
| コロナ | 7,600 | 872.00 | 6,627,200 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 17,700 | 1,844.00 | 32,638,800 | |
| 駒井ハルテック | 2,000 | 1,500.00 | 3,000,000 | |
| 高田機工 | 600 | 2,462.00 | 1,477,200 | |
| 三和ホールディングス | 122,800 | 1,221.00 | 149,938,800 | |
| 文化シヤッター | 38,400 | 1,097.00 | 42,124,800 | |
| 三協立山 | 18,200 | 543.00 | 9,882,600 | |
| アルインコ | 10,300 | 974.00 | 10,032,200 | |
| 東洋シヤッター | 2,100 | 504.00 | 1,058,400 | |
| ＬＩＸＩＬ | 194,200 | 2,065.00 | 401,023,000 | |
| 日本フイルコン | 8,800 | 446.00 | 3,924,800 | |
| ノーリツ | 19,500 | 1,427.00 | 27,826,500 | |
| 長府製作所 | 13,300 | 1,929.00 | 25,655,700 | |
| リンナイ | 24,100 | 9,600.00 | 231,360,000 | |
| ユニプレス | 23,100 | 764.00 | 17,648,400 | |
| ダイニチ工業 | 6,500 | 651.00 | 4,231,500 | |
| 日東精工 | 19,200 | 495.00 | 9,504,000 | |
| 三洋工業 | 1,500 | 1,880.00 | 2,820,000 | |
| 岡部 | 21,500 | 711.00 | 15,286,500 | |
| ジーテクト | 14,800 | 1,439.00 | 21,297,200 | |
| 東プレ | 23,400 | 1,152.00 | 26,956,800 | |
| 高周波熱錬 | 21,800 | 656.00 | 14,300,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 東京製綱 | 7,800 | 868.00 | 6,770,400 | |
| サンコール | 11,800 | 641.00 | 7,563,800 | |
| モリテックスチール | 9,900 | 267.00 | 2,643,300 | |
| パイオラックス | 18,300 | 1,720.00 | 31,476,000 | |
| エイチワン | 13,700 | 614.00 | 8,411,800 | |
| 日本発条 | 117,800 | 843.00 | 99,305,400 | |
| 中央発條 | 7,400 | 724.00 | 5,357,600 | |
| アドバネクス | 1,600 | 1,099.00 | 1,758,400 | |
| 三浦工業 | 54,300 | 3,130.00 | 169,959,000 | |
| タクマ | 40,200 | 1,224.00 | 49,204,800 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 89,000 | 3,455.00 | 307,495,000 | |
| アトラグループ | 3,100 | 184.00 | 570,400 | |
| インターワークス | 3,600 | 351.00 | 1,263,600 | |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 6,900 | 1,784.00 | 12,309,600 | |
| ＫｅｅＰｅｒ技研 | 9,600 | 3,350.00 | 32,160,000 | |
| ファーストロジック | 1,900 | 855.00 | 1,624,500 | |
| 三機サービス | 2,200 | 916.00 | 2,015,200 | |
| Ｇｕｎｏｓｙ | 8,000 | 605.00 | 4,840,000 | |
| デザインワン・ジャパン | 3,700 | 217.00 | 802,900 | |
| イー・ガーディアン | 5,000 | 2,600.00 | 13,000,000 | |
| リブセンス | 6,000 | 280.00 | 1,680,000 | |
| ジャパンマテリアル | 40,600 | 2,235.00 | 90,741,000 | |
| ベクトル | 20,900 | 1,310.00 | 27,379,000 | |
| ウチヤマホールディングス | 5,700 | 266.00 | 1,516,200 | |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 11,100 | 1,226.00 | 13,608,600 | |
| キャリアリンク | 4,800 | 2,713.00 | 13,022,400 | |
| ＩＢＪ | 8,000 | 993.00 | 7,944,000 | |
| アサンテ | 6,500 | 1,614.00 | 10,491,000 | |
| バリューＨＲ | 11,500 | 1,522.00 | 17,503,000 | |
| Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ | 12,200 | 4,625.00 | 56,425,000 | |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 4,800 | 1,092.00 | 5,241,600 | |
| ＥＲＩホールディングス | 3,800 | 1,170.00 | 4,446,000 | |
| アビスト | 1,900 | 2,925.00 | 5,557,500 | |
| シグマクシス・ホールディングス | 20,000 | 1,209.00 | 24,180,000 | |
| ウィルグループ | 11,100 | 1,205.00 | 13,375,500 | |
| エスクロー・エージェント・ジャパン | 14,200 | 144.00 | 2,044,800 | |
| メドピア | 10,500 | 1,375.00 | 14,437,500 | |
| レアジョブ | 2,300 | 941.00 | 2,164,300 | |
| リクルートホールディングス | 983,400 | 4,188.00 | 4,118,479,200 | |
| エラン | 17,600 | 956.00 | 16,825,600 | |
| ツガミ | 28,900 | 1,228.00 | 35,489,200 | |
| オークマ | 12,900 | 4,685.00 | 60,436,500 | |
| 芝浦機械 | 13,000 | 2,723.00 | 35,399,000 | |
| アマダ | 208,100 | 1,054.00 | 219,337,400 | |
| アイダエンジニアリング | 26,800 | 778.00 | 20,850,400 | |
| ＴＡＫＩＳＡＷＡ | 3,600 | 1,082.00 | 3,895,200 | |
| ＦＵＪＩ | 56,600 | 2,044.00 | 115,690,400 | |
| 牧野フライス製作所 | 14,400 | 4,300.00 | 61,920,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| オーエスジー | 62,300 | 1,860.00 | 115,878,000 | |
| ダイジェット工業 | 1,300 | 824.00 | 1,071,200 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 37,600 | 700.00 | 26,320,000 | |
| ＤＭＧ森精機 | 79,000 | 1,868.00 | 147,572,000 | |
| ソディック | 35,900 | 735.00 | 26,386,500 | |
| ディスコ | 20,900 | 39,400.00 | 823,460,000 | |
| 日東工器 | 6,300 | 1,489.00 | 9,380,700 | |
| 日進工具 | 11,000 | 1,008.00 | 11,088,000 | |
| パンチ工業 | 11,000 | 388.00 | 4,268,000 | |
| 冨士ダイス | 6,100 | 575.00 | 3,507,500 | |
| 土木管理総合試験所 | 5,600 | 304.00 | 1,702,400 | |
| 日本郵政 | 1,740,600 | 1,085.50 | 1,889,421,300 | |
| ベルシステム２４ホールディングス | 17,800 | 1,354.00 | 24,101,200 | |
| 鎌倉新書 | 15,000 | 988.00 | 14,820,000 | |
| ＳＭＮ | 3,100 | 466.00 | 1,444,600 | |
| 一蔵 | 1,600 | 450.00 | 720,000 | |
| グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ | 1,800 | 680.00 | 1,224,000 | |
| エアトリ | 8,400 | 2,584.00 | 21,705,600 | |
| アトラエ | 10,500 | 1,218.00 | 12,789,000 | |
| ストライク | 6,400 | 4,225.00 | 27,040,000 | |
| ソラスト | 36,500 | 684.00 | 24,966,000 | |
| セラク | 4,800 | 1,162.00 | 5,577,600 | |
| インソース | 33,100 | 1,433.00 | 47,432,300 | |
| 豊田自動織機 | 94,500 | 7,450.00 | 704,025,000 | |
| 豊和工業 | 7,100 | 947.00 | 6,723,700 | |
| ニデックオーケーケー | 5,200 | 916.00 | 4,763,200 | |
| 石川製作所 | 3,300 | 1,457.00 | 4,808,100 | |
| 東洋機械金属 | 8,900 | 552.00 | 4,912,800 | |
| 津田駒工業 | 2,300 | 588.00 | 1,352,400 | |
| エンシュウ | 2,600 | 674.00 | 1,752,400 | |
| 島精機製作所 | 20,800 | 1,822.00 | 37,897,600 | |
| オプトラン | 19,200 | 2,537.00 | 48,710,400 | |
| ＮＣホールディングス | 2,500 | 2,086.00 | 5,215,000 | |
| イワキ | 8,500 | 1,223.00 | 10,395,500 | |
| フリュー | 13,500 | 1,053.00 | 14,215,500 | |
| ヤマシンフィルタ | 31,000 | 506.00 | 15,686,000 | |
| 日阪製作所 | 12,600 | 817.00 | 10,294,200 | |
| やまびこ | 21,400 | 1,087.00 | 23,261,800 | |
| 野村マイクロ・サイエンス | 4,500 | 4,305.00 | 19,372,500 | |
| 平田機工 | 6,100 | 5,810.00 | 35,441,000 | |
| ペガサスミシン製造 | 14,300 | 775.00 | 11,082,500 | |
| マルマエ | 6,200 | 1,613.00 | 10,000,600 | |
| タツモ | 7,100 | 1,691.00 | 12,006,100 | |
| ナブテスコ | 81,900 | 3,455.00 | 282,964,500 | |
| 三井海洋開発 | 16,400 | 1,363.00 | 22,353,200 | |
| レオン自動機 | 13,700 | 1,035.00 | 14,179,500 | |
| ＳＭＣ | 42,300 | 60,710.00 | 2,568,033,000 | |
| ホソカワミクロン | 10,000 | 2,678.00 | 26,780,000 | |
| ユニオンツール | 5,700 | 3,250.00 | 18,525,000 | |
| オイレス工業 | 18,200 | 1,455.00 | 26,481,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日精エー・エス・ビー機械 | 5,800 | 4,335.00 | 25,143,000 | |
| サトーホールディングス | 18,500 | 1,904.00 | 35,224,000 | |
| 技研製作所 | 13,500 | 2,905.00 | 39,217,500 | |
| 日本エアーテック | 6,500 | 1,057.00 | 6,870,500 | |
| カワタ | 3,800 | 823.00 | 3,127,400 | |
| 日精樹脂工業 | 9,700 | 932.00 | 9,040,400 | |
| オカダアイヨン | 4,100 | 1,535.00 | 6,293,500 | |
| ワイエイシイホールディングス | 5,400 | 2,014.00 | 10,875,600 | |
| 小松製作所 | 611,300 | 2,889.50 | 1,766,351,350 | |
| 住友重機械工業 | 77,100 | 2,667.00 | 205,625,700 | |
| 日立建機 | 52,000 | 2,939.00 | 152,828,000 | |
| 日工 | 19,300 | 615.00 | 11,869,500 | |
| 巴工業 | 5,500 | 2,290.00 | 12,595,000 | |
| 井関農機 | 12,100 | 1,183.00 | 14,314,300 | |
| ＴＯＷＡ | 13,200 | 1,862.00 | 24,578,400 | |
| 丸山製作所 | 2,100 | 1,548.00 | 3,250,800 | |
| 北川鉄工所 | 5,100 | 1,123.00 | 5,727,300 | |
| シンニッタン | 14,400 | 224.00 | 3,225,600 | |
| ローツェ | 6,700 | 7,870.00 | 52,729,000 | |
| タカキタ | 3,800 | 395.00 | 1,501,000 | |
| クボタ | 690,500 | 1,837.50 | 1,268,793,750 | |
| 荏原実業 | 6,400 | 2,226.00 | 14,246,400 | |
| 東洋エンジニアリング | 16,800 | 591.00 | 9,928,800 | |
| 三菱化工機 | 4,300 | 2,092.00 | 8,995,600 | |
| 月島機械 | 17,700 | 962.00 | 17,027,400 | |
| 帝国電機製作所 | 9,900 | 2,274.00 | 22,512,600 | |
| 東京機械製作所 | 3,000 | 548.00 | 1,644,000 | |
| 新東工業 | 26,300 | 666.00 | 17,515,800 | |
| 澁谷工業 | 12,200 | 2,314.00 | 28,230,800 | |
| アイチコーポレーション | 18,400 | 763.00 | 14,039,200 | |
| 小森コーポレーション | 30,200 | 806.00 | 24,341,200 | |
| 鶴見製作所 | 10,000 | 1,990.00 | 19,900,000 | |
| 日本ギア工業 | 4,400 | 362.00 | 1,592,800 | |
| 酒井重工業 | 1,900 | 3,435.00 | 6,526,500 | |
| 荏原製作所 | 53,300 | 4,870.00 | 259,571,000 | |
| 石井鐵工所 | 1,000 | 2,181.00 | 2,181,000 | |
| 酉島製作所 | 11,200 | 1,471.00 | 16,475,200 | |
| 北越工業 | 13,000 | 1,299.00 | 16,887,000 | |
| ダイキン工業 | 155,700 | 21,510.00 | 3,349,107,000 | |
| オルガノ | 17,900 | 3,020.00 | 54,058,000 | |
| トーヨーカネツ | 4,900 | 2,570.00 | 12,593,000 | |
| 栗田工業 | 72,900 | 5,590.00 | 407,511,000 | |
| 椿本チエイン | 18,400 | 3,005.00 | 55,292,000 | |
| 大同工業 | 5,200 | 743.00 | 3,863,600 | |
| 日機装 | 32,200 | 959.00 | 30,879,800 | |
| 木村化工機 | 9,900 | 728.00 | 7,207,200 | |
| レイズネクスト | 18,300 | 1,257.00 | 23,003,100 | |
| アネスト岩田 | 22,200 | 857.00 | 19,025,400 | |
| ダイフク | 67,200 | 6,560.00 | 440,832,000 | |
| サムコ | 4,300 | 3,345.00 | 14,383,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 加藤製作所 | 6,000 | 708.00 | 4,248,000 | |
| 油研工業 | 1,600 | 1,797.00 | 2,875,200 | |
| タダノ | 68,800 | 910.00 | 62,608,000 | |
| フジテック | 47,800 | 3,000.00 | 143,400,000 | |
| ＣＫＤ | 36,000 | 1,950.00 | 70,200,000 | |
| 平和 | 43,300 | 2,334.00 | 101,062,200 | |
| 理想科学工業 | 11,500 | 2,048.00 | 23,552,000 | |
| ＳＡＮＫＹＯ | 25,500 | 4,965.00 | 126,607,500 | |
| 日本金銭機械 | 14,300 | 1,116.00 | 15,958,800 | |
| マースグループホールディングス | 7,600 | 2,258.00 | 17,160,800 | |
| フクシマガリレイ | 9,600 | 4,200.00 | 40,320,000 | |
| オーイズミ | 5,000 | 484.00 | 2,420,000 | |
| ダイコク電機 | 7,100 | 1,971.00 | 13,994,100 | |
| 竹内製作所 | 23,600 | 2,830.00 | 66,788,000 | |
| アマノ | 36,900 | 2,377.00 | 87,711,300 | |
| ＪＵＫＩ | 20,100 | 621.00 | 12,482,100 | |
| サンデン | 19,300 | 192.00 | 3,705,600 | |
| ジャノメ | 13,100 | 581.00 | 7,611,100 | |
| ブラザー工業 | 174,400 | 1,989.00 | 346,881,600 | |
| マックス | 16,100 | 1,912.00 | 30,783,200 | |
| モリタホールディングス | 22,700 | 1,163.00 | 26,400,100 | |
| グローリー | 33,800 | 2,164.00 | 73,143,200 | |
| 新晃工業 | 13,000 | 1,475.00 | 19,175,000 | |
| 大和冷機工業 | 19,900 | 1,128.00 | 22,447,200 | |
| セガサミーホールディングス | 104,800 | 1,933.00 | 202,578,400 | |
| 日本ピストンリング | 4,500 | 1,227.00 | 5,521,500 | |
| リケン | 5,100 | 2,262.00 | 11,536,200 | |
| ＴＰＲ | 15,300 | 1,235.00 | 18,895,500 | |
| ツバキ・ナカシマ | 32,000 | 1,028.00 | 32,896,000 | |
| ホシザキ | 83,900 | 4,475.00 | 375,452,500 | |
| 大豊工業 | 11,200 | 611.00 | 6,843,200 | |
| 日本精工 | 239,700 | 701.00 | 168,029,700 | |
| ＮＴＮ | 257,100 | 262.00 | 67,360,200 | |
| ジェイテクト | 116,100 | 922.00 | 107,044,200 | |
| 不二越 | 9,600 | 3,695.00 | 35,472,000 | |
| ミネベアミツミ | 226,900 | 2,078.00 | 471,498,200 | |
| 日本トムソン | 31,800 | 533.00 | 16,949,400 | |
| ＴＨＫ | 75,300 | 2,598.00 | 195,629,400 | |
| ユーシン精機 | 10,500 | 666.00 | 6,993,000 | |
| 前澤給装工業 | 9,200 | 918.00 | 8,445,600 | |
| イーグル工業 | 14,400 | 1,072.00 | 15,436,800 | |
| 前澤工業 | 8,300 | 616.00 | 5,112,800 | |
| 日本ピラー工業 | 12,000 | 2,976.00 | 35,712,000 | |
| キッツ | 48,000 | 797.00 | 38,256,000 | |
| 日立製作所 | 655,100 | 6,565.00 | 4,300,731,500 | |
| 東芝 | 251,100 | 4,558.00 | 1,144,513,800 | |
| 三菱電機 | 1,348,600 | 1,286.50 | 1,734,973,900 | |
| 富士電機 | 79,200 | 5,200.00 | 411,840,000 | |
| 東洋電機製造 | 4,700 | 848.00 | 3,985,600 | |
| 安川電機 | 154,500 | 4,500.00 | 695,250,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| シンフォニア　テクノロジー | 14,300 | 1,475.00 | 21,092,500 | |
| 明電舎 | 19,700 | 1,828.00 | 36,011,600 | |
| オリジン | 2,700 | 1,235.00 | 3,334,500 | |
| 山洋電気 | 5,600 | 5,750.00 | 32,200,000 | |
| デンヨー | 9,900 | 1,508.00 | 14,929,200 | |
| ＰＨＣホールディングス | 18,100 | 1,491.00 | 26,987,100 | |
| ソシオネクスト | 13,300 | 6,880.00 | 91,504,000 | |
| ベイカレント・コンサルティング | 105,000 | 4,470.00 | 469,350,000 | |
| Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 2,700 | 1,921.00 | 5,186,700 | |
| アイモバイル | 6,900 | 1,169.00 | 8,066,100 | |
| キャリアインデックス | 4,700 | 313.00 | 1,471,100 | |
| ＭＳ－Ｊａｐａｎ | 4,400 | 1,070.00 | 4,708,000 | |
| 船場 | 1,500 | 703.00 | 1,054,500 | |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 47,100 | 1,613.00 | 75,972,300 | |
| フルテック | 1,600 | 1,106.00 | 1,769,600 | |
| グリーンズ | 5,000 | 1,098.00 | 5,490,000 | |
| ツナググループ・ホールディングス | 3,800 | 470.00 | 1,786,000 | |
| ＧＡＭＥＷＩＴＨ | 4,100 | 319.00 | 1,307,900 | |
| ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ | 1,500 | 615.00 | 922,500 | |
| ウェルビー | 9,700 | 721.00 | 6,993,700 | |
| エル・ティー・エス | 1,600 | 2,750.00 | 4,400,000 | |
| ミダックホールディングス | 8,000 | 2,674.00 | 21,392,000 | |
| 日総工産 | 9,900 | 572.00 | 5,662,800 | |
| キュービーネットホールディングス | 6,900 | 1,348.00 | 9,301,200 | |
| ＲＰＡホールディングス | 17,900 | 272.00 | 4,868,800 | |
| 三櫻工業 | 19,600 | 637.00 | 12,485,200 | |
| マキタ | 162,300 | 3,195.00 | 518,548,500 | |
| 東芝テック | 19,400 | 3,555.00 | 68,967,000 | |
| 芝浦メカトロニクス | 2,300 | 10,860.00 | 24,978,000 | |
| マブチモーター | 32,300 | 3,655.00 | 118,056,500 | |
| 日本電産 | 317,000 | 7,085.00 | 2,245,945,000 | |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 9,600 | 481.00 | 4,617,600 | |
| トレックス・セミコンダクター | 6,000 | 2,636.00 | 15,816,000 | |
| 東光高岳 | 7,800 | 1,978.00 | 15,428,400 | |
| ダブル・スコープ | 42,600 | 1,415.00 | 60,279,000 | |
| 宮越ホールディングス | 5,700 | 767.00 | 4,371,900 | |
| ダイヘン | 11,700 | 3,985.00 | 46,624,500 | |
| ヤーマン | 25,300 | 1,410.00 | 35,673,000 | |
| ＪＶＣケンウッド | 118,800 | 353.00 | 41,936,400 | |
| ミマキエンジニアリング | 12,300 | 606.00 | 7,453,800 | |
| Ｉ－ＰＥＸ | 7,200 | 1,117.00 | 8,042,400 | |
| 日新電機 | 31,200 | 1,298.00 | 40,497,600 | |
| 大崎電気工業 | 30,900 | 519.00 | 16,037,100 | |
| オムロン | 119,600 | 6,662.00 | 796,775,200 | |
| 日東工業 | 17,600 | 2,264.00 | 39,846,400 | |
| ＩＤＥＣ | 19,200 | 2,912.00 | 55,910,400 | |
| 正興電機製作所 | 4,900 | 952.00 | 4,664,800 | |
| 不二電機工業 | 2,500 | 1,141.00 | 2,852,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ジーエス・ユアサ　コーポレーション | 42,800 | 2,164.00 | 92,619,200 | |
| サクサホールディングス | 2,600 | 1,180.00 | 3,068,000 | |
| メルコホールディングス | 3,600 | 3,010.00 | 10,836,000 | |
| テクノメディカ | 3,200 | 1,700.00 | 5,440,000 | |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディングス | 4,000 | 1,373.00 | 5,492,000 | |
| 日本電気 | 184,500 | 4,555.00 | 840,397,500 | |
| 富士通 | 130,000 | 18,500.00 | 2,405,000,000 | |
| 沖電気工業 | 59,000 | 706.00 | 41,654,000 | |
| 岩崎通信機 | 5,700 | 768.00 | 4,377,600 | |
| 電気興業 | 6,000 | 1,935.00 | 11,610,000 | |
| サンケン電気 | 12,000 | 6,880.00 | 82,560,000 | |
| ナカヨ | 2,000 | 1,063.00 | 2,126,000 | |
| アイホン | 7,900 | 1,813.00 | 14,322,700 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 851,100 | 1,256.50 | 1,069,407,150 | |
| セイコーエプソン | 173,800 | 1,972.00 | 342,733,600 | |
| ワコム | 103,400 | 602.00 | 62,246,800 | |
| アルバック | 30,900 | 5,840.00 | 180,456,000 | |
| アクセル | 4,800 | 1,713.00 | 8,222,400 | |
| ＥＩＺＯ | 9,600 | 3,385.00 | 32,496,000 | |
| ジャパンディスプレイ | 501,300 | 44.00 | 22,057,200 | |
| 日本信号 | 29,700 | 1,007.00 | 29,907,900 | |
| 京三製作所 | 27,400 | 402.00 | 11,014,800 | |
| 能美防災 | 17,700 | 1,553.00 | 27,488,100 | |
| ホーチキ | 9,800 | 1,382.00 | 13,543,600 | |
| 星和電機 | 5,200 | 434.00 | 2,256,800 | |
| エレコム | 31,100 | 1,358.00 | 42,233,800 | |
| パナソニック　ホールディングス | 1,541,300 | 1,110.00 | 1,710,843,000 | |
| シャープ | 157,200 | 1,003.00 | 157,671,600 | |
| アンリツ | 91,800 | 1,272.00 | 116,769,600 | |
| 富士通ゼネラル | 36,900 | 3,335.00 | 123,061,500 | |
| ソニーグループ | 913,900 | 11,100.00 | 10,144,290,000 | |
| ＴＤＫ | 206,600 | 4,370.00 | 902,842,000 | |
| 帝国通信工業 | 5,800 | 1,413.00 | 8,195,400 | |
| タムラ製作所 | 55,900 | 733.00 | 40,974,700 | |
| アルプスアルパイン | 116,500 | 1,213.00 | 141,314,500 | |
| 池上通信機 | 4,200 | 529.00 | 2,221,800 | |
| 日本電波工業 | 15,600 | 1,532.00 | 23,899,200 | |
| 鈴木 | 7,600 | 859.00 | 6,528,400 | |
| メイコー | 14,200 | 2,628.00 | 37,317,600 | |
| 日本トリム | 2,700 | 2,657.00 | 7,173,900 | |
| ローランド　ディー．ジー． | 7,300 | 2,809.00 | 20,505,700 | |
| フォスター電機 | 12,000 | 893.00 | 10,716,000 | |
| ＳＭＫ | 3,100 | 2,350.00 | 7,285,000 | |
| ヨコオ | 10,400 | 2,173.00 | 22,599,200 | |
| ティアック | 20,100 | 118.00 | 2,371,800 | |
| ホシデン | 31,200 | 1,556.00 | 48,547,200 | |
| ヒロセ電機 | 21,600 | 16,470.00 | 355,752,000 | |
| 日本航空電子工業 | 26,700 | 2,150.00 | 57,405,000 | |
| ＴＯＡ | 15,000 | 765.00 | 11,475,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| マクセル | 28,300 | 1,394.00 | 39,450,200 | |
| 古野電気 | 16,900 | 941.00 | 15,902,900 | |
| スミダコーポレーション | 11,900 | 1,470.00 | 17,493,000 | |
| アイコム | 5,000 | 2,589.00 | 12,945,000 | |
| リオン | 5,300 | 1,792.00 | 9,497,600 | |
| 横河電機 | 142,600 | 2,156.00 | 307,445,600 | |
| 新電元工業 | 4,900 | 3,225.00 | 15,802,500 | |
| アズビル | 90,200 | 3,445.00 | 310,739,000 | |
| 東亜ディーケーケー | 6,000 | 785.00 | 4,710,000 | |
| 日本光電工業 | 59,600 | 3,150.00 | 187,740,000 | |
| チノー | 5,300 | 1,799.00 | 9,534,700 | |
| 共和電業 | 12,200 | 336.00 | 4,099,200 | |
| 日本電子材料 | 8,400 | 1,433.00 | 12,037,200 | |
| 堀場製作所 | 28,800 | 5,850.00 | 168,480,000 | |
| アドバンテスト | 101,700 | 8,700.00 | 884,790,000 | |
| 小野測器 | 4,900 | 379.00 | 1,857,100 | |
| エスペック | 10,400 | 1,889.00 | 19,645,600 | |
| キーエンス | 129,200 | 55,220.00 | 7,134,424,000 | |
| 日置電機 | 6,700 | 6,260.00 | 41,942,000 | |
| シスメックス | 111,300 | 8,315.00 | 925,459,500 | |
| 日本マイクロニクス | 21,300 | 1,348.00 | 28,712,400 | |
| メガチップス | 10,700 | 2,549.00 | 27,274,300 | |
| ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ | 6,000 | 3,600.00 | 21,600,000 | |
| ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ | 10,900 | 661.00 | 7,204,900 | |
| 澤藤電機 | 1,500 | 1,120.00 | 1,680,000 | |
| デンソー | 266,400 | 6,662.00 | 1,774,756,800 | |
| 原田工業 | 5,700 | 850.00 | 4,845,000 | |
| コーセル | 17,300 | 1,005.00 | 17,386,500 | |
| イリソ電子工業 | 11,800 | 4,370.00 | 51,566,000 | |
| オプテックスグループ | 23,600 | 1,901.00 | 44,863,600 | |
| 千代田インテグレ | 5,200 | 2,196.00 | 11,419,200 | |
| レーザーテック | 63,700 | 23,950.00 | 1,525,615,000 | |
| スタンレー電気 | 91,800 | 2,586.00 | 237,394,800 | |
| 岩崎電気 | 4,200 | 2,270.00 | 9,534,000 | |
| ウシオ電機 | 67,400 | 1,682.00 | 113,366,800 | |
| 岡谷電機産業 | 10,000 | 252.00 | 2,520,000 | |
| ヘリオス　テクノ　ホールディング | 11,800 | 480.00 | 5,664,000 | |
| エノモト | 3,300 | 1,729.00 | 5,705,700 | |
| 日本セラミック | 13,000 | 2,349.00 | 30,537,000 | |
| 遠藤照明 | 5,700 | 748.00 | 4,263,600 | |
| 古河電池 | 9,500 | 1,080.00 | 10,260,000 | |
| 双信電機 | 5,200 | 373.00 | 1,939,600 | |
| 山一電機 | 11,200 | 1,770.00 | 19,824,000 | |
| 図研 | 11,200 | 3,030.00 | 33,936,000 | |
| 日本電子 | 32,200 | 3,680.00 | 118,496,000 | |
| カシオ計算機 | 96,200 | 1,335.00 | 128,427,000 | |
| ファナック | 126,800 | 20,825.00 | 2,640,610,000 | |
| 日本シイエムケイ | 27,500 | 471.00 | 12,952,500 | |
| エンプラス | 3,800 | 3,690.00 | 14,022,000 | |
| 大真空 | 15,700 | 707.00 | 11,099,900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ローム | 59,600 | 9,830.00 | 585,868,000 | |
| 浜松ホトニクス | 103,700 | 6,550.00 | 679,235,000 | |
| 三井ハイテック | 13,200 | 6,560.00 | 86,592,000 | |
| 新光電気工業 | 45,800 | 3,680.00 | 168,544,000 | |
| 京セラ | 200,600 | 6,555.00 | 1,314,933,000 | |
| 協栄産業 | 1,200 | 1,693.00 | 2,031,600 | |
| 太陽誘電 | 62,800 | 4,220.00 | 265,016,000 | |
| 村田製作所 | 391,700 | 7,050.00 | 2,761,485,000 | |
| 双葉電子工業 | 24,500 | 532.00 | 13,034,000 | |
| 日東電工 | 94,000 | 7,770.00 | 730,380,000 | |
| 北陸電気工業 | 4,800 | 1,259.00 | 6,043,200 | |
| 東海理化電機製作所 | 36,400 | 1,414.00 | 51,469,600 | |
| ニチコン | 26,200 | 1,264.00 | 33,116,800 | |
| 日本ケミコン | 12,700 | 1,603.00 | 20,358,100 | |
| ＫＯＡ | 19,400 | 1,910.00 | 37,054,000 | |
| 三井Ｅ＆Ｓホールディングス | 59,000 | 384.00 | 22,656,000 | |
| 日立造船 | 107,000 | 815.00 | 87,205,000 | |
| 三菱重工業 | 228,200 | 5,001.00 | 1,141,228,200 | |
| 川崎重工業 | 97,300 | 2,892.00 | 281,391,600 | |
| ＩＨＩ | 82,200 | 3,735.00 | 307,017,000 | |
| 名村造船所 | 33,100 | 385.00 | 12,743,500 | |
| 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 | 880.00 | 4,048,000 | |
| マネジメントソリューションズ | 7,300 | 3,540.00 | 25,842,000 | |
| プロレド・パートナーズ | 3,200 | 510.00 | 1,632,000 | |
| ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ | 3,900 | 359.00 | 1,400,100 | |
| テノ．ホールディングス | 1,600 | 612.00 | 979,200 | |
| フロンティア・マネジメント | 4,500 | 1,336.00 | 6,012,000 | |
| ピアラ | 1,900 | 537.00 | 1,020,300 | |
| コプロ・ホールディングス | 2,000 | 1,049.00 | 2,098,000 | |
| ギークス | 1,700 | 896.00 | 1,523,200 | |
| カーブスホールディングス | 40,700 | 852.00 | 34,676,400 | |
| フォーラムエンジニアリング | 7,700 | 842.00 | 6,483,400 | |
| ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ | 4,600 | 1,146.00 | 5,271,600 | |
| 日本車輌製造 | 4,900 | 1,932.00 | 9,466,800 | |
| 三菱ロジスネクスト | 20,600 | 671.00 | 13,822,600 | |
| 近畿車輌 | 1,500 | 1,059.00 | 1,588,500 | |
| 一家ホールディングス | 3,000 | 623.00 | 1,869,000 | |
| フルサト・マルカホールディングス | 13,500 | 3,205.00 | 43,267,500 | |
| ヤマエグループホールディングス | 7,700 | 1,430.00 | 11,011,000 | |
| ジャパンクラフトホールディングス | 4,400 | 611.00 | 2,688,400 | |
| ＦＰＧ | 51,600 | 1,049.00 | 54,128,400 | |
| 島根銀行 | 4,300 | 465.00 | 1,999,500 | |
| じもとホールディングス | 8,300 | 435.00 | 3,610,500 | |
| 全国保証 | 33,200 | 4,955.00 | 164,506,000 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 631,300 | 326.00 | 205,803,800 | |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 10,500 | 1,177.00 | 12,358,500 | |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 16,300 | 2,549.00 | 41,548,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 九州フィナンシャルグループ | 223,700 | 446.00 | 99,770,200 | |
| かんぽ生命保険 | 154,400 | 2,198.00 | 339,371,200 | |
| ゆうちょ銀行 | 362,300 | 1,136.00 | 411,572,800 | |
| あんしん保証 | 5,400 | 269.00 | 1,452,600 | |
| 富山第一銀行 | 31,600 | 584.00 | 18,454,400 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 701,400 | 545.00 | 382,263,000 | |
| ジェイリース | 4,300 | 2,687.00 | 11,554,100 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 80,500 | 976.00 | 78,568,000 | |
| イントラスト | 4,800 | 848.00 | 4,070,400 | |
| 日本モーゲージサービス | 7,100 | 896.00 | 6,361,600 | |
| ＣＡＳＡ | 4,800 | 885.00 | 4,248,000 | |
| アルヒ | 15,600 | 1,010.00 | 15,756,000 | |
| プレミアグループ | 21,400 | 1,598.00 | 34,197,200 | |
| 日産自動車 | 1,835,200 | 430.20 | 789,503,040 | |
| いすゞ自動車 | 375,600 | 1,540.00 | 578,424,000 | |
| トヨタ自動車 | 7,094,300 | 1,837.50 | 13,035,776,250 | |
| 日野自動車 | 166,400 | 502.00 | 83,532,800 | |
| 三菱自動車工業 | 503,900 | 498.00 | 250,942,200 | |
| エフテック | 8,800 | 510.00 | 4,488,000 | |
| レシップホールディングス | 5,100 | 455.00 | 2,320,500 | |
| ＧＭＢ | 2,400 | 701.00 | 1,682,400 | |
| ファルテック | 2,000 | 589.00 | 1,178,000 | |
| 武蔵精密工業 | 31,500 | 1,576.00 | 49,644,000 | |
| 日産車体 | 22,800 | 817.00 | 18,627,600 | |
| 新明和工業 | 40,500 | 1,031.00 | 41,755,500 | |
| 極東開発工業 | 22,700 | 1,450.00 | 32,915,000 | |
| トピー工業 | 10,500 | 1,562.00 | 16,401,000 | |
| ティラド | 3,200 | 2,599.00 | 8,316,800 | |
| 曙ブレーキ工業 | 78,900 | 150.00 | 11,835,000 | |
| タチエス | 20,300 | 1,125.00 | 22,837,500 | |
| ＮＯＫ | 50,000 | 1,177.00 | 58,850,000 | |
| フタバ産業 | 34,600 | 348.00 | 12,040,800 | |
| ＫＹＢ | 12,300 | 3,460.00 | 42,558,000 | |
| 市光工業 | 18,500 | 364.00 | 6,734,000 | |
| 大同メタル工業 | 25,200 | 479.00 | 12,070,800 | |
| プレス工業 | 57,500 | 419.00 | 24,092,500 | |
| ミクニ | 14,800 | 331.00 | 4,898,800 | |
| 太平洋工業 | 29,600 | 1,009.00 | 29,866,400 | |
| 河西工業 | 17,100 | 132.00 | 2,257,200 | |
| アイシン | 99,600 | 3,550.00 | 353,580,000 | |
| マツダ | 427,200 | 1,013.00 | 432,753,600 | |
| 今仙電機製作所 | 8,100 | 643.00 | 5,208,300 | |
| 本田技研工業 | 1,050,300 | 3,140.00 | 3,297,942,000 | |
| スズキ | 237,200 | 4,291.00 | 1,017,825,200 | |
| ＳＵＢＡＲＵ | 408,800 | 2,070.50 | 846,420,400 | |
| 安永 | 5,600 | 657.00 | 3,679,200 | |
| ヤマハ発動機 | 202,900 | 3,025.00 | 613,772,500 | |
| 小糸製作所 | 155,300 | 2,076.00 | 322,402,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＴＢＫ | 12,800 | 240.00 | 3,072,000 | |
| エクセディ | 21,100 | 1,613.00 | 34,034,300 | |
| ミツバ | 24,100 | 456.00 | 10,989,600 | |
| 豊田合成 | 37,600 | 2,045.00 | 76,892,000 | |
| 愛三工業 | 21,400 | 683.00 | 14,616,200 | |
| 盟和産業 | 1,500 | 927.00 | 1,390,500 | |
| 日本プラスト | 10,100 | 404.00 | 4,080,400 | |
| ヨロズ | 12,000 | 705.00 | 8,460,000 | |
| エフ・シー・シー | 22,900 | 1,332.00 | 30,502,800 | |
| 新家工業 | 2,700 | 2,087.00 | 5,634,900 | |
| シマノ | 52,900 | 21,580.00 | 1,141,582,000 | |
| テイ・エス　テック | 59,200 | 1,514.00 | 89,628,800 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 11,300 | 1,578.00 | 17,831,400 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 19,800 | 2,777.00 | 54,984,600 | |
| ひろぎんホールディングス | 165,900 | 647.00 | 107,337,300 | |
| マーキュリアホールディングス | 7,500 | 601.00 | 4,507,500 | |
| おきなわフィナンシャルグループ | 12,000 | 2,318.00 | 27,816,000 | |
| ダイレクトマーケティングミックス | 15,200 | 1,560.00 | 23,712,000 | |
| ポピンズ | 1,800 | 1,723.00 | 3,101,400 | |
| ＬＩＴＡＬＩＣＯ | 10,400 | 2,235.00 | 23,244,000 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 16,500 | 2,849.00 | 47,008,500 | |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 10,800 | 4,345.00 | 46,926,000 | |
| ネットプロテクションズホールディングス | 42,000 | 514.00 | 21,588,000 | |
| プロクレアホールディングス | 15,600 | 2,148.00 | 33,508,800 | |
| あいちフィナンシャルグループ | 17,700 | 2,277.00 | 40,302,900 | |
| ジャムコ | 7,000 | 1,403.00 | 9,821,000 | |
| 小野建 | 12,500 | 1,458.00 | 18,225,000 | |
| はるやまホールディングス | 5,600 | 436.00 | 2,441,600 | |
| 南陽 | 2,500 | 1,932.00 | 4,830,000 | |
| ノジマ | 44,600 | 1,372.00 | 61,191,200 | |
| 佐鳥電機 | 8,400 | 1,270.00 | 10,668,000 | |
| カッパ・クリエイト | 21,500 | 1,406.00 | 30,229,000 | |
| エコートレーディング | 2,400 | 700.00 | 1,680,000 | |
| 伯東 | 7,800 | 4,195.00 | 32,721,000 | |
| コンドーテック | 10,600 | 983.00 | 10,419,800 | |
| 中山福 | 7,200 | 321.00 | 2,311,200 | |
| ライトオン | 10,400 | 592.00 | 6,156,800 | |
| ナガイレーベン | 17,300 | 1,894.00 | 32,766,200 | |
| 三菱食品 | 12,500 | 3,015.00 | 37,687,500 | |
| 良品計画 | 176,300 | 1,406.00 | 247,877,800 | |
| パリミキホールディングス | 17,300 | 265.00 | 4,584,500 | |
| 松田産業 | 10,500 | 2,265.00 | 23,782,500 | |
| 第一興商 | 26,300 | 3,865.00 | 101,649,500 | |
| メディパルホールディングス | 141,700 | 1,688.00 | 239,189,600 | |
| アドヴァングループ | 12,900 | 837.00 | 10,797,300 | |
| ＳＰＫ | 6,000 | 1,387.00 | 8,322,000 | |
| 萩原電気ホールディングス | 5,200 | 2,459.00 | 12,786,800 | |
| アルビス | 4,600 | 2,368.00 | 10,892,800 | |
| アズワン | 19,900 | 5,570.00 | 110,843,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| スズデン | 4,800 | 2,237.00 | 10,737,600 | |
| 尾家産業 | 3,300 | 926.00 | 3,055,800 | |
| シモジマ | 9,400 | 942.00 | 8,854,800 | |
| ドウシシャ | 14,400 | 1,634.00 | 23,529,600 | |
| 小津産業 | 3,100 | 1,524.00 | 4,724,400 | |
| コナカ | 14,800 | 339.00 | 5,017,200 | |
| 高速 | 7,100 | 1,720.00 | 12,212,000 | |
| ハウス　オブ　ローゼ | 1,600 | 1,624.00 | 2,598,400 | |
| Ｇ－７ホールディングス | 17,100 | 1,546.00 | 26,436,600 | |
| たけびし | 5,200 | 1,527.00 | 7,940,400 | |
| イオン北海道 | 20,100 | 1,112.00 | 22,351,200 | |
| コジマ | 26,200 | 549.00 | 14,383,800 | |
| ヒマラヤ | 4,400 | 924.00 | 4,065,600 | |
| コーナン商事 | 18,400 | 3,320.00 | 61,088,000 | |
| ネットワンシステムズ | 48,200 | 3,380.00 | 162,916,000 | |
| エコス | 5,000 | 1,820.00 | 9,100,000 | |
| ワタミ | 16,500 | 961.00 | 15,856,500 | |
| マルシェ | 4,700 | 390.00 | 1,833,000 | |
| リックス | 2,600 | 2,180.00 | 5,668,000 | |
| システムソフト | 45,000 | 92.00 | 4,140,000 | |
| 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 | 306,500 | 2,300.00 | 704,950,000 | |
| 丸文 | 12,100 | 956.00 | 11,567,600 | |
| 西松屋チェーン | 30,200 | 1,499.00 | 45,269,800 | |
| ゼンショーホールディングス | 74,900 | 3,255.00 | 243,799,500 | |
| ハピネット | 11,500 | 1,977.00 | 22,735,500 | |
| 幸楽苑ホールディングス | 8,800 | 1,051.00 | 9,248,800 | |
| ハークスレイ | 4,800 | 811.00 | 3,892,800 | |
| 橋本総業ホールディングス | 5,400 | 1,025.00 | 5,535,000 | |
| 日本ライフライン | 40,100 | 904.00 | 36,250,400 | |
| サイゼリヤ | 22,700 | 2,924.00 | 66,374,800 | |
| タカショー | 11,800 | 715.00 | 8,437,000 | |
| ＶＴホールディングス | 52,000 | 471.00 | 24,492,000 | |
| アルゴグラフィックス | 11,800 | 3,640.00 | 42,952,000 | |
| 魚力 | 4,300 | 2,114.00 | 9,090,200 | |
| ＩＤＯＭ | 41,300 | 678.00 | 28,001,400 | |
| 日本エム・ディ・エム | 7,600 | 856.00 | 6,505,600 | |
| ポプラ | 3,200 | 140.00 | 448,000 | |
| フジ・コーポレーション | 7,700 | 1,305.00 | 10,048,500 | |
| ユナイテッドアローズ | 14,500 | 1,769.00 | 25,650,500 | |
| 進和 | 9,100 | 2,004.00 | 18,236,400 | |
| エスケイジャパン | 3,300 | 603.00 | 1,989,900 | |
| ダイトロン | 5,300 | 2,268.00 | 12,020,400 | |
| ハイデイ日高 | 20,100 | 1,954.00 | 39,275,400 | |
| シークス | 19,300 | 1,309.00 | 25,263,700 | |
| ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 8,000 | 198.00 | 1,584,000 | |
| コロワイド | 62,900 | 1,789.00 | 112,528,100 | |
| ピーシーデポコーポレーション | 15,200 | 270.00 | 4,104,000 | |
| 田中商事 | 4,100 | 555.00 | 2,275,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| オーハシテクニカ | 6,700 | 1,425.00 | 9,547,500 | |
| 壱番屋 | 10,900 | 4,630.00 | 50,467,000 | |
| 白銅 | 4,900 | 2,555.00 | 12,519,500 | |
| トップカルチャー | 4,600 | 183.00 | 841,800 | |
| ＰＬＡＮＴ | 3,200 | 647.00 | 2,070,400 | |
| スギホールディングス | 27,600 | 5,840.00 | 161,184,000 | |
| ダイコー通産 | 1,500 | 1,090.00 | 1,635,000 | |
| 薬王堂ホールディングス | 7,600 | 2,781.00 | 21,135,600 | |
| 島津製作所 | 157,400 | 3,790.00 | 596,546,000 | |
| ＪＭＳ | 11,900 | 490.00 | 5,831,000 | |
| クボテック | 3,100 | 200.00 | 620,000 | |
| 長野計器 | 9,400 | 1,096.00 | 10,302,400 | |
| ブイ・テクノロジー | 6,200 | 2,667.00 | 16,535,400 | |
| スター精密 | 24,500 | 1,610.00 | 39,445,000 | |
| 東京計器 | 9,900 | 1,249.00 | 12,365,100 | |
| 愛知時計電機 | 5,000 | 1,354.00 | 6,770,000 | |
| インターアクション | 7,700 | 1,600.00 | 12,320,000 | |
| オーバル | 11,300 | 461.00 | 5,209,300 | |
| 東京精密 | 28,300 | 4,435.00 | 125,510,500 | |
| マニー | 56,700 | 1,962.00 | 111,245,400 | |
| ニコン | 200,900 | 1,216.00 | 244,294,400 | |
| トプコン | 67,900 | 1,562.00 | 106,059,800 | |
| オリンパス | 807,700 | 2,406.00 | 1,943,326,200 | |
| 理研計器 | 7,900 | 4,395.00 | 34,720,500 | |
| ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 22,100 | 9,040.00 | 199,784,000 | |
| キヤノン電子 | 14,300 | 1,526.00 | 21,821,800 | |
| タムロン | 9,700 | 3,025.00 | 29,342,500 | |
| ＨＯＹＡ | 276,000 | 13,335.00 | 3,680,460,000 | |
| シード | 6,500 | 501.00 | 3,256,500 | |
| ノーリツ鋼機 | 12,200 | 2,397.00 | 29,243,400 | |
| Ａ＆Ｄホロンホールディングス | 18,700 | 1,025.00 | 19,167,500 | |
| 朝日インテック | 170,600 | 2,220.00 | 378,732,000 | |
| キヤノン | 708,800 | 2,910.00 | 2,062,608,000 | |
| リコー | 323,900 | 990.00 | 320,661,000 | |
| シチズン時計 | 141,900 | 580.00 | 82,302,000 | |
| リズム | 4,100 | 1,621.00 | 6,646,100 | |
| 大研医器 | 9,800 | 449.00 | 4,400,200 | |
| メニコン | 44,300 | 2,780.00 | 123,154,000 | |
| シンシア | 1,200 | 501.00 | 601,200 | |
| ＫＹＯＲＩＴＳＵ | 19,200 | 120.00 | 2,304,000 | |
| 中本パックス | 4,000 | 1,595.00 | 6,380,000 | |
| スノーピーク | 22,100 | 2,293.00 | 50,675,300 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 29,800 | 2,515.00 | 74,947,000 | |
| トランザクション | 9,900 | 1,192.00 | 11,800,800 | |
| 粧美堂 | 3,700 | 351.00 | 1,298,700 | |
| ニホンフラッシュ | 12,100 | 880.00 | 10,648,000 | |
| 前田工繊 | 14,000 | 3,130.00 | 43,820,000 | |
| 永大産業 | 14,000 | 220.00 | 3,080,000 | |
| アートネイチャー | 13,200 | 740.00 | 9,768,000 | |
| バンダイナムコホールディングス | 117,800 | 8,233.00 | 969,847,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| アイフィスジャパン | 3,800 | 592.00 | 2,249,600 | |
| ＳＨＯＥＩ | 13,500 | 5,090.00 | 68,715,000 | |
| フランスベッドホールディングス | 16,000 | 954.00 | 15,264,000 | |
| マーベラス | 21,000 | 684.00 | 14,364,000 | |
| パイロットコーポレーション | 20,100 | 4,715.00 | 94,771,500 | |
| 萩原工業 | 8,400 | 1,158.00 | 9,727,200 | |
| エイベックス | 22,000 | 1,628.00 | 35,816,000 | |
| フジシールインターナショナル | 26,000 | 1,652.00 | 42,952,000 | |
| タカラトミー | 59,600 | 1,225.00 | 73,010,000 | |
| 広済堂ホールディングス | 8,500 | 1,956.00 | 16,626,000 | |
| エステールホールディングス | 3,100 | 624.00 | 1,934,400 | |
| レック | 18,400 | 959.00 | 17,645,600 | |
| タカノ | 4,800 | 668.00 | 3,206,400 | |
| 三光合成 | 17,700 | 480.00 | 8,496,000 | |
| プロネクサス | 10,800 | 953.00 | 10,292,400 | |
| ホクシン | 9,900 | 149.00 | 1,475,100 | |
| ウッドワン | 4,400 | 911.00 | 4,008,400 | |
| 大建工業 | 7,800 | 2,093.00 | 16,325,400 | |
| きもと | 19,100 | 225.00 | 4,297,500 | |
| 凸版印刷 | 169,000 | 1,921.00 | 324,649,000 | |
| 大日本印刷 | 153,200 | 2,606.00 | 399,239,200 | |
| 共同印刷 | 3,700 | 2,745.00 | 10,156,500 | |
| ＮＩＳＳＨＡ | 24,500 | 1,854.00 | 45,423,000 | |
| 光村印刷 | 600 | 1,158.00 | 694,800 | |
| 藤森工業 | 10,300 | 3,075.00 | 31,672,500 | |
| ヴィア・ホールディングス | 18,400 | 99.00 | 1,821,600 | |
| ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ | 8,800 | 2,021.00 | 17,784,800 | |
| 前澤化成工業 | 8,200 | 1,339.00 | 10,979,800 | |
| 未来工業 | 4,800 | 1,450.00 | 6,960,000 | |
| アシックス | 119,300 | 2,911.00 | 347,282,300 | |
| ツツミ | 2,700 | 1,868.00 | 5,043,600 | |
| ウェーブロックホールディングス | 4,000 | 612.00 | 2,448,000 | |
| ＪＳＰ | 9,100 | 1,508.00 | 13,722,800 | |
| ニチハ | 16,200 | 2,646.00 | 42,865,200 | |
| ローランド | 9,500 | 3,530.00 | 33,535,000 | |
| エフピコ | 24,400 | 3,545.00 | 86,498,000 | |
| 小松ウオール工業 | 4,800 | 1,834.00 | 8,803,200 | |
| ヤマハ | 81,400 | 4,830.00 | 393,162,000 | |
| 河合楽器製作所 | 3,600 | 2,541.00 | 9,147,600 | |
| クリナップ | 14,500 | 641.00 | 9,294,500 | |
| ピジョン | 82,300 | 2,044.00 | 168,221,200 | |
| 天馬 | 11,100 | 2,068.00 | 22,954,800 | |
| 兼松サステック | 600 | 1,561.00 | 936,600 | |
| キングジム | 11,500 | 880.00 | 10,120,000 | |
| 象印マホービン | 38,600 | 1,448.00 | 55,892,800 | |
| リンテック | 25,800 | 2,137.00 | 55,134,600 | |
| 信越ポリマー | 24,000 | 1,148.00 | 27,552,000 | |
| 東リ | 29,400 | 230.00 | 6,762,000 | |
| イトーキ | 26,400 | 627.00 | 16,552,800 | |
| 任天堂 | 815,700 | 5,547.00 | 4,524,687,900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三菱鉛筆 | 18,300 | 1,377.00 | 25,199,100 | |
| 松風 | 5,800 | 2,233.00 | 12,951,400 | |
| タカラスタンダード | 25,000 | 1,346.00 | 33,650,000 | |
| コクヨ | 62,200 | 1,783.00 | 110,902,600 | |
| ナカバヤシ | 14,000 | 474.00 | 6,636,000 | |
| ニフコ | 46,700 | 3,080.00 | 143,836,000 | |
| 立川ブラインド工業 | 6,000 | 1,152.00 | 6,912,000 | |
| グローブライド | 10,500 | 2,570.00 | 26,985,000 | |
| オカムラ | 38,900 | 1,405.00 | 54,654,500 | |
| バルカー | 10,900 | 2,656.00 | 28,950,400 | |
| ＭＵＴＯＨホールディングス | 1,000 | 1,611.00 | 1,611,000 | |
| 伊藤忠商事 | 842,200 | 4,055.00 | 3,415,121,000 | |
| 丸紅 | 1,079,200 | 1,507.00 | 1,626,354,400 | |
| スクロール | 20,100 | 711.00 | 14,291,100 | |
| 高島 | 2,000 | 2,920.00 | 5,840,000 | |
| ヨンドシーホールディングス | 11,700 | 1,711.00 | 20,018,700 | |
| 三陽商会 | 4,900 | 1,365.00 | 6,688,500 | |
| 長瀬産業 | 64,200 | 1,979.00 | 127,051,800 | |
| ナイガイ | 4,100 | 261.00 | 1,070,100 | |
| 蝶理 | 7,300 | 2,170.00 | 15,841,000 | |
| 豊田通商 | 119,700 | 4,930.00 | 590,121,000 | |
| オンワードホールディングス | 83,800 | 312.00 | 26,145,600 | |
| 三共生興 | 19,600 | 478.00 | 9,368,800 | |
| 兼松 | 53,100 | 1,469.00 | 78,003,900 | |
| 美津濃 | 12,700 | 2,709.00 | 34,404,300 | |
| ツカモトコーポレーション | 1,800 | 1,350.00 | 2,430,000 | |
| ルックホールディングス | 3,800 | 2,581.00 | 9,807,800 | |
| 三井物産 | 1,000,000 | 3,808.00 | 3,808,000,000 | |
| 日本紙パルプ商事 | 7,200 | 4,665.00 | 33,588,000 | |
| 東京エレクトロン | 91,100 | 42,990.00 | 3,916,389,000 | |
| カメイ | 14,500 | 1,195.00 | 17,327,500 | |
| 東都水産 | 600 | 5,150.00 | 3,090,000 | |
| ＯＵＧホールディングス | 1,900 | 2,382.00 | 4,525,800 | |
| スターゼン | 10,500 | 2,069.00 | 21,724,500 | |
| セイコーグループ | 19,900 | 3,010.00 | 59,899,000 | |
| 山善 | 36,800 | 1,016.00 | 37,388,800 | |
| 椿本興業 | 2,000 | 3,815.00 | 7,630,000 | |
| 住友商事 | 846,400 | 2,174.00 | 1,840,073,600 | |
| ＢＩＰＲＯＧＹ | 47,700 | 3,250.00 | 155,025,000 | |
| 内田洋行 | 5,900 | 4,550.00 | 26,845,000 | |
| 三菱商事 | 854,700 | 4,289.00 | 3,665,808,300 | |
| 第一実業 | 4,800 | 4,355.00 | 20,904,000 | |
| キヤノンマーケティングジャパン | 31,600 | 2,893.00 | 91,418,800 | |
| 西華産業 | 5,300 | 1,570.00 | 8,321,000 | |
| 佐藤商事 | 9,500 | 1,220.00 | 11,590,000 | |
| 菱洋エレクトロ | 11,600 | 2,402.00 | 27,863,200 | |
| 東京産業 | 12,500 | 736.00 | 9,200,000 | |
| ユアサ商事 | 12,200 | 3,520.00 | 42,944,000 | |
| 神鋼商事 | 3,500 | 5,140.00 | 17,990,000 | |
| トルク | 7,400 | 203.00 | 1,502,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 阪和興業 | 24,500 | 3,705.00 | 90,772,500 | |
| 正栄食品工業 | 9,100 | 3,885.00 | 35,353,500 | |
| カナデン | 11,100 | 1,106.00 | 12,276,600 | |
| 菱電商事 | 11,100 | 1,695.00 | 18,814,500 | |
| ニプロ | 107,700 | 1,021.00 | 109,961,700 | |
| 岩谷産業 | 31,000 | 5,600.00 | 173,600,000 | |
| ナイス | 3,800 | 1,380.00 | 5,244,000 | |
| ニチモウ | 1,500 | 2,902.00 | 4,353,000 | |
| 極東貿易 | 8,000 | 1,387.00 | 11,096,000 | |
| アステナホールディングス | 23,600 | 426.00 | 10,053,600 | |
| 兼松エレクトロニクス | 8,200 | 4,370.00 | 35,834,000 | |
| 三愛オブリ | 37,600 | 1,246.00 | 46,849,600 | |
| 稲畑産業 | 27,900 | 2,398.00 | 66,904,200 | |
| ＧＳＩクレオス | 7,900 | 1,489.00 | 11,763,100 | |
| 明和産業 | 18,100 | 661.00 | 11,964,100 | |
| クワザワホールディングス | 4,600 | 425.00 | 1,955,000 | |
| キムラタン | 75,800 | 21.00 | 1,591,800 | |
| ゴールドウイン | 22,900 | 9,250.00 | 211,825,000 | |
| ユニ・チャーム | 269,900 | 4,802.00 | 1,296,059,800 | |
| デサント | 22,300 | 3,225.00 | 71,917,500 | |
| キング | 5,600 | 494.00 | 2,766,400 | |
| ワキタ | 25,100 | 1,158.00 | 29,065,800 | |
| ヤマトインターナショナル | 10,300 | 240.00 | 2,472,000 | |
| 東邦ホールディングス | 33,900 | 2,061.00 | 69,867,900 | |
| サンゲツ | 34,300 | 2,134.00 | 73,196,200 | |
| ミツウロコグループホールディングス | 17,600 | 1,059.00 | 18,638,400 | |
| シナネンホールディングス | 4,500 | 3,840.00 | 17,280,000 | |
| 伊藤忠エネクス | 33,900 | 1,048.00 | 35,527,200 | |
| サンリオ | 38,700 | 4,565.00 | 176,665,500 | |
| サンワ　テクノス | 7,000 | 1,561.00 | 10,927,000 | |
| リョーサン | 14,400 | 2,873.00 | 41,371,200 | |
| 新光商事 | 18,300 | 1,184.00 | 21,667,200 | |
| トーホー | 5,800 | 1,645.00 | 9,541,000 | |
| 三信電気 | 5,400 | 2,327.00 | 12,565,800 | |
| 東陽テクニカ | 15,000 | 1,354.00 | 20,310,000 | |
| モスフードサービス | 20,000 | 3,050.00 | 61,000,000 | |
| 加賀電子 | 11,100 | 4,140.00 | 45,954,000 | |
| 三益半導体工業 | 11,900 | 2,454.00 | 29,202,600 | |
| 都築電気 | 6,700 | 1,303.00 | 8,730,100 | |
| ソーダニッカ | 10,000 | 700.00 | 7,000,000 | |
| 立花エレテック | 10,000 | 1,743.00 | 17,430,000 | |
| 木曽路 | 20,600 | 2,081.00 | 42,868,600 | |
| ＳＲＳホールディングス | 22,600 | 882.00 | 19,933,200 | |
| 千趣会 | 25,200 | 385.00 | 9,702,000 | |
| タカキュー | 9,700 | 74.00 | 717,800 | |
| リテールパートナーズ | 20,100 | 1,272.00 | 25,567,200 | |
| ケーヨー | 22,100 | 888.00 | 19,624,800 | |
| 上新電機 | 12,100 | 1,931.00 | 23,365,100 | |
| 日本瓦斯 | 73,100 | 1,992.00 | 145,615,200 | |
| ロイヤルホールディングス | 26,200 | 2,400.00 | 62,880,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 東天紅 | 600 | 754.00 | 452,400 | |
| いなげや | 13,200 | 1,237.00 | 16,328,400 | |
| チヨダ | 13,000 | 770.00 | 10,010,000 | |
| ライフコーポレーション | 11,900 | 2,559.00 | 30,452,100 | |
| リンガーハット | 17,700 | 2,247.00 | 39,771,900 | |
| ＭｒＭａｘＨＤ | 19,100 | 656.00 | 12,529,600 | |
| テンアライド | 14,500 | 255.00 | 3,697,500 | |
| ＡＯＫＩホールディングス | 25,300 | 674.00 | 17,052,200 | |
| オークワ | 21,900 | 882.00 | 19,315,800 | |
| コメリ | 21,000 | 2,662.00 | 55,902,000 | |
| 青山商事 | 29,200 | 867.00 | 25,316,400 | |
| しまむら | 16,000 | 12,490.00 | 199,840,000 | |
| はせがわ | 6,400 | 328.00 | 2,099,200 | |
| 高島屋 | 103,000 | 1,767.00 | 182,001,000 | |
| 松屋 | 23,100 | 1,027.00 | 23,723,700 | |
| エイチ・ツー・オー　リテイリング | 66,400 | 1,221.00 | 81,074,400 | |
| 近鉄百貨店 | 4,500 | 2,523.00 | 11,353,500 | |
| 丸井グループ | 100,800 | 2,124.00 | 214,099,200 | |
| クレディセゾン | 80,600 | 1,674.00 | 134,924,400 | |
| アクシアル　リテイリング | 9,300 | 3,315.00 | 30,829,500 | |
| 井筒屋 | 6,500 | 382.00 | 2,483,000 | |
| イオン | 463,300 | 2,691.50 | 1,246,971,950 | |
| イズミ | 20,800 | 2,864.00 | 59,571,200 | |
| フォーバル | 5,300 | 986.00 | 5,225,800 | |
| 平和堂 | 22,800 | 2,070.00 | 47,196,000 | |
| フジ | 20,900 | 1,818.00 | 37,996,200 | |
| ヤオコー | 15,500 | 6,720.00 | 104,160,000 | |
| ゼビオホールディングス | 18,400 | 907.00 | 16,688,800 | |
| ケーズホールディングス | 108,600 | 1,115.00 | 121,089,000 | |
| ＰＡＬＴＡＣ | 21,500 | 4,610.00 | 99,115,000 | |
| 三谷産業 | 24,100 | 305.00 | 7,350,500 | |
| Ｏｌｙｍｐｉｃグループ | 5,100 | 512.00 | 2,611,200 | |
| 日産東京販売ホールディングス | 17,600 | 289.00 | 5,086,400 | |
| ＳＢＩ新生銀行 | 37,500 | 2,257.00 | 84,637,500 | |
| あおぞら銀行 | 79,900 | 2,604.00 | 208,059,600 | |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 8,079,900 | 908.00 | 7,336,549,200 | |
| りそなホールディングス | 1,624,200 | 717.90 | 1,166,013,180 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 231,200 | 4,599.00 | 1,063,288,800 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 929,800 | 5,345.00 | 4,969,781,000 | |
| 千葉銀行 | 354,600 | 945.00 | 335,097,000 | |
| 群馬銀行 | 246,900 | 492.00 | 121,474,800 | |
| 武蔵野銀行 | 16,300 | 2,067.00 | 33,692,100 | |
| 千葉興業銀行 | 29,600 | 450.00 | 13,320,000 | |
| 筑波銀行 | 55,700 | 230.00 | 12,811,000 | |
| 七十七銀行 | 40,700 | 2,109.00 | 85,836,300 | |
| 秋田銀行 | 8,400 | 1,844.00 | 15,489,600 | |
| 山形銀行 | 14,100 | 1,150.00 | 16,215,000 | |
| 岩手銀行 | 8,500 | 1,947.00 | 16,549,500 | |
| 東邦銀行 | 100,800 | 228.00 | 22,982,400 | |
| 東北銀行 | 6,200 | 1,005.00 | 6,231,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ふくおかフィナンシャルグループ | 101,500 | 2,915.00 | 295,872,500 | |
| スルガ銀行 | 112,000 | 416.00 | 46,592,000 | |
| 八十二銀行 | 260,900 | 548.00 | 142,973,200 | |
| 山梨中央銀行 | 13,000 | 1,099.00 | 14,287,000 | |
| 大垣共立銀行 | 24,200 | 1,847.00 | 44,697,400 | |
| 福井銀行 | 11,300 | 1,489.00 | 16,825,700 | |
| 清水銀行 | 5,000 | 1,524.00 | 7,620,000 | |
| 富山銀行 | 1,800 | 1,737.00 | 3,126,600 | |
| 滋賀銀行 | 21,100 | 2,620.00 | 55,282,000 | |
| 南都銀行 | 19,000 | 2,530.00 | 48,070,000 | |
| 百五銀行 | 119,800 | 373.00 | 44,685,400 | |
| 京都銀行 | 40,200 | 5,790.00 | 232,758,000 | |
| 紀陽銀行 | 45,500 | 1,527.00 | 69,478,500 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 80,800 | 956.00 | 77,244,800 | |
| 山陰合同銀行 | 79,500 | 760.00 | 60,420,000 | |
| 鳥取銀行 | 4,200 | 1,137.00 | 4,775,400 | |
| 百十四銀行 | 11,500 | 1,892.00 | 21,758,000 | |
| 四国銀行 | 20,100 | 952.00 | 19,135,200 | |
| 阿波銀行 | 18,700 | 2,057.00 | 38,465,900 | |
| 大分銀行 | 7,600 | 1,996.00 | 15,169,600 | |
| 宮崎銀行 | 8,100 | 2,459.00 | 19,917,900 | |
| 佐賀銀行 | 7,400 | 1,730.00 | 12,802,000 | |
| 琉球銀行 | 29,100 | 877.00 | 25,520,700 | |
| セブン銀行 | 455,800 | 260.00 | 118,508,000 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 1,840,200 | 1,904.50 | 3,504,660,900 | |
| 高知銀行 | 4,400 | 699.00 | 3,075,600 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 140,500 | 858.00 | 120,549,000 | |
| 芙蓉総合リース | 11,600 | 8,480.00 | 98,368,000 | |
| みずほリース | 18,800 | 3,310.00 | 62,228,000 | |
| 東京センチュリー | 23,700 | 4,430.00 | 104,991,000 | |
| ＳＢＩホールディングス | 184,100 | 2,599.00 | 478,475,900 | |
| 日本証券金融 | 50,900 | 1,127.00 | 57,364,300 | |
| アイフル | 210,700 | 382.00 | 80,487,400 | |
| 日本アジア投資 | 10,100 | 231.00 | 2,333,100 | |
| 長野銀行 | 4,000 | 1,380.00 | 5,520,000 | |
| 名古屋銀行 | 8,200 | 3,330.00 | 27,306,000 | |
| 北洋銀行 | 192,700 | 257.00 | 49,523,900 | |
| 大光銀行 | 3,900 | 1,204.00 | 4,695,600 | |
| 愛媛銀行 | 17,200 | 887.00 | 15,256,400 | |
| トマト銀行 | 4,300 | 1,019.00 | 4,381,700 | |
| 京葉銀行 | 59,000 | 586.00 | 34,574,000 | |
| 栃木銀行 | 58,300 | 301.00 | 17,548,300 | |
| 北日本銀行 | 4,500 | 2,064.00 | 9,288,000 | |
| 東和銀行 | 23,200 | 574.00 | 13,316,800 | |
| 福島銀行 | 13,200 | 257.00 | 3,392,400 | |
| 大東銀行 | 4,900 | 689.00 | 3,376,100 | |
| リコーリース | 12,000 | 3,780.00 | 45,360,000 | |
| イオンフィナンシャルサービス | 73,000 | 1,415.00 | 103,295,000 | |
| アコム | 227,000 | 307.00 | 69,689,000 | |
| ジャックス | 13,400 | 3,980.00 | 53,332,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| オリエントコーポレーション | 33,200 | 1,139.00 | 37,814,800 | |
| オリックス | 851,100 | 2,133.50 | 1,815,821,850 | |
| 三菱ＨＣキャピタル | 496,000 | 643.00 | 318,928,000 | |
| ジャフコ　グループ | 42,400 | 2,247.00 | 95,272,800 | |
| 九州リースサービス | 5,900 | 742.00 | 4,377,800 | |
| トモニホールディングス | 102,800 | 376.00 | 38,652,800 | |
| 大和証券グループ本社 | 909,600 | 597.00 | 543,031,200 | |
| 野村ホールディングス | 2,343,400 | 495.70 | 1,161,623,380 | |
| 岡三証券グループ | 111,700 | 401.00 | 44,791,700 | |
| 丸三証券 | 42,300 | 412.00 | 17,427,600 | |
| 東洋証券 | 42,200 | 289.00 | 12,195,800 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 138,400 | 366.00 | 50,654,400 | |
| 光世証券 | 2,600 | 363.00 | 943,800 | |
| 水戸証券 | 34,300 | 223.00 | 7,648,900 | |
| いちよし証券 | 23,400 | 613.00 | 14,344,200 | |
| 松井証券 | 75,300 | 775.00 | 58,357,500 | |
| ＳＯＭＰＯホールディングス | 218,400 | 5,703.00 | 1,245,535,200 | |
| 日本取引所グループ | 357,600 | 1,847.00 | 660,487,200 | |
| マネックスグループ | 142,000 | 475.00 | 67,450,000 | |
| 極東証券 | 15,900 | 594.00 | 9,444,600 | |
| 岩井コスモホールディングス | 14,500 | 1,308.00 | 18,966,000 | |
| アイザワ証券グループ | 18,300 | 709.00 | 12,974,700 | |
| フィデアホールディングス | 13,000 | 1,401.00 | 18,213,000 | |
| 池田泉州ホールディングス | 162,500 | 248.00 | 40,300,000 | |
| アニコム　ホールディングス | 43,100 | 599.00 | 25,816,900 | |
| ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス | 259,000 | 4,146.00 | 1,073,814,000 | |
| マネーパートナーズグループ | 13,100 | 276.00 | 3,615,600 | |
| スパークス・グループ | 14,100 | 1,705.00 | 24,040,500 | |
| 小林洋行 | 2,700 | 221.00 | 596,700 | |
| 第一生命ホールディングス | 647,800 | 2,872.00 | 1,860,481,600 | |
| 東京海上ホールディングス | 1,281,200 | 2,745.00 | 3,516,894,000 | |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 5,900 | 371.00 | 2,188,900 | |
| イー・ギャランティ | 20,500 | 2,398.00 | 49,159,000 | |
| アサックス | 5,800 | 596.00 | 3,456,800 | |
| ＮＥＣキャピタルソリューション | 6,200 | 2,145.00 | 13,299,000 | |
| Ｔ＆Ｄホールディングス | 341,500 | 1,912.00 | 652,948,000 | |
| アドバンスクリエイト | 7,400 | 1,090.00 | 8,066,000 | |
| 三井不動産 | 553,000 | 2,362.00 | 1,306,186,000 | |
| 三菱地所 | 767,800 | 1,655.50 | 1,271,092,900 | |
| 平和不動産 | 20,600 | 3,560.00 | 73,336,000 | |
| 東京建物 | 121,200 | 1,578.00 | 191,253,600 | |
| 京阪神ビルディング | 16,400 | 1,300.00 | 21,320,000 | |
| 住友不動産 | 230,000 | 3,030.00 | 696,900,000 | |
| 太平洋興発 | 4,800 | 820.00 | 3,936,000 | |
| テーオーシー | 23,000 | 643.00 | 14,789,000 | |
| 東京楽天地 | 1,800 | 4,070.00 | 7,326,000 | |
| レオパレス２１ | 143,300 | 310.00 | 44,423,000 | |
| スターツコーポレーション | 18,200 | 2,501.00 | 45,518,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| フジ住宅 | 17,800 | 648.00 | 11,534,400 | |
| 空港施設 | 15,500 | 515.00 | 7,982,500 | |
| 明和地所 | 6,400 | 716.00 | 4,582,400 | |
| ゴールドクレスト | 12,000 | 1,640.00 | 19,680,000 | |
| リログループ | 73,900 | 2,102.00 | 155,337,800 | |
| エスリード | 5,900 | 1,846.00 | 10,891,400 | |
| 日神グループホールディングス | 20,300 | 433.00 | 8,789,900 | |
| 日本エスコン | 28,600 | 756.00 | 21,621,600 | |
| ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス | 64,200 | 372.00 | 23,882,400 | |
| ＡＶＡＮＴＩＡ | 6,300 | 787.00 | 4,958,100 | |
| イオンモール | 66,000 | 1,685.00 | 111,210,000 | |
| 毎日コムネット | 4,800 | 691.00 | 3,316,800 | |
| ファースト住建 | 5,100 | 1,026.00 | 5,232,600 | |
| ランド | 766,300 | 9.00 | 6,896,700 | |
| カチタス | 34,200 | 3,000.00 | 102,600,000 | |
| 東祥 | 9,300 | 1,115.00 | 10,369,500 | |
| トーセイ | 21,100 | 1,358.00 | 28,653,800 | |
| 穴吹興産 | 3,000 | 1,998.00 | 5,994,000 | |
| サンフロンティア不動産 | 21,100 | 1,082.00 | 22,830,200 | |
| ＦＪネクストホールディングス | 13,300 | 963.00 | 12,807,900 | |
| インテリックス | 3,100 | 507.00 | 1,571,700 | |
| ランドビジネス | 4,800 | 223.00 | 1,070,400 | |
| サンネクスタグループ | 4,300 | 948.00 | 4,076,400 | |
| グランディハウス | 10,800 | 563.00 | 6,080,400 | |
| 東武鉄道 | 141,800 | 2,955.00 | 419,019,000 | |
| 相鉄ホールディングス | 42,600 | 2,176.00 | 92,697,600 | |
| 東急 | 362,200 | 1,594.00 | 577,346,800 | |
| 京浜急行電鉄 | 146,500 | 1,337.00 | 195,870,500 | |
| 小田急電鉄 | 195,700 | 1,615.00 | 316,055,500 | |
| 京王電鉄 | 68,400 | 4,620.00 | 316,008,000 | |
| 京成電鉄 | 83,300 | 3,550.00 | 295,715,000 | |
| 富士急行 | 15,900 | 4,485.00 | 71,311,500 | |
| 東日本旅客鉄道 | 219,100 | 7,229.00 | 1,583,873,900 | |
| 西日本旅客鉄道 | 165,000 | 5,440.00 | 897,600,000 | |
| 東海旅客鉄道 | 99,500 | 15,640.00 | 1,556,180,000 | |
| 西武ホールディングス | 156,100 | 1,405.00 | 219,320,500 | |
| 鴻池運輸 | 22,000 | 1,519.00 | 33,418,000 | |
| 西日本鉄道 | 34,500 | 2,383.00 | 82,213,500 | |
| ハマキョウレックス | 10,100 | 3,010.00 | 30,401,000 | |
| サカイ引越センター | 6,000 | 4,210.00 | 25,260,000 | |
| 近鉄グループホールディングス | 128,900 | 4,175.00 | 538,157,500 | |
| 阪急阪神ホールディングス | 172,000 | 3,755.00 | 645,860,000 | |
| 南海電気鉄道 | 61,600 | 2,740.00 | 168,784,000 | |
| 京阪ホールディングス | 53,200 | 3,445.00 | 183,274,000 | |
| 神戸電鉄 | 3,600 | 3,135.00 | 11,286,000 | |
| 名古屋鉄道 | 142,400 | 2,124.00 | 302,457,600 | |
| 山陽電気鉄道 | 9,700 | 2,108.00 | 20,447,600 | |
| アルプス物流 | 10,400 | 1,122.00 | 11,668,800 | |
| トランコム | 3,800 | 7,310.00 | 27,778,000 | |
| ヤマトホールディングス | 165,100 | 2,062.00 | 340,436,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 山九 | 32,800 | 4,695.00 | 153,996,000 | |
| 日新 | 9,800 | 2,097.00 | 20,550,600 | |
| 丸運 | 6,300 | 218.00 | 1,373,400 | |
| 丸全昭和運輸 | 7,900 | 2,943.00 | 23,249,700 | |
| センコーグループホールディングス | 68,400 | 942.00 | 64,432,800 | |
| トナミホールディングス | 2,400 | 3,570.00 | 8,568,000 | |
| ニッコンホールディングス | 41,300 | 2,305.00 | 95,196,500 | |
| 日本石油輸送 | 800 | 2,152.00 | 1,721,600 | |
| 福山通運 | 9,700 | 3,010.00 | 29,197,000 | |
| セイノーホールディングス | 80,300 | 1,150.00 | 92,345,000 | |
| エスライン | 3,900 | 791.00 | 3,084,900 | |
| 神奈川中央交通 | 3,800 | 3,170.00 | 12,046,000 | |
| ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス | 31,100 | 1,588.00 | 49,386,800 | |
| Ｃ＆Ｆロジホールディングス | 12,300 | 1,146.00 | 14,095,800 | |
| 日本郵船 | 345,100 | 3,073.00 | 1,060,492,300 | |
| 商船三井 | 227,300 | 3,240.00 | 736,452,000 | |
| 川崎汽船 | 109,900 | 2,774.00 | 304,862,600 | |
| ＮＳユナイテッド海運 | 6,900 | 3,775.00 | 26,047,500 | |
| 明治海運 | 12,400 | 685.00 | 8,494,000 | |
| 飯野海運 | 47,300 | 885.00 | 41,860,500 | |
| 共栄タンカー | 2,200 | 931.00 | 2,048,200 | |
| 九州旅客鉄道 | 91,100 | 2,813.00 | 256,264,300 | |
| ＳＧホールディングス | 247,500 | 1,838.00 | 454,905,000 | |
| ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス | 48,100 | 7,240.00 | 348,244,000 | |
| 日本航空 | 316,900 | 2,592.00 | 821,404,800 | |
| ＡＮＡホールディングス | 351,000 | 2,730.50 | 958,405,500 | |
| ビーウィズ | 4,100 | 1,077.00 | 4,415,700 | |
| パスコ | 2,400 | 1,350.00 | 3,240,000 | |
| ＴＲＥホールディングス | 28,000 | 1,431.00 | 40,068,000 | |
| 人・夢・技術グループ | 5,800 | 1,589.00 | 9,216,200 | |
| 西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス | 3,600 | 3,550.00 | 12,780,000 | |
| シルバーライフ | 3,100 | 1,823.00 | 5,651,300 | |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス | 1,200 | 1,549.00 | 1,858,800 | |
| Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ | 6,600 | 3,645.00 | 24,057,000 | |
| コーア商事ホールディングス | 9,600 | 616.00 | 5,913,600 | |
| ＫＰＰグループホールディングス | 31,700 | 827.00 | 26,215,900 | |
| ナルミヤ・インターナショナル | 2,000 | 897.00 | 1,794,000 | |
| ブックオフグループホールディングス | 8,000 | 1,323.00 | 10,584,000 | |
| ギフトホールディングス | 2,700 | 4,250.00 | 11,475,000 | |
| 三菱倉庫 | 27,700 | 2,921.00 | 80,911,700 | |
| 三井倉庫ホールディングス | 12,000 | 3,565.00 | 42,780,000 | |
| 住友倉庫 | 35,400 | 1,900.00 | 67,260,000 | |
| 澁澤倉庫 | 5,100 | 2,044.00 | 10,424,400 | |
| ヤマタネ | 6,000 | 1,677.00 | 10,062,000 | |
| 東陽倉庫 | 17,400 | 252.00 | 4,384,800 | |
| 乾汽船 | 16,400 | 1,993.00 | 32,685,200 | |
| 日本トランスシティ | 25,900 | 491.00 | 12,716,900 | |
| ケイヒン | 2,200 | 1,458.00 | 3,207,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 中央倉庫 | 6,200 | 936.00 | 5,803,200 | |
| 川西倉庫 | 2,100 | 995.00 | 2,089,500 | |
| 安田倉庫 | 8,900 | 927.00 | 8,250,300 | |
| ファイズホールディングス | 2,200 | 852.00 | 1,874,400 | |
| 東洋埠頭 | 3,800 | 1,254.00 | 4,765,200 | |
| 上組 | 61,800 | 2,606.00 | 161,050,800 | |
| サンリツ | 3,000 | 723.00 | 2,169,000 | |
| キムラユニティー | 6,100 | 776.00 | 4,733,600 | |
| キユーソー流通システム | 7,700 | 915.00 | 7,045,500 | |
| 東海運 | 7,700 | 282.00 | 2,171,400 | |
| エーアイテイー | 8,000 | 1,389.00 | 11,112,000 | |
| 内外トランスライン | 4,700 | 2,095.00 | 9,846,500 | |
| ショーエイコーポレーション | 3,900 | 562.00 | 2,191,800 | |
| 日本コンセプト | 4,100 | 1,508.00 | 6,182,800 | |
| ＴＢＳホールディングス | 66,200 | 1,494.00 | 98,902,800 | |
| 日本テレビホールディングス | 114,500 | 1,021.00 | 116,904,500 | |
| 朝日放送グループホールディングス | 12,100 | 633.00 | 7,659,300 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 31,300 | 1,307.00 | 40,909,100 | |
| スカパーＪＳＡＴホールディングス | 114,900 | 482.00 | 55,381,800 | |
| テレビ東京ホールディングス | 9,300 | 1,850.00 | 17,205,000 | |
| 日本ＢＳ放送 | 4,700 | 902.00 | 4,239,400 | |
| ビジョン | 17,100 | 1,392.00 | 23,803,200 | |
| スマートバリュー | 3,200 | 419.00 | 1,340,800 | |
| ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 11,500 | 2,206.00 | 25,369,000 | |
| ワイヤレスゲート | 5,600 | 235.00 | 1,316,000 | |
| コネクシオ | 8,500 | 1,909.00 | 16,226,500 | |
| 日本通信 | 119,500 | 224.00 | 26,768,000 | |
| クロップス | 2,000 | 944.00 | 1,888,000 | |
| 日本電信電話 | 1,660,300 | 3,727.00 | 6,187,938,100 | |
| ＫＤＤＩ | 1,001,300 | 3,900.00 | 3,905,070,000 | |
| ソフトバンク | 2,081,500 | 1,463.00 | 3,045,234,500 | |
| 光通信 | 15,300 | 18,370.00 | 281,061,000 | |
| エムティーアイ | 11,800 | 510.00 | 6,018,000 | |
| GMOインターネットグループ | 48,100 | 2,444.00 | 117,556,400 | |
| ファイバーゲート | 6,900 | 882.00 | 6,085,800 | |
| アイドママーケティングコミュニケーション | 3,000 | 272.00 | 816,000 | |
| ＫＡＤＯＫＡＷＡ | 68,500 | 2,423.00 | 165,975,500 | |
| 学研ホールディングス | 21,600 | 924.00 | 19,958,400 | |
| ゼンリン | 22,100 | 802.00 | 17,724,200 | |
| 昭文社ホールディングス | 5,500 | 284.00 | 1,562,000 | |
| インプレスホールディングス | 11,300 | 212.00 | 2,395,600 | |
| 東京電力ホールディングス | 1,164,500 | 435.00 | 506,557,500 | |
| 中部電力 | 476,000 | 1,280.00 | 609,280,000 | |
| 関西電力 | 498,800 | 1,210.00 | 603,548,000 | |
| 中国電力 | 205,700 | 666.00 | 136,996,200 | |
| 北陸電力 | 121,800 | 518.00 | 63,092,400 | |
| 東北電力 | 315,800 | 662.00 | 209,059,600 | |
| 四国電力 | 110,300 | 723.00 | 79,746,900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 九州電力 | 297,800 | 714.00 | 212,629,200 | |
| 北海道電力 | 124,600 | 446.00 | 55,571,600 | |
| 沖縄電力 | 30,200 | 1,026.00 | 30,985,200 | |
| 電源開発 | 97,200 | 2,028.00 | 197,121,600 | |
| エフオン | 9,400 | 496.00 | 4,662,400 | |
| イーレックス | 22,900 | 2,136.00 | 48,914,400 | |
| レノバ | 34,400 | 2,240.00 | 77,056,000 | |
| 東京瓦斯 | 273,100 | 2,489.00 | 679,745,900 | |
| 大阪瓦斯 | 261,600 | 2,023.00 | 529,216,800 | |
| 東邦瓦斯 | 50,700 | 2,363.00 | 119,804,100 | |
| 北海道瓦斯 | 7,700 | 1,629.00 | 12,543,300 | |
| 広島ガス | 27,400 | 337.00 | 9,233,800 | |
| 西部ガスホールディングス | 12,000 | 1,674.00 | 20,088,000 | |
| 静岡ガス | 29,400 | 1,061.00 | 31,193,400 | |
| メタウォーター | 16,200 | 1,632.00 | 26,438,400 | |
| アイネット | 7,800 | 1,337.00 | 10,428,600 | |
| 松竹 | 7,400 | 11,380.00 | 84,212,000 | |
| 東宝 | 81,000 | 4,830.00 | 391,230,000 | |
| エイチ・アイ・エス | 34,700 | 2,070.00 | 71,829,000 | |
| 東映 | 3,700 | 17,180.00 | 63,566,000 | |
| ラックランド | 4,200 | 2,901.00 | 12,184,200 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 406,600 | 1,921.00 | 781,078,600 | |
| 共立メンテナンス | 22,700 | 5,880.00 | 133,476,000 | |
| イチネンホールディングス | 14,100 | 1,240.00 | 17,484,000 | |
| 建設技術研究所 | 6,700 | 3,135.00 | 21,004,500 | |
| スペース | 9,700 | 881.00 | 8,545,700 | |
| アインホールディングス | 18,700 | 5,870.00 | 109,769,000 | |
| 燦ホールディングス | 5,800 | 1,746.00 | 10,126,800 | |
| ピー・シー・エー | 7,800 | 1,356.00 | 10,576,800 | |
| スバル興業 | 600 | 9,360.00 | 5,616,000 | |
| 東京テアトル | 4,900 | 1,119.00 | 5,483,100 | |
| タナベコンサルティンググループ | 5,200 | 635.00 | 3,302,000 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 5,500 | 1,869.00 | 10,279,500 | |
| ナガワ | 3,600 | 7,610.00 | 27,396,000 | |
| 東京都競馬 | 11,200 | 3,810.00 | 42,672,000 | |
| 常磐興産 | 4,700 | 1,215.00 | 5,710,500 | |
| カナモト | 24,300 | 2,250.00 | 54,675,000 | |
| ＤＴＳ | 28,500 | 2,943.00 | 83,875,500 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 65,200 | 6,400.00 | 417,280,000 | |
| シーイーシー | 18,100 | 1,484.00 | 26,860,400 | |
| カプコン | 128,700 | 4,130.00 | 531,531,000 | |
| 西尾レントオール | 12,300 | 3,005.00 | 36,961,500 | |
| アイ・エス・ビー | 6,500 | 1,172.00 | 7,618,000 | |
| アゴーラ　ホスピタリティー　グループ | 75,400 | 22.00 | 1,658,800 | |
| 日本空港ビルデング | 45,000 | 6,500.00 | 292,500,000 | |
| トランス・コスモス | 16,500 | 3,230.00 | 53,295,000 | |
| 乃村工藝社 | 58,000 | 935.00 | 54,230,000 | |
| ジャステック | 7,900 | 1,147.00 | 9,061,300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＳＣＳＫ | 105,700 | 2,035.00 | 215,099,500 | |
| 藤田観光 | 5,800 | 3,075.00 | 17,835,000 | |
| ＫＮＴ－ＣＴホールディングス | 7,900 | 1,628.00 | 12,861,200 | |
| 日本管財 | 13,900 | 2,459.00 | 34,180,100 | |
| トーカイ | 11,700 | 1,882.00 | 22,019,400 | |
| 白洋舎 | 1,200 | 1,761.00 | 2,113,200 | |
| セコム | 135,200 | 7,405.00 | 1,001,156,000 | |
| ＮＳＷ | 5,000 | 2,030.00 | 10,150,000 | |
| セントラル警備保障 | 7,100 | 2,235.00 | 15,868,500 | |
| アイネス | 9,100 | 1,322.00 | 12,030,200 | |
| 丹青社 | 25,600 | 712.00 | 18,227,200 | |
| メイテック | 53,000 | 2,398.00 | 127,094,000 | |
| ＴＫＣ | 23,200 | 3,445.00 | 79,924,000 | |
| 富士ソフト | 14,500 | 7,520.00 | 109,040,000 | |
| 応用地質 | 12,800 | 2,157.00 | 27,609,600 | |
| 船井総研ホールディングス | 27,900 | 2,658.00 | 74,158,200 | |
| ＮＳＤ | 46,300 | 2,236.00 | 103,526,800 | |
| 進学会ホールディングス | 4,500 | 297.00 | 1,336,500 | |
| 丸紅建材リース | 800 | 1,718.00 | 1,374,400 | |
| オオバ | 8,200 | 651.00 | 5,338,200 | |
| コナミグループ | 55,400 | 5,990.00 | 331,846,000 | |
| いであ | 3,000 | 1,683.00 | 5,049,000 | |
| 学究社 | 5,200 | 1,830.00 | 9,516,000 | |
| ベネッセホールディングス | 49,500 | 1,933.00 | 95,683,500 | |
| イオンディライト | 14,500 | 2,953.00 | 42,818,500 | |
| ナック | 6,000 | 934.00 | 5,604,000 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 8,900 | 2,733.00 | 24,323,700 | |
| ダイセキ | 27,100 | 4,470.00 | 121,137,000 | |
| ステップ | 5,400 | 1,784.00 | 9,633,600 | |
| 日鉄物産 | 9,400 | 9,260.00 | 87,044,000 | |
| 泉州電業 | 6,700 | 3,110.00 | 20,837,000 | |
| 元気寿司 | 4,400 | 3,090.00 | 13,596,000 | |
| トラスコ中山 | 28,700 | 2,016.00 | 57,859,200 | |
| ヤマダホールディングス | 560,500 | 461.00 | 258,390,500 | |
| オートバックスセブン | 47,400 | 1,410.00 | 66,834,000 | |
| モリト | 9,800 | 723.00 | 7,085,400 | |
| アークランズ | 19,900 | 1,564.00 | 31,123,600 | |
| ニトリホールディングス | 55,200 | 16,465.00 | 908,868,000 | |
| グルメ杵屋 | 11,200 | 998.00 | 11,177,600 | |
| 愛眼 | 7,400 | 166.00 | 1,228,400 | |
| ケーユーホールディングス | 8,000 | 1,310.00 | 10,480,000 | |
| 吉野家ホールディングス | 53,400 | 2,280.00 | 121,752,000 | |
| 加藤産業 | 16,600 | 3,460.00 | 57,436,000 | |
| 北恵 | 3,100 | 672.00 | 2,083,200 | |
| イノテック | 8,500 | 1,305.00 | 11,092,500 | |
| イエローハット | 24,100 | 1,708.00 | 41,162,800 | |
| 松屋フーズホールディングス | 6,400 | 3,900.00 | 24,960,000 | |
| ＪＢＣＣホールディングス | 9,500 | 1,777.00 | 16,881,500 | |
| ＪＫホールディングス | 10,800 | 1,011.00 | 10,918,800 | |
| サガミホールディングス | 22,000 | 1,207.00 | 26,554,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日伝 | 8,000 | 1,695.00 | 13,560,000 | |
| 関西フードマーケット | 12,300 | 1,249.00 | 15,362,700 | |
| ミロク情報サービス | 11,700 | 1,453.00 | 17,000,100 | |
| 北沢産業 | 7,000 | 190.00 | 1,330,000 | |
| 杉本商事 | 6,000 | 1,949.00 | 11,694,000 | |
| 因幡電機産業 | 35,400 | 2,680.00 | 94,872,000 | |
| 王将フードサービス | 8,900 | 5,940.00 | 52,866,000 | |
| プレナス | 4,300 | 2,633.00 | 11,321,900 | |
| ミニストップ | 10,000 | 1,409.00 | 14,090,000 | |
| アークス | 25,000 | 2,091.00 | 52,275,000 | |
| バローホールディングス | 25,900 | 1,763.00 | 45,661,700 | |
| 東テク | 4,600 | 3,425.00 | 15,755,000 | |
| ミスミグループ本社 | 206,200 | 2,975.00 | 613,445,000 | |
| アルテック | 7,700 | 309.00 | 2,379,300 | |
| ベルク | 6,700 | 5,420.00 | 36,314,000 | |
| 大　庄 | 7,400 | 1,041.00 | 7,703,400 | |
| タキヒヨー | 3,300 | 852.00 | 2,811,600 | |
| ファーストリテイリング | 20,500 | 81,450.00 | 1,669,725,000 | |
| ソフトバンクグループ | 749,200 | 5,969.00 | 4,471,974,800 | |
| 蔵王産業 | 2,100 | 1,747.00 | 3,668,700 | |
| スズケン | 42,500 | 3,415.00 | 145,137,500 | |
| サンドラッグ | 51,900 | 3,750.00 | 194,625,000 | |
| サックスバー　ホールディングス | 12,900 | 741.00 | 9,558,900 | |
| ジェコス | 8,900 | 832.00 | 7,404,800 | |
| ヤマザワ | 2,400 | 1,287.00 | 3,088,800 | |
| やまや | 2,700 | 2,506.00 | 6,766,200 | |
| グローセル | 14,900 | 410.00 | 6,109,000 | |
| ベルーナ | 32,800 | 668.00 | 21,910,400 | |
| 合計 | 151,587,400 | | 353,679,998,270 | |

**（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。**

**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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 4,053,655,090 |
| 国債証券 | 454,459,252,500 |
| 地方債証券 | 33,085,236,568 |
| 特殊債券 | 30,336,795,621 |
| 社債券 | 26,305,786,990 |
| 未収利息 | 573,223,919 |
| 前払費用 | 218,738,821 |
| 流動資産合計 | 549,032,689,509 |
| 資産合計 | 549,032,689,509 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 890,550,000 |
| 未払解約金 | 3,570,847,000 |
| 流動負債合計 | 4,461,397,000 |
| 負債合計 | 4,461,397,000 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 441,014,150,576 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 103,557,141,933 |
| 元本等合計 | 544,571,292,509 |
| 純資産合計 | 544,571,292,509 |
| 負債純資産合計 | 549,032,689,509 |

**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1月12日<br>至　2023年1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<br>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 | 2023年1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 | 369,783,791,323円 |
| 同期中追加設定元本額 | 1,169,484,119,608円 |
| 同期中一部解約元本額 | 1,098,253,760,355円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド | 25,571,332,599円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型） | 58,809,581円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型） | 124,020,616円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型） | 75,850,769円 |
| グローバル８資産ラップファンド（安定型） | 742,020,244円 |
| グローバル８資産ラップファンド（中立型） | 171,025,697円 |
| グローバル８資産ラップファンド（積極型） | 48,241,237円 |
| たわらノーロード　国内債券 | 17,364,958,987円 |
| たわらノーロード　バランス（８資産均等型） | 3,616,037,121円 |
| たわらノーロード　バランス（堅実型） | 1,199,717,259円 |
| たわらノーロード　バランス（標準型） | 2,109,138,614円 |
| たわらノーロード　バランス（積極型） | 269,480,830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） | 104,558,442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） | 1,542,760,375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） | 1,666,622,304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） | 476,258,871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） | 85,583,914円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（保守型） | 26,216,858円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定型） | 17,817,056円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型） | 148,222,785円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（成長型） | 4,644,448円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（積極型） | 62,284円 |
| ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞ | 13,867,302,113円 |
| Ｏｎｅグローバルバランス | 17,028,893円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型 | 9,659,577,766円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型 | 13,589,090,732円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型 | 5,756,072,336円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド | 2,332,626,189円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド | 2,419,618,075円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド | 410,790,143円 |
| マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞ | 97,387,528円 |
| マネックス資産設計ファンド＜育成型＞ | 3,538,729,678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） | 4,592,822,348円 |

| | |
|---|---|
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０） | 1,937,579,442円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０） | 377,779,353円 |
| 投資のソムリエ | 80,029,834,906円 |
| クルーズコントロール | 169,807,558円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞ | 5,784,022,021円 |
| ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ | 5,545,357,902円 |
| ４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞ | 1,253,348,629円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型 | 6,328,603,093円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド | 27,477,190,803円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５） | 486,265,731円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５） | 243,888,522円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ） | 43,535,284円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５） | 1,900,114,047円 |
| ４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 3,357,257,288円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 6,230,472,381円 |
| ９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 5,384,001,424円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０） | 607,579,349円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０） | 260,718,800円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０） | 161,227,928円 |
| ４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞ | 1,170,539,158円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５） | 34,161,306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） | 1,906,690,506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） | 1,951,282,575円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定） | 1,531,718,947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） | 1,187,822,769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） | 1,876,345,673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） | 4,856,348,265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） | 1,872,779,890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） | 1,693,642,819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） | 1,920,698,394円 |
| ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け） | 9,123,851,273円 |
| Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定） | 2,647,924,770円 |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定） | 2,137,889,400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） | 572,063,871円 |
| ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 259,022,731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） | 5,397,074,453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） | 5,408,411,752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） | 5,364,968,629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） | 3,234,781,518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） | 42,202,559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） | 1,052,664,270円 |
| しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定） | 73,817,129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） | 144,547,692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） | 94,214,793円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 20,938,554円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 81,650,343円 |
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 29,866,214円 |
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 321,234円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 23,373,943円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 104,660,524円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 3,040,314,338円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 2,081,148,646円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 4,076,894,090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） | 63,014,352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） | 146,651,765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） | 1,806,576,968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） | 146,600,056円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 530,150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） | 1,969,194,963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） | 42,545,996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） | 289,097,684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） | 442,250,998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） | 775,955,494円 |
| ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 275,148,153円 |
| ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 95,648,909円 |
| コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定） | 905,339,373円 |
| 動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞ | 371,987,197円 |
| コア資産形成ファンド | 248,361,857円 |
| ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ） | 46,931,506,941円 |
| ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］ | 49,382,497,717円 |
| ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］ | 11,120,562,428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］ | 1,689,593,873円 |
| 計 | 441,014,150,576円 |
| ２．　受益権の総数 | 441,014,150,576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1月12日<br>至　2023年1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 | 2023年1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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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 | 2023年1月11日現在<br>当期の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|
| 国債証券 | △11,417,672,250 |
| 地方債証券 | △1,136,858,716 |
| 特殊債券 | △1,432,220,894 |
| 社債券 | △950,302,050 |
| 合計 | △14,937,053,910 |

（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2023年1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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 1.2348円 |

| | |
|---|---|
| （1万口当たり純資産額） | (12,348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**

**2023年1月11日現在**

| 種類 | 銘柄 | 券面総額（円） | 評価額（円） | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | ４３５回　利付国庫債券（２年） | 3,720,000,000 | 3,720,446,400 | |
| | ４３７回　利付国庫債券（２年） | 3,850,000,000 | 3,850,000,000 | |
| | ４３８回　利付国庫債券（２年） | 3,800,000,000 | 3,799,696,000 | |
| | ４３９回　利付国庫債券（２年） | 3,900,000,000 | 3,899,376,000 | |
| | ４４０回　利付国庫債券（２年） | 1,700,000,000 | 1,699,711,000 | |
| | ４４１回　利付国庫債券（２年） | 1,100,000,000 | 1,099,802,000 | |
| | ４４２回　利付国庫債券（２年） | 1,500,000,000 | 1,499,715,000 | |
| | １３９回　利付国庫債券（５年） | 2,550,000,000 | 2,553,162,000 | |
| | １４０回　利付国庫債券（５年） | 5,390,000,000 | 5,396,575,800 | |
| | １４１回　利付国庫債券（５年） | 2,810,000,000 | 2,814,018,300 | |
| | １４２回　利付国庫債券（５年） | 5,230,000,000 | 5,238,054,200 | |
| | １４３回　利付国庫債券（５年） | 3,100,000,000 | 3,104,712,000 | |
| | １４４回　利付国庫債券（５年） | 5,000,000,000 | 5,007,900,000 | |
| | １４５回　利付国庫債券（５年） | 4,850,000,000 | 4,857,808,500 | |
| | １４６回　利付国庫債券（５年） | 4,400,000,000 | 4,407,084,000 | |
| | １４７回　利付国庫債券（５年） | 3,350,000,000 | 3,344,673,500 | |
| | １４８回　利付国庫債券（５年） | 4,910,000,000 | 4,897,381,300 | |
| | １４９回　利付国庫債券（５年） | 4,410,000,000 | 4,392,977,400 | |
| | １５０回　利付国庫債券（５年） | 4,020,000,000 | 3,997,930,200 | |
| | １５１回　利付国庫債券（５年） | 3,500,000,000 | 3,475,255,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| １５２回　利付国庫債券（５年） | 2,730,000,000 | 2,721,482,400 | |
| １５３回　利付国庫債券（５年） | 4,710,000,000 | 4,668,552,000 | |
| １５４回　利付国庫債券（５年） | 5,000,000,000 | 4,969,850,000 | |
| １回　利付国庫債券（４０年） | 110,000,000 | 130,846,100 | |
| ２回　利付国庫債券（４０年） | 630,000,000 | 720,354,600 | |
| ３回　利付国庫債券（４０年） | 540,000,000 | 619,569,000 | |
| ４回　利付国庫債券（４０年） | 720,000,000 | 822,276,000 | |
| ５回　利付国庫債券（４０年） | 1,010,000,000 | 1,108,000,300 | |
| ６回　利付国庫債券（４０年） | 1,040,000,000 | 1,111,416,800 | |
| ７回　利付国庫債券（４０年） | 1,210,000,000 | 1,232,602,800 | |
| ８回　利付国庫債券（４０年） | 1,190,000,000 | 1,121,563,100 | |
| ９回　利付国庫債券（４０年） | 1,950,000,000 | 1,335,672,000 | |
| １０回　利付国庫債券（４０年） | 1,770,000,000 | 1,428,336,900 | |
| １１回　利付国庫債券（４０年） | 1,280,000,000 | 993,561,600 | |
| １２回　利付国庫債券（４０年） | 1,540,000,000 | 1,061,753,000 | |
| １３回　利付国庫債券（４０年） | 1,970,000,000 | 1,348,465,000 | |
| １４回　利付国庫債券（４０年） | 2,050,000,000 | 1,500,641,000 | |
| １５回　利付国庫債券（４０年） | 1,640,000,000 | 1,308,457,600 | |
| ３３３回　利付国庫債券（１０年） | 6,330,000,000 | 6,375,322,800 | |
| ３３４回　利付国庫債券（１０年） | 4,420,000,000 | 4,457,083,800 | |
| ３３５回　利付国庫債券（１０年） | 4,610,000,000 | 4,647,709,800 | |
| ３３６回　利付国庫債券（１０年） | 3,000,000,000 | 3,027,870,000 | |
| ３３７回　利付国庫債券（１０年） | 1,900,000,000 | 1,910,298,000 | |
| ３３８回　利付国庫債券（１０年） | 4,630,000,000 | 4,667,364,100 | |
| ３３９回　利付国庫債券（１０年） | 5,080,000,000 | 5,125,110,400 | |
| ３４０回　利付国庫債券（１０年） | 5,240,000,000 | 5,290,618,400 | |
| ３４１回　利付国庫債券（１０年） | 5,220,000,000 | 5,258,993,400 | |
| ３４２回　利付国庫債券（１０年） | 3,420,000,000 | 3,424,890,600 | |
| ３４３回　利付国庫債券（１０年） | 4,190,000,000 | 4,192,849,200 | |
| ３４４回　利付国庫債券（１０年） | 3,270,000,000 | 3,268,790,100 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ３４５回　利付国庫債券（１０年） | 5,880,000,000 | 5,869,592,400 | |
| ３４６回　利付国庫債券（１０年） | 3,990,000,000 | 3,977,551,200 | |
| ３４７回　利付国庫債券（１０年） | 4,530,000,000 | 4,509,071,400 | |
| ３４８回　利付国庫債券（１０年） | 4,570,000,000 | 4,542,442,900 | |
| ３４９回　利付国庫債券（１０年） | 4,750,000,000 | 4,714,090,000 | |
| ３５０回　利付国庫債券（１０年） | 6,160,000,000 | 6,103,328,000 | |
| ３５１回　利付国庫債券（１０年） | 3,920,000,000 | 3,876,997,600 | |
| ３５２回　利付国庫債券（１０年） | 4,660,000,000 | 4,600,119,000 | |
| ３５３回　利付国庫債券（１０年） | 4,110,000,000 | 4,049,048,700 | |
| ３５４回　利付国庫債券（１０年） | 3,700,000,000 | 3,638,506,000 | |
| ３５５回　利付国庫債券（１０年） | 3,330,000,000 | 3,267,296,100 | |
| ３５６回　利付国庫債券（１０年） | 3,900,000,000 | 3,818,802,000 | |
| ３５７回　利付国庫債券（１０年） | 3,820,000,000 | 3,731,299,600 | |
| ３５８回　利付国庫債券（１０年） | 3,350,000,000 | 3,262,732,500 | |
| ３５９回　利付国庫債券（１０年） | 4,570,000,000 | 4,438,932,400 | |
| ３６０回　利付国庫債券（１０年） | 4,800,000,000 | 4,649,232,000 | |
| ３６１回　利付国庫債券（１０年） | 4,620,000,000 | 4,465,276,200 | |
| ３６２回　利付国庫債券（１０年） | 4,760,000,000 | 4,590,448,800 | |
| ３６３回　利付国庫債券（１０年） | 4,470,000,000 | 4,302,598,500 | |
| ３６４回　利付国庫債券（１０年） | 4,600,000,000 | 4,422,854,000 | |
| ３６５回　利付国庫債券（１０年） | 4,030,000,000 | 3,875,489,800 | |
| ３６６回　利付国庫債券（１０年） | 4,180,000,000 | 4,068,101,400 | |
| ３６７回　利付国庫債券（１０年） | 4,200,000,000 | 4,110,540,000 | |
| ３６８回　利付国庫債券（１０年） | 4,400,000,000 | 4,311,868,000 | |
| １回　利付国庫債券（３０年） | 110,000,000 | 127,277,700 | |
| ２回　利付国庫債券（３０年） | 100,000,000 | 113,546,000 | |
| ４回　利付国庫債券（３０年） | 200,000,000 | 236,456,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ６回　利付国庫債券（３０年） | 200,000,000 | 231,828,000 | |
| ８回　利付国庫債券（３０年） | 500,000,000 | 558,195,000 | |
| １１回　利付国庫債券（３０年） | 250,000,000 | 276,462,500 | |
| １２回　利付国庫債券（３０年） | 230,000,000 | 263,722,600 | |
| １３回　利付国庫債券（３０年） | 150,000,000 | 170,415,000 | |
| １４回　利付国庫債券（３０年） | 340,000,000 | 400,778,400 | |
| １５回　利付国庫債券（３０年） | 260,000,000 | 309,550,800 | |
| １６回　利付国庫債券（３０年） | 240,000,000 | 285,900,000 | |
| １７回　利付国庫債券（３０年） | 270,000,000 | 318,807,900 | |
| １８回　利付国庫債券（３０年） | 400,000,000 | 467,904,000 | |
| １９回　利付国庫債券（３０年） | 280,000,000 | 327,686,800 | |
| ２０回　利付国庫債券（３０年） | 330,000,000 | 394,389,600 | |
| ２１回　利付国庫債券（３０年） | 310,000,000 | 363,236,300 | |
| ２２回　利付国庫債券（３０年） | 290,000,000 | 347,135,800 | |
| ２３回　利付国庫債券（３０年） | 350,000,000 | 419,132,000 | |
| ２４回　利付国庫債券（３０年） | 970,000,000 | 1,162,671,100 | |
| ２５回　利付国庫債券（３０年） | 330,000,000 | 387,212,100 | |
| ２６回　利付国庫債券（３０年） | 620,000,000 | 735,586,600 | |
| ２７回　利付国庫債券（３０年） | 620,000,000 | 743,863,600 | |
| ２８回　利付国庫債券（３０年） | 770,000,000 | 924,077,000 | |
| ２９回　利付国庫債券（３０年） | 860,000,000 | 1,019,117,200 | |
| ３０回　利付国庫債券（３０年） | 880,000,000 | 1,029,309,600 | |
| ３１回　利付国庫債券（３０年） | 720,000,000 | 830,491,200 | |
| ３２回　利付国庫債券（３０年） | 970,000,000 | 1,133,299,500 | |
| ３３回　利付国庫債券（３０年） | 1,180,000,000 | 1,320,620,600 | |
| ３４回　利付国庫債券（３０年） | 1,200,000,000 | 1,381,176,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ３５回　利付国庫債券（３０年） | 1,460,000,000 | 1,633,302,000 | |
| ３６回　利付国庫債券（３０年） | 1,770,000,000 | 1,981,532,700 | |
| ３７回　利付国庫債券（３０年） | 2,260,000,000 | 2,492,079,400 | |
| ３８回　利付国庫債券（３０年） | 1,450,000,000 | 1,573,453,000 | |
| ３９回　利付国庫債券（３０年） | 1,500,000,000 | 1,653,315,000 | |
| ４０回　利付国庫債券（３０年） | 1,330,000,000 | 1,440,762,400 | |
| ４１回　利付国庫債券（３０年） | 1,170,000,000 | 1,244,961,900 | |
| ４２回　利付国庫債券（３０年） | 1,320,000,000 | 1,403,028,000 | |
| ４３回　利付国庫債券（３０年） | 1,250,000,000 | 1,327,137,500 | |
| ４４回　利付国庫債券（３０年） | 1,400,000,000 | 1,484,686,000 | |
| ４５回　利付国庫債券（３０年） | 1,370,000,000 | 1,400,030,400 | |
| ４６回　利付国庫債券（３０年） | 1,570,000,000 | 1,601,996,600 | |
| ４７回　利付国庫債券（３０年） | 1,460,000,000 | 1,515,012,800 | |
| ４８回　利付国庫債券（３０年） | 1,180,000,000 | 1,176,955,600 | |
| ４９回　利付国庫債券（３０年） | 1,390,000,000 | 1,383,981,300 | |
| ５０回　利付国庫債券（３０年） | 1,260,000,000 | 1,104,478,200 | |
| ５１回　利付国庫債券（３０年） | 1,290,000,000 | 999,053,400 | |
| ５２回　利付国庫債券（３０年） | 1,330,000,000 | 1,078,683,200 | |
| ５３回　利付国庫債券（３０年） | 1,560,000,000 | 1,291,102,800 | |
| ５４回　利付国庫債券（３０年） | 1,350,000,000 | 1,167,790,500 | |
| ５５回　利付国庫債券（３０年） | 1,420,000,000 | 1,224,735,800 | |
| ５６回　利付国庫債券（３０年） | 1,260,000,000 | 1,083,524,400 | |
| ５７回　利付国庫債券（３０年） | 1,330,000,000 | 1,140,342,000 | |
| ５８回　利付国庫債券（３０年） | 1,740,000,000 | 1,486,116,600 | |
| ５９回　利付国庫債券（３０年） | 1,420,000,000 | 1,179,352,600 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ６０回　利付国庫債券（３０年） | 1,200,000,000 | 1,043,268,000 | |
| ６１回　利付国庫債券（３０年） | 1,040,000,000 | 856,648,000 | |
| ６２回　利付国庫債券（３０年） | 1,270,000,000 | 987,602,800 | |
| ６３回　利付国庫債券（３０年） | 1,310,000,000 | 986,783,700 | |
| ６４回　利付国庫債券（３０年） | 1,030,000,000 | 772,129,200 | |
| ６５回　利付国庫債券（３０年） | 950,000,000 | 716,518,500 | |
| ６６回　利付国庫債券（３０年） | 1,390,000,000 | 1,043,375,700 | |
| ６７回　利付国庫債券（３０年） | 1,570,000,000 | 1,233,030,900 | |
| ６８回　利付国庫債券（３０年） | 1,370,000,000 | 1,073,148,400 | |
| ６９回　利付国庫債券（３０年） | 1,330,000,000 | 1,068,960,900 | |
| ７０回　利付国庫債券（３０年） | 1,610,000,000 | 1,290,914,100 | |
| ７１回　利付国庫債券（３０年） | 1,300,000,000 | 1,039,831,000 | |
| ７２回　利付国庫債券（３０年） | 1,490,000,000 | 1,188,915,700 | |
| ７３回　利付国庫債券（３０年） | 1,390,000,000 | 1,108,566,700 | |
| ７４回　利付国庫債券（３０年） | 1,520,000,000 | 1,313,720,800 | |
| ７５回　利付国庫債券（３０年） | 1,520,000,000 | 1,421,625,600 | |
| ７６回　利付国庫債券（３０年） | 1,420,000,000 | 1,356,014,800 | |
| ６７回　利付国庫債券（２０年） | 50,000,000 | 51,127,000 | |
| ７０回　利付国庫債券（２０年） | 50,000,000 | 51,711,500 | |
| ７１回　利付国庫債券（２０年） | 40,000,000 | 41,254,400 | |
| ７２回　利付国庫債券（２０年） | 460,000,000 | 476,178,200 | |
| ７３回　利付国庫債券（２０年） | 380,000,000 | 394,565,400 | |
| ７４回　利付国庫債券（２０年） | 40,000,000 | 41,610,800 | |
| ７５回　利付国庫債券（２０年） | 180,000,000 | 188,130,600 | |
| ７６回　利付国庫債券（２０年） | 70,000,000 | 72,856,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ７７回　利付国庫債券（２０年） | 40,000,000 | 41,719,200 | |
| ７８回　利付国庫債券（２０年） | 250,000,000 | 261,345,000 | |
| ７９回　利付国庫債券（２０年） | 50,000,000 | 52,390,500 | |
| ８０回　利付国庫債券（２０年） | 90,000,000 | 94,522,500 | |
| ８１回　利付国庫債券（２０年） | 400,000,000 | 421,048,000 | |
| ８２回　利付国庫債券（２０年） | 140,000,000 | 147,742,000 | |
| ８３回　利付国庫債券（２０年） | 70,000,000 | 74,218,900 | |
| ８４回　利付国庫債券（２０年） | 170,000,000 | 179,747,800 | |
| ８５回　利付国庫債券（２０年） | 590,000,000 | 628,344,100 | |
| ８６回　利付国庫債券（２０年） | 120,000,000 | 128,560,800 | |
| ８７回　利付国庫債券（２０年） | 120,000,000 | 128,179,200 | |
| ８８回　利付国庫債券（２０年） | 590,000,000 | 634,875,400 | |
| ８９回　利付国庫債券（２０年） | 10,000,000 | 10,726,300 | |
| ９０回　利付国庫債券（２０年） | 470,000,000 | 506,166,500 | |
| ９１回　利付国庫債券（２０年） | 110,000,000 | 118,869,300 | |
| ９２回　利付国庫債券（２０年） | 1,160,000,000 | 1,249,018,400 | |
| ９３回　利付国庫債券（２０年） | 370,000,000 | 398,123,700 | |
| ９４回　利付国庫債券（２０年） | 670,000,000 | 723,713,900 | |
| ９５回　利付国庫債券（２０年） | 550,000,000 | 600,776,000 | |
| ９６回　利付国庫債券（２０年） | 120,000,000 | 130,023,600 | |
| ９７回　利付国庫債券（２０年） | 660,000,000 | 720,627,600 | |
| ９８回　利付国庫債券（２０年） | 160,000,000 | 173,955,200 | |
| ９９回　利付国庫債券（２０年） | 750,000,000 | 817,860,000 | |
| １００回　利付国庫債券（２０年） | 830,000,000 | 912,120,200 | |
| １０１回　利付国庫債券（２０年） | 230,000,000 | 255,106,800 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| １０２回　利付国庫債券（２０年） | 500,000,000 | 556,455,000 | |
| １０３回　利付国庫債券（２０年） | 160,000,000 | 177,209,600 | |
| １０４回　利付国庫債券（２０年） | 110,000,000 | 120,653,500 | |
| １０５回　利付国庫債券（２０年） | 640,000,000 | 703,827,200 | |
| １０６回　利付国庫債券（２０年） | 500,000,000 | 552,660,000 | |
| １０７回　利付国庫債券（２０年） | 600,000,000 | 661,452,000 | |
| １０８回　利付国庫債券（２０年） | 690,000,000 | 752,638,200 | |
| １０９回　利付国庫債券（２０年） | 350,000,000 | 382,718,000 | |
| １１０回　利付国庫債券（２０年） | 440,000,000 | 486,455,200 | |
| １１１回　利付国庫債券（２０年） | 460,000,000 | 512,591,800 | |
| １１２回　利付国庫債券（２０年） | 740,000,000 | 819,957,000 | |
| １１３回　利付国庫債券（２０年） | 2,170,000,000 | 2,411,065,300 | |
| １１４回　利付国庫債券（２０年） | 1,110,000,000 | 1,235,696,400 | |
| １１５回　利付国庫債券（２０年） | 360,000,000 | 403,192,800 | |
| １１６回　利付国庫債券（２０年） | 530,000,000 | 594,744,800 | |
| １１７回　利付国庫債券（２０年） | 1,070,000,000 | 1,193,264,000 | |
| １１８回　利付国庫債券（２０年） | 555,000,000 | 616,005,600 | |
| １１９回　利付国庫債券（２０年） | 470,000,000 | 514,725,200 | |
| １２０回　利付国庫債券（２０年） | 670,000,000 | 724,129,300 | |
| １２１回　利付国庫債券（２０年） | 640,000,000 | 706,592,000 | |
| １２２回　利付国庫債券（２０年） | 570,000,000 | 625,084,800 | |
| １２３回　利付国庫債券（２０年） | 1,050,000,000 | 1,177,795,500 | |
| １２４回　利付国庫債券（２０年） | 600,000,000 | 668,448,000 | |
| １２５回　利付国庫債券（２０年） | 600,000,000 | 679,386,000 | |
| １２６回　利付国庫債券（２０年） | 510,000,000 | 569,246,700 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| １２７回　利付国庫債券（２０年） | 540,000,000 | 598,492,800 | |
| １２８回　利付国庫債券（２０年） | 1,370,000,000 | 1,521,549,400 | |
| １２９回　利付国庫債券（２０年） | 760,000,000 | 837,930,400 | |
| １３０回　利付国庫債券（２０年） | 910,000,000 | 1,005,140,500 | |
| １３１回　利付国庫債券（２０年） | 790,000,000 | 866,045,400 | |
| １３２回　利付国庫債券（２０年） | 830,000,000 | 912,078,700 | |
| １３３回　利付国庫債券（２０年） | 1,030,000,000 | 1,140,642,600 | |
| １３４回　利付国庫債券（２０年） | 900,000,000 | 998,784,000 | |
| １３５回　利付国庫債券（２０年） | 740,000,000 | 814,747,400 | |
| １３６回　利付国庫債券（２０年） | 360,000,000 | 393,213,600 | |
| １３７回　利付国庫債券（２０年） | 880,000,000 | 971,643,200 | |
| １３８回　利付国庫債券（２０年） | 920,000,000 | 998,844,000 | |
| １３９回　利付国庫債券（２０年） | 1,000,000,000 | 1,095,160,000 | |
| １４０回　利付国庫債券（２０年） | 2,450,000,000 | 2,710,386,000 | |
| １４１回　利付国庫債券（２０年） | 1,560,000,000 | 1,726,576,800 | |
| １４２回　利付国庫債券（２０年） | 1,330,000,000 | 1,484,532,700 | |
| １４３回　利付国庫債券（２０年） | 1,630,000,000 | 1,787,278,700 | |
| １４４回　利付国庫債券（２０年） | 1,350,000,000 | 1,467,301,500 | |
| １４５回　利付国庫債券（２０年） | 2,150,000,000 | 2,377,577,500 | |
| １４６回　利付国庫債券（２０年） | 2,140,000,000 | 2,365,727,200 | |
| １４７回　利付国庫債券（２０年） | 2,490,000,000 | 2,724,582,900 | |
| １４８回　利付国庫債券（２０年） | 2,360,000,000 | 2,554,487,600 | |
| １４９回　利付国庫債券（２０年） | 2,440,000,000 | 2,638,274,400 | |
| １５０回　利付国庫債券（２０年） | 2,500,000,000 | 2,671,725,000 | |
| １５１回　利付国庫債券（２０年） | 2,460,000,000 | 2,570,011,200 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| １５２回　利付国庫債券（２０年） | 2,240,000,000 | 2,335,558,400 | |
| １５３回　利付国庫債券（２０年） | 2,200,000,000 | 2,316,534,000 | |
| １５４回　利付国庫債券（２０年） | 2,230,000,000 | 2,318,040,400 | |
| １５５回　利付国庫債券（２０年） | 2,380,000,000 | 2,411,749,200 | |
| １５６回　利付国庫債券（２０年） | 2,040,000,000 | 1,910,766,000 | |
| １５７回　利付国庫債券（２０年） | 2,360,000,000 | 2,142,714,800 | |
| １５８回　利付国庫債券（２０年） | 2,780,000,000 | 2,620,511,400 | |
| １５９回　利付国庫債券（２０年） | 2,260,000,000 | 2,152,039,800 | |
| １６０回　利付国庫債券（２０年） | 2,280,000,000 | 2,193,656,400 | |
| １６１回　利付国庫債券（２０年） | 2,010,000,000 | 1,900,173,600 | |
| １６２回　利付国庫債券（２０年） | 2,370,000,000 | 2,231,426,100 | |
| １６３回　利付国庫債券（２０年） | 2,340,000,000 | 2,194,101,000 | |
| １６４回　利付国庫債券（２０年） | 2,740,000,000 | 2,521,183,600 | |
| １６５回　利付国庫債券（２０年） | 2,230,000,000 | 2,043,995,700 | |
| １６６回　利付国庫債券（２０年） | 1,980,000,000 | 1,862,823,600 | |
| １６７回　利付国庫債券（２０年） | 2,050,000,000 | 1,861,748,500 | |
| １６８回　利付国庫債券（２０年） | 1,690,000,000 | 1,503,711,300 | |
| １６９回　利付国庫債券（２０年） | 1,960,000,000 | 1,706,121,200 | |
| １７０回　利付国庫債券（２０年） | 1,600,000,000 | 1,386,288,000 | |
| １７１回　利付国庫債券（２０年） | 1,740,000,000 | 1,500,541,200 | |
| １７２回　利付国庫債券（２０年） | 1,380,000,000 | 1,206,396,000 | |
| １７３回　利付国庫債券（２０年） | 2,020,000,000 | 1,757,824,200 | |
| １７４回　利付国庫債券（２０年） | 1,970,000,000 | 1,706,433,700 | |
| １７５回　利付国庫債券（２０年） | 2,130,000,000 | 1,871,247,600 | |
| １７６回　利付国庫債券（２０年） | 1,900,000,000 | 1,662,994,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | １７７回　利付国庫債券（２０年） | 1,950,000,000 | 1,669,141,500 | |
| | １７８回　利付国庫債券（２０年） | 2,200,000,000 | 1,913,802,000 | |
| | １７９回　利付国庫債券（２０年） | 2,050,000,000 | 1,779,154,000 | |
| | １８０回　利付国庫債券（２０年） | 2,040,000,000 | 1,869,027,600 | |
| | １８１回　利付国庫債券（２０年） | 2,200,000,000 | 2,050,730,000 | |
| | １８２回　利付国庫債券（２０年） | 2,180,000,000 | 2,101,759,800 | |
| 国債証券　合計 | | 460,745,000,000 | 454,459,252,500 | |
| 地方債証券 | ７６０回　東京都公募公債 | 100,000,000 | 99,323,000 | |
| | ７８３回　東京都公募公債 | 110,000,000 | 108,742,700 | |
| | ７９６回　東京都公募公債 | 200,000,000 | 192,930,000 | |
| | ８０２回　東京都公募公債 | 400,000,000 | 385,584,000 | |
| | ８１３回　東京都公募公債 | 300,000,000 | 287,913,000 | |
| | １回　東京都公募公債　３０年 | 200,000,000 | 227,278,000 | |
| | １４回　東京都公募公債　３０年 | 100,000,000 | 110,765,000 | |
| | ５回　東京都公募公債　２０年 | 100,000,000 | 104,265,000 | |
| | ７回　東京都公募公債　２０年 | 100,000,000 | 105,352,000 | |
| | ９回　東京都公募公債　２０年 | 200,000,000 | 215,322,000 | |
| | １０回　東京都公募公債　２０年 | 300,000,000 | 323,136,000 | |
| | １８回　東京都公募公債　２０年 | 100,000,000 | 110,185,000 | |
| | ２１回　東京都公募公債　２０年 | 100,000,000 | 110,630,000 | |
| | ３１回　東京都公募公債　２０年 | 200,000,000 | 206,822,000 | |
| | ２８年度６回　北海道公募公債 | 100,000,000 | 99,405,000 | |
| | ３０年度８回　北海道公募公債 | 400,000,000 | 395,144,000 | |
| | ３０年度１４回　北海道公募公債 | 400,000,000 | 392,820,000 | |
| | 令和２年度１９回　北海道公募公債 | 100,000,000 | 95,437,000 | |
| | ３６回２号　宮城県公募公債　１０年 | 250,000,000 | 239,465,000 | |
| | ２０８回　神奈川県公募公債 | 300,000,000 | 301,791,000 | |
| | ２１３回　神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 100,835,000 | |
| | ２３７回　神奈川県公募公債 | 200,000,000 | 195,844,000 | |
| | ２５１回　神奈川県公募公債　１０年 | 200,000,000 | 191,718,000 | |
| | ２５８回　神奈川県公募公債　１０年 | 300,000,000 | 288,345,000 | |
| | ３回　神奈川県公募公債　３０年 | 100,000,000 | 119,600,000 | |
| | １１回　神奈川県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 109,530,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| １６回　神奈川県公募公債　２０年 | 300,000,000 | 331,725,000 | |
| １９回　神奈川県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 109,146,000 | |
| ４１３回　大阪府公募公債　１０年 | 100,000,000 | 99,111,000 | |
| ４１９回　大阪府公募公債　１０年 | 100,000,000 | 99,474,000 | |
| ４６４回　大阪府公募公債　１０年 | 200,000,000 | 189,848,000 | |
| ４６７回　大阪府公募公債　１０年 | 200,000,000 | 190,844,000 | |
| ４６９回　大阪府公募公債　１０年 | 200,000,000 | 190,026,000 | |
| ４７２回　大阪府公募公債　１０年 | 200,000,000 | 189,206,000 | |
| ４７４回　大阪府公募公債　１０年 | 300,000,000 | 284,115,000 | |
| １０回　大阪府公募公債　２０年 | 200,000,000 | 218,532,000 | |
| １３回　大阪府公募公債　２０年 | 100,000,000 | 102,004,000 | |
| １４回　大阪府公募公債　２０年 | 100,000,000 | 93,059,000 | |
| １９０回　大阪府公募公債　５年 | 300,000,000 | 296,715,000 | |
| ２６年度１１回　京都府公募公債 | 350,000,000 | 352,271,500 | |
| ２９年度１３回　京都府公募公債 | 109,330,000 | 108,192,968 | |
| 令和２年度１回　京都府公募公債 | 400,000,000 | 385,464,000 | |
| 令和２年度１４回　京都府公募公債 | 200,000,000 | 192,044,000 | |
| ２６年度１７回　兵庫県公募公債 | 200,000,000 | 201,312,000 | |
| 令和元年度１６回　兵庫県公募公債 | 200,000,000 | 192,900,000 | |
| 令和３年度２回　兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 95,587,000 | |
| ２回　兵庫県公募公債　３０年 | 100,000,000 | 115,752,000 | |
| １回　兵庫県公募公債　１５年 | 200,000,000 | 210,204,000 | |
| １回　兵庫県公募公債（１２年） | 300,000,000 | 304,203,000 | |
| ５回　兵庫県公募公債　１５年 | 300,000,000 | 313,914,000 | |
| ９回　兵庫県公募公債　１５年 | 100,000,000 | 102,854,000 | |
| ５回　兵庫県公募公債　１２年 | 100,000,000 | 101,577,000 | |
| 令和元年度　９回　静岡県公募公債 | 200,000,000 | 193,058,000 | |
| 令和２年度　１０回　静岡県公募公債 | 100,000,000 | 95,875,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 令和２年度　１４回　静岡県公募公債 | 200,000,000 | 190,806,000 | |
| ２回　静岡県公募公債　１５年 | 100,000,000 | 104,744,000 | |
| ４回　静岡県公募公債　１５年 | 100,000,000 | 104,804,000 | |
| ８回　静岡県公募公債　１５年 | 200,000,000 | 202,370,000 | |
| １回　静岡県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 105,391,000 | |
| ７回　静岡県公募公債　２０年 | 300,000,000 | 331,137,000 | |
| ２２年度１４回　愛知県公募公債 | 300,000,000 | 331,602,000 | |
| ２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年 | 100,000,000 | 111,879,000 | |
| ２６年度４回　愛知県公募公債　２０年 | 200,000,000 | 213,870,000 | |
| ２７年度８回　愛知県公募公債　３０年 | 150,000,000 | 151,500,000 | |
| ２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年 | 100,000,000 | 100,861,000 | |
| ３０年度１９回　愛知県公募公債 | 200,000,000 | 194,950,000 | |
| 令和元年度７回　愛知県公募公債 | 300,000,000 | 216,726,000 | |
| ３０年度３回　広島県公募公債 | 100,000,000 | 98,825,000 | |
| 令和２年　７回　広島県公募公債 | 200,000,000 | 192,026,000 | |
| ２７年度　２回　広島県公募公債　３０年 | 100,000,000 | 83,621,000 | |
| 令和２年　２回　広島県公募公債 | 100,000,000 | 86,171,000 | |
| ２６年度５回　埼玉県公募公債 | 400,000,000 | 402,932,000 | |
| 令和元年度第８回　埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 193,246,000 | |
| ６回　埼玉県公募公債　３０年 | 200,000,000 | 175,156,000 | |
| １２回　埼玉県公募公債　３０年 | 300,000,000 | 223,758,000 | |
| ９回　埼玉県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 110,542,000 | |
| １３回　埼玉県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 107,691,000 | |
| １４回　埼玉県公募公債　２０年 | 300,000,000 | 320,898,000 | |
| １５回　埼玉県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 102,338,000 | |
| ２５年度１１回　福岡県公募公債 | 200,000,000 | 201,290,000 | |
| ２８年度８回　福岡県公募公債 | 100,000,000 | 99,795,000 | |
| ３０年度６回　福岡県公募公債 | 200,000,000 | 196,592,000 | |
| 令和元年度１回　福岡県公募公債 | 200,000,000 | 193,394,000 | |
| 令和２年５回　福岡県公募公債 | 100,000,000 | 95,793,000 | |
| ２４年度１回　福岡県公募公債　１５年 | 100,000,000 | 104,599,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 令和元年３回　福岡県公募公債　３０年 | 200,000,000 | 147,182,000 | |
| ２０回２号　福岡県公募公債 | 100,000,000 | 109,004,000 | |
| ２１年度２回　福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 110,934,000 | |
| ２４年度２回　福岡県公募公債（２０年） | 300,000,000 | 325,365,000 | |
| ２７年度４回　千葉県公募公債 | 200,000,000 | 202,230,000 | |
| ２７年度９回　千葉県公募公債 | 100,000,000 | 99,729,000 | |
| 令和３年　５回　千葉県公募公債 | 200,000,000 | 189,454,000 | |
| １４回　千葉県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 103,291,000 | |
| １８回　千葉県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 101,889,000 | |
| ２１回　千葉県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 91,711,000 | |
| ２５年度２回　新潟県公募公債 | 100,000,000 | 100,621,000 | |
| 令和３年度１回　長野県公募公債　１０年 | 200,000,000 | 191,506,000 | |
| ５回　群馬県公募公債　２０年 | 100,000,000 | 106,738,000 | |
| １３２回　共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,640,000 | |
| １４２回　共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 502,025,000 | |
| １４４回　共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 402,760,000 | |
| １４６回　共同発行市場公募地方債 | 600,000,000 | 605,616,000 | |
| １４８回　共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 504,955,000 | |
| １５０回　共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 302,784,000 | |
| １５３回　共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,863,000 | |
| １５７回　共同発行市場公募地方債 | 120,000,000 | 119,588,400 | |
| １５９回　共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 199,074,000 | |
| １６０回　共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 497,195,000 | |
| １６６回　共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 497,990,000 | |
| １６９回　共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 497,780,000 | |
| １７３回　共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 397,632,000 | |
| １７４回　共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 99,028,000 | |
| １７８回　共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 99,184,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| １７９回　共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 495,980,000 | |
| １８９回　共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 98,351,000 | |
| １９４回　共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 291,876,000 | |
| １９６回　共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 483,785,000 | |
| ２０３回　共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 96,252,000 | |
| ２２７回　共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 477,160,000 | |
| ２２８回　共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 474,450,000 | |
| ３０年度３回　堺市公募公債 | 100,000,000 | 98,212,000 | |
| ２６年度１回　長崎県公募公債 | 100,000,000 | 100,709,000 | |
| 令和元年度１回　島根県公募公債 | 200,000,000 | 180,242,000 | |
| 令和２年度１回　福島県公募公債 | 200,000,000 | 191,416,000 | |
| ２６年度１回　静岡市公募公債 | 100,000,000 | 100,699,000 | |
| ２６年度１回　浜松市公募公債 | 100,000,000 | 100,385,000 | |
| ２９年度４回　大阪市公募公債 | 200,000,000 | 198,106,000 | |
| 令和２年　２回　大阪市公募公債 | 300,000,000 | 288,654,000 | |
| ６回　大阪市公募公債　２０年 | 200,000,000 | 219,856,000 | |
| ４８８回　名古屋市公募公債　１０年 | 450,000,000 | 453,510,000 | |
| ５１１回　名古屋市公募公債　１０年 | 200,000,000 | 192,014,000 | |
| １６回　名古屋市公募公債　２０年 | 100,000,000 | 106,635,000 | |
| １７回　名古屋市公募公債　２０年 | 100,000,000 | 102,517,000 | |
| ５回　京都市公募公債　３０年定時償還 | 200,000,000 | 177,064,000 | |
| ４回　京都市公募公債　２０年 | 100,000,000 | 108,370,000 | |
| ９回　京都市公募公債　２０年 | 200,000,000 | 221,938,000 | |
| ２４年度１２回　神戸市公募公債 | 200,000,000 | 217,564,000 | |
| ２６年度４回　神戸市公募公債 | 100,000,000 | 100,712,000 | |
| ３０年度７回　神戸市公募公債　３０年 | 300,000,000 | 296,490,000 | |
| 令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年 | 200,000,000 | 155,480,000 | |
| 令和元年度３回　横浜市公募公債 | 400,000,000 | 385,840,000 | |
| ２回　横浜市公募公債　３０年 | 100,000,000 | 117,318,000 | |
| １７回　横浜市公募公債　２０年 | 100,000,000 | 109,120,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ２９回　横浜市公募公債　２０年 | 100,000,000 | 106,752,000 | |
| | ２３年度７回　札幌市公募公債　３０年 | 100,000,000 | 111,454,000 | |
| | ２６年度４回　札幌市公募公債　１０年 | 100,000,000 | 100,581,000 | |
| | ２９年度５回　札幌市公募公債　２０年 | 300,000,000 | 277,800,000 | |
| | 第９１回　川崎市公募公債 | 200,000,000 | 196,894,000 | |
| | ６回　川崎市公募公債　２０年 | 200,000,000 | 220,560,000 | |
| | ５回　川崎市公募公債　３０年 | 100,000,000 | 111,629,000 | |
| | ６回　北九州市公募公債　２０年 | 100,000,000 | 108,826,000 | |
| | １１回　北九州市公募公債　２０年 | 300,000,000 | 331,134,000 | |
| | １７回　北九州市公募公債　２０年 | 100,000,000 | 106,467,000 | |
| | ２２年度８回　福岡市公募公債 | 100,000,000 | 114,312,000 | |
| | ３０年度７回　福岡市公募公債 | 200,000,000 | 184,808,000 | |
| | ２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年 | 100,000,000 | 85,266,000 | |
| | ２６年度３回　広島市公募公債 | 100,000,000 | 100,590,000 | |
| | ２９年度２回　広島市公募公債 | 200,000,000 | 185,968,000 | |
| | ２９年度６回　広島市公募公債 | 300,000,000 | 297,438,000 | |
| | ３０年度２回　仙台市公募公債　２０年 | 100,000,000 | 92,833,000 | |
| | 令和３年度３回　仙台市公募公債　５年 | 300,000,000 | 296,643,000 | |
| | １７回　さいたま市公募公債 | 200,000,000 | 193,262,000 | |
| | 令和２年度１回　高知県公募公債 | 200,000,000 | 191,416,000 | |
| | ２６年度１回　相模原市公募公債 | 100,000,000 | 100,655,000 | |
| | ２６年度１回　三重県公募公債 | 100,000,000 | 100,605,000 | |
| | ３０年度３回　岡山県公募公債　１０年 | 200,000,000 | 195,368,000 | |
| 地方債証券　合計 | | 33,239,330,000 | 33,085,236,568 | |
| 特殊債券 | ９回　新関西国際空港社債 | 200,000,000 | 206,822,000 | |
| | １２回　新関西国際空港社債 | 200,000,000 | 204,572,000 | |
| | ７８回　日本政策投資銀行債券 | 300,000,000 | 297,990,000 | |
| | １２５回　日本政策投資銀行債券 | 500,000,000 | 423,050,000 | |
| | １２７回　日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 99,572,000 | |
| | １３１回　日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 76,037,000 | |
| | １５６回　日本政策投資銀行債券 | 400,000,000 | 381,944,000 | |
| | ３３回　政保日本政策投資銀行社債 | 300,000,000 | 298,860,000 | |
| | １回　高速道路機構債 | 300,000,000 | 372,102,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| １９回　高速道路機構債 | 150,000,000 | 179,202,000 | |
| ２６回　高速道路機構債 | 200,000,000 | 236,998,000 | |
| ３６回　高速道路機構債 | 300,000,000 | 363,960,000 | |
| ５０回　高速道路機構債 | 300,000,000 | 264,222,000 | |
| ７５回　日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 109,556,000 | |
| １２４回　日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 106,331,000 | |
| １３９回　日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 100,573,000 | |
| １５５回　日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 102,809,000 | |
| １５９回　日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 99,070,000 | |
| １６２回　日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 98,996,000 | |
| １６９回　高速道路機構債 | 100,000,000 | 90,859,000 | |
| １７２回　高速道路機構債 | 200,000,000 | 179,310,000 | |
| ２１０回　高速道路機構債 | 100,000,000 | 91,352,000 | |
| ９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 110,541,000 | |
| １１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 107,380,000 | |
| １２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 500,000,000 | 544,320,000 | |
| １５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 109,780,000 | |
| １８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 106,618,000 | |
| ２１１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 100,655,000 | |
| ２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 100,787,000 | |
| ２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 201,614,000 | |
| ２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 300,000,000 | 308,340,000 | |
| ２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 500,000,000 | 503,700,000 | |
| ２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 103,830,000 | |
| ２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 100,838,000 | |
| ２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 196,258,000 | |
| 第２６２回　政保道路債 | 500,000,000 | 507,390,000 | |
| ２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 95,849,000 | |
| ２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 300,000,000 | 298,845,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ２８６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 182,046,000 | |
| ３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 99,496,000 | |
| ３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 800,000,000 | 795,576,000 | |
| ３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 187,748,000 | |
| ３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 92,650,000 | |
| ３９８回　政保道路債 | 300,000,000 | 224,136,000 | |
| ４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 141,988,000 | |
| ４１８回　高速道路機構債 | 200,000,000 | 153,924,000 | |
| ４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 156,202,000 | |
| ２８回　日本道路・機構承継債 | 500,000,000 | 595,510,000 | |
| １回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 200,000,000 | 217,362,000 | |
| １回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 300,000,000 | 330,882,000 | |
| ２回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 300,000,000 | 331,452,000 | |
| １３回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 100,000,000 | 110,572,000 | |
| ７９回　政保地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 313,752,000 | |
| １９回　地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 217,564,000 | |
| ２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 100,000,000 | 108,571,000 | |
| ２４回　地方公共団体金融機構債券２０年 | 200,000,000 | 217,728,000 | |
| Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 207,674,000 | |
| Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 326,166,000 | |
| ３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 100,000,000 | 106,663,000 | |
| ６４回　政保地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 302,220,000 | |
| ３９回　地方公共団体金融機構債券 | 500,000,000 | 523,950,000 | |
| ４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 300,000,000 | 299,961,000 | |
| ７１回　政保地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,628,000 | |
| ４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 200,000,000 | 205,810,000 | |
| ２８８回　政保地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 301,722,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年 | 400,000,000 | 398,232,000 | |
| ９１回　政保地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 99,453,000 | |
| ５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 100,000,000 | 93,471,000 | |
| ９６回　地方公共団体金融機構債券 | 500,000,000 | 496,015,000 | |
| ９８回　政保地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 99,398,000 | |
| １０３回　政保地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 99,126,000 | |
| １１３回　政保地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 98,916,000 | |
| ７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年 | 300,000,000 | 248,706,000 | |
| １０回　地方公共団体金融機構債券　３０年 | 300,000,000 | 218,769,000 | |
| Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券 | 500,000,000 | 497,210,000 | |
| １５回　日本政策金融公庫債券 | 200,000,000 | 217,186,000 | |
| ４０回　政保日本政策金融公庫債券 | 103,000,000 | 102,609,630 | |
| ２３回　国際協力銀行債券 | 100,000,000 | 105,487,000 | |
| ９３回　都市再生債券 | 100,000,000 | 102,920,000 | |
| １０９回　都市再生機構債券 | 200,000,000 | 202,650,000 | |
| １６５回　都市再生機構債券 | 200,000,000 | 152,388,000 | |
| １１回　独立行政法人福祉医療機構 | 100,000,000 | 107,401,000 | |
| ２１回　政保中部国際空港債券 | 100,000,000 | 100,738,000 | |
| ３９回　住宅金融支援機構債券 | 200,000,000 | 219,390,000 | |
| ６１回　住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 104,728,000 | |
| ７５回　住宅金融支援機構債券 | 350,000,000 | 385,714,000 | |
| ８０回　住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 104,755,000 | |
| １１５回　住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 109,916,000 | |
| １２４回　住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 104,700,000 | |
| １４８回　住宅金融支援機構債券 | 250,000,000 | 267,015,000 | |
| １５９回　住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 100,873,000 | |
| １７２回　住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 100,826,000 | |
| １８７回　住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 99,529,000 | |
| ２２２回　住宅金融支援機構債券 | 300,000,000 | 296,436,000 | |
| ２３０回　住宅金融支援機構債券 | 300,000,000 | 296,634,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ２３３回　住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 90,693,000 | |
| ３２１回　住宅金融支援機構債券 | 500,000,000 | 494,895,000 | |
| ３２５回　住宅金融支援機構債券 | 500,000,000 | 494,895,000 | |
| ２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券 | 29,712,000 | 29,840,652 | |
| ４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 45,132,000 | 45,845,085 | |
| ４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 10,170,000 | 10,215,358 | |
| ４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 48,640,000 | 48,859,366 | |
| ５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 29,046,000 | 29,153,760 | |
| ４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 9,878,000 | 9,917,907 | |
| ２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 16,383,000 | 17,104,015 | |
| ２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 101,900,000 | 106,978,696 | |
| ３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 155,088,000 | 161,685,443 | |
| ３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 21,684,000 | 22,511,461 | |
| ４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 18,633,000 | 19,373,289 | |
| ５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 21,835,000 | 22,590,491 | |
| ５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 22,949,000 | 23,730,183 | |
| ６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 28,311,000 | 29,190,905 | |
| ６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 69,152,000 | 70,752,177 | |
| ７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 31,516,000 | 32,326,591 | |
| ８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 37,534,000 | 38,114,275 | |
| ８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 38,095,000 | 38,694,996 | |
| ８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 41,820,000 | 42,415,935 | |
| ９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 43,497,000 | 43,811,918 | |
| ９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 48,900,000 | 48,387,528 | |
| ９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 55,272,000 | 55,082,969 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 57,179,000 | 57,320,803 | |
| １１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 214,500,000 | 206,968,905 | |
| １１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,846,000 | 70,672,275 | |
| １１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,496,000 | 70,421,164 | |
| １１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,740,000 | 70,587,623 | |
| １２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 227,190,000 | 219,226,990 | |
| １２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 227,262,000 | 219,151,019 | |
| １３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 154,106,000 | 148,476,507 | |
| １３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 231,438,000 | 222,453,576 | |
| １３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 230,994,000 | 222,040,672 | |
| １３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 399,035,000 | 384,729,595 | |
| １３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 79,826,000 | 76,879,622 | |
| １４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 82,171,000 | 78,234,187 | |
| １５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 263,157,000 | 249,012,311 | |
| １５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 351,856,000 | 334,164,680 | |
| １６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 270,273,000 | 256,853,945 | |
| １６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 277,440,000 | 263,917,574 | |
| １７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 842,580,000 | 798,799,543 | |
| ６回　沖縄振興開発金融公庫債券 | 400,000,000 | 417,856,000 | |
| ２１回　沖縄振興開発金融公庫債券 | 100,000,000 | 101,046,000 | |
| い第８２８号　利付商工債 | 100,000,000 | 99,945,000 | |
| い第８４３号　利付商工債 | 100,000,000 | 99,713,000 | |
| い第８５１号　利付商工債 | 300,000,000 | 298,092,000 | |
| い第８５４号　利付商工債 | 300,000,000 | 297,531,000 | |
| い第８５５号　利付商工債 | 200,000,000 | 198,278,000 | |
| ３６９回　利附信金中金債（５年） | 400,000,000 | 398,328,000 | |
| ３７７回　利附信金中金債（５年） | 300,000,000 | 297,942,000 | |
| ７回　広島県・広島市折半保証広島高速道路債券 | 100,000,000 | 100,551,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | １５回　国際協力機構債 | 100,000,000 | 109,136,000 | |
| | ７２回　東日本高速道路社債 | 200,000,000 | 196,788,000 | |
| | ７７回　東日本高速道路社債 | 300,000,000 | 294,003,000 | |
| | ８５回　中日本高速道路債券 | 300,000,000 | 298,344,000 | |
| | ８７回　中日本高速道路債券 | 400,000,000 | 396,600,000 | |
| | ７１回　鉄道建設運輸施設債 | 100,000,000 | 100,673,000 | |
| | ７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 100,000,000 | 100,496,000 | |
| | ９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 200,000,000 | 190,420,000 | |
| 特殊債券　合計 | | 30,405,236,000 | 30,336,795,621 | |
| 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 | 290,553,000 | |
| | 2回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド） | 100,000,000 | 99,372,000 | |
| | 6回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債 | 200,000,000 | 200,302,000 | |
| | １１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６） | 100,000,000 | 97,860,000 | |
| | ２５回　首都高速道路社債 | 100,000,000 | 99,696,000 | |
| | ２７回　首都高速道路社債 | 400,000,000 | 397,144,000 | |
| | １６回　成田国際空港社債 | 100,000,000 | 100,625,000 | |
| | ３７回　成田国際空港社債 | 100,000,000 | 83,245,000 | |
| | ５７回　東日本高速道路社債 | 100,000,000 | 99,168,000 | |
| | ６７回　東日本高速道路社債 | 200,000,000 | 193,024,000 | |
| | ７９回　東日本高速道路社債 | 300,000,000 | 296,892,000 | |
| | ８３回　東日本高速道路社債 | 200,000,000 | 197,928,000 | |
| | ９０回　中日本高速道路債券 | 200,000,000 | 197,798,000 | |
| | ９１回　中日本高速道路債券 | 500,000,000 | 493,825,000 | |
| | ２５回　西日本高速道路社債 | 200,000,000 | 201,192,000 | |
| | ２６回　西日本高速道路社債 | 100,000,000 | 100,840,000 | |
| | ３３回　西日本高速道路債券 | 300,000,000 | 298,311,000 | |
| | ３４回　西日本高速道路債券 | 200,000,000 | 199,070,000 | |
| | ６１回　西日本高速道路債券 | 500,000,000 | 494,650,000 | |
| | ６２回　西日本高速道路債券 | 500,000,000 | 493,820,000 | |
| | ２４回　大和ハウス工業社債 | 200,000,000 | 198,068,000 | |
| | １０回　キリンホールディングス社債 | 100,000,000 | 100,640,000 | |
| | 3回　ダイドーグループＨＤ社債 | 300,000,000 | 289,872,000 | |
| | 9回　野村不動産ホールディングス社債 | 100,000,000 | 93,569,000 | |
| | １２回　セブン＆アイ・ホールディングス社債 | 100,000,000 | 101,066,000 | |
| | １４回　セブン＆アイ・ホールディングス社債 | 200,000,000 | 198,960,000 | |
| | ３０回　東レ社債 | 300,000,000 | 297,753,000 | |
| | ４２回　王子ホールディングス社債 | 200,000,000 | 198,490,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ４９回　住友化学社債 | 100,000,000 | 100,795,000 | |
| ２３回　三菱ケミカルホールディングス社債 | 200,000,000 | 186,292,000 | |
| ４０回　三菱ケミカルホールディングス社債 | 100,000,000 | 98,935,000 | |
| １７回　ダイセル社債 | 300,000,000 | 289,665,000 | |
| １６回　武田薬品工業社債 | 500,000,000 | 467,890,000 | |
| ４回　住友三井オートサービス社債 | 100,000,000 | 99,511,000 | |
| ４回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債 | 300,000,000 | 292,389,000 | |
| １４回　ブリヂストン社債 | 300,000,000 | 293,586,000 | |
| ３５回　三菱マテリアル社債 | 300,000,000 | 297,099,000 | |
| １７回　パナソニック社債 | 100,000,000 | 99,862,000 | |
| １９回　パナソニック社債 | 100,000,000 | 96,262,000 | |
| ２３回　パナソニック社債 | 200,000,000 | 190,826,000 | |
| ２９回　三菱重工業社債 | 100,000,000 | 100,616,000 | |
| ５８回　川崎重工業社債 | 300,000,000 | 284,760,000 | |
| 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 | 97,813,000 | |
| １６回　トヨタ自動車社債 | 200,000,000 | 201,050,000 | |
| ２６回　トヨタ自動車社債 | 200,000,000 | 198,424,000 | |
| ２６回　豊田通商社債 | 100,000,000 | 91,820,000 | |
| ７３回　三井物産社債 | 400,000,000 | 388,000,000 | |
| １２回　新生銀行社債 | 400,000,000 | 397,644,000 | |
| １３回　新生銀行社債 | 200,000,000 | 199,148,000 | |
| ８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債 | 100,000,000 | 107,605,000 | |
| １２回　りそな銀行劣後社債 | 100,000,000 | 106,280,000 | |
| ２０回　三井住友信託銀行社債 | 300,000,000 | 295,797,000 | |
| １０回　三井住友信託銀行社債 | 200,000,000 | 200,790,000 | |
| １１回　セブン銀行社債 | 200,000,000 | 200,904,000 | |
| ２８回　芙蓉総合リース社債 | 300,000,000 | 296,010,000 | |
| １７回　ＮＴＴファイナンス社債 | 300,000,000 | 296,295,000 | |
| １８回　ＮＴＴファイナンス社債 | 400,000,000 | 387,320,000 | |
| ６９回　ホンダファイナンス社債 | 300,000,000 | 296,814,000 | |
| ８１回　トヨタファイナンス社債 | 100,000,000 | 98,810,000 | |
| ９６回　トヨタファイナンス社債 | 100,000,000 | 99,273,000 | |
| ８０回　日立キャピタル社債 | 200,000,000 | 191,752,000 | |
| ８６回　日立キャピタル社債 | 300,000,000 | 285,846,000 | |
| ２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債 | 100,000,000 | 97,088,000 | |
| ２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債 | 200,000,000 | 197,400,000 | |
| ２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債 | 200,000,000 | 198,804,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債 | 200,000,000 | 191,366,000 | |
| ５６回　三菱ＵＦＪリース社債 | 300,000,000 | 296,199,000 | |
| 3回　野村ホールディングス社債 | 300,000,000 | 294,492,000 | |
| ７２回　三菱地所社債 | 100,000,000 | 103,366,000 | |
| １０６回　住友不動産社債 | 100,000,000 | 99,955,000 | |
| １０８回　住友不動産社債 | 200,000,000 | 198,590,000 | |
| ８０回　東京急行電鉄社債 | 100,000,000 | 102,299,000 | |
| ４３回　京浜急行電鉄社債 | 100,000,000 | 88,907,000 | |
| ３９回　東日本旅客鉄道社債 | 300,000,000 | 312,630,000 | |
| ４２回　東日本旅客鉄道社債 | 200,000,000 | 209,456,000 | |
| ６５回　東日本旅客鉄道普通社債 | 100,000,000 | 108,980,000 | |
| ７１回　東日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 107,439,000 | |
| ７３回　東日本旅客鉄道普通社債 | 200,000,000 | 217,998,000 | |
| １０７回　東日本旅客鉄道普通社債 | 100,000,000 | 93,800,000 | |
| １２５回　東日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 86,017,000 | |
| １２７回　東日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 89,769,000 | |
| １４７回　東日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 95,792,000 | |
| １６０回　東日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 71,246,000 | |
| １６３回　東日本旅客鉄道社債 | 300,000,000 | 296,766,000 | |
| １６５回　東日本旅客鉄道社債 | 200,000,000 | 167,712,000 | |
| １７１回　東日本旅客鉄道社債 | 200,000,000 | 150,356,000 | |
| ２１回　西日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 109,080,000 | |
| ６０回　西日本旅客鉄道社債 | 200,000,000 | 191,426,000 | |
| ７０回　西日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 77,057,000 | |
| ７１回　西日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 71,784,000 | |
| ７４回　西日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 94,327,000 | |
| ７５回　西日本旅客鉄道社債 | 200,000,000 | 167,186,000 | |
| １４回　東海旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 102,283,000 | |
| ３２回　東海旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 107,960,000 | |
| 4回　東京地下鉄社債 | 120,000,000 | 128,095,200 | |
| ４７回　東京地下鉄社債 | 100,000,000 | 70,700,000 | |
| 7回　ニッコンＨＤ社債 | 300,000,000 | 288,306,000 | |
| 6回　横浜高速鉄道社債 | 200,000,000 | 191,630,000 | |
| １２回　ソフトバンク社債 | 400,000,000 | 387,708,000 | |
| ３０回　光通信社債 | 200,000,000 | 180,290,000 | |
| ５２７回　中部電力社債 | 100,000,000 | 90,305,000 | |
| ５３２回　中部電力社債 | 200,000,000 | 190,014,000 | |
| ４９７回　関西電力社債 | 100,000,000 | 101,319,000 | |
| ５０８回　関西電力社債 | 300,000,000 | 296,820,000 | |
| ５３０回　関西電力社債 | 400,000,000 | 383,508,000 | |
| ５３１回　関西電力社債 | 200,000,000 | 170,430,000 | |
| ５４１回　関西電力社債 | 300,000,000 | 277,992,000 | |
| ３９６回　中国電力社債 | 200,000,000 | 188,160,000 | |
| ４２５回　中国電力社債 | 100,000,000 | 94,676,000 | |
| ３０７回　北陸電力社債 | 100,000,000 | 101,848,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ３１１回　北陸電力社債 | 100,000,000 | 100,623,000 | |
| | ４８８回　東北電力社債 | 100,000,000 | 98,864,000 | |
| | ５２１回　東北電力社債 | 400,000,000 | 380,720,000 | |
| | ５２５回　東北電力社債 | 200,000,000 | 195,010,000 | |
| | ５３６回　東北電力社債 | 300,000,000 | 276,513,000 | |
| | ３２０回　四国電力社債 | 300,000,000 | 281,589,000 | |
| | ４２６回　九州電力社債 | 400,000,000 | 403,268,000 | |
| | ４２８回　九州電力社債 | 100,000,000 | 100,901,000 | |
| | ４６３回　九州電力社債 | 100,000,000 | 88,834,000 | |
| | ４６６回　九州電力社債 | 100,000,000 | 87,590,000 | |
| | ４９１回　九州電力社債 | 300,000,000 | 278,553,000 | |
| | ４９２回　九州電力社債 | 100,000,000 | 82,091,000 | |
| | ４９３回　九州電力社債 | 200,000,000 | 196,634,000 | |
| | ５０７回　九州電力社債 | 200,000,000 | 189,256,000 | |
| | ３２１回　北海道電力社債 | 261,000,000 | 263,711,790 | |
| | ３４０回　北海道電力社債 | 300,000,000 | 296,514,000 | |
| | ３５０回　北海道電力社債 | 200,000,000 | 176,838,000 | |
| | １３回　電源開発社債 | 200,000,000 | 207,870,000 | |
| | ５４回　電源開発社債 | 100,000,000 | 98,167,000 | |
| | ７５回　電源開発社債 | 200,000,000 | 185,164,000 | |
| | ４１回　東京瓦斯社債 | 200,000,000 | 180,404,000 | |
| | ５２回　東京瓦斯社債 | 100,000,000 | 85,177,000 | |
| | ５５回　東京瓦斯社債 | 100,000,000 | 81,660,000 | |
| | ５７回　東京瓦斯社債 | 300,000,000 | 200,550,000 | |
| | ７回　ファーストリテイリング社債 | 200,000,000 | 197,790,000 | |
| | ８回　ファーストリテイリング社債 | 200,000,000 | 182,548,000 | |
| 社債券　合計 | | 27,281,000,000 | 26,305,786,990 | |
| 合計 | | | 544,187,071,679 | |

**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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 20,045,538,691 |
| コール・ローン | 701,245,493 |
| 株式 | 758,902,393,554 |
| 投資信託受益証券 | 1,387,813,868 |
| 投資証券 | 16,438,191,165 |
| 派生商品評価勘定 | 453,572,789 |
| 未収配当金 | 727,005,199 |
| 差入委託証拠金 | 5,000,860,885 |
| 流動資産合計 | 803,656,621,644 |
| 資産合計 | 803,656,621,644 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 157,739,693 |
| 未払解約金 | 132,471,000 |
| 流動負債合計 | 290,210,693 |
| 負債合計 | 290,210,693 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 136,103,425,952 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 667,262,984,999 |
| 元本等合計 | 803,366,410,951 |
| 純資産合計 | 803,366,410,951 |
| 負債純資産合計 | 803,656,621,644 |

**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1月12日<br>至　2023年1月11日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br>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。<br><br>投資信託受益証券<br>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。<br><br>投資証券<br>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<br>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。<br><br>為替予約取引<br>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<br>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<br>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 | 2023年1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 | 110,505,806,204円 |
| 同期中追加設定元本額 | 67,449,577,662円 |
| 同期中一部解約元本額 | 41,851,957,914円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド | 2,885,896,332円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型） | 1,570,182円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型） | 9,868,791円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型） | 31,635,755円 |

| | |
|---|---|
| グローバル８資産ラップファンド（安定型） | 19,806,701円 |
| グローバル８資産ラップファンド（中立型） | 13,703,681円 |
| グローバル８資産ラップファンド（積極型） | 20,015,732円 |
| たわらノーロード　先進国株式 | 41,780,071,157円 |
| たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞ | 389,136,980円 |
| たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞ | 3,122,498,117円 |
| たわらノーロード　バランス（８資産均等型） | 803,536,592円 |
| たわらノーロード　バランス（堅実型） | 84,703,395円 |
| たわらノーロード　バランス（標準型） | 729,563,804円 |
| たわらノーロード　バランス（積極型） | 919,101,327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） | 154,199,702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） | 458,086,442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） | 374,127,446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） | 547,399,793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） | 650,130円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型） | 20,500,198円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（成長型） | 3,440,777円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（積極型） | 11,584,238円 |
| たわらノーロード　全世界株式 | 569,971,854円 |
| ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞ | 55,261,932,028円 |
| Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド | 2,740,957,547円 |
| Ｏｎｅグローバルバランス | 3,936,160円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型 | 157,051,956円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型 | 801,207,495円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型 | 1,049,854,726円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド | 95,890,173円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド | 254,881,313円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド | 249,599,739円 |
| マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞ | 17,255,462円 |
| マネックス資産設計ファンド＜育成型＞ | 625,170,428円 |
| マネックス資産設計ファンド　エボリューション | 123,209,099円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０） | 170,887,344円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０） | 197,773,572円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０） | 320,757,125円 |
| 投資のソムリエ | 5,525,197,498円 |
| クルーズコントロール | 19,684,327円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞ | 399,404,474円 |
| ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ | 208,870,039円 |
| ４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞ | 236,034,860円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型 | 399,920,075円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド | 1,735,334,229円 |
| ワールドアセットバランス（基本コース） | 144,201,865円 |
| ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） | 95,332,662円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５） | 24,827,000円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５） | 12,452,181円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ） | 2,750,822円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５） | 57,205,642円 |
| ４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 140,719,146円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 119,987,740円 |
| ９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 156,421,181円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０） | 29,873,525円 |

| | |
|---|---|
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０） | 13,325,336円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０） | 8,232,922円 |
| ４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞ | 103,406,568円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５） | 1,745,486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） | 1,221,926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） | 1,199,488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） | 758,879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） | 1,198,559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） | 852,212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） | 1,104,248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） | 449,088,232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） | 40,493,896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） | 1,109,106,982円 |
| ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定） | 201,377,880円 |
| 外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定） | 1,060,843,381円 |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定） | 144,027,954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） | 1,328,457円 |
| ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 7,216,287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） | 2,045,203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） | 2,912,731円 |
| しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定） | 4,654,846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） | 25,783,979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） | 50,456,413円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 1,920,456円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 17,480,514円 |
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 1,277,021円 |
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 34,214円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 3,340,512円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 22,406,686円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 163,013,861円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 260,240,407円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 873,451,334円 |
| ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定） | 45,680,614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） | 38,311,434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） | 257,785,829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） | 10,455,792円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 172,664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） | 105,292,969円 |
| ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 9,122,401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） | 30,924,908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） | 47,291,972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） | 99,789,660円 |
| 動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞ | 9,895,958円 |
| コア資産形成ファンド | 6,569,591円 |
| ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ） | 3,727,423,300円 |
| ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド | 140,470,398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） | 6,736,066円 |
| ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］ | 1,261,770,351円 |
| ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］ | 1,400,076,236円 |
| 計 | 136,103,425,952円 |
| ２．　受益権の総数 | 136,103,425,952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1月12日<br>至　2023年1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。<br>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 | 2023年1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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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 | 2023年1月11日現在<br>当期の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|
| 株式 | △60,154,235,810 |
| 投資信託受益証券 | △132,076,139 |
| 投資証券 | △2,537,503,657 |
| 合計 | △62,823,815,606 |

（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2023年1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 | 2023年1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 | 2,311,216,779 | － | 2,313,345,425 | 2,128,646 |
| アメリカ・ドル | 1,700,614,930 | － | 1,701,987,236 | 1,372,306 |
| イギリス・ポンド | 113,533,458 | － | 113,637,115 | 103,657 |
| オーストラリア・ドル | 59,403,762 | － | 59,445,638 | 41,876 |
| カナダ・ドル | 76,288,536 | － | 76,289,464 | 928 |
| ユーロ | 361,376,093 | － | 361,985,972 | 609,879 |
| 合計 | 2,311,216,779 | － | 2,313,345,425 | 2,128,646 |

（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 | 2023年1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 | 28,175,361,223 | － | 28,469,065,673 | 293,704,450 |
| 合計 | 28,175,361,223 | － | 28,469,065,673 | 293,704,450 |

（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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 5.9026円 |
| （1万口当たり純資産額） | (59,026円) |

附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

2023年1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 | 1,118,663 | 89.870 | 100,534,243.810 | |
| | ABBOTT LABORATORIES | 213,851 | 113.850 | 24,346,936.350 | |
| | AES CORP | 79,505 | 27.230 | 2,164,921.150 | |
| | INTL BUSINESS MACHINES CORP | 108,940 | 144.800 | 15,774,512.000 | |
| | ADVANCED MICRO DEVICES | 195,897 | 68.050 | 13,330,790.850 | |
| | ADOBE INC | 57,266 | 338.700 | 19,395,994.200 | |
| | CHUBB LTD | 50,533 | 224.770 | 11,358,302.410 | |
| | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 26,919 | 312.670 | 8,416,763.730 | |
| | ALLSTATE CORP | 32,939 | 141.260 | 4,652,963.140 | |
| | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 82,340 | 211.340 | 17,401,735.600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| AMGEN INC | 65,395 | 273.880 | 17,910,382.600 | |
| HESS CORP | 33,470 | 143.620 | 4,806,961.400 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 77,915 | 152.000 | 11,843,080.000 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 62,653 | 97.280 | 6,094,883.840 | |
| AFLAC INC | 72,673 | 72.000 | 5,232,456.000 | |
| AMERICAN INTL GROUP | 93,843 | 63.450 | 5,954,338.350 | |
| ANALOG DEVICES | 63,336 | 169.220 | 10,717,717.920 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 82,900 | 67.310 | 5,579,999.000 | |
| VALERO ENERGY CORP | 48,490 | 132.010 | 6,401,164.900 | |
| ANSYS INC | 10,831 | 248.400 | 2,690,420.400 | |
| APPLE INC | 1,959,610 | 130.730 | 256,179,815.300 | |
| APPLIED MATERIALS INC | 106,803 | 108.040 | 11,538,996.120 | |
| ALBEMARLE CORP | 13,961 | 223.900 | 3,125,867.900 | |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 69,412 | 86.230 | 5,985,396.760 | |
| AMEREN CORP | 31,621 | 89.120 | 2,818,063.520 | |
| ARROW ELECTRONICS INC | 9,936 | 111.210 | 1,104,982.560 | |
| AUTODESK INC | 26,907 | 193.430 | 5,204,621.010 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 50,947 | 240.780 | 12,267,018.660 | |
| AUTOZONE INC | 2,313 | 2,435.520 | 5,633,357.760 | |
| AVERY DENNISON CORP | 9,514 | 189.730 | 1,805,091.220 | |
| BALL CORP | 36,411 | 56.090 | 2,042,292.990 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 158,774 | 316.350 | 50,228,154.900 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 90,954 | 48.010 | 4,366,701.540 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 63,174 | 45.740 | 2,889,578.760 | |
| BECTON DICKINSON & CO | 35,061 | 255.370 | 8,953,527.570 | |
| AMETEK INC | 27,428 | 142.810 | 3,916,992.680 | |
| VERIZON COMM INC | 514,992 | 41.950 | 21,603,914.400 | |
| WR BERKLEY CORP | 29,191 | 73.350 | 2,141,159.850 | |
| BEST BUY CO INC | 25,405 | 84.270 | 2,140,879.350 | |
| BIO-RAD LABORATORIES-CL A | 3,021 | 432.920 | 1,307,851.320 | |
| YUM! BRANDS INC | 33,465 | 129.400 | 4,330,371.000 | |
| FIRSTENERGY CORP | 67,213 | 42.590 | 2,862,601.670 | |
| BOEING CO | 68,391 | 206.690 | 14,135,735.790 | |
| ROBERT HALF INTL INC | 14,456 | 75.050 | 1,084,922.800 | |
| BORGWARNER INC | 27,800 | 43.070 | 1,197,346.000 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 175,352 | 46.060 | 8,076,713.120 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 14,494 | 92.800 | 1,345,043.200 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 19,529 | 105.530 | 2,060,895.370 | |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC | 2,731 | 1,520.860 | 4,153,468.660 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 257,999 | 71.650 | 18,485,628.350 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ONEOK INC | 52,652 | 69.310 | 3,649,310.120 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 7,891 | 140.980 | 1,112,473.180 | |
| UNITED RENTALS INC | 8,287 | 381.470 | 3,161,241.890 | |
| SEMPRA ENERGY | 38,567 | 157.510 | 6,074,688.170 | |
| FEDEX CORP | 29,483 | 188.740 | 5,564,621.420 | |
| VERISIGN INC | 11,850 | 208.000 | 2,464,800.000 | |
| AMPHENOL CORP | 71,112 | 79.300 | 5,639,181.600 | |
| BROWN-FORMAN CORP | 38,405 | 65.260 | 2,506,310.300 | |
| QUANTA SERVICES INC | 17,560 | 139.510 | 2,449,795.600 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 101,765 | 5.910 | 601,431.150 | |
| CSX CORP | 263,536 | 32.400 | 8,538,566.400 | |
| COTERRA ENERGY INC | 99,916 | 25.080 | 2,505,893.280 | |
| CAMPBELL SOUP CO | 26,978 | 56.000 | 1,510,768.000 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 19,343 | 220.000 | 4,255,460.000 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 31,857 | 78.130 | 2,488,987.410 | |
| CARLISLE COS INC | 6,119 | 238.850 | 1,461,523.150 | |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED | 132,291 | 9.680 | 1,280,576.880 | |
| CATERPILLAR INC | 64,631 | 250.510 | 16,190,711.810 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 12,631 | 124.640 | 1,574,327.840 | |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC | 97,073 | 5.600 | 543,608.800 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 357,732 | 138.600 | 49,581,655.200 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 30,236 | 81.290 | 2,457,884.440 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 19,878 | 110.510 | 2,196,717.780 | |
| CINTAS CORP | 11,173 | 444.970 | 4,971,649.810 | |
| CISCO SYSTEMS INC | 505,907 | 48.810 | 24,693,320.670 | |
| CLEVELAND-CLIFFS INC | 56,364 | 18.810 | 1,060,206.840 | |
| CLOROX COMPANY | 14,322 | 140.980 | 2,019,115.560 | |
| COCA-COLA CO/THE | 502,166 | 62.130 | 31,199,573.580 | |
| COPART INC | 54,011 | 61.620 | 3,328,157.820 | |
| COGNEX CORP | 20,432 | 51.720 | 1,056,743.040 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 96,159 | 78.310 | 7,530,211.290 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 32,963 | 153.160 | 5,048,613.080 | |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 7,434 | 292.000 | 2,170,728.000 | |
| NRG ENERGY, INC. | 28,364 | 32.860 | 932,041.040 | |
| COMCAST CORP-CL A | 541,547 | 37.880 | 20,513,800.360 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 55,843 | 40.440 | 2,258,290.920 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 43,855 | 98.090 | 4,301,736.950 | |
| CMS ENERGY CORP | 36,603 | 64.890 | 2,375,168.670 | |
| COOPER COS INC | 6,342 | 343.850 | 2,180,696.700 | |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO | 21,281 | 50.860 | 1,082,351.660 | |
| CORNING INC | 95,758 | 35.840 | 3,431,966.720 | |
| WOLFSPEED INC | 15,684 | 74.230 | 1,164,223.320 | |
| SEALED AIR CORP | 17,610 | 53.940 | 949,883.400 | |
| HEICO CORP-CL A | 9,463 | 122.730 | 1,161,393.990 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CUMMINS INC | 16,869 | 247.720 | 4,178,788.680 | |
| DARLING INTERNATIONAL INC | 20,032 | 65.480 | 1,311,695.360 | |
| DR HORTON INC | 40,602 | 93.580 | 3,799,535.160 | |
| DANAHER CORP | 84,457 | 266.890 | 22,540,728.730 | |
| MOODY'S CORP | 20,682 | 297.250 | 6,147,724.500 | |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 62,906 | 61.210 | 3,850,476.260 | |
| TARGET CORP | 55,931 | 155.970 | 8,723,558.070 | |
| DEERE & CO | 35,044 | 437.430 | 15,329,296.920 | |
| MORGAN STANLEY | 157,543 | 88.920 | 14,008,723.560 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 27,024 | 125.170 | 3,382,594.080 | |
| COSTAR GROUP INC | 47,398 | 77.830 | 3,688,986.340 | |
| THE WALT DISNEY CO | 223,809 | 95.560 | 21,387,188.040 | |
| DOLLAR TREE INC | 26,771 | 145.880 | 3,905,353.480 | |
| DOVER CORP | 17,842 | 139.300 | 2,485,390.600 | |
| OMNICOM GROUP | 26,570 | 85.800 | 2,279,706.000 | |
| DTE ENERGY CO | 23,792 | 120.020 | 2,855,515.840 | |
| DUKE ENERGY CORP | 94,043 | 105.430 | 9,914,953.490 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 15,676 | 150.310 | 2,356,259.560 | |
| EBAY INC | 67,667 | 45.090 | 3,051,105.030 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 883,002 | 34.120 | 30,128,028.240 | |
| CITIGROUP INC | 233,298 | 48.190 | 11,242,630.620 | |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 16,790 | 89.630 | 1,504,887.700 | |
| EATON CORP PLC | 47,526 | 160.410 | 7,623,645.660 | |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 32,734 | 164.320 | 5,378,850.880 | |
| DISH NETWORK CORP | 24,416 | 14.830 | 362,089.280 | |
| ECOLAB INC | 30,824 | 152.200 | 4,691,412.800 | |
| PERKINELMER INC | 15,649 | 133.400 | 2,087,576.600 | |
| ELECTRONIC ARTS INC | 33,011 | 124.020 | 4,094,024.220 | |
| SALESFORCE INC | 122,661 | 147.440 | 18,085,137.840 | |
| ERIE INDEMNITY CO | 3,372 | 253.060 | 853,318.320 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 71,700 | 97.820 | 7,013,694.000 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 17,567 | 114.300 | 2,007,908.100 | |
| ENTERGY CORP | 23,769 | 107.730 | 2,560,634.370 | |
| EOG RESOURCES INC | 71,192 | 127.610 | 9,084,811.120 | |
| EQUIFAX INC | 15,156 | 205.000 | 3,106,980.000 | |
| EQT CORP | 40,996 | 34.040 | 1,395,503.840 | |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE | 28,280 | 262.450 | 7,422,086.000 | |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL | 19,974 | 108.540 | 2,167,977.960 | |
| EXXON MOBIL CORP | 509,183 | 110.090 | 56,055,956.470 | |
| FMC CORP | 15,534 | 128.700 | 1,999,225.800 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 239,711 | 84.540 | 20,265,167.940 | |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 4,716 | 409.280 | 1,930,164.480 | |
| FAIR ISAAC CORP | 2,962 | 585.860 | 1,735,317.320 | |
| ASSURANT INC | 5,823 | 126.520 | 736,725.960 | |
| FASTENAL CO | 68,855 | 48.500 | 3,339,467.500 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 84,362 | 34.460 | 2,907,114.520 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| M&T BANK CORP | 20,766 | 148.000 | 3,073,368.000 | |
| FIRST HORIZON CORP | 69,634 | 24.550 | 1,709,514.700 | |
| FISERV INC | 73,824 | 101.040 | 7,459,176.960 | |
| FORD MOTOR CO | 479,168 | 12.840 | 6,152,517.120 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 37,916 | 29.150 | 1,105,251.400 | |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 172,370 | 44.710 | 7,706,662.700 | |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 1,587 | 801.980 | 1,272,742.260 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 26,269 | 192.680 | 5,061,510.920 | |
| DENTSPLY SIRONA INC | 25,599 | 33.320 | 852,958.680 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 28,725 | 247.540 | 7,110,586.500 | |
| GENERAL MILLS INC | 72,417 | 84.050 | 6,086,648.850 | |
| GENUINE PARTS CO | 17,374 | 169.750 | 2,949,236.500 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 151,364 | 87.140 | 13,189,858.960 | |
| GARTNER INC | 9,564 | 331.990 | 3,175,152.360 | |
| MCKESSON CORP | 17,325 | 382.670 | 6,629,757.750 | |
| NVIDIA CORP | 304,283 | 159.090 | 48,408,382.470 | |
| GENERAL ELECTRIC CO | 132,408 | 75.270 | 9,966,350.160 | |
| WW GRAINGER INC | 5,466 | 563.920 | 3,082,386.720 | |
| HALLIBURTON CO | 111,570 | 40.940 | 4,567,675.800 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 47,224 | 100.530 | 4,747,428.720 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 41,654 | 357.360 | 14,885,473.440 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 24,320 | 201.950 | 4,911,424.000 | |
| HASBRO INC | 15,437 | 64.480 | 995,377.760 | |
| HENRY SCHEIN INC | 17,431 | 79.970 | 1,393,957.070 | |
| HEICO CORP | 5,185 | 157.430 | 816,274.550 | |
| HERSHEY FOODS CORP | 18,695 | 224.780 | 4,202,262.100 | |
| HP INC | 125,955 | 29.090 | 3,664,030.950 | |
| F5 INC | 6,924 | 143.940 | 996,640.560 | |
| CROWN HOLDINGS INC NPR | 15,322 | 85.240 | 1,306,047.280 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 43,715 | 31.830 | 1,391,448.450 | |
| HOLOGIC INC | 30,695 | 80.570 | 2,473,096.150 | |
| HOME DEPOT INC | 125,091 | 320.630 | 40,107,927.330 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 22,880 | 111.400 | 2,548,832.000 | |
| HORMEL FOODS CORP | 34,578 | 45.910 | 1,587,475.980 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 78,791 | 30.560 | 2,407,852.960 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 3,602 | 248.360 | 894,592.720 | |
| HUBBELL INC | 6,903 | 234.750 | 1,620,479.250 | |
| HUMANA INC | 15,368 | 481.590 | 7,401,075.120 | |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 10,348 | 175.380 | 1,814,832.240 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 181,491 | 14.470 | 2,626,174.770 | |
| BIOGEN INC | 17,603 | 281.460 | 4,954,540.380 | |
| IDEX CORP | 9,065 | 234.800 | 2,128,462.000 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 37,531 | 227.480 | 8,537,551.880 | |
| INTUIT INC | 32,479 | 388.680 | 12,623,937.720 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| IDEXX LABORATORIES INC | 10,162 | 469.110 | 4,767,095.820 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 27,989 | 178.930 | 5,008,071.770 | |
| INTEL CORP | 497,669 | 29.440 | 14,651,375.360 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 31,979 | 115.990 | 3,709,244.210 | |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 44,153 | 37.620 | 1,661,035.860 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 45,679 | 35.690 | 1,630,283.510 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 8,152 | 178.370 | 1,454,072.240 | |
| INCYTE CORP | 24,449 | 79.550 | 1,944,917.950 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 320,456 | 175.160 | 56,131,072.960 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 39,402 | 76.200 | 3,002,432.400 | |
| KLA CORPORATION | 17,734 | 416.270 | 7,382,132.180 | |
| DEVON ENERGY CORP | 74,759 | 63.130 | 4,719,535.670 | |
| KELLOGG CO | 29,915 | 70.750 | 2,116,486.250 | |
| KEYCORP | 106,247 | 18.210 | 1,934,757.870 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 42,173 | 135.860 | 5,729,623.780 | |
| BLACKROCK INC/NEW YORK | 18,251 | 757.280 | 13,821,117.280 | |
| KROGER CO | 82,775 | 45.980 | 3,805,994.500 | |
| LAM RESEARCH CORP | 16,432 | 458.610 | 7,535,879.520 | |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 5,890 | 409.250 | 2,410,482.500 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 11,029 | 132.730 | 1,463,879.170 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 20,036 | 87.390 | 1,750,946.040 | |
| PLUG POWER INC | 56,149 | 14.950 | 839,427.550 | |
| LENNAR CORP | 29,937 | 96.570 | 2,891,016.090 | |
| ELI LILLY & CO | 98,682 | 352.750 | 34,810,075.500 | |
| BATH & BODY WORKS INC | 28,156 | 45.800 | 1,289,544.800 | |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 17,937 | 31.460 | 564,298.020 | |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 89,557 | 178.770 | 16,010,104.890 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 35,535 | 155.230 | 5,516,098.050 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 28,941 | 462.290 | 13,379,134.890 | |
| LOEWS CORP | 23,530 | 59.040 | 1,389,211.200 | |
| LOWE'S COS INC | 75,785 | 201.400 | 15,263,099.000 | |
| DOMINION ENERGY INC | 101,828 | 61.830 | 6,296,025.240 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 40,401 | 38.850 | 1,569,578.850 | |
| MCCORMICK & CO INC | 29,367 | 84.370 | 2,477,693.790 | |
| MCDONALD'S CORPORATION | 89,724 | 268.910 | 24,127,680.840 | |
| S&P GLOBAL INC | 41,825 | 354.390 | 14,822,361.750 | |
| EVEREST RE GROUP LTD | 5,353 | 358.950 | 1,921,459.350 | |
| MARKEL CORPORATION | 1,674 | 1,371.670 | 2,296,175.580 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 77,695 | 77.020 | 5,984,068.900 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 61,050 | 170.390 | 10,402,309.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MASCO CORP | 28,937 | 50.810 | 1,470,288.970 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 7,736 | 343.960 | 2,660,874.560 | |
| METLIFE INC | 81,792 | 71.570 | 5,853,853.440 | |
| MEDTRONIC PLC | 161,408 | 78.890 | 12,733,477.120 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 94,367 | 77.690 | 7,331,372.230 | |
| CVS HEALTH CORP | 158,698 | 90.650 | 14,385,973.700 | |
| MERCK & CO.INC. | 309,456 | 110.810 | 34,290,819.360 | |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 54,362 | 64.270 | 3,493,845.740 | |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 10,593 | 245.290 | 2,598,356.970 | |
| MICROSOFT CORP | 863,965 | 228.850 | 197,718,390.250 | |
| MICRON TECH INC | 135,654 | 57.210 | 7,760,765.340 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 66,120 | 75.450 | 4,988,754.000 | |
| 3M CO | 67,396 | 128.130 | 8,635,449.480 | |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 6,311 | 115.150 | 726,711.650 | |
| ENTEGRIS INC | 17,709 | 76.440 | 1,353,675.960 | |
| CHARLES RIVER LABORATORIES INT | 6,445 | 234.130 | 1,508,967.850 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 20,578 | 262.350 | 5,398,638.300 | |
| ILLUMINA INC | 18,747 | 194.450 | 3,645,354.150 | |
| XCEL ENERGY INC | 64,922 | 72.110 | 4,681,525.420 | |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 11,716 | 109.770 | 1,286,065.320 | |
| NETAPP INC | 24,953 | 64.210 | 1,602,232.130 | |
| NEWELL BRANDS INC | 41,984 | 14.660 | 615,485.440 | |
| NEWMONT CORP | 99,287 | 53.150 | 5,277,104.050 | |
| NVR INC | 365 | 4,828.530 | 1,762,413.450 | |
| NIKE INC-CL B | 155,133 | 125.840 | 19,521,936.720 | |
| NORDSON CORP | 6,447 | 241.450 | 1,556,628.150 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 28,997 | 254.650 | 7,384,086.050 | |
| EVERSOURCE ENERGY | 43,042 | 85.690 | 3,688,268.980 | |
| NISOURCE INC | 53,270 | 27.560 | 1,468,121.200 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 24,836 | 94.840 | 2,355,446.240 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 17,823 | 495.790 | 8,836,465.170 | |
| WELLS FARGO & CO | 462,740 | 42.360 | 19,601,666.400 | |
| NUCOR CORP | 31,660 | 151.160 | 4,785,725.600 | |
| CHENIERE ENERGY INC | 27,166 | 146.510 | 3,980,090.660 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 46,654 | 98.500 | 4,595,419.000 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 114,744 | 64.150 | 7,360,827.600 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 11,630 | 306.600 | 3,565,758.000 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 7,757 | 826.880 | 6,414,108.160 | |
| ORACLE CORP | 192,714 | 86.500 | 16,669,761.000 | |
| PACCAR INC | 43,201 | 100.490 | 4,341,268.490 | |
| PTC INC | 13,665 | 127.400 | 1,740,921.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EXELON CORP | 121,664 | 43.690 | 5,315,500.160 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 15,434 | 310.500 | 4,792,257.000 | |
| PAYCHEX INC | 38,461 | 117.310 | 4,511,859.910 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 8,596 | 232.250 | 1,996,421.000 | |
| PPL CORPORATION | 88,737 | 30.170 | 2,677,195.290 | |
| PEPSICO INC | 168,777 | 177.850 | 30,016,989.450 | |
| PENTAIR PLC | 19,804 | 47.980 | 950,195.920 | |
| PFIZER INC | 684,875 | 47.620 | 32,613,747.500 | |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 32,796 | 48.800 | 1,600,444.800 | |
| CONOCOPHILLIPS | 155,665 | 118.080 | 18,380,923.200 | |
| PG&E CORP | 178,257 | 15.940 | 2,841,416.580 | |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 27,268 | 231.160 | 6,303,270.880 | |
| ALTRIA GROUP INC | 218,091 | 45.990 | 10,030,005.090 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 49,864 | 164.940 | 8,224,568.160 | |
| BROWN & BROWN INC | 30,650 | 59.870 | 1,835,015.500 | |
| GARMIN LTD | 17,835 | 98.920 | 1,764,238.200 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 28,341 | 129.780 | 3,678,094.980 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 54,129 | 481.400 | 26,057,700.600 | |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 27,707 | 117.200 | 3,247,260.400 | |
| QUEST DIAGNOSTICS | 14,536 | 152.540 | 2,217,321.440 | |
| PROCTER & GAMBLE CO | 291,314 | 151.890 | 44,247,683.460 | |
| PROGRESSIVE CORP | 70,907 | 133.020 | 9,432,049.140 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 60,100 | 63.670 | 3,826,567.000 | |
| PULTE GROUP INC | 29,050 | 48.430 | 1,406,891.500 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 33,653 | 105.310 | 3,543,997.430 | |
| QUALCOMM INC | 137,686 | 116.910 | 16,096,870.260 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 23,437 | 110.970 | 2,600,803.890 | |
| EXACT SCIENCES CORP | 23,386 | 60.090 | 1,405,264.740 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 12,959 | 698.950 | 9,057,693.050 | |
| REPLIGEN CORP | 6,730 | 168.450 | 1,133,668.500 | |
| RESMED INC | 17,366 | 212.680 | 3,693,400.880 | |
| US BANCORP | 170,632 | 46.660 | 7,961,689.120 | |
| SEAGEN INC | 16,860 | 132.500 | 2,233,950.000 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 45,851 | 63.070 | 2,891,822.570 | |
| ROSS STORES INC | 42,360 | 119.790 | 5,074,304.400 | |
| ROLLINS INC | 25,920 | 36.500 | 946,080.000 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 13,120 | 443.460 | 5,818,195.200 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 13,905 | 271.660 | 3,777,432.300 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 27,477 | 58.930 | 1,619,219.610 | |
| RPM INTERNATIONAL INC | 16,467 | 86.810 | 1,429,500.270 | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 77,236 | 274.930 | 21,234,493.480 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 168,645 | 67.310 | 11,351,494.950 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 13,232 | 253.380 | 3,352,724.160 | |
| THE TRAVELERS COMPANIES INC | 29,595 | 191.220 | 5,659,155.900 | |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 75,043 | 69.000 | 5,177,967.000 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 4,811 | 2,220.950 | 10,684,990.450 | |
| SCHLUMBERGER LTD | 171,376 | 55.960 | 9,590,200.960 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 175,962 | 85.620 | 15,065,866.440 | |
| POOL CORP | 4,660 | 325.060 | 1,514,779.600 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 26,144 | 125.500 | 3,281,072.000 | |
| BUNGE LTD | 18,642 | 97.510 | 1,817,781.420 | |
| SEI INVESTMENTS CO | 14,477 | 60.990 | 882,952.230 | |
| ELEVANCE HEALTH INC | 29,398 | 470.680 | 13,837,050.640 | |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 19,104 | 167.260 | 3,195,335.040 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 29,468 | 87.620 | 2,581,986.160 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 30,476 | 234.100 | 7,134,431.600 | |
| CENTENE CORP | 70,080 | 76.120 | 5,334,489.600 | |
| SVB FINANCIAL GROUP | 7,330 | 252.680 | 1,852,144.400 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 14,856 | 59.860 | 889,280.160 | |
| SNAP-ON INC | 6,118 | 244.420 | 1,495,361.560 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 44,592 | 99.350 | 4,430,215.200 | |
| ADVANCE AUTO PARTS | 7,165 | 151.970 | 1,088,865.050 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 45,008 | 68.200 | 3,069,545.600 | |
| SOUTHERN CO | 131,528 | 71.110 | 9,352,956.080 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 160,237 | 46.000 | 7,370,902.000 | |
| SOUTHWEST AIRLINES | 19,700 | 36.210 | 713,337.000 | |
| AT&T INC | 860,287 | 19.470 | 16,749,787.890 | |
| CHEVRON CORP | 227,013 | 176.040 | 39,963,368.520 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 19,270 | 84.030 | 1,619,258.100 | |
| STATE STREET CORP | 46,198 | 81.460 | 3,763,289.080 | |
| STARBUCKS CORP | 138,714 | 106.000 | 14,703,684.000 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 22,937 | 106.860 | 2,451,047.820 | |
| STRYKER CORP | 41,473 | 263.810 | 10,940,992.130 | |
| NETFLIX INC | 53,857 | 327.540 | 17,640,321.780 | |
| GEN DIGITAL INC | 73,086 | 21.600 | 1,578,657.600 | |
| KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 16,730 | 55.310 | 925,336.300 | |
| SYNOPSYS INC | 18,779 | 327.630 | 6,152,563.770 | |
| SYSCO CORP | 62,521 | 79.960 | 4,999,179.160 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 43,844 | 271.360 | 11,897,507.840 | |
| TELEFLEX INC | 5,532 | 259.480 | 1,435,443.360 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 134,781 | 10.990 | 1,481,243.190 | |
| TERADYNE INC | 18,512 | 94.780 | 1,754,567.360 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 111,714 | 178.400 | 19,929,777.600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TEXTRON INC | 25,824 | 70.840 | 1,829,372.160 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 47,854 | 568.030 | 27,182,507.620 | |
| GLOBE LIFE INC | 12,153 | 121.530 | 1,476,954.090 | |
| DAVITA INC | 6,813 | 79.780 | 543,541.140 | |
| TRACTOR SUPPLY CO | 13,690 | 221.740 | 3,035,620.600 | |
| BIO-TECHNE CORP | 20,652 | 86.540 | 1,787,224.080 | |
| TRIMBLE INC | 28,676 | 52.500 | 1,505,490.000 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 5,300 | 313.070 | 1,659,271.000 | |
| TYSON FOODS INC | 35,684 | 65.580 | 2,340,156.720 | |
| UGI CORP | 24,160 | 40.450 | 977,272.000 | |
| MARATHON OIL CORP | 84,059 | 27.010 | 2,270,433.590 | |
| UNION PACIFIC CORP | 76,466 | 212.280 | 16,232,202.480 | |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 179,195 | 99.920 | 17,905,164.400 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 114,300 | 486.000 | 55,549,800.000 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 8,096 | 147.500 | 1,194,160.000 | |
| VF CORP | 37,887 | 29.970 | 1,135,473.390 | |
| PARAMOUNT GLOBAL | 67,467 | 19.890 | 1,341,918.630 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 31,026 | 288.750 | 8,958,757.500 | |
| VULCAN MATERIALS CO | 16,452 | 176.750 | 2,907,891.000 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 91,706 | 36.700 | 3,365,610.200 | |
| WALMART INC | 184,019 | 144.860 | 26,656,992.340 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 50,578 | 154.910 | 7,835,037.980 | |
| WATERS CORP | 7,511 | 335.930 | 2,523,170.230 | |
| WEBSTER FINANCIAL CORP | 22,285 | 47.470 | 1,057,868.950 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 8,653 | 245.930 | 2,128,032.290 | |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 12,679 | 159.020 | 2,016,214.580 | |
| VAIL RESORTS INC | 5,235 | 250.630 | 1,312,048.050 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 35,421 | 38.170 | 1,352,019.570 | |
| WABTEC CORP | 20,273 | 101.240 | 2,052,438.520 | |
| WHIRLPOOL CORP | 6,832 | 154.700 | 1,056,910.400 | |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 18,833 | 97.510 | 1,836,405.830 | |
| WYNN RESORTS LTD | 12,757 | 97.470 | 1,243,424.790 | |
| NASDAQ INC | 41,596 | 62.540 | 2,601,413.840 | |
| CME GROUP INC | 44,342 | 177.500 | 7,870,705.000 | |
| WILLIAMS COS INC | 151,890 | 32.140 | 4,881,744.600 | |
| LKQ CORP | 31,504 | 56.170 | 1,769,579.680 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 29,066 | 54.970 | 1,597,758.020 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 38,318 | 96.720 | 3,706,116.960 | |
| CARMAX INC | 18,673 | 67.390 | 1,258,373.470 | |
| TJX COMPANIES INC | 140,433 | 82.440 | 11,577,296.520 | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP | 5,958 | 286.930 | 1,709,528.940 | |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 114,349 | 4.760 | 544,301.240 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD | 17,328 | 51.000 | 883,728.000 | |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 15,092 | 219.500 | 3,312,694.000 | |
| SIGNATURE BANK | 7,996 | 114.510 | 915,621.960 | |
| CBRE GROUP INC | 41,089 | 82.730 | 3,399,292.970 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC | 15,779 | 20.810 | 328,360.990 | |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 107,099 | 22.030 | 2,359,390.970 | |
| DOMINO'S PIZZA INC | 4,115 | 339.730 | 1,397,988.950 | |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 5,387 | 388.170 | 2,091,071.790 | |
| WESTLAKE CORP | 4,187 | 110.770 | 463,793.990 | |
| T-MOBILE US INC | 75,987 | 149.560 | 11,364,615.720 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 42,972 | 53.800 | 2,311,893.600 | |
| MOSAIC CO/THE | 42,561 | 44.830 | 1,908,009.630 | |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 4,193 | 321.120 | 1,346,456.160 | |
| CELANESE CORP | 13,841 | 118.530 | 1,640,573.730 | |
| DEXCOM INC | 48,710 | 110.880 | 5,400,964.800 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 19,186 | 94.640 | 1,815,763.040 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 24,027 | 83.000 | 1,994,241.000 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 13,123 | 319.770 | 4,196,341.710 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 36,034 | 21.520 | 775,451.680 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 67,741 | 106.650 | 7,224,577.650 | |
| LIVE NATION | 20,444 | 72.560 | 1,483,416.640 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 3,304 | 1,451.430 | 4,795,524.720 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 6,148 | 658.800 | 4,050,302.400 | |
| MASTERCARD INC | 105,296 | 371.010 | 39,065,868.960 | |
| WESTERN UNION CO | 46,712 | 14.450 | 674,988.400 | |
| OWENS CORNING | 13,227 | 89.690 | 1,186,329.630 | |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 15,108 | 99.980 | 1,510,497.840 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 17,861 | 60.650 | 1,083,269.650 | |
| FIRST SOLAR INC | 11,903 | 171.010 | 2,035,532.030 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 13,610 | 139.030 | 1,892,198.300 | |
| DELTA AIR LINES INC | 15,786 | 38.090 | 601,288.740 | |
| INSULET CORP | 8,834 | 299.060 | 2,641,896.040 | |
| DISCOVER FINANCIAL | 33,236 | 105.610 | 3,510,053.960 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 38,762 | 122.700 | 4,756,097.400 | |
| MASIMO CORP | 5,688 | 153.450 | 872,823.600 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 13,904 | 309.480 | 4,303,009.920 | |
| VMWARE INC | 24,654 | 124.260 | 3,063,506.040 | |
| MERCADOLIBRE INC | 5,418 | 915.780 | 4,961,696.040 | |
| ULTA BEAUTY INC | 6,073 | 488.620 | 2,967,389.260 | |
| INVESCO LTD | 38,530 | 19.520 | 752,105.600 | |
| MSCI INC | 9,807 | 488.080 | 4,786,600.560 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 189,517 | 102.190 | 19,366,742.230 | |
| VISA INC | 199,385 | 221.090 | 44,082,029.650 | |
| KEURIG DR PEPPER INC | 92,816 | 35.690 | 3,312,603.040 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 22,809 | 160.770 | 3,667,002.930 | |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 60,388 | 116.500 | 7,035,202.000 | |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC | 16,182 | 61.290 | 991,794.780 | |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE | 241,328 | 18.740 | 4,522,486.720 | |
| XYLEM INC | 22,848 | 112.940 | 2,580,453.120 | |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV | 33,342 | 91.680 | 3,056,794.560 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 4,713 | 223.970 | 1,055,570.610 | |
| SPLUNK INC | 20,898 | 86.520 | 1,808,094.960 | |
| EPAM SYSTEMS INC | 7,090 | 326.880 | 2,317,579.200 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 27,835 | 250.400 | 6,969,884.000 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 18,974 | 183.540 | 3,482,487.960 | |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 7,792 | 152.600 | 1,189,059.200 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 8,844 | 191.930 | 1,697,428.920 | |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA | 22,434 | 126.730 | 2,843,060.820 | |
| NXP SEMICONDUCTOR NV | 32,109 | 166.070 | 5,332,341.630 | |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP | 16,343 | 97.140 | 1,587,559.020 | |
| TARGA RESOURCES CORP | 25,830 | 74.390 | 1,921,493.700 | |
| LEAR CORP | 6,911 | 134.930 | 932,501.230 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 12,709 | 122.490 | 1,556,725.410 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 26,335 | 53.370 | 1,405,498.950 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 27,899 | 241.760 | 6,744,862.240 | |
| FORTINET INC | 81,166 | 48.420 | 3,930,057.720 | |
| HORIZON PHARMA PLC | 27,613 | 113.060 | 3,121,925.780 | |
| TESLA INC | 325,351 | 118.850 | 38,667,966.350 | |
| GENERAC HOLDINGS INC | 6,914 | 109.560 | 757,497.840 | |
| ENPHASE ENERGY INC | 16,090 | 229.830 | 3,697,964.700 | |
| GENERAL MOTORS CO | 171,210 | 37.110 | 6,353,603.100 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 39,230 | 26.710 | 1,047,833.300 | |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 9,661 | 225.780 | 2,181,260.580 | |
| APTIV PLC | 34,310 | 99.640 | 3,418,648.400 | |
| PHILLIPS 66 | 59,404 | 101.570 | 6,033,664.280 | |
| META PLATFORMS INC | 279,047 | 132.990 | 37,110,460.530 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 22,514 | 215.510 | 4,851,992.140 | |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 20,087 | 141.950 | 2,851,349.650 | |
| SERVICENOW INC | 24,507 | 380.840 | 9,333,245.880 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| PALO ALTO NETWORKS INC | 36,942 | 134.190 | 4,957,246.980 | |
| WORKDAY INC | 24,052 | 160.210 | 3,853,370.920 | |
| ABBVIE INC | 215,856 | 159.640 | 34,459,251.840 | |
| ZOETIS INC | 57,061 | 154.360 | 8,807,935.960 | |
| NEWS CORP/NEW-CL A | 54,211 | 19.390 | 1,051,151.290 | |
| CDW CORP | 16,465 | 186.380 | 3,068,746.700 | |
| HOWMET AEROSPACE INC | 42,413 | 40.550 | 1,719,847.150 | |
| TWILIO INC | 21,090 | 50.420 | 1,063,357.800 | |
| SNAP INC | 127,318 | 9.420 | 1,199,335.560 | |
| TRADE DESK INC A | 53,230 | 44.840 | 2,386,833.200 | |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 22,466 | 64.550 | 1,450,180.300 | |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | 8,845 | 40.400 | 357,338.000 | |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C | 19,871 | 40.320 | 801,198.720 | |
| OKTA INC | 17,828 | 67.990 | 1,212,125.720 | |
| BLACK KNIGHT INC | 17,653 | 61.920 | 1,093,073.760 | |
| BAKER HUGHES CO | 126,292 | 30.870 | 3,898,634.040 | |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 18,167 | 98.050 | 1,781,274.350 | |
| BROADCOM INC | 49,306 | 574.930 | 28,347,498.580 | |
| ARES MANAGEMENT CORP | 19,534 | 72.430 | 1,414,847.620 | |
| MONGODB INC | 7,891 | 182.090 | 1,436,872.190 | |
| BURLINGTON STORES INC | 8,453 | 220.610 | 1,864,816.330 | |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 61,321 | 12.980 | 795,946.580 | |
| VEEVA SYSTEMS INC | 16,856 | 161.200 | 2,717,187.200 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | 24,212 | 44.110 | 1,067,991.320 | |
| EVERGY INC | 28,226 | 64.180 | 1,811,544.680 | |
| ALLEGION PLC | 10,140 | 112.040 | 1,136,085.600 | |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 18,314 | 62.960 | 1,153,049.440 | |
| STERIS PLC | 12,524 | 201.520 | 2,523,836.480 | |
| DOCUSIGN INC | 26,362 | 58.050 | 1,530,314.100 | |
| WIX.COM LTD | 5,855 | 76.850 | 449,956.750 | |
| DROPBOX INC | 30,479 | 22.450 | 684,253.550 | |
| KKR & CO INC | 67,430 | 50.130 | 3,380,265.900 | |
| FUTU HOLDINGS LTD ADR | 5,050 | 47.190 | 238,309.500 | |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC | 27,921 | 70.860 | 1,978,482.060 | |
| MODERNA INC | 40,114 | 189.650 | 7,607,620.100 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 34,409 | 129.460 | 4,454,589.140 | |
| ARAMARK | 31,133 | 44.050 | 1,371,408.650 | |
| CIGNA CORP | 37,115 | 303.790 | 11,275,165.850 | |
| DELL TECHNOLOGIES INC | 32,770 | 42.490 | 1,392,397.300 | |
| DOW INC | 87,667 | 56.470 | 4,950,555.490 | |
| OVINTIV INC | 31,603 | 49.000 | 1,548,547.000 | |
| AMCOR PLC | 172,505 | 12.120 | 2,090,760.600 | |
| PINTEREST INC | 69,746 | 25.940 | 1,809,211.240 | |
| FOX CORP-A | 36,501 | 31.890 | 1,164,016.890 | |
| FOX CORP-B | 15,511 | 29.980 | 465,019.780 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CLARIVATE ANALYTICS PLC | 42,586 | 9.490 | 404,141.140 | |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC | 25,723 | 95.670 | 2,460,919.410 | |
| CHEWY INC | 9,648 | 40.990 | 395,471.520 | |
| AVANTOR INC | 78,214 | 21.470 | 1,679,254.580 | |
| DYNATRACE INC | 25,429 | 36.690 | 932,990.010 | |
| CLOUDFLARE INC | 29,770 | 41.800 | 1,244,386.000 | |
| TRADEWEB MARKETS INC | 13,800 | 68.770 | 949,026.000 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 101,898 | 44.000 | 4,483,512.000 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 50,475 | 81.670 | 4,122,293.250 | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 181,560 | 28.040 | 5,090,942.400 | |
| CORTEVA INC | 86,360 | 61.750 | 5,332,730.000 | |
| MATCH GROUP INC | 35,259 | 44.970 | 1,585,597.230 | |
| FERGUSON PLC | 25,702 | 139.450 | 3,584,143.900 | |
| BILL.COM HOLDINGS INC | 11,988 | 101.650 | 1,218,580.200 | |
| BLACKSTONE INC | 85,115 | 80.530 | 6,854,310.950 | |
| PAYLOCITY HOLDING CORP | 5,322 | 187.180 | 996,171.960 | |
| CARLYLE GROUP INC | 24,530 | 32.560 | 798,696.800 | |
| DATADOG INC | 29,179 | 66.770 | 1,948,281.830 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC | 22,308 | 56.460 | 1,259,509.680 | |
| INGERSOLL RAND INC | 51,479 | 56.430 | 2,904,959.970 | |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC | 44,135 | 60.000 | 2,648,100.000 | |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 6,341 | 298.340 | 1,891,773.940 | |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC | 38,342 | 16.450 | 630,725.900 | |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD | 9,267 | 17.530 | 162,450.510 | |
| UNITY SOFTWARE INC | 30,839 | 31.140 | 960,326.460 | |
| AON PLC | 25,506 | 307.330 | 7,838,758.980 | |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 275,379 | 12.560 | 3,458,760.240 | |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP | 736 | 2,093.410 | 1,540,749.760 | |
| BENTLEY SYSTEMS INC | 22,566 | 37.240 | 840,357.840 | |
| COINBASE GLOBAL INC | 13,094 | 43.230 | 566,053.620 | |
| AFFIRM HOLDINGS INC | 18,528 | 10.060 | 186,391.680 | |
| AIRBNB INC | 47,177 | 88.540 | 4,177,051.580 | |
| CONSTELLATION ENERGY CORP | 38,995 | 83.080 | 3,239,704.600 | |
| ROYALTY PHARMA PLC | 41,775 | 39.260 | 1,640,086.500 | |
| ROBLOX CORP | 45,019 | 32.010 | 1,441,058.190 | |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC | 29,656 | 25.470 | 755,338.320 | |
| VIATRIS INC | 150,826 | 11.840 | 1,785,779.840 | |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 26,444 | 45.300 | 1,197,913.200 | |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP | 12,687 | 88.370 | 1,121,150.190 | |
| HF SINCLAIR CORP | 20,299 | 51.700 | 1,049,458.300 | |
| SNOWFLAKE INC | 26,591 | 137.940 | 3,667,962.540 | |
| DOORDASH INC | 29,575 | 48.040 | 1,420,783.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ARISTA NETWORKS INC | 29,367 | 115.230 | 3,383,959.410 | |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 47,354 | 66.520 | 3,149,988.080 | |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC | 202,824 | 6.700 | 1,358,920.800 | |
| FNF GROUP | 31,004 | 40.040 | 1,241,400.160 | |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 14,561 | 127.500 | 1,856,527.500 | |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 101,624 | 37.010 | 3,761,104.240 | |
| APA CORP | 40,946 | 43.240 | 1,770,505.040 | |
| LUCID GROUP INC | 44,910 | 7.190 | 322,902.900 | |
| U-HAUL HOLDING CO | 11,981 | 57.190 | 685,193.390 | |
| ASPEN TECHNOLOGY INC | 3,721 | 202.070 | 751,902.470 | |
| TOAST INC | 32,620 | 18.320 | 597,598.400 | |
| GRAB HOLDINGS LTD | 168,328 | 3.720 | 626,180.160 | |
| CATALENT INC | 20,564 | 48.100 | 989,128.400 | |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 61,118 | 32.840 | 2,007,115.120 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | 63,378 | 41.260 | 2,614,976.280 | |
| CYBERARK SOFTWARE LTD | 5,237 | 120.300 | 630,011.100 | |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 22,209 | 178.010 | 3,953,424.090 | |
| HUBSPOT INC | 5,802 | 289.070 | 1,677,184.140 | |
| QORVO INC | 11,596 | 96.180 | 1,115,303.280 | |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I | 15,335 | 85.360 | 1,308,995.600 | |
| SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | 6,728 | 285.480 | 1,920,709.440 | |
| GODADDY INC | 19,713 | 73.040 | 1,439,837.520 | |
| ETSY INC | 15,614 | 126.930 | 1,981,885.020 | |
| TRANSUNION | 22,126 | 64.100 | 1,418,276.600 | |
| ALCOA CORP | 19,669 | 52.980 | 1,042,063.620 | |
| BLOCK INC | 66,910 | 70.030 | 4,685,707.300 | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 60,266 | 73.920 | 4,454,862.720 | |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | 26,221 | 56.000 | 1,468,376.000 | |
| WESTROCK CO | 27,826 | 36.710 | 1,021,492.460 | |
| KRAFT HEINZ CO | 87,780 | 42.330 | 3,715,727.400 | |
| NOVOCURE LTD | 10,423 | 93.030 | 969,651.690 | |
| FORTIVE CORP | 42,608 | 66.120 | 2,817,240.960 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 31,039 | 131.200 | 4,072,316.800 | |
| ALPHABET INC-CL A | 730,399 | 88.420 | 64,581,879.580 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO | 156,384 | 17.060 | 2,667,911.040 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 133,121 | 77.920 | 10,372,788.320 | |
| SEA LTD ADR | 43,908 | 54.210 | 2,380,252.680 | |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 44,924 | 29.900 | 1,343,227.600 | |
| ZILLOW GROUP INC-C | 16,321 | 40.860 | 666,876.060 | |
| ALPHABET INC-CL C | 678,721 | 89.240 | 60,569,062.040 | |
| ZSCALER INC | 10,310 | 104.970 | 1,082,240.700 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | LINDE PLC | 60,875 | 322.030 | 19,603,576.250 | |
| | ROKU INC | 15,660 | 47.120 | 737,899.200 | |
| | CHARTER COMMUNICATIONS INC | 14,085 | 374.640 | 5,276,804.400 | |
| | VISTRA CORP | 41,133 | 22.400 | 921,379.200 | |
| アメリカ・ドル　小計 | | 41,434,095 | | 4,119,765,053.530<br>(545,456,893,086) | |
| イギリス・ポンド | ANTOFAGASTA PLC | 45,963 | 17.545 | 806,420.830 | |
| | ASHTEAD GROUP | 54,304 | 50.640 | 2,749,954.560 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 29,397 | 27.330 | 803,420.010 | |
| | BARCLAYS PLC | 2,022,417 | 1.716 | 3,470,467.570 | |
| | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 124,196 | 4.236 | 526,094.250 | |
| | BT GROUP PLC | 756,852 | 1.251 | 946,821.850 | |
| | BUNZL PLC | 38,593 | 29.330 | 1,131,932.690 | |
| | AVIVA PLC | 348,683 | 4.584 | 1,598,362.870 | |
| | CRODA INTERNATIONAL | 16,782 | 67.740 | 1,136,812.680 | |
| | DIAGEO PLC | 278,619 | 36.315 | 10,118,048.980 | |
| | SCHRODERS PLC | 110,366 | 4.529 | 499,847.610 | |
| | DCC PLC | 11,135 | 42.870 | 477,357.450 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 436,527 | 10.225 | 4,463,488.570 | |
| | KINGFISHER PLC | 225,392 | 2.505 | 564,606.960 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 379,623 | 8.394 | 3,186,555.460 | |
| | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 262,877 | 31.535 | 8,289,826.190 | |
| | HALMA PLC | 41,997 | 20.900 | 877,737.300 | |
| | NEXT PLC | 18,751 | 62.660 | 1,174,937.660 | |
| | IMPERIAL BRANDS PLC | 107,889 | 20.520 | 2,213,882.280 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 19,976 | 21.880 | 437,074.880 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 157,426 | 34.935 | 5,499,677.310 | |
| | COMPASS GROUP PLC | 212,418 | 19.175 | 4,073,115.150 | |
| | HSBC HOLDINGS PLC | 2,445,384 | 5.641 | 13,794,411.140 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 738,179 | 2.583 | 1,906,716.350 | |
| | UNILEVER PLC | 307,132 | 41.980 | 12,893,401.360 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 90,569 | 10.250 | 928,332.250 | |
| | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 42,351 | 17.545 | 743,048.290 | |
| | PEARSON PLC | 84,159 | 9.160 | 770,896.440 | |
| | PERSIMMON PLC | 35,252 | 12.790 | 450,873.080 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 333,971 | 12.410 | 4,144,580.110 | |
| | RIO TINTO PLC | 137,792 | 60.730 | 8,368,108.160 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 3,220,482 | 0.877 | 2,824,362.710 | |
| | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 88,653 | 59.020 | 5,232,300.060 | |
| | RELX PLC | 229,145 | 23.420 | 5,366,575.900 | |
| | RENTOKIL INITIAL PLC | 312,114 | 5.110 | 1,594,902.540 | |
| | ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC | 1,121,924 | 1.010 | 1,133,143.240 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | NATWEST GROUP PLC | 670,464 | 2.754 | 1,846,457.850 | |
| | ST JAMES'S PLACE PLC | 67,448 | 11.500 | 775,652.000 | |
| | SSE PLC | 131,574 | 16.740 | 2,202,548.760 | |
| | BP PLC | 2,266,380 | 4.751 | 10,767,571.380 | |
| | SAGE GROUP PLC(THE) | 128,893 | 7.776 | 1,002,271.960 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 51,695 | 16.280 | 841,594.600 | |
| | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 8,936 | 110.750 | 989,662.000 | |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 294,895 | 6.878 | 2,028,287.810 | |
| | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 8,477,863 | 0.480 | 4,069,374.240 | |
| | TAYLOR WIMPLEY PLC | 569,863 | 1.062 | 605,194.500 | |
| | TESCO PLC | 934,247 | 2.421 | 2,261,811.980 | |
| | 3I GROUP PLC | 107,283 | 13.990 | 1,500,889.170 | |
| | SMITH & NEPHEW PLC | 107,679 | 11.825 | 1,273,304.170 | |
| | GSK PLC | 499,550 | 14.140 | 7,063,637.000 | |
| | LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 39,268 | 72.800 | 2,858,710.400 | |
| | WPP PLC | 142,785 | 8.806 | 1,257,364.710 | |
| | ASTRAZENECA PLC | 189,322 | 118.020 | 22,343,782.440 | |
| | WHITBREAD PLC | 25,470 | 28.400 | 723,348.000 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 23,309 | 42.450 | 989,467.050 | |
| | BURBERRY GROUP PLC | 52,229 | 22.380 | 1,168,885.020 | |
| | INTERCONTINENTAL HOTELS | 21,752 | 51.940 | 1,129,798.880 | |
| | SAINSBURY (J) PLC | 192,097 | 2.458 | 472,174.420 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 21,325 | 22.720 | 484,504.000 | |
| | THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 11,360 | 40.960 | 465,305.600 | |
| | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 18,455 | 16.730 | 308,752.150 | |
| | AVEVA GROUP PLC | 11,702 | 32.170 | 376,453.340 | |
| | ABRDN PLC | 285,831 | 1.966 | 561,943.740 | |
| | EXPERIAN PLC | 112,709 | 28.820 | 3,248,273.380 | |
| | MONDI PLC | 58,887 | 14.720 | 866,816.640 | |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 36,942 | 8.784 | 324,498.520 | |
| | OCADO GROUP PLC | 69,766 | 7.204 | 502,594.260 | |
| | INFORMA PLC | 186,195 | 6.434 | 1,197,978.630 | |
| | GLENCORE PLC | 1,187,922 | 5.341 | 6,344,691.400 | |
| | ENTAIN PLC | 74,451 | 14.585 | 1,085,867.830 | |
| | COCA-COLA HBC AG | 21,338 | 19.550 | 417,157.900 | |
| | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 86,223 | 6.240 | 538,031.520 | |
| | M&G PLC | 270,401 | 1.965 | 531,337.960 | |
| | JD SPORTS FASHION PLC | 252,180 | 1.409 | 355,321.620 | |
| | HALEON PLC | 622,766 | 3.125 | 1,946,143.750 | |
| | SHELL PLC | 889,720 | 23.765 | 21,144,195.800 | |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 110,833 | 5.498 | 609,359.830 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 487,207 | 1.464 | 713,271.040 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | 34,706,505 | | 225,392,381.990<br>(36,285,919,577) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| イスラエル・シュケル | BANK HAPOALIM BM | 146,703 | 32.240 | 4,729,704.720 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL BM | 180,343 | 29.720 | 5,359,793.960 | |
| | BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 287,773 | 5.920 | 1,703,616.160 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 2,553 | 589.000 | 1,503,717.000 | |
| | TOWER SEMICONDUCTOR LTD | 12,574 | 152.700 | 1,920,049.800 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK LTD | 162,944 | 18.260 | 2,975,357.440 | |
| | ICL GROUP LTD | 103,067 | 26.000 | 2,679,742.000 | |
| | NICE LTD | 7,640 | 672.000 | 5,134,080.000 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 17,440 | 114.000 | 1,988,160.000 | |
| | AZRIELI GROUP | 4,672 | 227.000 | 1,060,544.000 | |
| イスラエル・シュケル　小計 | | 925,709 | | 29,054,765.080<br>(1,110,394,673) | |
| オーストラリア・ドル | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 21,754 | 66.420 | 1,444,900.680 | |
| | WESTPAC BANKING CORPORATION | 423,771 | 23.410 | 9,920,479.110 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 210,104 | 21.770 | 4,573,964.080 | |
| | TELSTRA GROUP LTD | 482,855 | 3.960 | 1,912,105.800 | |
| | ASX LTD | 23,664 | 66.280 | 1,568,449.920 | |
| | BHP GROUP LTD | 619,881 | 47.800 | 29,630,311.800 | |
| | AMPOL LTD | 31,828 | 27.470 | 874,315.160 | |
| | COMPUTERSHARE LT | 72,081 | 24.210 | 1,745,081.010 | |
| | CSL LIMITED | 58,245 | 275.630 | 16,054,069.350 | |
| | REA GROUP LTD | 6,134 | 112.830 | 692,099.220 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 379,633 | 13.250 | 5,030,137.250 | |
| | COCHLEAR LTD | 7,836 | 208.050 | 1,630,279.800 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 213,229 | 7.690 | 1,639,731.010 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 205,033 | 103.320 | 21,184,009.560 | |
| | RIO TINTO LIMITED | 45,936 | 118.230 | 5,431,013.280 | |
| | APA GROUP | 164,300 | 10.440 | 1,715,292.000 | |
| | ARISTOCRAT LEISU | 76,675 | 32.060 | 2,458,200.500 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 281,664 | 4.630 | 1,304,104.320 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 60,767 | 28.720 | 1,745,228.240 | |
| | IGO LTD | 91,947 | 13.910 | 1,278,982.770 | |
| | ORICA LTD | 43,659 | 14.870 | 649,209.330 | |
| | LEND LEASE CORP LTD | 65,475 | 8.030 | 525,764.250 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 50,325 | 17.690 | 890,249.250 | |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 46,642 | 173.520 | 8,093,319.840 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 154,162 | 11.820 | 1,822,194.840 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 392,866 | 29.930 | 11,758,479.380 | |
| | NEWCREST MINING LTD | 112,815 | 22.270 | 2,512,390.050 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | QANTAS AIRWAYS LIMITED | 112,659 | 6.330 | 713,131.470 | |
| | QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 172,487 | 12.770 | 2,202,658.990 | |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 135,578 | 11.730 | 1,590,329.940 | |
| | REECE LTD | 31,558 | 14.390 | 454,119.620 | |
| | SANTOS LTD | 417,358 | 7.050 | 2,942,373.900 | |
| | SONIC HEALTHCARE | 52,774 | 30.460 | 1,607,496.040 | |
| | WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD | 25,985 | 27.780 | 721,863.300 | |
| | WESFARMERS LTD | 139,720 | 46.970 | 6,562,648.400 | |
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 235,431 | 35.010 | 8,242,439.310 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 145,725 | 33.630 | 4,900,731.750 | |
| | SEEK LTD | 38,405 | 21.260 | 816,490.300 | |
| | MINERAL RESOURCES LTD | 21,179 | 84.750 | 1,794,920.250 | |
| | BRAMBLES LTD | 170,929 | 11.500 | 1,965,683.500 | |
| | PILBARA MINERALS LTD | 327,947 | 3.870 | 1,269,154.890 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 222,849 | 3.700 | 824,541.300 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 79,233 | 13.380 | 1,060,137.540 | |
| | XERO LTD | 14,590 | 71.640 | 1,045,227.600 | |
| | IDP EDUCATION LTD | 23,781 | 29.500 | 701,539.500 | |
| | LOTTERY CORP LTD | 227,460 | 4.720 | 1,073,611.200 | |
| | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA | 160,470 | 6.300 | 1,010,961.000 | |
| | ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 355,854 | 23.720 | 8,440,856.880 | |
| | MEDIBANK PVT LTD | 298,576 | 2.880 | 859,898.880 | |
| | SOUTH32 LTD(AUD) | 596,694 | 4.450 | 2,655,288.300 | |
| | COLES GROUP LTD | 151,233 | 16.580 | 2,507,443.140 | |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 14,823 | 50.520 | 748,857.960 | |
| オーストラリア・ドル　小計 | | 8,516,579 | | 194,796,766.760<br>(17,790,788,708) | |
| カナダ・ドル | AGNICO EAGLE MINES LTD | 52,200 | 74.170 | 3,871,674.000 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 214,835 | 26.060 | 5,598,600.100 | |
| | BANK OF MONTREAL | 82,585 | 127.650 | 10,541,975.250 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 144,527 | 67.610 | 9,771,470.470 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 40,967 | 95.250 | 3,902,106.750 | |
| | BCE INC | 7,697 | 61.450 | 472,980.650 | |
| | BROOKFIELD CORP | 170,004 | 45.220 | 7,687,580.880 | |
| | SAPUTO INC | 26,668 | 35.160 | 937,646.880 | |
| | ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO | 92,311 | 9.700 | 895,416.700 | |
| | DESCARTES SYSTEMS GRP (THE) | 11,508 | 95.150 | 1,094,986.200 | |
| | CGI INC | 25,261 | 114.530 | 2,893,142.330 | |
| | CCL INDUSTRIES INC | 16,363 | 59.540 | 974,253.020 | |
| | CAE INC | 40,808 | 27.460 | 1,120,587.680 | |
| | CAMECO CORP | 54,264 | 33.990 | 1,844,433.360 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ROGERS COMM-CL B | 45,607 | 63.390 | 2,891,027.730 | |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 109,348 | 56.930 | 6,225,181.640 | |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 136,276 | 74.370 | 10,134,846.120 | |
| CANADIAN TIRE CORP-CL A | 6,124 | 152.000 | 930,848.000 | |
| CANADIAN UTILITIES LTD | 16,330 | 36.920 | 602,903.600 | |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 70,975 | 163.140 | 11,578,861.500 | |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 21,713 | 39.140 | 849,846.820 | |
| OPEN TEXT CORP | 33,217 | 41.570 | 1,380,830.690 | |
| EMPIRE CO LTD | 29,433 | 36.060 | 1,061,353.980 | |
| KINROSS GOLD CORP | 219,914 | 6.200 | 1,363,466.800 | |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC | 13,286 | 79.520 | 1,056,502.720 | |
| FORTIS INC | 60,484 | 55.280 | 3,343,555.520 | |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 74,203 | 30.940 | 2,295,840.820 | |
| TELUS CORP | 31,890 | 26.990 | 860,711.100 | |
| GREAT WEST LIFECO INC | 34,208 | 33.400 | 1,142,547.200 | |
| IMPERIAL OIL LTD | 27,246 | 64.180 | 1,748,648.280 | |
| ENBRIDGE INC | 244,225 | 55.040 | 13,442,144.000 | |
| IGM FINANCIAL INC | 12,478 | 40.080 | 500,118.240 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 233,861 | 24.770 | 5,792,736.970 | |
| LOBLAW CO LTD | 21,600 | 119.090 | 2,572,344.000 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 101,210 | 62.570 | 6,332,709.700 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 32,328 | 82.000 | 2,650,896.000 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 75,884 | 62.940 | 4,776,138.960 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 2,799 | 817.430 | 2,287,986.570 | |
| METRO INC | 28,629 | 74.180 | 2,123,699.220 | |
| EMERA INC | 30,947 | 52.000 | 1,609,244.000 | |
| ONEX CORP | 10,157 | 64.730 | 657,462.610 | |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 19,323 | 24.280 | 469,162.440 | |
| POWER CORP OF CANADA | 65,500 | 34.210 | 2,240,755.000 | |
| QUEBECOR INC-B | 17,195 | 31.750 | 545,941.250 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 169,273 | 132.900 | 22,496,381.700 | |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 113,049 | 102.640 | 11,603,349.360 | |
| SHAW COMM INC-B | 59,877 | 38.650 | 2,314,246.050 | |
| SUNCOR ENERGY INC | 165,224 | 41.660 | 6,883,231.840 | |
| LUNDIN MINING CORP | 68,762 | 9.630 | 662,178.060 | |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 57,326 | 53.090 | 3,043,437.340 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 19,979 | 155.400 | 3,104,736.600 | |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 9,665 | 101.950 | 985,346.750 | |
| TORONTO DOMINION BANK (THE) C$ | 221,445 | 86.000 | 19,044,270.000 | |
| TC ENERGY CORP | 123,753 | 54.770 | 6,777,951.810 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | WEST FRASER TIMBER CO LTD | 8,102 | 97.520 | 790,107.040 | |
| | WESTON (GEORGE) LTD | 8,379 | 173.190 | 1,451,159.010 | |
| | INTACT FINANCIAL CORP | 21,566 | 199.190 | 4,295,731.540 | |
| | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 53,414 | 58.360 | 3,117,241.040 | |
| | CONSTELLATION SOFTWARE INC | 2,530 | 2,242.560 | 5,673,676.800 | |
| | FRANCO-NEVADA CORP NPR | 23,163 | 193.340 | 4,478,334.420 | |
| | TOURMALINE OIL CORP | 39,298 | 63.190 | 2,483,240.620 | |
| | KEYERA CORP | 24,571 | 29.700 | 729,758.700 | |
| | PARKLAND CORP | 15,665 | 30.680 | 480,602.200 | |
| | ALTAGAS LTD | 33,833 | 23.470 | 794,060.510 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 68,179 | 46.480 | 3,168,959.920 | |
| | DOLLARAMA INC | 32,535 | 81.370 | 2,647,372.950 | |
| | CENOVUS ENERGY INC W/I | 167,715 | 25.160 | 4,219,709.400 | |
| | ARC RESOURCES LTD | 74,961 | 15.830 | 1,186,632.630 | |
| | NORTHLAND POWER INC | 34,152 | 37.830 | 1,291,970.160 | |
| | ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | 51,243 | 18.700 | 958,244.100 | |
| | TMX GROUP LTD | 7,040 | 137.960 | 971,238.400 | |
| | BRP INC | 4,307 | 105.910 | 456,154.370 | |
| | IVANHOE MINES LTD | 64,027 | 12.040 | 770,885.080 | |
| | NUTRIEN LTD | 66,177 | 99.800 | 6,604,464.600 | |
| | TFI INTERNATIONAL INC | 9,399 | 141.600 | 1,330,898.400 | |
| | WSP GLOBAL INC | 15,681 | 166.900 | 2,617,158.900 | |
| | IA FINANCIAL CORP INC | 12,011 | 80.190 | 963,162.090 | |
| | GFL ENVIRONMENTAL INC | 27,577 | 40.990 | 1,130,381.230 | |
| | NUVEI CORP | 7,929 | 40.700 | 322,710.300 | |
| | BROOKFIELD RENEWABLE CORP | 16,103 | 38.630 | 622,058.890 | |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD | 42,501 | 40.630 | 1,726,815.630 | |
| | AIR CANADA | 18,814 | 20.790 | 391,143.060 | |
| | RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 35,384 | 88.560 | 3,133,607.040 | |
| | SHOPIFY INC | 146,823 | 49.010 | 7,195,795.230 | |
| | FIRSTSERVICE CORP | 5,237 | 179.100 | 937,946.700 | |
| | HYDRO ONE LTD | 37,626 | 35.950 | 1,352,654.700 | |
| カナダ・ドル　小計 | | 4,990,683 | | 290,284,170.920<br>(28,619,116,411) | |
| シンガポール・ドル | SINGAPORE TECH ENG | 144,200 | 3.410 | 491,722.000 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 211,910 | 34.560 | 7,323,609.600 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 39,400 | 7.680 | 302,592.000 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 15,500 | 28.510 | 441,905.000 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 99,800 | 8.970 | 895,206.000 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 761,193 | 0.980 | 745,969.140 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | KEPPEL CORP LTD | 184,900 | 7.270 | 1,344,223.000 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 398,198 | 12.540 | 4,993,402.920 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 943,330 | 2.470 | 2,330,025.100 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 162,700 | 5.580 | 907,866.000 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 139,966 | 30.100 | 4,212,976.600 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 43,600 | 6.650 | 289,940.000 | |
| | VENTURE CORP LTD | 43,800 | 17.580 | 770,004.000 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 258,500 | 4.130 | 1,067,605.000 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE | 306,590 | 3.730 | 1,143,580.700 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | 3,753,587 | | 27,260,627.060<br>(2,710,796,755) | |
| スイス・フラン | CREDIT SUISSE GROUP AG | 451,599 | 3.058 | 1,380,989.740 | |
| | LOGITECH INTL-REG | 23,734 | 61.360 | 1,456,318.240 | |
| | NESTLE SA-REGISTERED | 335,501 | 111.380 | 37,368,101.380 | |
| | CIE FINANC RICHEMONT | 64,458 | 134.950 | 8,698,607.100 | |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 85,335 | 292.550 | 24,964,754.250 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 5,236 | 186.800 | 978,084.800 | |
| | SIKA INHABER | 17,793 | 240.400 | 4,277,437.200 | |
| | SGS SA-REG | 748 | 2,264.000 | 1,693,472.000 | |
| | NOVARTIS AG-REG SHS | 263,600 | 83.520 | 22,015,872.000 | |
| | BALOISE HOLDING AG -R | 5,675 | 149.000 | 845,575.000 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG | 460 | 1,828.000 | 840,880.000 | |
| | CLARIANT AG-REG | 21,072 | 15.290 | 322,190.880 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 3,431 | 528.400 | 1,812,940.400 | |
| | ABB LTD | 194,538 | 30.240 | 5,882,829.120 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 19,842 | 32.010 | 635,142.420 | |
| | GEBERIT AG | 4,377 | 495.800 | 2,170,116.600 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 9,027 | 470.500 | 4,247,203.500 | |
| | LINDT & SPRUENGLI PART | 117 | 9,500.000 | 1,111,500.000 | |
| | LINDT & SPRUENGLI NAMEN | 13 | 95,800.000 | 1,245,400.000 | |
| | GIVAUDAN-REG | 1,105 | 3,008.000 | 3,323,840.000 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 18,153 | 449.100 | 8,152,512.300 | |
| | ROCHE HOLDING AG-BEARER | 3,612 | 353.200 | 1,275,758.400 | |
| | HOLCIM LTD | 66,607 | 50.640 | 3,372,978.480 | |
| | TEMENOS GROUP | 7,082 | 55.980 | 396,450.360 | |
| | BACHEM HOLDING AG | 4,673 | 82.550 | 385,756.150 | |
| | SONOVA HOLDING AG | 6,135 | 228.500 | 1,401,847.500 | |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG | 6,887 | 218.400 | 1,504,120.800 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG | 12,969 | 115.850 | 1,502,458.650 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-B | 3,130 | 291.900 | 913,647.000 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-REG | 9,259 | 53.150 | 492,115.850 | |
| | SCHINDLER NAMEN | 2,720 | 175.400 | 477,088.000 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG | 3,610 | 508.400 | 1,835,324.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BANQUE CANTONALE VAUD | 4,903 | 87.800 | 430,483.400 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING | 810 | 660.000 | 534,600.000 | |
| | SWISS PRIME SITE AG | 8,372 | 83.100 | 695,713.200 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 2,852 | 862.400 | 2,459,564.800 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 26,031 | 56.780 | 1,478,040.180 | |
| | SWISS RE LTD | 36,229 | 92.860 | 3,364,224.940 | |
| | BKW AG | 3,194 | 131.700 | 420,649.800 | |
| | SIG GROUP AG | 38,322 | 22.100 | 846,916.200 | |
| | ALCON INC | 61,285 | 66.720 | 4,088,935.200 | |
| | UBS GROUP AG | 403,341 | 18.545 | 7,479,958.840 | |
| | VAT GROUP AG | 3,325 | 279.000 | 927,675.000 | |
| スイス・フラン　小計 | | 2,241,162 | | 169,708,073.680<br>(24,373,473,542) | |
| スウェーデン・クローナ | ATLAS COPCO AB-A SHS | 334,122 | 131.580 | 43,963,772.760 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 194,204 | 116.900 | 22,702,447.600 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 366,551 | 63.390 | 23,235,667.890 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 25,755 | 218.700 | 5,632,618.500 | |
| | INVESTOR AB-A SHS | 58,437 | 200.600 | 11,722,462.200 | |
| | LUNDBERGS B | 7,859 | 462.300 | 3,633,215.700 | |
| | SKF AB-B SHS | 46,594 | 179.650 | 8,370,612.100 | |
| | SANDVIK AB | 133,350 | 203.000 | 27,070,050.000 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 195,837 | 125.850 | 24,646,086.450 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 43,937 | 175.300 | 7,702,156.100 | |
| | SWEDBANK AB | 112,296 | 190.100 | 21,347,469.600 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | 70,211 | 142.200 | 9,984,004.200 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 184,499 | 110.150 | 20,322,564.850 | |
| | VOLVO AB-A SHS | 24,198 | 205.800 | 4,979,948.400 | |
| | VOLVO AB-B SHS | 179,832 | 195.080 | 35,081,626.560 | |
| | HOLMEN AB-B SHS | 10,142 | 429.400 | 4,354,974.800 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 64,416 | 90.960 | 5,859,279.360 | |
| | INDUSTRIVARDEN A | 15,292 | 266.700 | 4,078,376.400 | |
| | INDUSTRIVARDEN C | 21,325 | 266.000 | 5,672,450.000 | |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 26,907 | 159.380 | 4,288,437.660 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 76,085 | 92.680 | 7,051,557.800 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 226,392 | 197.420 | 44,694,308.640 | |
| | HENNES&MAURITZ AB-B SHS | 82,287 | 127.640 | 10,503,112.680 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 124,612 | 236.400 | 29,458,276.800 | |
| | TELIA CO AB | 344,810 | 27.640 | 9,530,548.400 | |
| | BOLIDEN AB | 36,260 | 431.700 | 15,653,442.000 | |
| | ALFA LAVAL AB | 35,313 | 323.900 | 11,437,880.700 | |
| | KINNEVIK AB-B | 36,278 | 155.600 | 5,644,856.800 | |
| | FASTIGHETS AB BALDER | 72,942 | 53.700 | 3,916,985.400 | |
| | INDUTRADE AB | 29,769 | 228.500 | 6,802,216.500 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 47,769 | 79.700 | 3,807,189.300 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | NIBE INDUSTRIER AB | 185,845 | 104.150 | 19,355,756.750 | |
| | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | 18,380 | 223.500 | 4,107,930.000 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 248,163 | 116.200 | 28,836,540.600 | |
| | SAGAX AB | 19,038 | 262.300 | 4,993,667.400 | |
| | EPIROC AB-A | 84,563 | 207.200 | 17,521,453.600 | |
| | EPIROC AB-B | 41,205 | 177.800 | 7,326,249.000 | |
| | ESSITY AB-B | 75,180 | 288.800 | 21,711,984.000 | |
| | EQT AB | 31,718 | 245.400 | 7,783,597.200 | |
| | EMBRACER GROUP AB | 79,791 | 47.890 | 3,821,190.990 | |
| | VOLVO CAR AB | 63,710 | 49.540 | 3,156,193.400 | |
| | LIFCO AB | 26,835 | 184.750 | 4,957,766.250 | |
| | EVOLUTION AB | 22,326 | 1,129.600 | 25,219,449.600 | |
| | NORDEA BANK ABP | 403,793 | 119.560 | 48,277,491.080 | |
| | INVESTMENT AB LATOUR | 15,539 | 208.500 | 3,239,881.500 | |
| スウェーデン・クローナ　小計 | | 4,544,367 | | 643,457,747.520<br>(8,184,782,548) | |
| デンマーク・クローネ | CARLSBERG AS-B | 12,549 | 927.600 | 11,640,452.400 | |
| | A P MOLLER A/S | 663 | 15,060.000 | 9,984,780.000 | |
| | AP MOLLER MAERSK A | 359 | 14,850.000 | 5,331,150.000 | |
| | DANSKE BANK A/S | 85,371 | 142.450 | 12,161,098.950 | |
| | GENMAB A/S | 7,926 | 2,999.000 | 23,770,074.000 | |
| | NOVOZYMES-B SHS | 23,859 | 354.200 | 8,450,857.800 | |
| | ROCKWOOL AS | 873 | 1,787.000 | 1,560,051.000 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 202,240 | 930.700 | 188,224,768.000 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 125,436 | 198.700 | 24,924,133.200 | |
| | COLOPLAST-B | 15,343 | 841.000 | 12,903,463.000 | |
| | DSV A/S | 22,074 | 1,087.000 | 23,994,438.000 | |
| | DEMANT A/S | 11,367 | 199.150 | 2,263,738.050 | |
| | TRYG A/S | 44,887 | 158.950 | 7,134,788.650 | |
| | PANDORA A/S | 9,912 | 539.000 | 5,342,568.000 | |
| | CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 12,538 | 503.600 | 6,314,136.800 | |
| | ORSTED A/S | 23,240 | 640.600 | 14,887,544.000 | |
| デンマーク・クローネ　小計 | | 598,637 | | 358,888,041.850<br>(6,865,528,241) | |
| ニュージーランド・ドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 164,341 | 8.090 | 1,329,518.690 | |
| | FISHER & PAYKEL | 78,460 | 23.380 | 1,834,394.800 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 219,038 | 5.300 | 1,160,901.400 | |
| | MIGHTY RIVER POWER LTD | 62,834 | 5.650 | 355,012.100 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 132,157 | 5.380 | 711,004.660 | |
| ニュージーランド・ドル　小計 | | 656,830 | | 5,390,831.650<br>(454,824,466) | |
| ノルウェー・クローネ | MOWI ASA | 45,504 | 173.750 | 7,906,320.000 | |
| | NORSK HYDRO ASA | 162,971 | 75.060 | 12,232,603.260 | |
| | TELENOR ASA | 85,954 | 99.380 | 8,542,108.520 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | KONGSBERG GRUPPEN ASA | 11,185 | 392.200 | 4,386,757.000 | |
| | ORKLA ASA | 116,068 | 72.880 | 8,459,035.840 | |
| | EQUINOR ASA | 115,617 | 309.100 | 35,737,214.700 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 19,834 | 455.600 | 9,036,370.400 | |
| | AKER BP ASA | 38,723 | 304.900 | 11,806,642.700 | |
| | SALMAR ASA | 7,248 | 398.000 | 2,884,704.000 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 25,721 | 186.700 | 4,802,110.700 | |
| | ADEVINTA ASA | 24,382 | 70.850 | 1,727,464.700 | |
| | DNB BANK ASA | 119,319 | 193.400 | 23,076,294.600 | |
| ノルウェー・クローネ　小計 | | 772,526 | | 130,597,626.420<br>(1,734,336,479) | |
| ユーロ | CRH PLC | 90,748 | 40.365 | 3,663,043.020 | |
| | FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 19,953 | 140.700 | 2,807,387.100 | |
| | KERRY GROUP PLC-A | 18,268 | 86.420 | 1,578,720.560 | |
| | KINGSPAN GROUP PLC | 17,451 | 55.920 | 975,859.920 | |
| | UMICORE | 24,290 | 35.370 | 859,137.300 | |
| | AIR LIQUIDE | 63,347 | 141.700 | 8,976,269.900 | |
| | AIRBUS SE | 73,377 | 115.100 | 8,445,692.700 | |
| | AXA SA | 228,092 | 27.450 | 6,261,125.400 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 83,720 | 26.470 | 2,216,068.400 | |
| | ADIDAS AG | 20,476 | 140.100 | 2,868,687.600 | |
| | ASSICURAZIONI GENERALI | 133,912 | 17.330 | 2,320,694.960 | |
| | DASSAULT AVIATION SA | 3,120 | 151.300 | 472,056.000 | |
| | DANONE | 79,150 | 49.490 | 3,917,133.500 | |
| | SAFRAN SA | 40,925 | 121.840 | 4,986,302.000 | |
| | INTESA SANPAOLO | 2,050,973 | 2.250 | 4,614,689.250 | |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 39,262 | 90.520 | 3,553,996.240 | |
| | ACCOR SA | 18,305 | 26.420 | 483,618.100 | |
| | BOUYGUES | 29,123 | 30.460 | 887,086.580 | |
| | BNP PARIBAS | 133,053 | 58.350 | 7,763,642.550 | |
| | THALES SA | 12,886 | 115.600 | 1,489,621.600 | |
| | CAPGEMINI SA | 19,839 | 163.600 | 3,245,660.400 | |
| | UNICREDIT SPA | 241,149 | 14.598 | 3,520,293.100 | |
| | D'IETEREN TRDG | 2,736 | 175.500 | 480,168.000 | |
| | KONINKLIJKE DSM NV | 20,425 | 119.950 | 2,449,978.750 | |
| | COMMERZBANK AG | 141,036 | 9.430 | 1,329,969.480 | |
| | EIFFAGE | 8,993 | 95.260 | 856,673.180 | |
| | FRESENIUS SE & CO KGAA | 48,948 | 27.510 | 1,346,559.480 | |
| | UNITED INTERNET | 10,010 | 21.000 | 210,210.000 | |
| | PUBLICIS GROUPE | 26,472 | 61.360 | 1,624,321.920 | |
| | IBERDROLA SA | 730,877 | 10.795 | 7,889,817.210 | |
| | ENI SPA | 296,020 | 13.974 | 4,136,583.480 | |
| | JERONIMO MARTINS | 34,644 | 21.360 | 739,995.840 | |
| | KESKO OYJ-B | 35,252 | 21.250 | 749,105.000 | |
| | KBC GROUPE | 32,213 | 63.920 | 2,059,054.960 | |
| | HANNOVER RUECK SE | 7,105 | 185.800 | 1,320,109.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| WARTSILA OYJ | 50,956 | 8.460 | 431,087.760 | |
| L'OREAL | 29,178 | 364.350 | 10,631,004.300 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 33,871 | 756.300 | 25,616,637.300 | |
| GEA GROUP AG | 17,490 | 40.230 | 703,622.700 | |
| BOLLORE | 114,808 | 5.335 | 612,500.680 | |
| MEDIOBANCA SPA | 86,792 | 9.408 | 816,539.130 | |
| MICHELIN(CGDE)-B | 86,908 | 28.710 | 2,495,128.680 | |
| CONTINENTAL AG | 12,921 | 63.960 | 826,427.160 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 118,731 | 37.605 | 4,464,879.250 | |
| OMV AG | 17,258 | 47.330 | 816,821.140 | |
| VERBUND AG | 7,320 | 73.150 | 535,458.000 | |
| PERNOD-RICARD | 24,888 | 187.500 | 4,666,500.000 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD | 16,854 | 56.800 | 957,307.200 | |
| RENAULT SA | 27,902 | 36.365 | 1,014,656.230 | |
| REPSOL SA | 178,713 | 14.790 | 2,643,165.270 | |
| REMY COINTREAU | 2,866 | 163.900 | 469,737.400 | |
| MERCK KGAA | 15,234 | 192.500 | 2,932,545.000 | |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 61,460 | 51.720 | 3,178,711.200 | |
| RWE AG | 77,853 | 39.450 | 3,071,300.850 | |
| SEB SA | 2,596 | 90.200 | 234,159.200 | |
| SOCIETE GENERALE-A | 100,409 | 24.550 | 2,465,040.950 | |
| VINCI S.A. | 66,767 | 99.400 | 6,636,639.800 | |
| SODEXO | 9,822 | 88.100 | 865,318.200 | |
| SOFINA | 1,449 | 217.200 | 314,722.800 | |
| SOLVAY SA | 9,070 | 101.400 | 919,698.000 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 66,119 | 144.280 | 9,539,649.320 | |
| VIVENDI SE | 76,073 | 9.412 | 715,999.070 | |
| SAP SE | 126,307 | 104.680 | 13,221,816.760 | |
| TELEFONICA S.A | 614,947 | 3.568 | 2,194,130.890 | |
| TOTALENERGIES SE | 303,774 | 58.410 | 17,743,439.340 | |
| VALEO | 26,570 | 18.985 | 504,431.450 | |
| E.ON SE | 280,287 | 9.882 | 2,769,796.130 | |
| VOEST-ALPINE AG | 10,593 | 27.280 | 288,977.040 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 13,376 | 61.050 | 816,604.800 | |
| SIEMENS AG-REG | 92,954 | 138.140 | 12,840,665.560 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 62,233 | 34.790 | 2,165,086.070 | |
| ING GROEP NV-CVA | 454,638 | 12.188 | 5,541,127.940 | |
| PUMA AG | 16,210 | 62.000 | 1,005,020.000 | |
| BAYER AG | 121,329 | 53.960 | 6,546,912.840 | |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 74,960 | 13.990 | 1,048,690.400 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 19,644 | 64.860 | 1,274,109.840 | |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 99,529 | 67.750 | 6,743,089.750 | |
| BASF SE | 110,117 | 51.700 | 5,693,048.900 | |
| BEIERSDORF AG | 12,940 | 109.450 | 1,416,283.000 | |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 20,809 | 57.820 | 1,203,176.380 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 23,855 | 33.020 | 787,692.100 | |
| ASM INTERNATIONAL NV | 5,188 | 274.400 | 1,423,587.200 | |
| ORANGE | 255,481 | 9.892 | 2,527,218.050 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 58,396 | 48.780 | 2,848,556.880 | |
| RANDSTAD NV | 15,584 | 56.300 | 877,379.200 | |
| ALLIANZ SE | 49,878 | 216.300 | 10,788,611.400 | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 317,956 | 4.781 | 1,520,147.630 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 125,884 | 27.355 | 3,443,556.820 | |
| HERMES INTL | 3,916 | 1,606.500 | 6,291,054.000 | |
| ENDESA S.A. | 37,701 | 18.710 | 705,385.710 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 72,342 | 8.365 | 605,140.830 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 45,686 | 31.980 | 1,461,038.280 | |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 16,705 | 321.800 | 5,375,669.000 | |
| ARCELOR MITTAL (NL) | 66,878 | 27.205 | 1,819,415.990 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 81,900 | 34.390 | 2,816,541.000 | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 23,571 | 28.220 | 665,173.620 | |
| RHEINMETALL STAMM | 4,693 | 211.600 | 993,038.800 | |
| HEINEKEN NV | 32,026 | 90.220 | 2,889,385.720 | |
| AKZO NOBEL | 22,627 | 66.260 | 1,499,265.020 | |
| ASML HOLDING NV | 49,677 | 582.700 | 28,946,787.900 | |
| AEGON NV | 196,332 | 4.944 | 970,665.400 | |
| VOLKSWAGEN AG | 3,315 | 159.250 | 527,913.750 | |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 22,269 | 127.280 | 2,834,398.320 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 735,118 | 6.310 | 4,638,594.580 | |
| KERING | 8,881 | 524.300 | 4,656,308.300 | |
| ACCIONA S.A. | 2,642 | 180.300 | 476,352.600 | |
| FORTUM OYJ | 54,194 | 14.745 | 799,090.530 | |
| AGEAS | 18,136 | 44.190 | 801,429.840 | |
| UCB SA | 16,732 | 77.840 | 1,302,418.880 | |
| NEMETSCHEK SE | 9,878 | 50.900 | 502,790.200 | |
| CARREFOUR SA | 75,572 | 16.825 | 1,271,498.900 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 17,677 | 25.540 | 451,470.580 | |
| NOKIA OYJ | 637,662 | 4.557 | 2,905,825.730 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 115,512 | 15.372 | 1,775,650.460 | |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 32,047 | 98.080 | 3,143,169.760 | |
| SANOFI | 137,939 | 90.070 | 12,424,165.730 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 80,161 | 37.120 | 2,975,576.320 | |
| ELISA OYJ | 20,242 | 51.240 | 1,037,200.080 | |
| BANCO SANTANDER SA | 2,066,857 | 3.036 | 6,274,977.850 | |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA | 49,011 | 16.415 | 804,515.560 | |
| QIAGEN N.V. | 27,412 | 47.040 | 1,289,460.480 | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 253,716 | 11.656 | 2,957,313.690 | |
| BMW VORZUG | 7,821 | 84.750 | 662,829.750 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ENEL SPA | 1,019,343 | 5.536 | 5,643,082.840 | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 393,301 | 19.970 | 7,854,220.970 | |
| SARTORIUS AG | 2,847 | 389.700 | 1,109,475.900 | |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 11,032 | 23.810 | 262,671.920 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 159,023 | 30.820 | 4,901,088.860 | |
| RATIONAL AG | 516 | 606.000 | 312,696.000 | |
| CARL ZEISS MEDITEC AG | 4,866 | 128.000 | 622,848.000 | |
| BECHTLE AG | 8,139 | 35.100 | 285,678.900 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 475,739 | 3.004 | 1,429,119.950 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 14,779 | 66.620 | 984,576.980 | |
| TELEPERFORMANCE | 7,845 | 236.100 | 1,852,204.500 | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 22,570 | 162.800 | 3,674,396.000 | |
| EURAZEO | 5,673 | 61.450 | 348,605.850 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 11,318 | 76.700 | 868,090.600 | |
| HEINEKEN HOLDING NV-A | 10,853 | 72.600 | 787,927.800 | |
| INDITEX | 136,321 | 26.740 | 3,645,223.540 | |
| ESSILORLUXOTTICA | 35,682 | 172.650 | 6,160,497.300 | |
| SNAM SPA | 256,415 | 4.828 | 1,237,971.620 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 143,720 | 10.476 | 1,505,610.720 | |
| ENAGAS | 38,270 | 16.040 | 613,850.800 | |
| WENDEL | 5,449 | 93.100 | 507,301.900 | |
| TENARIS SA | 55,855 | 15.845 | 885,022.470 | |
| TELECOM ITALIA SPA | 908,286 | 0.249 | 226,163.210 | |
| TERNA SPA | 166,064 | 7.254 | 1,204,628.250 | |
| BIOMERIEUX | 4,870 | 99.160 | 482,909.200 | |
| GRIFOLS SA | 31,982 | 11.675 | 373,389.850 | |
| FERROVIAL SA | 56,362 | 25.750 | 1,451,321.500 | |
| NESTE OYJ | 50,599 | 44.370 | 2,245,077.630 | |
| RECORDATI SPA | 10,908 | 39.040 | 425,848.320 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 57,775 | 9.862 | 569,777.050 | |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG | 7,294 | 216.800 | 1,581,339.200 | |
| KONE OYJ | 43,814 | 50.640 | 2,218,740.960 | |
| ELIA GROUP | 4,078 | 137.700 | 561,540.600 | |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 3,109 | 294.200 | 914,667.800 | |
| ENGIE | 221,751 | 13.156 | 2,917,356.150 | |
| ALSTOM | 37,007 | 24.750 | 915,923.250 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 65,012 | 12.000 | 780,144.000 | |
| IPSEN SA | 3,873 | 104.700 | 405,503.100 | |
| ARKEMA SA | 6,392 | 88.760 | 567,353.920 | |
| LEGRAND SA | 32,783 | 79.360 | 2,601,658.880 | |
| AMPLIFON SPA | 12,300 | 28.010 | 344,523.000 | |
| ADP | 3,975 | 132.350 | 526,091.250 | |
| ORION OYJ | 13,559 | 53.940 | 731,372.460 | |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 59,406 | 12.545 | 745,248.270 | |
| SYMRISE AG | 17,265 | 105.750 | 1,825,773.750 | |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 32,422 | 37.940 | 1,230,090.680 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| PRYSMIAN SPA | 30,728 | 34.570 | 1,062,266.960 | |
| DIASORIN ITALIA SPA | 2,429 | 126.200 | 306,539.800 | |
| CAIXABANK | 566,059 | 3.887 | 2,200,271.330 | |
| BUREAU VERITAS SA | 31,295 | 26.010 | 813,982.950 | |
| GETLINK | 63,509 | 14.950 | 949,459.550 | |
| EDP RENOVAVEIS SA | 39,688 | 20.770 | 824,319.760 | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 54,712 | 54.560 | 2,985,086.720 | |
| BRENNTAG SE | 17,934 | 65.580 | 1,176,111.720 | |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 24,687 | 19.300 | 476,459.100 | |
| EDENRED | 31,091 | 48.310 | 1,502,006.210 | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 105,474 | 2.561 | 270,118.910 | |
| LEG IMMOBILIEN SE | 8,209 | 68.540 | 562,644.860 | |
| VONOVIA SE | 85,937 | 25.210 | 2,166,471.770 | |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 134,537 | 9.554 | 1,285,366.490 | |
| KNORR-BREMSE AG | 10,342 | 58.700 | 607,075.400 | |
| OCI NV | 12,329 | 32.200 | 396,993.800 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 34,318 | 47.500 | 1,630,105.000 | |
| FERRARI NV | 15,435 | 213.500 | 3,295,372.500 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 124,604 | 15.615 | 1,945,691.460 | |
| AROUNDTOWN SA | 113,225 | 2.608 | 295,290.800 | |
| AIB GROUP PLC | 147,578 | 3.870 | 571,126.860 | |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 17,293 | 39.720 | 686,877.960 | |
| MONCLER SPA | 25,014 | 51.900 | 1,298,226.600 | |
| NEXI SPA | 58,847 | 7.836 | 461,125.090 | |
| PROSUS NV | 102,526 | 74.370 | 7,624,858.620 | |
| DR ING HC F PORSCHE AG | 15,174 | 101.100 | 1,534,091.400 | |
| JDE PEET'S BV | 14,385 | 27.440 | 394,724.400 | |
| EXOR NV | 14,142 | 72.300 | 1,022,466.600 | |
| SIEMENS ENERGY AG | 59,014 | 17.665 | 1,042,482.310 | |
| EURONEXT NV | 10,081 | 71.240 | 718,170.440 | |
| IMCD NV | 6,823 | 141.700 | 966,819.100 | |
| WORLDLINE SA | 29,916 | 40.120 | 1,200,229.920 | |
| NN GROUP NV | 31,214 | 39.210 | 1,223,900.940 | |
| FINECOBANK SPA | 75,180 | 16.830 | 1,265,279.400 | |
| ARGENX SE | 6,753 | 354.600 | 2,394,613.800 | |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP BV | 92,502 | 23.595 | 2,182,584.690 | |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 56,693 | 30.100 | 1,706,459.300 | |
| CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA | 9,822 | 36.040 | 353,984.880 | |
| IBERDROLA SA-RTS | 730,877 | 0.178 | 130,096.100 | |
| ZALANDO SE | 31,321 | 38.990 | 1,221,205.790 | |
| STELLANTIS NV | 262,624 | 14.666 | 3,851,643.580 | |
| AENA SME SA | 8,494 | 127.700 | 1,084,683.800 | |
| CELLNEX TELECOM SAU | 64,293 | 32.600 | 2,095,951.800 | |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV | 22,670 | 22.990 | 521,183.300 | |
| ABN AMRO BANK NV | 52,835 | 14.605 | 771,655.170 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SCOUT24 SE | 10,048 | 49.770 | 500,088.960 | |
| | COVESTRO AG | 27,558 | 41.800 | 1,151,924.400 | |
| | HELLOFRESH SE | 17,856 | 24.940 | 445,328.640 | |
| | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 105,327 | 56.340 | 5,934,123.180 | |
| | POSTE ITALIANE SPA | 58,889 | 9.700 | 571,223.300 | |
| | AMUNDI SA | 6,292 | 57.550 | 362,104.600 | |
| | INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA | 41,879 | 9.798 | 410,330.440 | |
| | ADYEN NV | 2,593 | 1,340.000 | 3,474,620.000 | |
| | DELIVERY HERO SE | 22,564 | 47.850 | 1,079,687.400 | |
| ユーロ　小計 | | 22,926,806 | | 552,803,372.160<br>(78,636,279,690) | |
| 香港・ドル | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 257,000 | 15.060 | 3,870,420.000 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 197,296 | 57.600 | 11,364,249.600 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 93,314 | 42.250 | 3,942,516.500 | |
| | HONG KONG EXCHANGES &CLEAR | 145,391 | 373.800 | 54,347,155.800 | |
| | MTR CORP | 192,441 | 41.600 | 8,005,545.600 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 95,096 | 128.900 | 12,257,874.400 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 170,972 | 28.000 | 4,787,216.000 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 151,320 | 42.900 | 6,491,628.000 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 1,536,406 | 7.690 | 11,814,962.140 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 260,904 | 53.500 | 13,958,364.000 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 419,995 | 27.550 | 11,570,862.250 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 173,066 | 22.550 | 3,902,638.300 | |
| | SINO LAND CO | 411,200 | 10.100 | 4,153,120.000 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 180,565 | 108.600 | 19,609,359.000 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD A | 53,020 | 67.250 | 3,565,595.000 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 180,156 | 94.550 | 17,033,749.800 | |
| | XINYI GLASS HOLDING CO LTD | 178,000 | 16.580 | 2,951,240.000 | |
| | AIA GROUP LTD | 1,454,316 | 86.350 | 125,580,186.600 | |
| | HKT TRUST / HKT LTD | 463,136 | 9.840 | 4,557,258.240 | |
| | SANDS CHINA LTD | 335,800 | 29.350 | 9,855,730.000 | |
| | SITC INTERNATIONAL CO LTD | 140,000 | 18.060 | 2,528,400.000 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 201,600 | 21.300 | 4,294,080.000 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD | 196,135 | 45.900 | 9,002,596.500 | |
| | ESR GROUP LTD | 216,400 | 16.000 | 3,462,400.000 | |
| | HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD | 246,500 | 5.090 | 1,254,685.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BUDWEISER BREWING CO APAC LTD | 265,000 | 26.350 | 6,982,750.000 | |
| | WH GROUP LTD | 931,500 | 4.880 | 4,545,720.000 | |
| | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 310,445 | 48.800 | 15,149,716.000 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 266,195 | 49.650 | 13,216,581.750 | |
| 香港・ドル　小計 | | 9,723,169 | | 394,056,600.480<br>(6,679,259,378) | |
| 合計 | | 135,790,655 | | 758,902,393,554<br>(758,902,393,554) | |

**（２）株式以外の有価証券**

2023年1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 | 1,284,033.870 | |
| | | GOODMAN GROUP | 214,602.000 | 3,828,499.680 | |
| | | GPT GROUP | 219,223.000 | 940,466.670 | |
| | | MIRVAC GROUP | 432,802.000 | 939,180.340 | |
| | | SCENTRE GROUP | 647,197.000 | 1,863,927.360 | |
| | | STOCKLAND | 259,328.000 | 949,140.480 | |
| | | VICINITY CENTRES | 386,564.000 | 765,396.720 | |
| | オーストラリア・ドル　小計 | | 2,323,705.000 | 10,570,645.120<br>(965,417,017) | |
| | シンガポール・ドル | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 787,231.000 | 1,574,462.000 | |
| | | CAPLAND ASCENDAS REIT | 440,678.000 | 1,203,050.940 | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 474,100.000 | 772,783.000 | |
| | | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL | 405,500.000 | 697,460.000 | |
| | シンガポール・ドル　小計 | | 2,107,509.000 | 4,247,755.940<br>(422,396,851) | |
| 投資信託受益証券　合計 | | | 4,431,214 | 1,387,813,868<br>(1,387,813,868) | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 18,835.000 | 2,781,176.100 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT | 42,177.000 | 1,304,956.380 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 56,451.000 | 12,529,299.450 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 58,993.000 | 1,311,414.390 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 16,932.000 | 2,759,746.680 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 18,531.000 | 1,248,804.090 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 13,271.000 | 1,504,798.690 | |
| | | CROWN CASTLE INC | 52,742.000 | 7,758,348.200 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 34,187.000 | 3,498,013.840 | |
| | | EQUINIX INC | 11,088.000 | 7,707,823.200 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 20,486.000 | 1,341,628.140 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | EQUITY RESIDENTIAL | 46,054.000 | 2,705,672.500 | |
| | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 8,345.000 | 1,786,330.700 | |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 16,256.000 | 2,381,178.880 | |
| | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 30,095.000 | 1,539,058.300 | |
| | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 42,371.000 | 869,029.210 | |
| | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 62,566.000 | 1,636,100.900 | |
| | HOST HOTELS & RESORTS INC | 91,777.000 | 1,509,731.650 | |
| | INVITATION HOMES INC | 76,646.000 | 2,284,817.260 | |
| | IRON MOUNTAIN INC | 34,514.000 | 1,731,222.240 | |
| | KIMCO REALTY | 71,517.000 | 1,457,516.460 | |
| | MEDICAL PROPERTIES TRUST | 72,327.000 | 903,364.230 | |
| | MID AMERICA | 13,578.000 | 2,100,788.160 | |
| | PROLOGIS INC | 111,846.000 | 12,979,728.300 | |
| | PUBLIC STORAGE | 19,317.000 | 5,431,554.060 | |
| | REALTY INCOME CORP | 76,685.000 | 4,918,575.900 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 19,311.000 | 1,197,861.330 | |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 12,918.000 | 3,795,695.940 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 39,034.000 | 4,561,122.900 | |
| | SUN COMMUNITIES INC | 14,694.000 | 2,112,262.500 | |
| | UDR INC | 41,516.000 | 1,602,102.440 | |
| | VENTAS INC | 48,092.000 | 2,298,316.680 | |
| | VICI PROPERTIES INC | 114,690.000 | 3,713,662.200 | |
| | WELLTOWER INC | 58,944.000 | 4,066,546.560 | |
| | WEYERHAEUSER CO | 89,893.000 | 2,774,097.980 | |
| | WP CAREY INC | 23,664.000 | 1,901,639.040 | |
| アメリカ・ドル　小計 | | 1,580,343.000 | 116,003,985.480<br>(15,358,927,678) | |
| イギリス・ポンド | BRITISH LAND CO PLC | 119,111.000 | 488,593.320 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 77,092.000 | 513,895.270 | |
| | SEGRO PLC | 139,569.000 | 1,103,990.790 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | 335,772.000 | 2,106,479.380<br>(339,122,115) | |
| カナダ・ドル | CANADIAN APT PPTYS REIT | 8,722.000 | 393,449.420 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 14,424.000 | 313,577.760 | |
| カナダ・ドル　小計 | | 23,146.000 | 707,027.180<br>(69,705,810) | |
| ユーロ | COVIVIO | 5,066.000 | 296,107.700 | |
| | GECINA SA | 5,045.000 | 507,527.000 | |
| | KLEPIERRE | 25,279.000 | 556,138.000 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 13,535.000 | 715,730.800 | |
| | WAREHOUSES DE PAUW | 27,206.000 | 762,312.120 | |
| ユーロ　小計 | | 76,131.000 | 2,837,815.620 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | (403,679,272) | |
| | 香港・ドル | LINK REIT | 262,516.000 | 15,737,834.200 | |
| | 香港・ドル　小計 | | 262,516.000 | 15,737,834.200<br>(266,756,290) | |
| 投資証券　合計 | | | 2,277,908 | 16,438,191,165<br>(16,438,191,165) | |
| 合計 | | | | 17,826,005,033<br>(17,826,005,033) | |

（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 | 601銘柄 | 67.90 | － | － | 72.20 |
| | 投資証券 | 36銘柄 | － | － | 1.91 | |
| イギリス・ポンド | 株式 | 78銘柄 | 4.52 | － | － | 4.72 |
| | 投資証券 | 3銘柄 | － | － | 0.04 | |
| イスラエル・シュケル | 株式 | 10銘柄 | 0.14 | － | － | 0.14 |
| オーストラリア・ドル | 株式 | 52銘柄 | 2.21 | － | － | 2.41 |
| | 投資信託受益証券 | 7銘柄 | － | 0.12 | － | |
| カナダ・ドル | 株式 | 86銘柄 | 3.56 | － | － | 3.69 |
| | 投資証券 | 2銘柄 | － | － | 0.01 | |
| シンガポール・ドル | 株式 | 15銘柄 | 0.34 | － | － | 0.40 |
| | 投資信託受益証券 | 4銘柄 | － | 0.05 | － | |
| スイス・フラン | 株式 | 43銘柄 | 3.03 | － | － | 3.14 |
| スウェーデン・クローナ | 株式 | 45銘柄 | 1.02 | － | － | 1.05 |
| デンマーク・クローネ | 株式 | 16銘柄 | 0.85 | － | － | 0.88 |
| ニュージーランド・ドル | 株式 | 5銘柄 | 0.06 | － | － | 0.06 |
| ノルウェー・クローネ | 株式 | 12銘柄 | 0.22 | － | － | 0.22 |
| ユーロ | 株式 | 223銘柄 | 9.79 | － | － | 10.18 |
| | 投資証券 | 5銘柄 | － | － | 0.05 | |
| 香港・ドル | 株式 | 29銘柄 | 0.83 | － | － | 0.89 |
| | 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。

**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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 598,855,592 |
| コール・ローン | 447,863,642 |
| 国債証券 | 183,260,552,033 |
| 派生商品評価勘定 | 194,452 |
| 未収利息 | 1,092,379,589 |
| 前払費用 | 162,144,833 |
| 流動資産合計 | 185,561,990,141 |
| 資産合計 | 185,561,990,141 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 705,359 |
| 未払金 | 3,984,604,073 |
| 未払解約金 | 436,774,000 |
| 流動負債合計 | 4,422,083,432 |
| 負債合計 | 4,422,083,432 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 90,161,381,348 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 90,978,525,361 |
| 元本等合計 | 181,139,906,709 |
| 純資産合計 | 181,139,906,709 |
| 負債純資産合計 | 185,561,990,141 |

**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1月12日<br>至　2023年1月11日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>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<br>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<br>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 | 2023年1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 | 72,664,346,452円 |
| 同期中追加設定元本額 | 59,686,469,020円 |
| 同期中一部解約元本額 | 42,189,434,124円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド | 7,998,867,532円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型） | 4,763,445円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型） | 29,465,948円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型） | 71,260,998円 |
| グローバル８資産ラップファンド（安定型） | 60,096,696円 |
| グローバル８資産ラップファンド（中立型） | 40,921,685円 |
| グローバル８資産ラップファンド（積極型） | 45,093,310円 |
| たわらノーロード　先進国債券 | 16,468,978,025円 |
| たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞ | 236,946,771円 |
| たわらノーロード　バランス（８資産均等型） | 2,332,111,921円 |
| たわらノーロード　バランス（堅実型） | 63,907,819円 |
| たわらノーロード　バランス（標準型） | 322,707,186円 |
| たわらノーロード　バランス（積極型） | 67,946,157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） | 13,123,789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） | 596,489,405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） | 822,180,597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） | 313,556,462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） | 214,111,017円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（保守型） | 2,006,928円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定型） | 13,282,152円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型） | 173,477,312円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（成長型） | 14,270,510円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（積極型） | 23,513,045円 |
| ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞ | 6,629,794,544円 |
| Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド | 806,521,306円 |

| | |
|---|---|
| Ｏｎｅグローバルバランス | 11,412,208円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型 | 732,558,815円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型 | 2,319,739,613円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型 | 2,562,975,814円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド | 418,020,315円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド | 840,738,943円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド | 725,908,949円 |
| マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞ | 14,015,594円 |
| マネックス資産設計ファンド＜育成型＞ | 508,877,587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） | 146,595,885円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０） | 150,866,647円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０） | 229,942,536円 |
| クルーズコントロール | 155,908,387円 |
| ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ | 180,603,325円 |
| ４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞ | 576,899,281円 |
| ４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 612,720,890円 |
| ９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 181,820,147円 |
| ４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞ | 300,172,955円 |
| ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド | 1,053,505,619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） | 442,371,608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） | 453,267,711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） | 111,015,667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） | 275,675,518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） | 435,092,303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） | 941,278,253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） | 163,793,956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） | 392,835,435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） | 213,539,627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） | 5,402,900,023円 |
| ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け） | 2,607,596,617円 |
| 外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定） | 2,556,225,047円 |
| 先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定） | 5,283,700,038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） | 74,771,877円 |
| ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 49,222,893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） | 750,441,772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） | 361,185,468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） | 235,486,976円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 13,076,528円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 33,985,564円 |

| | |
|---|---|
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 7,458,867円 |
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 49,876円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 14,623,479円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 43,562,916円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 1,662,754,177円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 1,410,570,107円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 2,546,981,031円 |
| ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定） | 65,616,271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） | 128,420,174円 |
| ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 1,513,148,047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） | 341,079,324円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 164,845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） | 307,226,791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） | 276,127,849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） | 387,066,891円 |
| ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 52,326,009円 |
| 動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞ | 54,565,376円 |
| コア資産形成ファンド | 36,293,828円 |
| ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ） | 720,918,617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） | 305,355,414円 |
| ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］ | 7,052,612,220円 |
| ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］ | 3,311,988,029円 |
| 計 | 90,161,381,348円 |
| ２．　受益権の総数 | 90,161,381,348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1月12日<br>至　2023年1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。<br>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 | 2023年1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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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 | 2023年1月11日現在<br>当期の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|
| 国債証券 | △18,966,595,814 |
| 合計 | △18,966,595,814 |

（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2023年1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 | 2023年1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 | 99,711,080 | － | 100,278,375 | △567,295 |
| アメリカ・ドル | 30,448,110 | － | 30,580,334 | △132,224 |
| ユーロ | 69,262,970 | － | 69,698,041 | △435,071 |
| 買建 | 3,800,000,000 | － | 3,800,056,388 | 56,388 |
| アメリカ・ドル | 1,968,441,000 | － | 1,968,512,385 | 71,385 |
| イギリス・ポンド | 145,749,000 | － | 145,765,120 | 16,120 |
| オーストラリア・ドル | 58,803,000 | － | 58,809,698 | 6,698 |
| オフショア・人民元 | 174,856,000 | － | 174,779,847 | △76,153 |
| カナダ・ドル | 75,775,000 | － | 75,775,922 | 922 |
| ポーランド・ズロチ | 30,576,000 | － | 30,533,676 | △42,324 |
| メキシコ・ペソ | 37,801,000 | － | 37,781,413 | △19,587 |
| ユーロ | 1,307,999,000 | － | 1,308,098,327 | 99,327 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 合計 | 3,899,711,080 | － | 3,900,334,763 | △510,907 |

（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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 2.0091円 |
| （1万口当たり純資産額） | (20,091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

2023年1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 | 1,585,689.040 | |
| | | US T N/B 0.125 02/15/24 | 4,800,000.000 | 4,569,374.970 | |
| | | US T N/B 0.25 03/15/24 | 3,910,000.000 | 3,714,805.440 | |
| | | US T N/B 0.25 05/15/24 | 7,500,000.000 | 7,077,246.070 | |
| | | US T N/B 0.25 05/31/25 | 3,890,000.000 | 3,549,625.000 | |
| | | US T N/B 0.25 06/15/24 | 3,780,000.000 | 3,555,857.780 | |
| | | US T N/B 0.25 06/30/25 | 3,500,000.000 | 3,192,109.370 | |
| | | US T N/B 0.25 07/31/25 | 3,800,000.000 | 3,452,062.500 | |
| | | US T N/B 0.25 08/31/25 | 3,590,000.000 | 3,251,193.750 | |
| | | US T N/B 0.25 09/30/25 | 3,720,000.000 | 3,366,164.050 | |
| | | US T N/B 0.25 10/31/25 | 4,000,000.000 | 3,605,000.000 | |
| | | US T N/B 0.375 01/31/26 | 3,700,000.000 | 3,321,039.040 | |
| | | US T N/B 0.375 04/15/24 | 4,140,000.000 | 3,925,560.910 | |
| | | US T N/B 0.375 04/30/25 | 2,560,000.000 | 2,351,200.000 | |
| | | US T N/B 0.375 07/15/24 | 4,000,000.000 | 3,761,406.240 | |
| | | US T N/B 0.375 07/31/27 | 3,780,000.000 | 3,246,517.940 | |
| | | US T N/B 0.375 08/15/24 | 4,100,000.000 | 3,844,710.910 | |
| | | US T N/B 0.375 09/15/24 | 2,000,000.000 | 1,870,781.240 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | US T N/B 0.375 09/30/27 | 3,310,000.000 | 2,829,920.670 | |
| | | US T N/B 0.375 11/30/25 | 3,190,000.000 | 2,877,230.450 | |
| | | US T N/B 0.375 12/31/25 | 3,000,000.000 | 2,702,929.680 | |
| | | US T N/B 0.5 02/28/26 | 3,370,000.000 | 3,029,182.380 | |
| | | US T N/B 0.5 03/31/25 | 2,860,000.000 | 2,642,930.450 | |
| | | US T N/B 0.5 04/30/27 | 2,370,000.000 | 2,065,325.380 | |
| | | US T N/B 0.5 05/31/27 | 1,980,000.000 | 1,718,500.760 | |
| | | US T N/B 0.5 06/30/27 | 2,780,000.000 | 2,408,609.370 | |
| | | US T N/B 0.5 08/31/27 | 3,060,000.000 | 2,637,935.140 | |
| | | US T N/B 0.5 10/31/27 | 3,660,000.000 | 3,139,736.700 | |
| | | US T N/B 0.625 03/31/27 | 2,200,000.000 | 1,931,875.000 | |
| | | US T N/B 0.625 05/15/30 | 5,650,000.000 | 4,575,396.480 | |
| | | US T N/B 0.625 07/31/26 | 3,900,000.000 | 3,478,160.120 | |
| | | US T N/B 0.625 08/15/30 | 6,340,000.000 | 5,107,167.130 | |
| | | US T N/B 0.625 10/15/24 | 4,000,000.000 | 3,751,250.000 | |
| | | US T N/B 0.625 11/30/27 | 3,900,000.000 | 3,360,398.410 | |
| | | US T N/B 0.625 12/31/27 | 3,320,000.000 | 2,855,200.000 | |
| | | US T N/B 0.75 01/31/28 | 4,380,000.000 | 3,780,316.370 | |
| | | US T N/B 0.75 03/31/26 | 3,220,000.000 | 2,913,219.510 | |
| | | US T N/B 0.75 04/30/26 | 3,700,000.000 | 3,339,539.040 | |
| | | US T N/B 0.75 05/31/26 | 3,630,000.000 | 3,267,567.180 | |
| | | US T N/B 0.75 08/31/26 | 2,950,000.000 | 2,638,290.980 | |
| | | US T N/B 0.75 11/15/24 | 2,610,000.000 | 2,446,467.180 | |
| | | US T N/B 0.75 12/31/23 | 1,990,000.000 | 1,915,141.790 | |
| | | US T N/B 0.875 01/31/24 | 200,000.000 | 192,195.310 | |
| | | US T N/B 0.875 06/30/26 | 3,310,000.000 | 2,987,275.000 | |
| | | US T N/B 0.875 09/30/26 | 3,110,000.000 | 2,789,038.260 | |
| | | US T N/B 0.875 11/15/30 | 8,280,000.000 | 6,773,104.650 | |
| | | US T N/B 1.0 07/31/28 | 3,770,000.000 | 3,255,012.080 | |
| | | US T N/B 1.0 12/15/24 | 4,610,000.000 | 4,332,499.570 | |
| | | US T N/B 1.125 01/15/25 | 4,880,000.000 | 4,588,153.110 | |
| | | US T N/B 1.125 02/15/31 | 7,890,000.000 | 6,575,821.860 | |
| | | US T N/B 1.125 02/28/25 | 2,980,000.000 | 2,795,146.870 | |
| | | US T N/B 1.125 02/28/27 | 1,100,000.000 | 989,355.460 | |
| | | US T N/B 1.125 02/29/28 | 3,860,000.000 | 3,390,919.520 | |
| | | US T N/B 1.125 05/15/40 | 3,300,000.000 | 2,145,257.790 | |
| | | US T N/B 1.125 08/15/40 | 3,160,000.000 | 2,040,421.850 | |
| | | US T N/B 1.125 08/31/28 | 3,730,000.000 | 3,238,251.940 | |
| | | US T N/B 1.125 10/31/26 | 3,390,000.000 | 3,063,050.360 | |
| | | US T N/B 1.25 03/31/28 | 3,610,000.000 | 3,185,683.950 | |
| | | US T N/B 1.25 04/30/28 | 4,010,000.000 | 3,532,716.000 | |
| | | US T N/B 1.25 05/15/50 | 3,870,000.000 | 2,196,225.000 | |
| | | US T N/B 1.25 05/31/28 | 3,300,000.000 | 2,901,164.030 | |
| | | US T N/B 1.25 06/30/28 | 3,710,000.000 | 3,257,264.060 | |
| | | US T N/B 1.25 08/15/31 | 8,130,000.000 | 6,746,629.670 | |
| | | US T N/B 1.25 08/31/24 | 2,870,000.000 | 2,727,172.630 | |
| | | US T N/B 1.25 09/30/28 | 3,980,000.000 | 3,471,928.120 | |
| | | US T N/B 1.25 11/30/26 | 3,700,000.000 | 3,354,425.770 | |
| | | US T N/B 1.25 12/31/26 | 3,890,000.000 | 3,521,665.620 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | US T N/B 1.375 01/31/25 | 750,000.000 | 708,222.640 | |
| | | US T N/B 1.375 08/15/50 | 4,870,000.000 | 2,848,950.000 | |
| | | US T N/B 1.375 08/31/26 | 1,100,000.000 | 1,007,445.300 | |
| | | US T N/B 1.375 10/31/28 | 3,210,000.000 | 2,817,025.760 | |
| | | US T N/B 1.375 11/15/31 | 7,990,000.000 | 6,657,917.180 | |
| | | US T N/B 1.375 11/15/40 | 3,190,000.000 | 2,149,511.690 | |
| | | US T N/B 1.375 12/31/28 | 3,500,000.000 | 3,068,925.750 | |
| | | US T N/B 1.5 01/31/27 | 3,940,000.000 | 3,596,942.930 | |
| | | US T N/B 1.5 02/15/25 | 4,550,000.000 | 4,301,882.810 | |
| | | US T N/B 1.5 02/15/30 | 3,730,000.000 | 3,243,497.240 | |
| | | US T N/B 1.5 02/29/24 | 4,000,000.000 | 3,861,406.240 | |
| | | US T N/B 1.5 08/15/26 | 3,730,000.000 | 3,431,162.870 | |
| | | US T N/B 1.5 09/30/24 | 4,310,000.000 | 4,106,790.220 | |
| | | US T N/B 1.5 10/31/24 | 2,760,000.000 | 2,623,509.350 | |
| | | US T N/B 1.5 11/30/28 | 4,000,000.000 | 3,530,625.000 | |
| | | US T N/B 1.625 02/15/26 | 2,890,000.000 | 2,694,247.640 | |
| | | US T N/B 1.625 05/15/26 | 3,670,000.000 | 3,408,799.190 | |
| | | US T N/B 1.625 05/15/31 | 9,740,000.000 | 8,379,824.170 | |
| | | US T N/B 1.625 08/15/29 | 3,960,000.000 | 3,497,948.410 | |
| | | US T N/B 1.625 09/30/26 | 1,550,000.000 | 1,433,628.890 | |
| | | US T N/B 1.625 10/31/26 | 1,710,000.000 | 1,577,475.000 | |
| | | US T N/B 1.625 11/15/50 | 4,780,000.000 | 2,991,234.360 | |
| | | US T N/B 1.625 11/30/26 | 1,810,000.000 | 1,666,755.450 | |
| | | US T N/B 1.75 01/31/29 | 4,500,000.000 | 4,017,304.660 | |
| | | US T N/B 1.75 03/15/25 | 4,000,000.000 | 3,799,218.720 | |
| | | US T N/B 1.75 06/30/24 | 1,340,000.000 | 1,287,080.460 | |
| | | US T N/B 1.75 07/31/24 | 1,990,000.000 | 1,909,467.180 | |
| | | US T N/B 1.75 08/15/41 | 4,930,000.000 | 3,500,300.000 | |
| | | US T N/B 1.75 11/15/29 | 2,050,000.000 | 1,823,058.570 | |
| | | US T N/B 1.75 12/31/24 | 1,990,000.000 | 1,896,951.930 | |
| | | US T N/B 1.75 12/31/26 | 2,110,000.000 | 1,950,925.760 | |
| | | US T N/B 1.875 02/15/32 | 7,280,000.000 | 6,311,987.490 | |
| | | US T N/B 1.875 02/15/41 | 4,700,000.000 | 3,447,706.980 | |
| | | US T N/B 1.875 02/15/51 | 4,920,000.000 | 3,282,178.080 | |
| | | US T N/B 1.875 02/28/27 | 3,610,000.000 | 3,342,352.320 | |
| | | US T N/B 1.875 02/28/29 | 4,000,000.000 | 3,600,312.480 | |
| | | US T N/B 1.875 06/30/26 | 1,880,000.000 | 1,758,167.170 | |
| | | US T N/B 1.875 07/31/26 | 2,000,000.000 | 1,867,421.860 | |
| | | US T N/B 1.875 08/31/24 | 820,000.000 | 786,495.300 | |
| | | US T N/B 1.875 11/15/51 | 5,070,000.000 | 3,371,153.870 | |
| | | US T N/B 2.0 02/15/25 | 2,040,000.000 | 1,949,714.040 | |
| | | US T N/B 2.0 02/15/50 | 3,720,000.000 | 2,572,176.530 | |
| | | US T N/B 2.0 04/30/24 | 4,720,000.000 | 4,569,550.000 | |
| | | US T N/B 2.0 05/31/24 | 800,000.000 | 772,937.490 | |
| | | US T N/B 2.0 06/30/24 | 290,000.000 | 279,600.770 | |
| | | US T N/B 2.0 08/15/25 | 5,050,000.000 | 4,794,738.250 | |
| | | US T N/B 2.0 08/15/51 | 5,110,000.000 | 3,509,931.250 | |
| | | US T N/B 2.0 11/15/26 | 2,830,000.000 | 2,642,623.030 | |
| | | US T N/B 2.0 11/15/41 | 4,250,000.000 | 3,149,316.370 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | US T N/B 2.125 02/29/24 | 1,650,000.000 | 1,604,496.080 | |
| | | US T N/B 2.125 03/31/24 | 3,340,000.000 | 3,243,714.040 | |
| | | US T N/B 2.125 05/15/25 | 3,950,000.000 | 3,772,558.560 | |
| | | US T N/B 2.125 05/31/26 | 1,550,000.000 | 1,461,117.180 | |
| | | US T N/B 2.125 07/31/24 | 380,000.000 | 366,640.620 | |
| | | US T N/B 2.125 09/30/24 | 590,000.000 | 568,197.650 | |
| | | US T N/B 2.125 11/30/24 | 1,780,000.000 | 1,710,190.620 | |
| | | US T N/B 2.25 01/31/24 | 710,000.000 | 692,277.730 | |
| | | US T N/B 2.25 02/15/27 | 3,780,000.000 | 3,554,971.870 | |
| | | US T N/B 2.25 02/15/52 | 4,300,000.000 | 3,135,976.530 | |
| | | US T N/B 2.25 03/31/24 | 4,750,000.000 | 4,615,292.940 | |
| | | US T N/B 2.25 03/31/26 | 1,300,000.000 | 1,233,781.240 | |
| | | US T N/B 2.25 04/30/24 | 3,300,000.000 | 3,202,546.870 | |
| | | US T N/B 2.25 05/15/41 | 3,420,000.000 | 2,664,660.900 | |
| | | US T N/B 2.25 08/15/27 | 4,240,000.000 | 3,968,209.330 | |
| | | US T N/B 2.25 08/15/46 | 2,070,000.000 | 1,531,314.820 | |
| | | US T N/B 2.25 08/15/49 | 3,040,000.000 | 2,238,912.460 | |
| | | US T N/B 2.25 10/31/24 | 2,350,000.000 | 2,264,628.890 | |
| | | US T N/B 2.25 11/15/24 | 3,080,000.000 | 2,968,590.600 | |
| | | US T N/B 2.25 11/15/25 | 2,920,000.000 | 2,782,212.500 | |
| | | US T N/B 2.25 11/15/27 | 3,270,000.000 | 3,052,085.130 | |
| | | US T N/B 2.25 12/31/23 | 280,000.000 | 273,426.560 | |
| | | US T N/B 2.25 12/31/24 | 3,000,000.000 | 2,886,796.860 | |
| | | US T N/B 2.375 02/15/42 | 3,610,000.000 | 2,855,002.320 | |
| | | US T N/B 2.375 03/31/29 | 3,000,000.000 | 2,775,820.290 | |
| | | US T N/B 2.375 04/30/26 | 1,260,000.000 | 1,199,559.370 | |
| | | US T N/B 2.375 05/15/27 | 4,430,000.000 | 4,177,697.620 | |
| | | US T N/B 2.375 05/15/29 | 3,470,000.000 | 3,208,258.960 | |
| | | US T N/B 2.375 05/15/51 | 4,760,000.000 | 3,575,950.000 | |
| | | US T N/B 2.375 08/15/24 | 4,610,000.000 | 4,462,515.990 | |
| | | US T N/B 2.375 11/15/49 | 3,790,000.000 | 2,869,444.510 | |
| | | US T N/B 2.5 01/31/24 | 2,550,000.000 | 2,493,023.430 | |
| | | US T N/B 2.5 01/31/25 | 500,000.000 | 483,046.870 | |
| | | US T N/B 2.5 02/15/45 | 2,310,000.000 | 1,814,071.870 | |
| | | US T N/B 2.5 02/15/46 | 1,770,000.000 | 1,381,567.950 | |
| | | US T N/B 2.5 02/28/26 | 2,280,000.000 | 2,181,675.000 | |
| | | US T N/B 2.5 03/31/27 | 2,650,000.000 | 2,513,669.900 | |
| | | US T N/B 2.5 04/30/24 | 4,010,000.000 | 3,903,014.440 | |
| | | US T N/B 2.5 05/15/24 | 5,100,000.000 | 4,962,539.020 | |
| | | US T N/B 2.5 05/15/46 | 2,230,000.000 | 1,740,619.540 | |
| | | US T N/B 2.5 05/31/24 | 4,180,000.000 | 4,065,703.120 | |
| | | US T N/B 2.625 01/31/26 | 2,460,000.000 | 2,367,365.620 | |
| | | US T N/B 2.625 02/15/29 | 4,330,000.000 | 4,069,354.240 | |
| | | US T N/B 2.625 03/31/25 | 1,790,000.000 | 1,732,524.200 | |
| | | US T N/B 2.625 04/15/25 | 3,000,000.000 | 2,900,625.000 | |
| | | US T N/B 2.625 05/31/27 | 3,410,000.000 | 3,250,023.010 | |
| | | US T N/B 2.625 07/31/29 | 2,570,000.000 | 2,409,174.200 | |
| | | US T N/B 2.625 12/31/23 | 3,530,000.000 | 3,460,227.320 | |
| | | US T N/B 2.625 12/31/25 | 1,000,000.000 | 963,164.060 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | US T N/B 2.75 02/15/24 | 2,090,000.000 | 2,047,383.580 | |
| | | US T N/B 2.75 02/15/28 | 3,370,000.000 | 3,211,899.580 | |
| | | US T N/B 2.75 02/28/25 | 1,960,000.000 | 1,902,578.100 | |
| | | US T N/B 2.75 04/30/27 | 3,000,000.000 | 2,874,375.000 | |
| | | US T N/B 2.75 05/15/25 | 4,000,000.000 | 3,876,875.000 | |
| | | US T N/B 2.75 05/31/29 | 3,300,000.000 | 3,118,500.000 | |
| | | US T N/B 2.75 06/30/25 | 1,040,000.000 | 1,007,500.000 | |
| | | US T N/B 2.75 07/31/27 | 3,820,000.000 | 3,655,411.700 | |
| | | US T N/B 2.75 08/15/32 | 4,840,000.000 | 4,504,225.000 | |
| | | US T N/B 2.75 08/15/42 | 1,540,000.000 | 1,288,185.920 | |
| | | US T N/B 2.75 08/15/47 | 2,230,000.000 | 1,817,624.200 | |
| | | US T N/B 2.75 08/31/25 | 1,830,000.000 | 1,769,667.180 | |
| | | US T N/B 2.75 11/15/42 | 1,556,000.000 | 1,297,558.120 | |
| | | US T N/B 2.75 11/15/47 | 2,250,000.000 | 1,833,398.420 | |
| | | US T N/B 2.875 04/30/25 | 2,000,000.000 | 1,944,375.000 | |
| | | US T N/B 2.875 04/30/29 | 3,000,000.000 | 2,856,796.860 | |
| | | US T N/B 2.875 05/15/28 | 5,360,000.000 | 5,135,131.200 | |
| | | US T N/B 2.875 05/15/32 | 6,650,000.000 | 6,264,507.800 | |
| | | US T N/B 2.875 05/15/43 | 2,290,000.000 | 1,943,995.300 | |
| | | US T N/B 2.875 05/15/49 | 3,300,000.000 | 2,772,515.620 | |
| | | US T N/B 2.875 05/15/52 | 4,510,000.000 | 3,779,591.370 | |
| | | US T N/B 2.875 05/31/25 | 1,570,000.000 | 1,525,475.760 | |
| | | US T N/B 2.875 06/15/25 | 7,120,000.000 | 6,919,193.710 | |
| | | US T N/B 2.875 07/31/25 | 2,200,000.000 | 2,138,812.500 | |
| | | US T N/B 2.875 08/15/28 | 4,530,000.000 | 4,326,857.810 | |
| | | US T N/B 2.875 08/15/45 | 1,770,000.000 | 1,483,688.650 | |
| | | US T N/B 2.875 11/15/46 | 1,080,000.000 | 902,475.000 | |
| | | US T N/B 2.875 11/30/25 | 1,360,000.000 | 1,318,084.360 | |
| | | US T N/B 3.0 02/15/47 | 1,960,000.000 | 1,673,962.490 | |
| | | US T N/B 3.0 02/15/48 | 2,650,000.000 | 2,265,957.010 | |
| | | US T N/B 3.0 02/15/49 | 3,310,000.000 | 2,846,082.810 | |
| | | US T N/B 3.0 05/15/42 | 1,080,000.000 | 942,637.500 | |
| | | US T N/B 3.0 05/15/45 | 400,000.000 | 342,625.000 | |
| | | US T N/B 3.0 05/15/47 | 1,620,000.000 | 1,382,315.620 | |
| | | US T N/B 3.0 07/15/25 | 3,200,000.000 | 3,117,624.980 | |
| | | US T N/B 3.0 07/31/24 | 3,820,000.000 | 3,735,989.830 | |
| | | US T N/B 3.0 08/15/48 | 2,810,000.000 | 2,406,062.500 | |
| | | US T N/B 3.0 08/15/52 | 3,530,000.000 | 3,041,867.180 | |
| | | US T N/B 3.0 09/30/25 | 1,750,000.000 | 1,703,242.180 | |
| | | US T N/B 3.0 10/31/25 | 1,270,000.000 | 1,235,521.470 | |
| | | US T N/B 3.0 11/15/44 | 1,560,000.000 | 1,340,381.240 | |
| | | US T N/B 3.0 11/15/45 | 860,000.000 | 736,710.930 | |
| | | US T N/B 3.125 02/15/42 | 860,000.000 | 768,289.050 | |
| | | US T N/B 3.125 02/15/43 | 1,740,000.000 | 1,540,035.920 | |
| | | US T N/B 3.125 05/15/48 | 2,830,000.000 | 2,475,586.700 | |
| | | US T N/B 3.125 08/15/25 | 3,030,000.000 | 2,959,457.810 | |
| | | US T N/B 3.125 08/15/44 | 2,090,000.000 | 1,834,954.680 | |
| | | US T N/B 3.125 08/31/27 | 1,730,000.000 | 1,683,506.250 | |
| | | US T N/B 3.125 08/31/29 | 3,110,000.000 | 3,004,308.570 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | US T N/B 3.125 11/15/28 | 4,380,000.000 | 4,241,414.030 | |
| | US T N/B 3.125 11/15/41 | 1,020,000.000 | 913,378.120 | |
| | US T N/B 3.25 05/15/42 | 3,760,000.000 | 3,415,137.490 | |
| | US T N/B 3.25 06/30/27 | 3,500,000.000 | 3,421,660.130 | |
| | US T N/B 3.25 06/30/29 | 3,000,000.000 | 2,918,554.680 | |
| | US T N/B 3.375 05/15/44 | 1,430,000.000 | 1,308,338.260 | |
| | US T N/B 3.375 08/15/42 | 1,500,000.000 | 1,386,796.870 | |
| | US T N/B 3.375 11/15/48 | 3,200,000.000 | 2,938,749.960 | |
| | US T N/B 3.5 02/15/39 | 500,000.000 | 485,781.250 | |
| | US T N/B 3.5 09/15/25 | 3,000,000.000 | 2,959,687.500 | |
| | US T N/B 3.625 02/15/44 | 1,630,000.000 | 1,553,211.710 | |
| | US T N/B 3.625 08/15/43 | 1,470,000.000 | 1,402,471.870 | |
| | US T N/B 3.75 08/15/41 | 820,000.000 | 806,034.360 | |
| | US T N/B 3.75 11/15/43 | 1,960,000.000 | 1,904,875.000 | |
| | US T N/B 3.875 08/15/40 | 1,290,000.000 | 1,301,690.620 | |
| | US T N/B 3.875 09/30/29 | 3,250,000.000 | 3,284,150.380 | |
| | US T N/B 3.875 11/30/27 | 7,000,000.000 | 7,048,671.840 | |
| | US T N/B 3.875 11/30/29 | 2,300,000.000 | 2,324,437.500 | |
| | US T N/B 4.0 10/31/29 | 2,000,000.000 | 2,036,562.500 | |
| | US T N/B 4.0 11/15/42 | 1,200,000.000 | 1,214,625.000 | |
| | US T N/B 4.0 11/15/52 | 2,460,000.000 | 2,572,429.670 | |
| | US T N/B 4.0 12/15/25 | 1,000,000.000 | 1,000,625.000 | |
| | US T N/B 4.125 09/30/27 | 2,000,000.000 | 2,030,390.620 | |
| | US T N/B 4.125 10/31/27 | 3,940,000.000 | 4,003,717.200 | |
| | US T N/B 4.125 11/15/32 | 2,500,000.000 | 2,604,882.800 | |
| | US T N/B 4.25 05/15/39 | 950,000.000 | 1,011,007.800 | |
| | US T N/B 4.25 09/30/24 | 2,200,000.000 | 2,195,316.390 | |
| | US T N/B 4.25 10/15/25 | 2,800,000.000 | 2,816,625.000 | |
| | US T N/B 4.25 11/15/40 | 600,000.000 | 634,031.250 | |
| | US T N/B 4.375 02/15/38 | 600,000.000 | 647,625.000 | |
| | US T N/B 4.375 05/15/40 | 910,000.000 | 978,463.270 | |
| | US T N/B 4.375 05/15/41 | 230,000.000 | 246,692.960 | |
| | US T N/B 4.375 10/31/24 | 2,070,000.000 | 2,070,929.880 | |
| | US T N/B 4.375 11/15/39 | 1,000,000.000 | 1,078,203.120 | |
| | US T N/B 4.5 02/15/36 | 400,000.000 | 438,750.000 | |
| | US T N/B 4.5 05/15/38 | 600,000.000 | 656,531.240 | |
| | US T N/B 4.5 08/15/39 | 980,000.000 | 1,073,482.790 | |
| | US T N/B 4.5 11/15/25 | 3,570,000.000 | 3,617,135.130 | |
| | US T N/B 4.5 11/30/24 | 2,200,000.000 | 2,207,476.560 | |
| | US T N/B 4.625 02/15/40 | 890,000.000 | 988,247.630 | |
| | US T N/B 4.75 02/15/41 | 830,000.000 | 933,425.770 | |
| | US T N/B 5.0 05/15/37 | 555,000.000 | 638,163.270 | |
| | US T N/B 5.25 11/15/28 | 850,000.000 | 915,941.400 | |
| | US T N/B 5.375 02/15/31 | 860,000.000 | 962,326.540 | |
| | US T N/B 6.0 02/15/26 | 400,000.000 | 423,531.240 | |
| | US T N/B 6.125 11/15/27 | 200,000.000 | 220,593.750 | |
| | US T N/B 6.25 05/15/30 | 759,000.000 | 881,685.230 | |
| **アメリカ・ドル　小計** | | 771,170,000.000<br>(102,102,908,000) | 693,375,911.420<br>(91,802,970,670) | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| イギリス・ポンド | UK TREASURY 0.125 01/30/26 | 950,000.000 | 862,056.310 | |
| | UK TREASURY 0.125 01/31/24 | 1,800,000.000 | 1,737,566.100 | |
| | UK TREASURY 0.125 01/31/28 | 1,040,000.000 | 879,999.320 | |
| | UK TREASURY 0.25 01/31/25 | 2,400,000.000 | 2,241,646.080 | |
| | UK TREASURY 0.25 07/31/31 | 1,770,000.000 | 1,341,660.000 | |
| | UK TREASURY 0.375 10/22/26 | 1,390,000.000 | 1,239,796.600 | |
| | UK TREASURY 0.375 10/22/30 | 1,220,000.000 | 961,360.000 | |
| | UK TREASURY 0.5 01/31/29 | 680,000.000 | 568,208.000 | |
| | UK TREASURY 0.5 10/22/61 | 1,670,000.000 | 605,074.400 | |
| | UK TREASURY 0.625 06/07/25 | 1,060,000.000 | 993,591.000 | |
| | UK TREASURY 0.625 07/31/35 | 1,350,000.000 | 925,704.720 | |
| | UK TREASURY 0.625 10/22/50 | 450,000.000 | 202,815.000 | |
| | UK TREASURY 0.875 01/31/46 | 1,670,000.000 | 886,436.000 | |
| | UK TREASURY 0.875 07/31/33 | 700,000.000 | 528,645.600 | |
| | UK TREASURY 0.875 10/22/29 | 2,710,000.000 | 2,289,950.000 | |
| | UK TREASURY 1.0 01/31/32 | 2,370,000.000 | 1,897,327.200 | |
| | UK TREASURY 1.0 04/22/24 | 950,000.000 | 921,405.000 | |
| | UK TREASURY 1.125 01/31/39 | 760,000.000 | 507,604.000 | |
| | UK TREASURY 1.125 10/22/73 | 740,000.000 | 329,625.600 | |
| | UK TREASURY 1.25 07/22/27 | 1,600,000.000 | 1,453,974.400 | |
| | UK TREASURY 1.25 07/31/51 | 1,330,000.000 | 725,284.100 | |
| | UK TREASURY 1.25 10/22/41 | 1,600,000.000 | 1,029,055.030 | |
| | UK TREASURY 1.5 07/22/26 | 1,100,000.000 | 1,029,268.460 | |
| | UK TREASURY 1.5 07/22/47 | 1,000,000.000 | 615,914.000 | |
| | UK TREASURY 1.5 07/31/53 | 350,000.000 | 202,035.540 | |
| | UK TREASURY 1.625 10/22/28 | 1,130,000.000 | 1,024,774.400 | |
| | UK TREASURY 1.625 10/22/54 | 870,000.000 | 517,147.140 | |
| | UK TREASURY 1.625 10/22/71 | 830,000.000 | 464,708.700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | UK TREASURY 1.75 01/22/49 | 630,000.000 | 406,836.100 | |
| | UK TREASURY 1.75 07/22/57 | 1,130,000.000 | 693,740.900 | |
| | UK TREASURY 1.75 09/07/37 | 1,390,000.000 | 1,059,597.000 | |
| | UK TREASURY 2.0 09/07/25 | 1,190,000.000 | 1,148,338.100 | |
| | UK TREASURY 2.5 07/22/65 | 1,250,000.000 | 938,262.500 | |
| | UK TREASURY 2.75 09/07/24 | 810,000.000 | 800,339.940 | |
| | UK TREASURY 3.25 01/22/44 | 1,270,000.000 | 1,134,592.600 | |
| | UK TREASURY 3.5 01/22/45 | 1,450,000.000 | 1,343,280.860 | |
| | UK TREASURY 3.5 07/22/68 | 930,000.000 | 893,451.000 | |
| | UK TREASURY 3.75 01/29/38 | 400,000.000 | 391,520.000 | |
| | UK TREASURY 3.75 07/22/52 | 970,000.000 | 940,948.500 | |
| | UK TREASURY 4.0 01/22/60 | 900,000.000 | 944,667.000 | |
| | UK TREASURY 4.125 01/29/27 | 200,000.000 | 203,716.360 | |
| | UK TREASURY 4.25 03/07/36 | 1,800,000.000 | 1,881,027.000 | |
| | UK TREASURY 4.25 06/07/32 | 1,440,000.000 | 1,520,553.600 | |
| | UK TREASURY 4.25 09/07/39 | 1,260,000.000 | 1,306,431.000 | |
| | UK TREASURY 4.25 12/07/27 | 910,000.000 | 942,306.070 | |
| | UK TREASURY 4.25 12/07/40 | 1,070,000.000 | 1,107,824.500 | |
| | UK TREASURY 4.25 12/07/46 | 1,080,000.000 | 1,120,284.000 | |
| | UK TREASURY 4.25 12/07/49 | 1,017,000.000 | 1,063,426.050 | |
| | UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 1,212,000.000 | 1,300,354.800 | |
| | UK TREASURY 4.5 09/07/34 | 900,000.000 | 966,744.000 | |
| | UK TREASURY 4.5 12/07/42 | 1,265,000.000 | 1,354,498.750 | |
| | UK TREASURY 4.75 12/07/30 | 1,095,000.000 | 1,189,345.200 | |
| | UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 980,000.000 | 1,076,726.000 | |
| | UK TREASURY 5.0 03/07/25 | 1,095,000.000 | 1,129,980.420 | |
| | UK TREASURY 6.0 12/07/28 | 680,000.000 | 767,958.000 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | 63,814,000.000<br>(10,273,415,860) | 54,609,382.950<br>(8,791,564,561) | |
| イスラエル・シュケル | ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24 | 320,000.000 | 301,523.200 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26 | 310,000.000 | 282,002.040 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25 | 1,890,000.000 | 1,758,599.640 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30 | 2,860,000.000 | 2,435,967.820 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37 | 1,450,000.000 | 1,129,741.400 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25 | 2,300,000.000 | 2,193,429.500 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27 | 2,230,000.000 | 2,103,902.420 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28 | 1,460,000.000 | 1,372,880.340 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24 | 1,320,000.000 | 1,317,378.480 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47 | 1,570,000.000 | 1,616,541.080 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42 | 1,090,000.000 | 1,391,093.970 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26 | 220,000.000 | 241,095.800 | |
| イスラエル・シュケル　小計 | | | 17,020,000.000<br>(650,458,446) | 16,144,155.690<br>(616,986,041) | |
| | オーストラリア・ドル | AUSTRALIAN 0.25 11/21/24 | 1,990,000.000 | 1,882,782.510 | |
| | | AUSTRALIAN 0.25 11/21/25 | 1,160,000.000 | 1,064,060.800 | |
| | | AUSTRALIAN 0.5 09/21/26 | 1,815,000.000 | 1,635,228.960 | |
| | | AUSTRALIAN 1.0 11/21/31 | 2,170,000.000 | 1,731,295.310 | |
| | | AUSTRALIAN 1.0 12/21/30 | 1,670,000.000 | 1,366,014.410 | |
| | | AUSTRALIAN 1.25 05/21/32 | 1,890,000.000 | 1,525,681.610 | |
| | | AUSTRALIAN 1.5 06/21/31 | 1,610,000.000 | 1,357,446.250 | |
| | | AUSTRALIAN 1.75 06/21/51 | 1,200,000.000 | 727,080.000 | |
| | | AUSTRALIAN 1.75 11/21/32 | 1,850,000.000 | 1,551,784.480 | |
| | | AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 880,000.000 | 825,308.000 | |
| | | AUSTRALIAN 2.5 05/21/30 | 1,810,000.000 | 1,680,717.350 | |
| | | AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 970,000.000 | 963,513.750 | |
| | | AUSTRALIAN 2.75 05/21/41 | 900,000.000 | 745,040.400 | |
| | | AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 650,000.000 | 578,799.270 | |
| | | AUSTRALIAN 2.75 11/21/27 | 1,230,000.000 | 1,188,918.000 | |
| | | AUSTRALIAN 2.75 11/21/28 | 960,000.000 | 921,925.950 | |
| | | AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 1,400,000.000 | 1,325,100.000 | |
| | | AUSTRALIAN 3.0 03/21/47 | 880,000.000 | 732,084.420 | |
| | | AUSTRALIAN 3.0 11/21/33 | 1,620,000.000 | 1,512,087.710 | |
| | | AUSTRALIAN 3.25 04/21/25 | 1,380,000.000 | 1,379,048.480 | |
| | | AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 1,500,000.000 | 1,475,911.270 | |
| | | AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 1,020,000.000 | 924,260.110 | |
| | | AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 830,000.000 | 811,715.630 | |
| | | AUSTRALIAN 3.75 05/21/34 | 600,000.000 | 598,565.020 | |
| | | AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 | 1,200,000.000 | 1,234,045.060 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | AUSTRALIAN 4.5 04/21/33 | 1,230,000.000 | 1,311,751.210 | |
| | AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 1,440,000.000 | 1,516,474.800 | |
| **オーストラリア・ドル　小計** | | 35,855,000.000<br>(3,274,637,150) | 32,566,640.760<br>(2,974,311,301) | |
| **オフショア・人民元** | CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24 | 10,000,000.000 | 9,946,326.300 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24 | 4,200,000.000 | 4,190,997.130 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25 | 30,000,000.000 | 29,774,456.090 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25 | 8,490,000.000 | 8,449,353.950 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 | 34,500,000.000 | 34,392,099.870 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24 | 12,000,000.000 | 12,005,448.000 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27 | 4,000,000.000 | 3,964,147.880 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24 | 15,300,000.000 | 15,325,162.380 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27 | 30,100,000.000 | 29,876,294.680 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27 | 20,410,000.000 | 20,264,189.530 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32 | 7,300,000.000 | 7,117,994.940 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29 | 17,500,000.000 | 17,290,826.170 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 | 6,600,000.000 | 6,528,520.150 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 | 26,600,000.000 | 26,687,604.440 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32 | 13,000,000.000 | 12,758,460.390 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32 | 20,000,000.000 | 19,778,004.400 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29 | 20,000,000.000 | 19,931,400.000 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32 | 3,000,000.000 | 2,964,132.540 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29 | 11,000,000.000 | 10,985,480.000 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32 | 6,300,000.000 | 6,266,421.000 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27 | 7,500,000.000 | 7,557,101.250 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31 | 4,100,000.000 | 4,105,016.760 | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28 | 15,600,000.000 | 15,752,282.520 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31 | 1,000,000.000 | 1,012,290.000 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26 | 450,000.000 | 461,274.030 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27 | 3,500,000.000 | 3,607,430.400 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52 | 13,320,000.000 | 13,507,417.720 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50 | 5,100,000.000 | 5,180,666.190 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51 | 18,950,000.000 | 19,791,095.750 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27 | 5,000,000.000 | 5,243,357.500 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51 | 2,100,000.000 | 2,260,347.180 | |
| **オフショア・人民元　小計** | | | 376,920,000.000<br>(7,354,010,736) | 376,975,599.140<br>(7,355,095,520) | |
| **カナダ・ドル** | | CANADA 0.25 03/01/26 | 1,410,000.000 | 1,272,305.040 | |
| | | CANADA 0.25 04/01/24 | 1,500,000.000 | 1,430,659.500 | |
| | | CANADA 0.5 09/01/25 | 1,910,000.000 | 1,757,582.000 | |
| | | CANADA 0.5 12/01/30 | 1,800,000.000 | 1,473,444.000 | |
| | | CANADA 0.75 02/01/24 | 200,000.000 | 192,705.400 | |
| | | CANADA 0.75 10/01/24 | 810,000.000 | 767,327.580 | |
| | | CANADA 1.0 06/01/27 | 550,000.000 | 501,641.250 | |
| | | CANADA 1.0 09/01/26 | 1,270,000.000 | 1,165,545.040 | |
| | | CANADA 1.25 03/01/25 | 700,000.000 | 663,709.200 | |
| | | CANADA 1.25 03/01/27 | 1,210,000.000 | 1,114,142.590 | |
| | | CANADA 1.25 06/01/30 | 1,850,000.000 | 1,625,254.600 | |
| | | CANADA 1.5 04/01/25 | 1,100,000.000 | 1,046,313.400 | |
| | | CANADA 1.5 05/01/24 | 940,000.000 | 908,324.820 | |
| | | CANADA 1.5 06/01/26 | 700,000.000 | 657,559.000 | |
| | | CANADA 1.5 06/01/31 | 2,470,000.000 | 2,175,783.480 | |
| | | CANADA 1.5 09/01/24 | 440,000.000 | 423,045.920 | |
| | | CANADA 1.5 12/01/31 | 2,020,000.000 | 1,767,124.280 | |
| | | CANADA 1.75 12/01/53 | 2,070,000.000 | 1,504,126.170 | |
| | | CANADA 2.0 06/01/28 | 850,000.000 | 804,214.750 | |
| | | CANADA 2.0 06/01/32 | 1,940,000.000 | 1,764,237.940 | |
| | | CANADA 2.0 12/01/51 | 2,940,000.000 | 2,301,429.060 | |
| | | CANADA 2.25 03/01/24 | 420,000.000 | 410,813.340 | |
| | | CANADA 2.25 06/01/25 | 800,000.000 | 774,584.000 | |
| | | CANADA 2.25 06/01/29 | 430,000.000 | 409,765.920 | |
| | | CANADA 2.25 12/01/29 | 500,000.000 | 475,236.000 | |
| | | CANADA 2.5 06/01/24 | 970,000.000 | 949,367.130 | |
| | | CANADA 2.5 12/01/32 | 1,300,000.000 | 1,231,859.200 | |
| | | CANADA 2.75 08/01/24 | 590,000.000 | 578,428.330 | |
| | | CANADA 2.75 09/01/27 | 850,000.000 | 832,223.950 | |
| | | CANADA 2.75 12/01/48 | 630,000.000 | 584,256.960 | |
| | | CANADA 2.75 12/01/64 | 390,000.000 | 355,165.590 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CANADA 3.0 10/01/25 | 500,000.000 | 491,308.500 | |
| | CANADA 3.0 11/01/24 | 860,000.000 | 846,008.660 | |
| | CANADA 3.5 03/01/28 | 480,000.000 | 486,572.160 | |
| | CANADA 3.5 12/01/45 | 700,000.000 | 734,839.000 | |
| | CANADA 3.75 02/01/25 | 1,160,000.000 | 1,157,166.120 | |
| | CANADA 4.0 06/01/41 | 570,000.000 | 631,142.760 | |
| | CANADA 5.0 06/01/37 | 340,000.000 | 409,633.360 | |
| | CANADA 5.75 06/01/29 | 1,090,000.000 | 1,256,466.980 | |
| | CANADA 5.75 06/01/33 | 610,000.000 | 748,542.590 | |
| カナダ・ドル　小計 | | 41,870,000.000<br>(4,127,963,300) | 38,679,855.570<br>(3,813,446,961) | |
| シンガポール・ドル | SINGAPORE 0.5 11/01/25 | 380,000.000 | 355,566.000 | |
| | SINGAPORE 1.25 11/01/26 | 410,000.000 | 387,450.000 | |
| | SINGAPORE 1.625 07/01/31 | 350,000.000 | 316,841.990 | |
| | SINGAPORE 1.875 03/01/50 | 490,000.000 | 429,730.000 | |
| | SINGAPORE 1.875 10/01/51 | 410,000.000 | 362,173.500 | |
| | SINGAPORE 2.0 02/01/24 | 280,000.000 | 276,358.370 | |
| | SINGAPORE 2.125 06/01/26 | 370,000.000 | 361,268.000 | |
| | SINGAPORE 2.25 08/01/36 | 590,000.000 | 547,579.000 | |
| | SINGAPORE 2.375 06/01/25 | 780,000.000 | 769,470.000 | |
| | SINGAPORE 2.375 07/01/39 | 140,000.000 | 130,620.000 | |
| | SINGAPORE 2.625 05/01/28 | 420,000.000 | 416,304.000 | |
| | SINGAPORE 2.75 03/01/46 | 500,000.000 | 522,500.000 | |
| | SINGAPORE 2.75 04/01/42 | 340,000.000 | 349,936.500 | |
| | SINGAPORE 2.875 07/01/29 | 480,000.000 | 480,864.000 | |
| | SINGAPORE 2.875 09/01/30 | 620,000.000 | 619,690.000 | |
| | SINGAPORE 3.0 08/01/72 | 125,000.000 | 138,679.430 | |
| | SINGAPORE 3.0 09/01/24 | 810,000.000 | 808,894.350 | |
| | SINGAPORE 3.375 09/01/33 | 330,000.000 | 344,355.000 | |
| | SINGAPORE 3.5 03/01/27 | 800,000.000 | 821,360.000 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | 8,625,000.000<br>(857,670,000) | 8,439,640.140<br>(839,237,816) | |
| スウェーデン・クローナ | SWEDEN 0.125 05/12/31 | 4,540,000.000 | 3,870,759.950 | |
| | SWEDEN 0.75 05/12/28 | 2,890,000.000 | 2,684,344.990 | |
| | SWEDEN 0.75 11/12/29 | 3,010,000.000 | 2,755,622.190 | |
| | SWEDEN 1.0 11/12/26 | 6,210,000.000 | 5,909,426.730 | |
| | SWEDEN 2.25 06/01/32 | 2,800,000.000 | 2,851,352.000 | |
| | SWEDEN 2.5 05/12/25 | 6,120,000.000 | 6,111,992.880 | |
| | SWEDEN 3.5 03/30/39 | 3,420,000.000 | 4,145,467.500 | |
| スウェーデン・クローナ　小計 | | 28,990,000.000<br>(368,752,800) | 28,328,966.240<br>(360,344,451) | |
| デンマーク・クローネ | DENMARK 0.0 11/15/24 | 980,000.000 | 933,254.000 | |
| | DENMARK 0.0 11/15/31 | 4,180,000.000 | 3,351,114.360 | |
| | DENMARK 0.25 11/15/52 | 2,970,000.000 | 1,685,678.500 | |
| | DENMARK 0.5 11/15/27 | 6,350,000.000 | 5,783,632.060 | |
| | DENMARK 0.5 11/15/29 | 5,750,000.000 | 5,042,492.390 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | DENMARK 1.75 11/15/25 | 4,040,000.000 | 3,947,078.780 | |
| | DENMARK 4.5 11/15/39 | 7,960,000.000 | 10,116,211.940 | |
| デンマーク・クローネ　小計 | | 32,230,000.000<br>(616,559,900) | 30,859,462.030<br>(590,341,509) | |
| ニュージーランド・ドル | NEW ZEALAND 0.25 05/15/28 | 350,000.000 | 283,986.930 | |
| | NEW ZEALAND 0.5 05/15/24 | 650,000.000 | 612,594.390 | |
| | NEW ZEALAND 0.5 05/15/26 | 360,000.000 | 316,279.720 | |
| | NEW ZEALAND 1.5 05/15/31 | 350,000.000 | 283,535.000 | |
| | NEW ZEALAND 1.75 05/15/41 | 400,000.000 | 266,327.030 | |
| | NEW ZEALAND 2.0 05/15/32 | 350,000.000 | 290,898.720 | |
| | NEW ZEALAND 2.75 04/15/25 | 450,000.000 | 431,737.390 | |
| | NEW ZEALAND 2.75 04/15/37 | 330,000.000 | 273,319.060 | |
| | NEW ZEALAND 2.75 05/15/51 | 440,000.000 | 330,152.570 | |
| | NEW ZEALAND 3.0 04/20/29 | 350,000.000 | 326,337.870 | |
| | NEW ZEALAND 3.5 04/14/33 | 350,000.000 | 329,057.930 | |
| | NEW ZEALAND 4.25 05/15/34 | 130,000.000 | 129,597.000 | |
| | NEW ZEALAND 4.5 04/15/27 | 700,000.000 | 704,547.480 | |
| ニュージーランド・ドル　小計 | | 5,210,000.000<br>(439,567,700) | 4,578,371.090<br>(386,277,169) | |
| ノルウェー・クローネ | NORWAY 1.25 09/17/31 | 2,650,000.000 | 2,281,716.250 | |
| | NORWAY 1.375 08/19/30 | 4,310,000.000 | 3,819,336.670 | |
| | NORWAY 1.5 02/19/26 | 4,480,000.000 | 4,278,776.320 | |
| | NORWAY 1.75 02/17/27 | 2,400,000.000 | 2,286,636.000 | |
| | NORWAY 1.75 03/13/25 | 5,540,000.000 | 5,381,556.000 | |
| | NORWAY 1.75 09/06/29 | 3,300,000.000 | 3,047,863.500 | |
| | NORWAY 2.0 04/26/28 | 2,070,000.000 | 1,971,054.000 | |
| | NORWAY 2.125 05/18/32 | 1,170,000.000 | 1,077,892.920 | |
| | NORWAY 3.0 03/14/24 | 2,370,000.000 | 2,362,688.920 | |
| ノルウェー・クローネ　小計 | | 28,290,000.000<br>(375,691,200) | 26,507,520.580<br>(352,019,873) | |
| ポーランド・ズロチ | POLAND 0.25 10/25/26 | 1,880,000.000 | 1,524,962.000 | |
| | POLAND 0.75 04/25/25 | 3,370,000.000 | 3,005,871.500 | |
| | POLAND 07/25/24 | 1,710,000.000 | 1,563,395.600 | |
| | POLAND 1.25 10/25/30 | 3,930,000.000 | 2,805,116.100 | |
| | POLAND 1.75 04/25/32 | 2,160,000.000 | 1,518,264.000 | |
| | POLAND 2.25 10/25/24 | 2,150,000.000 | 2,017,501.950 | |
| | POLAND 2.5 04/25/24 | 780,000.000 | 746,809.440 | |
| | POLAND 2.5 07/25/26 | 2,790,000.000 | 2,481,381.360 | |
| | POLAND 2.5 07/25/27 | 2,360,000.000 | 2,048,008.000 | |
| | POLAND 2.75 04/25/28 | 3,480,000.000 | 2,994,505.200 | |
| | POLAND 2.75 10/25/29 | 630,000.000 | 521,498.250 | |
| | POLAND 3.25 07/25/25 | 3,730,000.000 | 3,499,045.860 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | POLAND 3.75 05/25/27 | 1,450,000.000 | 1,344,295.000 | |
| | POLAND 5.75 04/25/29 | 1,440,000.000 | 1,433,160.000 | |
| ポーランド・ズロチ　小計 | | 31,860,000.000<br>(965,759,436) | 27,503,814.260<br>(833,712,120) | |
| マレーシア・リンギット | MALAYSIA 2.632 04/15/31 | 1,000,000.000 | 903,271.890 | |
| | MALAYSIA 3.478 06/14/24 | 1,000,000.000 | 1,000,915.400 | |
| | MALAYSIA 3.502 05/31/27 | 650,000.000 | 642,282.290 | |
| | MALAYSIA 3.582 07/15/32 | 1,400,000.000 | 1,359,473.580 | |
| | MALAYSIA 3.733 06/15/28 | 2,000,000.000 | 1,985,699.100 | |
| | MALAYSIA 3.757 05/22/40 | 1,500,000.000 | 1,392,334.420 | |
| | MALAYSIA 3.828 07/05/34 | 1,820,000.000 | 1,779,100.670 | |
| | MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 1,660,000.000 | 1,625,992.070 | |
| | MALAYSIA 3.882 03/14/25 | 300,000.000 | 302,240.400 | |
| | MALAYSIA 3.885 08/15/29 | 700,000.000 | 696,959.830 | |
| | MALAYSIA 3.892 03/15/27 | 600,000.000 | 603,156.600 | |
| | MALAYSIA 3.899 11/16/27 | 1,430,000.000 | 1,437,407.400 | |
| | MALAYSIA 3.9 11/30/26 | 1,660,000.000 | 1,672,447.330 | |
| | MALAYSIA 3.906 07/15/26 | 320,000.000 | 322,699.230 | |
| | MALAYSIA 3.955 09/15/25 | 2,400,000.000 | 2,423,353.680 | |
| | MALAYSIA 4.059 09/30/24 | 900,000.000 | 908,860.050 | |
| | MALAYSIA 4.065 06/15/50 | 400,000.000 | 370,062.020 | |
| | MALAYSIA 4.181 07/15/24 | 1,030,000.000 | 1,040,828.180 | |
| | MALAYSIA 4.232 06/30/31 | 480,000.000 | 487,580.300 | |
| | MALAYSIA 4.254 05/31/35 | 600,000.000 | 608,259.300 | |
| | MALAYSIA 4.392 04/15/26 | 1,050,000.000 | 1,074,526.110 | |
| | MALAYSIA 4.498 04/15/30 | 1,200,000.000 | 1,237,822.200 | |
| | MALAYSIA 4.504 04/30/29 | 300,000.000 | 309,006.660 | |
| | MALAYSIA 4.642 11/07/33 | 500,000.000 | 525,177.450 | |
| | MALAYSIA 4.696 10/15/42 | 680,000.000 | 717,427.600 | |
| | MALAYSIA 4.736 03/15/46 | 300,000.000 | 310,731.390 | |
| | MALAYSIA 4.762 04/07/37 | 1,700,000.000 | 1,797,747.790 | |
| | MALAYSIA 4.893 06/08/38 | 620,000.000 | 665,924.140 | |
| | MALAYSIA 4.921 07/06/48 | 1,990,000.000 | 2,097,979.780 | |
| | MALAYSIA 4.935 09/30/43 | 1,600,000.000 | 1,716,799.040 | |
| マレーシア・リンギット　小計 | | 31,790,000.000<br>(962,095,739) | 32,016,065.900<br>(968,937,420) | |
| メキシコ・ペソ | MEXICAN BONDS 03/04/27 | 11,580,000.000 | 10,304,694.600 | |
| | MEXICAN BONDS 03/06/25 | 9,180,000.000 | 8,377,530.300 | |
| | MEXICAN BONDS 05/26/33 | 2,800,000.000 | 2,574,460.000 | |
| | MEXICAN BONDS 07/31/53 | 6,290,000.000 | 5,814,923.210 | |
| | MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36 | 5,485,000.000 | 6,109,467.250 | |
| | MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 15,502,000.000 | 15,595,066.410 | |
| | MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26 | 28,522,000.000 | 26,027,637.000 | |
| | MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 24,746,000.000 | 23,773,234.740 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31 | 30,648,000.000 | 29,192,986.200 | |
| | | MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 17,277,000.000 | 15,606,659.640 | |
| | | MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34 | 4,835,000.000 | 4,526,817.100 | |
| | | MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24 | 22,070,000.000 | 21,354,619.250 | |
| | | MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47 | 16,161,000.000 | 14,925,168.330 | |
| | | MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 | 20,159,000.000 | 20,138,034.640 | |
| | | MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38 | 15,642,000.000 | 15,302,255.760 | |
| | メキシコ・ペソ　小計 | | 230,897,000.000<br>(1,604,433,984) | 219,623,554.430<br>(1,526,098,193) | |
| | ユーロ | AUSTRIA 0.0 02/20/30 | 930,000.000 | 763,367.250 | |
| | | AUSTRIA 0.0 02/20/31 | 710,000.000 | 565,198.340 | |
| | | AUSTRIA 0.0 04/20/25 | 580,000.000 | 546,089.140 | |
| | | AUSTRIA 0.0 10/20/28 | 570,000.000 | 487,961.040 | |
| | | AUSTRIA 0.0 10/20/40 | 450,000.000 | 264,330.000 | |
| | | AUSTRIA 0.25 10/20/36 | 380,000.000 | 261,440.000 | |
| | | AUSTRIA 0.5 02/20/29 | 920,000.000 | 804,567.600 | |
| | | AUSTRIA 0.5 04/20/27 | 1,070,000.000 | 978,110.120 | |
| | | AUSTRIA 0.7 04/20/71 | 210,000.000 | 101,932.320 | |
| | | AUSTRIA 0.75 02/20/28 | 835,000.000 | 760,534.700 | |
| | | AUSTRIA 0.75 03/20/51 | 590,000.000 | 355,547.570 | |
| | | AUSTRIA 0.75 10/20/26 | 1,070,000.000 | 1,001,092.000 | |
| | | AUSTRIA 0.85 06/30/20 | 310,000.000 | 145,137.970 | |
| | | AUSTRIA 0.9 02/20/32 | 900,000.000 | 758,057.080 | |
| | | AUSTRIA 07/15/24 | 520,000.000 | 499,842.200 | |
| | | AUSTRIA 1.2 10/20/25 | 1,010,000.000 | 974,055.110 | |
| | | AUSTRIA 1.5 02/20/47 | 640,000.000 | 485,880.320 | |
| | | AUSTRIA 1.5 11/02/86 | 190,000.000 | 121,752.000 | |
| | | AUSTRIA 1.65 10/21/24 | 930,000.000 | 912,997.330 | |
| | | AUSTRIA 1.85 05/23/49 | 290,000.000 | 236,445.170 | |
| | | AUSTRIA 2.0 07/15/26 | 160,000.000 | 156,816.640 | |
| | | AUSTRIA 2.1 09/20/17 | 390,000.000 | 313,855.670 | |
| | | AUSTRIA 2.4 05/23/34 | 620,000.000 | 585,487.700 | |
| | | AUSTRIA 3.15 06/20/44 | 540,000.000 | 553,671.180 | |
| | | AUSTRIA 3.8 01/26/62 | 240,000.000 | 288,697.920 | |
| | | AUSTRIA 4.15 03/15/37 | 940,000.000 | 1,058,628.000 | |
| | | AUSTRIA 4.85 03/15/26 | 710,000.000 | 759,849.450 | |
| | | AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 415,000.000 | 479,449.500 | |
| | | BELGIUM 0.0 10/22/27 | 580,000.000 | 512,547.160 | |
| | | BELGIUM 0.0 10/22/31 | 940,000.000 | 737,607.950 | |
| | | BELGIUM 0.1 06/22/30 | 1,300,000.000 | 1,075,880.000 | |
| | | BELGIUM 0.35 06/22/32 | 600,000.000 | 475,980.000 | |
| | | BELGIUM 0.4 06/22/40 | 450,000.000 | 283,142.250 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BELGIUM 0.5 10/22/24 | 750,000.000 | 722,044.500 | |
| | | BELGIUM 0.65 06/22/71 | 520,000.000 | 239,330.520 | |
| | | BELGIUM 0.8 06/22/25 | 1,980,000.000 | 1,895,582.700 | |
| | | BELGIUM 0.8 06/22/27 | 960,000.000 | 886,665.600 | |
| | | BELGIUM 0.8 06/22/28 | 1,010,000.000 | 917,585.000 | |
| | | BELGIUM 0.9 06/22/29 | 1,430,000.000 | 1,285,799.730 | |
| | | BELGIUM 1.0 06/22/26 | 1,030,000.000 | 977,242.700 | |
| | | BELGIUM 1.0 06/22/31 | 1,070,000.000 | 928,968.650 | |
| | | BELGIUM 1.25 04/22/33 | 810,000.000 | 694,710.590 | |
| | | BELGIUM 1.4 06/22/53 | 710,000.000 | 472,307.620 | |
| | | BELGIUM 1.45 06/22/37 | 380,000.000 | 306,178.540 | |
| | | BELGIUM 1.6 06/22/47 | 780,000.000 | 576,223.240 | |
| | | BELGIUM 1.7 06/22/50 | 980,000.000 | 722,196.300 | |
| | | BELGIUM 1.9 06/22/38 | 610,000.000 | 517,123.230 | |
| | | BELGIUM 2.15 06/22/66 | 450,000.000 | 368,280.000 | |
| | | BELGIUM 2.25 06/22/57 | 390,000.000 | 326,241.240 | |
| | | BELGIUM 2.6 06/22/24 | 840,000.000 | 838,230.960 | |
| | | BELGIUM 2.75 04/22/39 | 220,000.000 | 207,553.720 | |
| | | BELGIUM 3.0 06/22/34 | 980,000.000 | 977,307.940 | |
| | | BELGIUM 3.75 06/22/45 | 740,000.000 | 809,201.100 | |
| | | BELGIUM 4.0 03/28/32 | 630,000.000 | 686,705.040 | |
| | | BELGIUM 4.25 03/28/41 | 1,280,000.000 | 1,461,234.790 | |
| | | BELGIUM 4.5 03/28/26 | 880,000.000 | 930,774.240 | |
| | | BELGIUM 5.0 03/28/35 | 1,320,000.000 | 1,575,732.030 | |
| | | BELGIUM 5.5 03/28/28 | 1,570,000.000 | 1,788,495.330 | |
| | | BUNDESOBL 0.0 04/10/26 | 2,110,000.000 | 1,953,986.600 | |
| | | BUNDESOBL 0.0 04/11/25 | 1,590,000.000 | 1,503,216.210 | |
| | | BUNDESOBL 0.0 04/16/27 | 1,360,000.000 | 1,231,545.280 | |
| | | BUNDESOBL 0.0 10/09/26 | 1,360,000.000 | 1,244,182.400 | |
| | | BUNDESOBL 0.0 10/10/25 | 1,750,000.000 | 1,637,422.500 | |
| | | BUNDESOBL 0.0 10/10/25 | 950,000.000 | 892,021.500 | |
| | | BUNDESOBL 04/05/24 | 1,260,000.000 | 1,220,058.000 | |
| | | BUNDESOBL 1.3 10/15/27 | 1,210,000.000 | 1,153,964.900 | |
| | | BUNDESOBL 1.3 10/15/27 | 1,790,000.000 | 1,709,056.200 | |
| | | BUNDESOBL 10/18/24 | 1,590,000.000 | 1,519,934.260 | |
| | | BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24 | 1,500,000.000 | 1,454,895.000 | |
| | | BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24 | 1,250,000.000 | 1,207,812.500 | |
| | | BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24 | 900,000.000 | 867,546.000 | |
| | | BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24 | 700,000.000 | 694,379.000 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30 | 2,120,000.000 | 1,809,314.000 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 | 1,540,000.000 | 1,285,776.800 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 | 2,900,000.000 | 2,363,531.900 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35 | 1,660,000.000 | 1,236,799.600 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36 | 1,580,000.000 | 1,149,102.400 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30 | 2,630,000.000 | 2,221,508.400 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30 | 590,000.000 | 498,319.900 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 | 1,890,000.000 | 1,560,100.500 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 | 800,000.000 | 661,000.000 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50 | 2,230,000.000 | 1,234,095.380 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50 | 710,000.000 | 392,637.100 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52 | 1,040,000.000 | 552,385.600 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27 | 1,620,000.000 | 1,450,499.400 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28 | 2,060,000.000 | 1,807,347.180 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27 | 2,120,000.000 | 1,949,679.200 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29 | 2,080,000.000 | 1,844,485.760 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 1,770,000.000 | 1,582,716.300 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 | 1,900,000.000 | 1,821,796.000 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26 | 2,860,000.000 | 2,698,410.000 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28 | 1,940,000.000 | 1,774,304.600 | |
| | | DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 | 1,910,000.000 | 1,762,244.310 | |
| | | DEUTSCHLAND 08/15/26 | 1,980,000.000 | 1,820,883.240 | |
| | | DEUTSCHLAND 08/15/29 | 1,990,000.000 | 1,717,338.160 | |
| | | DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38 | 350,000.000 | 286,762.000 | |
| | | DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24 | 1,820,000.000 | 1,775,772.180 | |
| | | DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25 | 2,420,000.000 | 2,330,193.800 | |
| | | DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | 2,430,000.000 | 1,976,566.860 | |
| | | DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24 | 1,520,000.000 | 1,498,213.650 | |
| | | DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32 | 1,430,000.000 | 1,356,769.700 | |
| | | DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24 | 1,430,000.000 | 1,417,510.380 | |
| | | DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53 | 600,000.000 | 541,542.000 | |
| | | DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29 | 800,000.000 | 789,696.000 | |
| | | DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44 | 1,810,000.000 | 1,867,938.100 | |
| | | DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46 | 2,170,000.000 | 2,264,570.770 | |
| | | DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 1,330,000.000 | 1,511,983.900 | |
| | | DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37 | 1,830,000.000 | 2,179,041.390 | |
| | | DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 1,700,000.000 | 2,127,431.000 | |
| | | DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 560,000.000 | 628,801.600 | |
| | | DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 1,820,000.000 | 2,257,400.600 | |
| | | DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 1,410,000.000 | 1,875,624.300 | |
| | | DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31 | 1,520,000.000 | 1,867,365.600 | |
| | | DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 1,310,000.000 | 1,510,141.800 | |
| | | DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 | 780,000.000 | 976,965.600 | |
| | | DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27 | 850,000.000 | 1,001,376.500 | |
| | | FINLAND 0.0 09/15/24 | 410,000.000 | 392,576.290 | |
| | | FINLAND 0.0 09/15/26 | 460,000.000 | 417,128.000 | |
| | | FINLAND 0.0 09/15/30 | 210,000.000 | 169,265.590 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | FINLAND 0.125 04/15/36 | 290,000.000 | 200,831.960 | |
| | | FINLAND 0.125 04/15/52 | 310,000.000 | 152,991.200 | |
| | | FINLAND 0.125 09/15/31 | 300,000.000 | 238,203.600 | |
| | | FINLAND 0.25 09/15/40 | 290,000.000 | 182,483.950 | |
| | | FINLAND 0.5 04/15/26 | 460,000.000 | 431,033.800 | |
| | | FINLAND 0.5 04/15/43 | 380,000.000 | 241,216.400 | |
| | | FINLAND 0.5 09/15/27 | 420,000.000 | 379,257.900 | |
| | | FINLAND 0.5 09/15/28 | 460,000.000 | 406,899.440 | |
| | | FINLAND 0.5 09/15/29 | 300,000.000 | 259,283.290 | |
| | | FINLAND 0.75 04/15/31 | 200,000.000 | 169,723.400 | |
| | | FINLAND 0.875 09/15/25 | 350,000.000 | 334,354.510 | |
| | | FINLAND 1.125 04/15/34 | 580,000.000 | 480,599.020 | |
| | | FINLAND 1.375 04/15/27 | 110,000.000 | 104,144.590 | |
| | | FINLAND 1.375 04/15/47 | 390,000.000 | 296,565.750 | |
| | | FINLAND 1.5 09/15/32 | 50,000.000 | 44,274.850 | |
| | | FINLAND 2.0 04/15/24 | 370,000.000 | 366,602.290 | |
| | | FINLAND 2.625 07/04/42 | 440,000.000 | 420,835.800 | |
| | | FINLAND 2.75 07/04/28 | 540,000.000 | 541,971.540 | |
| | | FINLAND 4.0 07/04/25 | 410,000.000 | 424,226.410 | |
| | | FRANCE OAT 0.0 02/25/24 | 1,220,000.000 | 1,183,711.100 | |
| | | FRANCE OAT 0.0 02/25/25 | 1,990,000.000 | 1,878,098.320 | |
| | | FRANCE OAT 0.0 02/25/26 | 2,910,000.000 | 2,681,905.470 | |
| | | FRANCE OAT 0.0 02/25/27 | 2,450,000.000 | 2,203,863.200 | |
| | | FRANCE OAT 0.0 05/25/32 | 2,290,000.000 | 1,775,666.000 | |
| | | FRANCE OAT 0.0 11/25/29 | 2,890,000.000 | 2,421,626.370 | |
| | | FRANCE OAT 0.0 11/25/30 | 3,480,000.000 | 2,831,867.400 | |
| | | FRANCE OAT 0.0 11/25/31 | 3,270,000.000 | 2,581,579.980 | |
| | | FRANCE OAT 0.25 11/25/26 | 2,620,000.000 | 2,395,142.200 | |
| | | FRANCE OAT 0.5 05/25/25 | 4,430,000.000 | 4,210,191.720 | |
| | | FRANCE OAT 0.5 05/25/26 | 3,460,000.000 | 3,225,031.400 | |
| | | FRANCE OAT 0.5 05/25/29 | 3,590,000.000 | 3,152,912.400 | |
| | | FRANCE OAT 0.5 05/25/40 | 1,650,000.000 | 1,079,741.850 | |
| | | FRANCE OAT 0.5 05/25/72 | 790,000.000 | 331,539.300 | |
| | | FRANCE OAT 0.5 06/25/44 | 1,150,000.000 | 697,424.400 | |
| | | FRANCE OAT 0.75 02/25/28 | 1,980,000.000 | 1,803,780.000 | |
| | | FRANCE OAT 0.75 05/25/28 | 5,110,000.000 | 4,636,170.140 | |
| | | FRANCE OAT 0.75 05/25/52 | 2,040,000.000 | 1,155,176.520 | |
| | | FRANCE OAT 0.75 05/25/53 | 2,050,000.000 | 1,132,793.100 | |
| | | FRANCE OAT 0.75 11/25/28 | 3,400,000.000 | 3,059,320.000 | |
| | | FRANCE OAT 03/25/24 | 3,020,000.000 | 2,923,797.900 | |
| | | FRANCE OAT 03/25/25 | 3,320,000.000 | 3,128,784.600 | |
| | | FRANCE OAT 1.0 05/25/27 | 2,360,000.000 | 2,205,202.880 | |
| | | FRANCE OAT 1.0 11/25/25 | 2,740,000.000 | 2,617,960.900 | |
| | | FRANCE OAT 1.25 05/25/34 | 2,860,000.000 | 2,397,932.680 | |
| | | FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 3,190,000.000 | 2,569,226.000 | |
| | | FRANCE OAT 1.25 05/25/38 | 500,000.000 | 387,850.000 | |
| | | FRANCE OAT 1.5 05/25/31 | 4,280,000.000 | 3,923,390.400 | |
| | | FRANCE OAT 1.5 05/25/50 | 2,470,000.000 | 1,770,826.980 | |
| | | FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 990,000.000 | 722,287.560 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | FRANCE OAT 1.75 06/25/39 | 2,070,000.000 | 1,731,141.000 | |
| | | FRANCE OAT 1.75 11/25/24 | 2,380,000.000 | 2,337,252.820 | |
| | | FRANCE OAT 2.0 05/25/48 | 1,950,000.000 | 1,587,150.000 | |
| | | FRANCE OAT 2.0 11/25/32 | 1,600,000.000 | 1,491,830.400 | |
| | | FRANCE OAT 2.25 05/25/24 | 2,500,000.000 | 2,484,035.000 | |
| | | FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 4,450,000.000 | 4,419,659.900 | |
| | | FRANCE OAT 2.5 05/25/43 | 250,000.000 | 226,564.500 | |
| | | FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 5,190,000.000 | 5,228,198.400 | |
| | | FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 2,030,000.000 | 2,086,827.820 | |
| | | FRANCE OAT 3.5 04/25/26 | 3,000,000.000 | 3,081,450.000 | |
| | | FRANCE OAT 4.0 04/25/55 | 1,530,000.000 | 1,813,050.000 | |
| | | FRANCE OAT 4.0 04/25/60 | 1,170,000.000 | 1,425,358.350 | |
| | | FRANCE OAT 4.0 10/25/38 | 1,940,000.000 | 2,155,636.820 | |
| | | FRANCE OAT 4.5 04/25/41 | 2,640,000.000 | 3,142,199.280 | |
| | | FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 1,930,000.000 | 2,271,320.500 | |
| | | FRANCE OAT 5.5 04/25/29 | 2,360,000.000 | 2,753,709.360 | |
| | | FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | 2,510,000.000 | 3,142,926.620 | |
| | | FRANCE OAT 6.0 10/25/25 | 2,170,000.000 | 2,362,191.680 | |
| | | IRISH 0.0 10/18/31 | 770,000.000 | 608,725.530 | |
| | | IRISH 0.2 05/15/27 | 520,000.000 | 470,009.950 | |
| | | IRISH 0.2 10/18/30 | 550,000.000 | 455,788.740 | |
| | | IRISH 0.35 10/18/32 | 400,000.000 | 318,302.000 | |
| | | IRISH 0.4 05/15/35 | 330,000.000 | 243,212.640 | |
| | | IRISH 0.55 04/22/41 | 250,000.000 | 162,336.000 | |
| | | IRISH 0.9 05/15/28 | 610,000.000 | 559,146.740 | |
| | | IRISH 1.0 05/15/26 | 950,000.000 | 905,243.600 | |
| | | IRISH 1.1 05/15/29 | 730,000.000 | 665,806.720 | |
| | | IRISH 1.3 05/15/33 | 390,000.000 | 336,690.900 | |
| | | IRISH 1.35 03/18/31 | 360,000.000 | 327,139.200 | |
| | | IRISH 1.5 05/15/50 | 580,000.000 | 422,212.740 | |
| | | IRISH 1.7 05/15/37 | 400,000.000 | 339,458.050 | |
| | | IRISH 2.0 02/18/45 | 740,000.000 | 613,013.780 | |
| | | IRISH 2.4 05/15/30 | 590,000.000 | 580,403.060 | |
| | | IRISH 3.4 03/18/24 | 390,000.000 | 393,483.090 | |
| | | IRISH 5.4 03/13/25 | 850,000.000 | 899,139.350 | |
| | | ITALY BTPS 0.0 01/15/24 | 1,000,000.000 | 969,800.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.0 04/01/26 | 1,520,000.000 | 1,365,720.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.0 04/15/24 | 1,400,000.000 | 1,348,508.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.0 08/01/26 | 1,250,000.000 | 1,110,500.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.0 08/15/24 | 1,460,000.000 | 1,391,453.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.0 12/15/24 | 1,360,000.000 | 1,283,445.600 | |
| | | ITALY BTPS 0.25 03/15/28 | 1,460,000.000 | 1,229,028.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.35 02/01/25 | 1,800,000.000 | 1,702,636.200 | |
| | | ITALY BTPS 0.45 02/15/29 | 1,200,000.000 | 983,640.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.5 02/01/26 | 1,610,000.000 | 1,478,942.780 | |
| | | ITALY BTPS 0.5 07/15/28 | 1,100,000.000 | 928,070.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.6 08/01/31 | 1,720,000.000 | 1,301,787.160 | |
| | | ITALY BTPS 0.85 01/15/27 | 1,310,000.000 | 1,187,056.500 | |
| | | ITALY BTPS 0.9 04/01/31 | 1,610,000.000 | 1,267,253.540 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | ITALY BTPS 0.95 03/01/37 | 1,080,000.000 | 706,104.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.95 06/01/32 | 1,380,000.000 | 1,049,076.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.95 08/01/30 | 1,350,000.000 | 1,088,370.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.95 09/15/27 | 1,180,000.000 | 1,051,380.000 | |
| | | ITALY BTPS 0.95 12/01/31 | 1,300,000.000 | 1,002,762.800 | |
| | | ITALY BTPS 1.1 04/01/27 | 1,100,000.000 | 999,405.000 | |
| | | ITALY BTPS 1.2 08/15/25 | 1,360,000.000 | 1,291,184.000 | |
| | | ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 1,530,000.000 | 1,413,198.270 | |
| | | ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 1,750,000.000 | 1,474,726.830 | |
| | | ITALY BTPS 1.45 03/01/36 | 1,120,000.000 | 804,272.000 | |
| | | ITALY BTPS 1.45 05/15/25 | 1,280,000.000 | 1,233,863.680 | |
| | | ITALY BTPS 1.45 11/15/24 | 1,040,000.000 | 1,010,873.760 | |
| | | ITALY BTPS 1.5 04/30/45 | 810,000.000 | 482,679.000 | |
| | | ITALY BTPS 1.5 06/01/25 | 1,460,000.000 | 1,406,096.800 | |
| | | ITALY BTPS 1.6 06/01/26 | 1,350,000.000 | 1,276,290.000 | |
| | | ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 1,790,000.000 | 1,467,062.520 | |
| | | ITALY BTPS 1.65 12/01/30 | 1,740,000.000 | 1,470,587.100 | |
| | | ITALY BTPS 1.7 09/01/51 | 1,020,000.000 | 601,039.080 | |
| | | ITALY BTPS 1.75 07/01/24 | 1,200,000.000 | 1,176,958.800 | |
| | | ITALY BTPS 1.8 03/01/41 | 1,150,000.000 | 786,485.000 | |
| | | ITALY BTPS 1.85 05/15/24 | 990,000.000 | 974,150.100 | |
| | | ITALY BTPS 1.85 07/01/25 | 1,740,000.000 | 1,685,190.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.0 02/01/28 | 1,350,000.000 | 1,253,272.500 | |
| | | ITALY BTPS 2.0 12/01/25 | 1,660,000.000 | 1,603,662.920 | |
| | | ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 2,300,000.000 | 2,164,842.800 | |
| | | ITALY BTPS 2.1 07/15/26 | 1,290,000.000 | 1,236,666.240 | |
| | | ITALY BTPS 2.15 03/01/72 | 360,000.000 | 215,172.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.15 09/01/52 | 510,000.000 | 327,879.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.2 06/01/27 | 1,290,000.000 | 1,228,080.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 860,000.000 | 681,550.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 1,330,000.000 | 1,125,047.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 1,150,000.000 | 812,590.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.5 11/15/25 | 1,350,000.000 | 1,326,461.400 | |
| | | ITALY BTPS 2.5 12/01/24 | 1,637,000.000 | 1,621,325.720 | |
| | | ITALY BTPS 2.5 12/01/32 | 1,340,000.000 | 1,159,341.200 | |
| | | ITALY BTPS 2.65 12/01/27 | 1,220,000.000 | 1,169,492.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.7 03/01/47 | 1,090,000.000 | 833,850.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.8 03/01/67 | 700,000.000 | 499,800.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.8 06/15/29 | 1,200,000.000 | 1,129,200.000 | |
| | | ITALY BTPS 2.8 12/01/28 | 1,740,000.000 | 1,662,021.900 | |
| | | ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 1,810,000.000 | 1,510,264.000 | |
| | | ITALY BTPS 3.0 08/01/29 | 1,610,000.000 | 1,538,752.670 | |
| | | ITALY BTPS 3.1 03/01/40 | 1,580,000.000 | 1,333,388.860 | |
| | | ITALY BTPS 3.25 03/01/38 | 600,000.000 | 522,960.000 | |
| | | ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 1,180,000.000 | 995,738.280 | |
| | | ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 1,120,000.000 | 1,011,850.560 | |
| | | ITALY BTPS 3.4 04/01/28 | 750,000.000 | 738,450.000 | |
| | | ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 1,190,000.000 | 1,033,568.550 | |
| | | ITALY BTPS 3.5 01/15/26 | 300,000.000 | 301,290.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | ITALY BTPS 3.5 03/01/30 | 1,870,000.000 | 1,836,605.540 | |
| | | ITALY BTPS 3.75 09/01/24 | 1,620,000.000 | 1,636,765.380 | |
| | | ITALY BTPS 3.85 09/01/49 | 850,000.000 | 783,071.850 | |
| | | ITALY BTPS 3.85 12/15/29 | 800,000.000 | 796,240.000 | |
| | | ITALY BTPS 4.0 02/01/37 | 2,170,000.000 | 2,102,079.000 | |
| | | ITALY BTPS 4.0 04/30/35 | 660,000.000 | 637,626.000 | |
| | | ITALY BTPS 4.4 05/01/33 | 200,000.000 | 201,560.000 | |
| | | ITALY BTPS 4.5 03/01/24 | 1,710,000.000 | 1,737,243.720 | |
| | | ITALY BTPS 4.5 03/01/26 | 1,910,000.000 | 1,978,760.000 | |
| | | ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 1,680,000.000 | 1,773,102.240 | |
| | | ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 1,110,000.000 | 1,161,905.820 | |
| | | ITALY BTPS 5.0 03/01/25 | 560,000.000 | 581,907.200 | |
| | | ITALY BTPS 5.0 08/01/34 | 1,660,000.000 | 1,756,778.000 | |
| | | ITALY BTPS 5.0 08/01/39 | 1,170,000.000 | 1,251,783.000 | |
| | | ITALY BTPS 5.0 09/01/40 | 1,250,000.000 | 1,337,750.000 | |
| | | ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 2,140,000.000 | 2,339,662.000 | |
| | | ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 1,460,000.000 | 1,638,704.000 | |
| | | ITALY BTPS 6.0 05/01/31 | 2,480,000.000 | 2,848,280.000 | |
| | | ITALY BTPS 6.5 11/01/27 | 1,510,000.000 | 1,711,585.000 | |
| | | ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 350,000.000 | 399,035.000 | |
| | | NETHERLANDS 0.0 01/15/26 | 640,000.000 | 592,367.550 | |
| | | NETHERLANDS 0.0 01/15/27 | 1,180,000.000 | 1,067,377.260 | |
| | | NETHERLANDS 0.0 01/15/29 | 1,110,000.000 | 955,089.510 | |
| | | NETHERLANDS 0.0 01/15/38 | 550,000.000 | 370,607.600 | |
| | | NETHERLANDS 0.0 01/15/52 | 1,000,000.000 | 512,631.000 | |
| | | NETHERLANDS 0.0 07/15/30 | 700,000.000 | 580,693.400 | |
| | | NETHERLANDS 0.0 07/15/31 | 900,000.000 | 726,681.600 | |
| | | NETHERLANDS 0.25 07/15/25 | 1,430,000.000 | 1,350,258.920 | |
| | | NETHERLANDS 0.25 07/15/29 | 1,010,000.000 | 875,887.150 | |
| | | NETHERLANDS 0.5 01/15/40 | 1,210,000.000 | 858,361.900 | |
| | | NETHERLANDS 0.5 07/15/26 | 1,420,000.000 | 1,323,440.000 | |
| | | NETHERLANDS 0.5 07/15/32 | 200,000.000 | 165,064.800 | |
| | | NETHERLANDS 0.75 07/15/27 | 1,160,000.000 | 1,073,951.200 | |
| | | NETHERLANDS 0.75 07/15/28 | 1,240,000.000 | 1,131,362.360 | |
| | | NETHERLANDS 01/15/24 | 830,000.000 | 808,512.960 | |
| | | NETHERLANDS 2.0 01/15/54 | 360,000.000 | 325,716.120 | |
| | | NETHERLANDS 2.0 07/15/24 | 1,440,000.000 | 1,426,528.800 | |
| | | NETHERLANDS 2.5 01/15/33 | 1,110,000.000 | 1,097,267.300 | |
| | | NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | 1,430,000.000 | 1,493,534.900 | |
| | | NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 1,420,000.000 | 1,650,143.660 | |
| | | NETHERLANDS 4.0 01/15/37 | 1,280,000.000 | 1,468,800.000 | |
| | | NETHERLANDS 5.5 01/15/28 | 780,000.000 | 891,462.000 | |
| | | SPAIN 0.0 01/31/25 | 1,400,000.000 | 1,322,510.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | SPAIN 0.0 01/31/26 | 1,470,000.000 | 1,348,720.590 | |
| | | SPAIN 0.0 01/31/27 | 1,610,000.000 | 1,433,141.500 | |
| | | SPAIN 0.0 01/31/28 | 1,160,000.000 | 1,004,038.000 | |
| | | SPAIN 0.0 05/31/24 | 1,260,000.000 | 1,212,063.300 | |
| | | SPAIN 0.0 05/31/25 | 670,000.000 | 626,596.670 | |
| | | SPAIN 0.1 04/30/31 | 1,380,000.000 | 1,075,710.000 | |
| | | SPAIN 0.25 07/30/24 | 1,080,000.000 | 1,038,717.000 | |
| | | SPAIN 0.5 04/30/30 | 1,500,000.000 | 1,253,314.500 | |
| | | SPAIN 0.5 10/31/31 | 1,640,000.000 | 1,305,246.480 | |
| | | SPAIN 0.6 10/31/29 | 1,630,000.000 | 1,392,434.020 | |
| | | SPAIN 0.7 04/30/32 | 1,550,000.000 | 1,235,195.000 | |
| | | SPAIN 0.8 07/30/27 | 1,750,000.000 | 1,594,687.500 | |
| | | SPAIN 0.8 07/30/29 | 700,000.000 | 608,825.000 | |
| | | SPAIN 0.85 07/30/37 | 700,000.000 | 481,957.000 | |
| | | SPAIN 1.0 07/30/42 | 540,000.000 | 342,576.000 | |
| | | SPAIN 1.0 10/31/50 | 1,240,000.000 | 676,916.000 | |
| | | SPAIN 1.2 10/31/40 | 1,260,000.000 | 855,678.600 | |
| | | SPAIN 1.25 10/31/30 | 1,750,000.000 | 1,535,100.000 | |
| | | SPAIN 1.3 10/31/26 | 1,730,000.000 | 1,637,635.300 | |
| | | SPAIN 1.4 04/30/28 | 1,170,000.000 | 1,081,909.530 | |
| | | SPAIN 1.4 07/30/28 | 1,510,000.000 | 1,395,164.500 | |
| | | SPAIN 1.45 04/30/29 | 1,400,000.000 | 1,278,925.200 | |
| | | SPAIN 1.45 10/31/27 | 1,560,000.000 | 1,459,476.720 | |
| | | SPAIN 1.45 10/31/71 | 410,000.000 | 202,020.940 | |
| | | SPAIN 1.5 04/30/27 | 2,210,000.000 | 2,089,776.000 | |
| | | SPAIN 1.6 04/30/25 | 1,630,000.000 | 1,588,557.250 | |
| | | SPAIN 1.85 07/30/35 | 1,840,000.000 | 1,540,650.600 | |
| | | SPAIN 1.9 10/31/52 | 670,000.000 | 450,363.280 | |
| | | SPAIN 1.95 04/30/26 | 1,330,000.000 | 1,294,248.270 | |
| | | SPAIN 1.95 07/30/30 | 1,770,000.000 | 1,637,542.050 | |
| | | SPAIN 2.15 10/31/25 | 2,410,000.000 | 2,373,389.690 | |
| | | SPAIN 2.35 07/30/33 | 1,470,000.000 | 1,339,905.000 | |
| | | SPAIN 2.55 10/31/32 | 1,720,000.000 | 1,609,871.840 | |
| | | SPAIN 2.7 10/31/48 | 1,190,000.000 | 1,004,761.030 | |
| | | SPAIN 2.75 10/31/24 | 2,190,000.000 | 2,189,036.400 | |
| | | SPAIN 2.9 10/31/46 | 1,180,000.000 | 1,047,568.600 | |
| | | SPAIN 3.45 07/30/43 | 250,000.000 | 239,740.700 | |
| | | SPAIN 3.45 07/30/66 | 1,120,000.000 | 1,046,030.720 | |
| | | SPAIN 3.8 04/30/24 | 1,470,000.000 | 1,487,713.500 | |
| | | SPAIN 4.2 01/31/37 | 1,400,000.000 | 1,505,210.000 | |
| | | SPAIN 4.65 07/30/25 | 1,135,000.000 | 1,187,263.340 | |
| | | SPAIN 4.7 07/30/41 | 1,630,000.000 | 1,870,733.070 | |
| | | SPAIN 4.8 01/31/24 | 1,200,000.000 | 1,224,812.400 | |
| | | SPAIN 4.9 07/30/40 | 1,290,000.000 | 1,508,655.000 | |
| | | SPAIN 5.15 10/31/28 | 2,330,000.000 | 2,598,649.000 | |
| | | SPAIN 5.15 10/31/44 | 1,210,000.000 | 1,486,926.650 | |
| | | SPAIN 5.75 07/30/32 | 1,615,000.000 | 1,957,191.850 | |
| | | SPAIN 5.9 07/30/26 | 1,630,000.000 | 1,799,816.660 | |
| | | SPAIN 6.0 01/31/29 | 1,460,000.000 | 1,705,517.980 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ユーロ　小計 | 471,767,000.000<br>(67,108,855,750) | 436,198,301.780<br>(62,049,208,428) | |
| 国債証券　合計 | | 201,082,780,000.900<br>(201,082,780,001) | 183,260,552,033<br>(183,260,552,033) | |
| 合計 | | | 183,260,552,033<br>(183,260,552,033) | |

（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<br>時価比率<br>(%) | 有価証券の合計金額に<br>対する比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 国債証券 | 261銘柄 | 50.68 | 50.09 |
| イギリス・ポンド | 国債証券 | 55銘柄 | 4.85 | 4.80 |
| イスラエル・シュケル | 国債証券 | 12銘柄 | 0.34 | 0.34 |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 | 27銘柄 | 1.64 | 1.62 |
| オフショア・人民元 | 国債証券 | 31銘柄 | 4.06 | 4.01 |
| カナダ・ドル | 国債証券 | 40銘柄 | 2.11 | 2.08 |
| シンガポール・ドル | 国債証券 | 19銘柄 | 0.46 | 0.46 |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 | 7銘柄 | 0.20 | 0.20 |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 | 7銘柄 | 0.33 | 0.32 |
| ニュージーランド・ドル | 国債証券 | 13銘柄 | 0.21 | 0.21 |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券 | 9銘柄 | 0.19 | 0.19 |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 | 14銘柄 | 0.46 | 0.45 |
| マレーシア・リンギット | 国債証券 | 30銘柄 | 0.53 | 0.53 |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 15銘柄 | 0.84 | 0.83 |
| ユーロ | 国債証券 | 358銘柄 | 34.25 | 33.86 |

（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。

**エマージング株式パッシブ・マザーファンド**

**貸借対照表**

（単位：円）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 4,273,619,660 |
| コール・ローン | 4,554,635,942 |
| 株式 | 91,379,149,211 |
| 投資信託受益証券 | 565,157,044 |
| 投資証券 | 93,850,461 |
| 派生商品評価勘定 | 310,762,171 |
| 未収入金 | 128,634,877 |
| 未収配当金 | 102,800,396 |
| 差入委託証拠金 | 1,428,304,744 |
| 流動資産合計 | 102,836,914,506 |
| 資産合計 | 102,836,914,506 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 26,995 |
| 未払解約金 | 4,147,285,000 |
| 流動負債合計 | 4,147,311,995 |
| 負債合計 | 4,147,311,995 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 70,027,488,260 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 28,662,114,251 |
| 元本等合計 | 98,689,602,511 |
| 純資産合計 | 98,689,602,511 |
| 負債純資産合計 | 102,836,914,506 |

**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1月12日<br>至　2023年1月11日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br>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。<br><br>投資信託受益証券<br>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。<br><br>投資証券<br>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<br>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。<br><br>為替予約取引<br>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<br>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<br>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 | 2023年1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 | 53,702,663,813円 |
| 同期中追加設定元本額 | 61,570,649,032円 |
| 同期中一部解約元本額 | 45,245,824,585円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞ | 8,939,235,619円 |
| ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ） | 221,373,908円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型） | 2,360,482円 |

| | |
|---|---|
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型） | 14,873,547円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型） | 47,963,706円 |
| グローバル８資産ラップファンド（安定型） | 29,778,979円 |
| グローバル８資産ラップファンド（中立型） | 20,650,978円 |
| グローバル８資産ラップファンド（積極型） | 30,267,775円 |
| たわらノーロード　新興国株式 | 10,823,532,925円 |
| たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞ | 2,807,493,692円 |
| たわらノーロード　バランス（８資産均等型） | 3,448,525,572円 |
| たわらノーロード　バランス（堅実型） | 31,496,219円 |
| たわらノーロード　バランス（標準型） | 119,283,395円 |
| たわらノーロード　バランス（積極型） | 200,926,526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） | 93,091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） | 104,324,038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） | 261,874,040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） | 186,387,988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） | 318,174,216円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定型） | 704,729円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型） | 8,890,183円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（成長型） | 2,353,416円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（積極型） | 7,068,234円 |
| たわらノーロード　全世界株式 | 332,047,143円 |
| Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド | 723,807,245円 |
| マネックス資産設計ファンド　エボリューション | 393,257,262円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０） | 366,379,426円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０） | 568,786,720円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０） | 1,041,246,012円 |
| 投資のソムリエ | 23,273,396,479円 |
| クルーズコントロール | 81,614,813円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞ | 1,681,147,034円 |
| ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ | 446,925,491円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型 | 1,872,449,573円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド | 8,129,863,305円 |
| ワールドアセットバランス（基本コース） | 622,686,789円 |
| ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） | 381,005,501円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５） | 71,800,890円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５） | 36,039,126円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ） | 12,882,758円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５） | 265,998,584円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 598,155,802円 |
| ９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 335,406,294円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０） | 90,344,235円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０） | 38,192,588円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０） | 23,864,626円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５） | 5,012,772円 |
| エマージング株式パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用） | 11,093,992円 |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定） | 631,642,248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） | 12,405,252円 |
| しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定） | 21,852,530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） | 228,075,182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） | 102,475,330円 |
| 計 | 70,027,488,260円 |

| | |
|---|---|
| ２．　受益権の総数 | 70,027,488,260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1月12日<br>至　2023年1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。<br>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 | 2023年1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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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 | 2023年1月11日現在<br>当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） |
|---|---|
| 株式 | △1,983,383,286 |
| 投資信託受益証券 | △29,037,184 |
| 投資証券 | 6,947,528 |
| 合計 | △2,005,472,942 |

（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4月19日から2023年1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 | 2023年1月11日現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち<br>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 | 716,848,140 | － | 717,980,995 | 1,132,855 |
| アメリカ・ドル | 716,848,140 | － | 717,980,995 | 1,132,855 |
| 合計 | 716,848,140 | － | 717,980,995 | 1,132,855 |

（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 | 2023年1月11日現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち<br>１年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 | | | | |
| 先物取引 | | | | |
| 買建 | 6,768,705,722 | － | 7,078,335,038 | 309,629,316 |
| 合計 | 6,768,705,722 | － | 7,078,335,038 | 309,629,316 |

（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）**

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.4093円<br>(14,093円) |

**附属明細表**

**第１　有価証券明細表**

**（１）株式**

2023年1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 | TRIP.COM GROUP LTD ADR | 55,584 | 37.650 | 2,092,737.600 | |
| | CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR | 17,959 | 8.140 | 146,186.260 | |
| | SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF | 24,210 | 0.000 | 0.000 | |
| | CREDICORP LTD | 7,612 | 148.000 | 1,126,576.000 | |
| | MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR | 42,311 | 0.000 | 0.000 | |
| | SOUTHERN COPPER CORP | 8,272 | 71.820 | 594,095.040 | |
| | GAZPROM PJSC | 966,942 | 0.000 | 0.000 | |
| | LUKOIL PJSC | 33,845 | 0.000 | 0.000 | |
| | COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR | 306,034 | 1.248 | 381,930.430 | |
| | INNER MONGOLIA YITAI COAL CO | 131,500 | 1.380 | 181,470.000 | |
| | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE | 86,488 | 0.833 | 72,044.500 | |
| | SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD | 57,440 | 3.100 | 178,064.000 | |
| | EFG-HERMES HOLDINGS GDR | 50,259 | 1.150 | 57,797.850 | |
| | SURGUTNEFTEGAZ ADR | 71,084 | 0.000 | 0.000 | |
| | X5 RETAIL GROUP NV GDR | 16,003 | 0.000 | 0.000 | |
| | NOVATEK PJSC GDR | 7,413 | 0.000 | 0.000 | |
| | NOVOLIPETSK STEEL GDR | 13,260 | 0.000 | 0.000 | |
| | MMC NORILSK NICKEL ADR | 53,953 | 0.000 | 0.000 | |
| | MAGNIT PJSC | 7,574 | 0.000 | 0.000 | |
| | ROSNEFT OIL CO PJSC | 107,951 | 0.000 | 0.000 | |
| | SEVERSTAL GDR | 18,608 | 0.000 | 0.000 | |
| | TATNEFT ADR | 19,509 | 0.000 | 0.000 | |
| | VTB BANK PJSC | 304,000,000 | 0.000 | 0.000 | |
| | VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR | 43,473 | 15.150 | 658,615.950 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | TAL EDUCATION GROUP-ADR | 46,195 | 9.500 | 438,852.500 | |
| | VK CO LTD GDR | 9,858 | 0.000 | 0.000 | |
| | SBERBANK OF RUSSIA PJSC | 897,112 | 0.000 | 0.000 | |
| | YANDEX NV | 25,601 | 0.000 | 0.000 | |
| | PHOSAGRO PJSC GDR | 18,163 | 0.000 | 0.000 | |
| | H WORLD GROUP LTD ADR | 20,483 | 44.190 | 905,143.770 | |
| | JOYY INC-ADR | 4,368 | 36.890 | 161,135.520 | |
| | DAQO NEW ENERGY CORP ADR | 5,996 | 44.530 | 267,001.880 | |
| | ZAI LAB LTD ADR | 8,902 | 42.260 | 376,198.520 | |
| | TCS GROUP HOLDING PLC GDR | 9,961 | 0.000 | 0.000 | |
| | 360 DIGITECH INC ADR | 12,687 | 22.980 | 291,547.260 | |
| | NIO INC ADR | 142,587 | 11.240 | 1,602,677.880 | |
| | TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR | 70,412 | 8.740 | 615,400.880 | |
| | AUTOHOME INC ADR | 7,801 | 35.730 | 278,729.730 | |
| | WEIBO CORP ADR | 8,996 | 20.800 | 187,116.800 | |
| | KANZHUN LTD ADR | 19,079 | 24.050 | 458,849.950 | |
| | KE HOLDINGS INC ADR | 69,275 | 18.170 | 1,258,726.750 | |
| | LEGEND BIOTECH CORP ADR | 5,058 | 49.810 | 251,938.980 | |
| | OZON HOLDINGS PLC ADR | 4,537 | 0.000 | 0.000 | |
| | LUFAX HOLDING LTD ADR | 60,438 | 2.470 | 149,281.860 | |
| | PINDUODUO INC ADR | 52,294 | 94.090 | 4,920,342.460 | |
| | YUM CHINA HOLDINGS INC | 42,886 | 59.170 | 2,537,564.620 | |
| | IQIYI INC ADR | 40,457 | 6.030 | 243,955.710 | |
| | POLYUS PJSC GDR | 6,787 | 0.000 | 0.000 | |
| | ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR | 42,575 | 28.200 | 1,200,615.000 | |
| アメリカ・ドル　小計 | | 307,779,792 | | 21,634,597.700<br>(2,864,420,735) | |
| アラブ首長国連邦・ディルハム | ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC | 149,810 | 9.140 | 1,369,263.400 | |
| | DUBAI ISLAMIC BANK PJSC | 279,091 | 5.640 | 1,574,073.240 | |
| | EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC | 363,295 | 24.300 | 8,828,068.500 | |
| | ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC | 291,901 | 8.990 | 2,624,189.990 | |
| | FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 459,487 | 16.200 | 7,443,689.400 | |
| | EMAAR PROPERTIES PJSC | 395,030 | 5.790 | 2,287,223.700 | |
| | ALDAR PROPERTIES PJSC | 413,204 | 4.390 | 1,813,965.560 | |
| | EMIRATES NBD BANK PJSC | 190,646 | 12.950 | 2,468,865.700 | |
| | Q HOLDING PJSC | 222,915 | 3.900 | 869,368.500 | |
| | MULTIPLY GROUP | 357,097 | 4.750 | 1,696,210.750 | |
| | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC | 311,988 | 4.640 | 1,447,624.320 | |
| アラブ首長国連邦・ディルハム　小計 | | 3,434,464 | | 32,422,543.060<br>(1,170,778,030) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| インド・ルピー | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 316,568 | 2,558.400 | 809,907,571.200 | |
| | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 88,686 | 347.350 | 30,805,082.100 | |
| | ASIAN PAINTS LTD | 39,680 | 2,960.350 | 117,466,688.000 | |
| | EICHER MOTORS LTD | 13,332 | 3,167.550 | 42,229,776.600 | |
| | GRASIM INDUSTRIES LTD | 27,870 | 1,651.000 | 46,013,370.000 | |
| | MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 88,048 | 1,314.900 | 115,774,315.200 | |
| | SHREE CEMENT LTD | 1,110 | 23,559.500 | 26,151,045.000 | |
| | ICICI BANK LTD | 536,948 | 861.350 | 462,500,159.800 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD | 68,931 | 249.200 | 17,177,605.200 | |
| | STATE BANK OF INDIA LTD | 187,727 | 595.150 | 111,725,724.050 | |
| | CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 28,293 | 722.100 | 20,430,375.300 | |
| | TATA STEEL LTD | 758,027 | 118.850 | 90,091,508.950 | |
| | TATA MOTORS LTD | 170,813 | 412.900 | 70,528,687.700 | |
| | JSW STEEL LTD | 71,665 | 745.200 | 53,404,758.000 | |
| | TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | 60,239 | 769.250 | 46,338,850.750 | |
| | BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD | 2,895 | 5,859.500 | 16,963,252.500 | |
| | TATA POWER CO LTD | 149,677 | 206.050 | 30,840,945.850 | |
| | BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 10,684 | 4,326.850 | 46,228,065.400 | |
| | NESTLE INDIA LTD | 3,501 | 20,023.950 | 70,103,848.950 | |
| | GAIL INDIA LTD | 257,886 | 98.100 | 25,298,616.600 | |
| | KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 57,534 | 1,795.550 | 103,305,173.700 | |
| | VEDANTA LTD | 74,877 | 316.050 | 23,664,875.850 | |
| | AXIS BANK LTD | 232,796 | 952.150 | 221,656,711.400 | |
| | TITAN COMPANY LTD | 37,021 | 2,468.200 | 91,375,232.200 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 263,145 | 149.350 | 39,300,705.750 | |
| | COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD | 14,144 | 1,499.850 | 21,213,878.400 | |
| | BHARAT ELECTRONICS LTD | 351,792 | 99.150 | 34,880,176.800 | |
| | LUPIN LTD | 17,511 | 758.850 | 13,288,222.350 | |
| | MPHASIS LTD | 8,886 | 1,988.750 | 17,672,032.500 | |
| | ACC LTD | 8,629 | 2,418.950 | 20,873,119.550 | |
| | BAJAJ FINANCE LTD | 28,559 | 5,904.150 | 168,616,619.850 | |
| | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP | 179,804 | 2,575.350 | 463,058,231.400 | |
| | INFOSYS LTD | 350,646 | 1,469.750 | 515,361,958.500 | |
| | WIPRO LTD | 145,337 | 393.050 | 57,124,707.850 | |
| | TATA ELXSI LTD | 3,406 | 6,199.800 | 21,116,518.800 | |
| | MRF LTD | 215 | 94,163.950 | 20,245,249.250 | |
| | INDIAN OIL CORP LTD | 326,644 | 80.600 | 26,327,506.400 | |
| | HINDUSTAN UNILEVER LTD | 85,753 | 2,643.850 | 226,718,069.050 | |
| | TRENT LTD | 18,269 | 1,223.650 | 22,354,861.850 | |
| | APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD | 10,275 | 4,466.650 | 45,894,828.750 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 112,189 | 1,063.850 | 119,352,267.650 | |
| DABUR INDIA LTD | 63,591 | 554.600 | 35,267,568.600 | |
| HERO MOTOCORP LTD | 10,549 | 2,712.050 | 28,609,415.450 | |
| SRF LTD | 15,454 | 2,270.100 | 35,082,125.400 | |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | 8,829 | 2,189.550 | 19,331,536.950 | |
| DR REDDYS LABORATORIES LTD | 12,180 | 4,288.700 | 52,236,366.000 | |
| BHARTI AIRTEL LTD | 227,302 | 792.850 | 180,216,390.700 | |
| UNITED SPIRITS LTD | 31,760 | 864.100 | 27,443,816.000 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD | 100,124 | 1,011.850 | 101,310,469.400 | |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 14,384 | 3,501.850 | 50,370,610.400 | |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 12,201 | 8,293.150 | 101,184,723.150 | |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 21,102 | 450.000 | 9,495,900.000 | |
| HAVELLS INDIA LTD | 26,114 | 1,181.600 | 30,856,302.400 | |
| TVS MOTOR COMPANY LTD | 23,063 | 1,016.300 | 23,438,926.900 | |
| INDRAPRASTHA GAS LTD | 30,576 | 426.450 | 13,039,135.200 | |
| JINDAL STEEL & POWER LTD | 44,243 | 599.000 | 26,501,557.000 | |
| BIOCON LTD | 33,274 | 257.900 | 8,581,364.600 | |
| SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT | 210,454 | 78.750 | 16,573,252.500 | |
| SHRIRAM FINANCE LTD | 26,086 | 1,333.900 | 34,796,115.400 | |
| PETRONET LNG LTD | 65,233 | 219.850 | 14,341,475.050 | |
| CIPLA LTD/INDIA | 51,586 | 1,078.700 | 55,645,818.200 | |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 70,065 | 2,106.650 | 147,602,432.250 | |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 10,332 | 6,920.300 | 71,500,539.600 | |
| TATA CONSULTANCY SERVICES LTD | 95,636 | 3,286.400 | 314,298,150.400 | |
| ADANI ENTERPRISES LTD | 28,833 | 3,646.900 | 105,151,067.700 | |
| NTPC LTD | 385,873 | 167.950 | 64,807,370.350 | |
| YES BANK LTD | 1,230,792 | 20.650 | 25,415,854.800 | |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 66,469 | 514.450 | 34,194,977.050 | |
| BHARAT FORGE LTD | 26,609 | 883.250 | 23,502,399.250 | |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 143,357 | 477.550 | 68,460,135.350 | |
| ITC LTD | 306,365 | 333.400 | 102,142,091.000 | |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 15,113 | 2,529.200 | 38,223,799.600 | |
| UNITED PHOSPHORUS LTD | 49,294 | 724.650 | 35,720,897.100 | |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | 9,851 | 1,565.350 | 15,420,262.850 | |
| SIEMENS INDIA LTD | 7,173 | 2,870.150 | 20,587,585.950 | |
| INFO EDGE INDIA LTD | 7,579 | 3,687.150 | 27,944,909.850 | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 41,211 | 911.650 | 37,570,008.150 | |
| TECH MAHINDRA LTD | 62,485 | 1,002.650 | 62,650,585.250 | |
| INDIAN HOTELS CO LTD | 92,561 | 310.350 | 28,726,306.350 | |
| MARICO LTD | 53,087 | 510.050 | 27,077,024.350 | |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 589 | 41,038.400 | 24,171,617.600 | |
| ABB LTD/INDIA | 5,891 | 2,841.650 | 16,740,160.150 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | DLF LTD | 70,028 | 373.050 | 26,123,945.400 | |
| | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 320,491 | 211.800 | 67,879,993.800 | |
| | ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE | 55,624 | 796.400 | 44,298,953.600 | |
| | BAJAJ FINSERV LTD | 39,194 | 1,413.300 | 55,392,880.200 | |
| | BAJAJ AUTO LTD | 6,864 | 3,574.200 | 24,533,308.800 | |
| | JUBILANT FOODWORKS LTD | 40,548 | 492.100 | 19,953,670.800 | |
| | ADANI POWER LTD | 77,437 | 279.200 | 21,620,410.400 | |
| | MUTHOOT FINANCE LTD | 11,565 | 1,074.350 | 12,424,857.750 | |
| | COAL INDIA LTD | 156,007 | 216.750 | 33,814,517.250 | |
| | INDUS TOWERS LTD | 64,346 | 183.200 | 11,788,187.200 | |
| | PI INDUSTRIES LTD | 7,418 | 3,289.750 | 24,403,365.500 | |
| | VARUN BEVERAGES LTD | 24,592 | 1,287.300 | 31,657,281.600 | |
| | TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD | 11,416 | 2,674.600 | 30,533,233.600 | |
| | LTIMINDTREE LTD | 9,300 | 4,231.600 | 39,353,880.000 | |
| | ADANI GREEN ENERGY LTD | 33,531 | 1,895.200 | 63,547,951.200 | |
| | HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 102,431 | 600.200 | 61,479,086.200 | |
| | AU SMALL FINANCE BANK LTD | 15,799 | 625.200 | 9,877,534.800 | |
| | BANDHAN BANK LTD | 73,413 | 246.050 | 18,063,268.650 | |
| | ADANI TOTAL GAS LTD | 27,988 | 3,656.400 | 102,335,323.200 | |
| | GODREJ PROPERTIES LTD | 12,688 | 1,212.250 | 15,381,028.000 | |
| | CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD | 39,547 | 669.000 | 26,456,943.000 | |
| | SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD | 23,890 | 782.000 | 18,681,980.000 | |
| | INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD | 26,775 | 636.950 | 17,054,336.250 | |
| | ZOMATO LTD | 332,258 | 54.700 | 18,174,512.600 | |
| | BERGER PAINTS INDIA LTD | 28,692 | 566.850 | 16,264,060.200 | |
| | ADANI TRANSMISSIONS LTD | 28,180 | 2,652.000 | 74,733,360.000 | |
| | AVENUE SUPERMARTS LTD | 16,878 | 3,877.400 | 65,442,757.200 | |
| | ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD | 23,926 | 1,241.700 | 29,708,914.200 | |
| | ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD | 36,667 | 465.650 | 17,073,988.550 | |
| | INTERGLOBE AVIATION LTD | 9,662 | 2,044.150 | 19,750,577.300 | |
| | SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 45,847 | 1,302.600 | 59,720,302.200 | |
| インド・ルピー　小計 | | 10,720,284 | | 7,757,136,648.700<br>(12,644,132,737) | |
| インドネシア・ルピア | ANEKA TAMBANG TBK PT | 902,200 | 2,040.000 | 1,840,488,000.000 | |
| | BARITO PACIFIC TBK PT | 2,887,506 | 820.000 | 2,367,754,920.000 | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 169,701 | 24,950.000 | 4,234,039,950.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT | 509,800 | 6,675.000 | 3,402,915,000.000 | |
| | UNILEVER INDONESIA TBK PT | 822,500 | 4,690.000 | 3,857,525,000.000 | |
| | PT ASTRA INTERNATIONAL TBK | 2,066,300 | 5,325.000 | 11,003,047,500.000 | |
| | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 5,035,700 | 3,830.000 | 19,286,731,000.000 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT | 752,600 | 6,250.000 | 4,703,750,000.000 | |
| | INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT | 292,400 | 8,550.000 | 2,500,020,000.000 | |
| | BANK MANDIRI | 1,883,100 | 9,275.000 | 17,465,752,500.000 | |
| | BANK RAKYAT INDONESIA | 7,173,000 | 4,430.000 | 31,776,390,000.000 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT | 717,900 | 8,725.000 | 6,263,677,500.000 | |
| | KALBE FARMA TBK PT | 2,330,100 | 2,050.000 | 4,776,705,000.000 | |
| | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | 274,432 | 7,050.000 | 1,934,745,600.000 | |
| | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 5,808,900 | 8,175.000 | 47,487,757,500.000 | |
| | VALE INDONESIA TBK PT | 287,700 | 7,250.000 | 2,085,825,000.000 | |
| | ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT | 1,380,900 | 3,140.000 | 4,336,026,000.000 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT | 259,300 | 10,200.000 | 2,644,860,000.000 | |
| | SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT | 1,697,900 | 2,720.000 | 4,618,288,000.000 | |
| | SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT | 2,218,600 | 1,155.000 | 2,562,483,000.000 | |
| | BANK JAGO TBK PT | 428,300 | 2,970.000 | 1,272,051,000.000 | |
| | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | 1,232,482 | 4,400.000 | 5,422,920,800.000 | |
| インドネシア・ルピア　小計 | | 39,131,321 | | 185,843,753,270.000<br>(1,579,671,903) | |
| オフショア・人民元 | EVE ENERGY CO LTD | 13,032 | 88.010 | 1,146,946.320 | |
| | SIEYUAN ELECTRIC CO LTD | 5,800 | 41.180 | 238,844.000 | |
| | LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD | 22,700 | 12.280 | 278,756.000 | |
| | WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD | 5,940 | 12.530 | 74,428.200 | |
| | CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | 3,000 | 113.230 | 339,690.000 | |
| | HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD | 20,800 | 22.080 | 459,264.000 | |
| | DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD | 5,100 | 35.100 | 179,010.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD | 48,300 | 6.180 | 298,494.000 | |
| TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD | 12,000 | 8.660 | 103,920.000 | |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD | 12,080 | 73.380 | 886,430.400 | |
| YUNNAN ALUMINIUM CO LTD | 36,800 | 12.040 | 443,072.000 | |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD | 17,500 | 17.300 | 302,750.000 | |
| UNISPLENDOUR CORP LTD | 21,240 | 22.870 | 485,758.800 | |
| JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD | 10,500 | 18.290 | 192,045.000 | |
| SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD | 19,100 | 11.610 | 221,751.000 | |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD | 1,200 | 108.270 | 129,924.000 | |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD | 16,200 | 22.690 | 367,578.000 | |
| HUAGONG TECH CO LTD | 7,500 | 17.110 | 128,325.000 | |
| CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC | 2,100 | 201.040 | 422,184.000 | |
| NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD | 8,900 | 19.590 | 174,351.000 | |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD | 18,300 | 32.470 | 594,201.000 | |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD | 13,900 | 24.520 | 340,828.000 | |
| YINTAI GOLD CO LTD | 23,900 | 11.830 | 282,737.000 | |
| TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD | 31,500 | 8.210 | 258,615.000 | |
| ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD | 61,800 | 4.040 | 249,672.000 | |
| GEM CO LTD | 29,100 | 7.510 | 218,541.000 | |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD | 2,600 | 107.690 | 279,994.000 | |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD | 6,900 | 39.880 | 275,172.000 | |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD | 18,600 | 3.940 | 73,284.000 | |
| INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD | 16,900 | 12.670 | 214,123.000 | |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD | 9,800 | 121.920 | 1,194,816.000 | |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD | 11,995 | 11.150 | 133,744.250 | |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD | 5,904 | 30.990 | 182,964.960 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ZHEJIANG NHU CO LTD | 27,312 | 18.880 | 515,650.560 | |
| HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD | 29,600 | 10.540 | 311,984.000 | |
| SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD | 13,360 | 29.340 | 391,982.400 | |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD | 6,600 | 23.880 | 157,608.000 | |
| BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC | 19,300 | 27.210 | 525,153.000 | |
| GUANGDONG HAID GROUP CO LTD | 9,300 | 62.970 | 585,621.000 | |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD | 10,400 | 31.040 | 322,816.000 | |
| AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD | 41,400 | 10.270 | 425,178.000 | |
| JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD | 11,500 | 31.520 | 362,480.000 | |
| MUYUAN FOODSTUFF CO LTD | 33,300 | 48.290 | 1,608,057.000 | |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD | 11,300 | 102.860 | 1,162,318.000 | |
| WESTONE INFORMATION INDUSTRY INC | 5,700 | 30.300 | 172,710.000 | |
| SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD | 18,000 | 11.030 | 198,540.000 | |
| CHINA BAOAN GROUP CO LTD | 18,000 | 12.130 | 218,340.000 | |
| TIANQI LITHIUM CORP | 10,100 | 85.930 | 867,893.000 | |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 11,200 | 10.610 | 118,832.000 | |
| TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD | 10,100 | 8.950 | 90,395.000 | |
| NAVINFO CO LTD | 5,600 | 11.760 | 65,856.000 | |
| BY-HEALTH CO LTD | 14,100 | 24.420 | 344,322.000 | |
| DAAN GENE CO LTD | 13,900 | 15.670 | 217,813.000 | |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD | 300 | 28.330 | 8,499.000 | |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC | 7,800 | 23.200 | 180,960.000 | |
| RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD | 71,750 | 11.880 | 852,390.000 | |
| CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD | 6,000 | 47.650 | 285,900.000 | |
| UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD | 6,139 | 124.050 | 761,542.950 | |
| INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD | 3,570 | 22.810 | 81,431.700 | |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD | 12,700 | 10.040 | 127,508.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| O-FILM TECH CO LTD | 8,600 | 4.880 | 41,968.000 | |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD | 36,700 | 4.320 | 158,544.000 | |
| FAW JIEFANG GROUP CO LTD | 32,000 | 7.990 | 255,680.000 | |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD | 50,467 | 31.930 | 1,611,411.310 | |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD | 10,800 | 31.820 | 343,656.000 | |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD | 11,184 | 38.590 | 431,590.560 | |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD | 11,100 | 35.150 | 390,165.000 | |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD | 6,900 | 23.340 | 161,046.000 | |
| XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD | 28,700 | 5.510 | 158,137.000 | |
| DONG-E-E-JIAO CO LTD | 4,900 | 40.830 | 200,067.000 | |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO | 15,300 | 8.420 | 128,826.000 | |
| HUADONG MEDICINE CO LTD | 7,500 | 49.400 | 370,500.000 | |
| YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD | 5,000 | 28.330 | 141,650.000 | |
| TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD | 99,100 | 3.190 | 316,129.000 | |
| 37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 6,600 | 20.460 | 135,036.000 | |
| AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD | 9,800 | 25.580 | 250,684.000 | |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD | 10,000 | 239.000 | 2,390,000.000 | |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD | 17,800 | 67.900 | 1,208,620.000 | |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 14,950 | 9.110 | 136,194.500 | |
| TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY | 22,300 | 40.840 | 910,732.000 | |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD | 31,240 | 14.770 | 461,414.800 | |
| BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD | 7,448 | 15.360 | 114,401.280 | |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD | 2,100 | 108.000 | 226,800.000 | |
| SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD | 36,480 | 6.020 | 219,609.600 | |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD | 14,300 | 9.160 | 130,988.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD | 45,054 | 29.650 | 1,335,851.100 | |
| QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD | 29,900 | 23.090 | 690,391.000 | |
| SHANXI SECURITIES CO LTD | 27,500 | 5.400 | 148,500.000 | |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD | 71,300 | 7.030 | 501,239.000 | |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD | 19,900 | 12.690 | 252,531.000 | |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD | 19,100 | 11.620 | 221,942.000 | |
| IFLYTEK CO LTD | 11,800 | 34.120 | 402,616.000 | |
| HESTEEL CO LTD | 93,400 | 2.260 | 211,084.000 | |
| GOERTEK INC | 25,100 | 18.280 | 458,828.000 | |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD | 21,300 | 6.530 | 139,089.000 | |
| BANK OF NINGBO CO LTD | 45,200 | 32.510 | 1,469,452.000 | |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD | 39,600 | 10.640 | 421,344.000 | |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION | 135,200 | 3.870 | 523,224.000 | |
| CHANGJIANG SECURITIES CO LTD | 28,300 | 5.420 | 153,386.000 | |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD | 37,600 | 5.370 | 201,912.000 | |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD | 68,188 | 13.360 | 910,991.680 | |
| WESTERN SECURITIES CO LTD | 22,700 | 6.170 | 140,059.000 | |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD | 27,400 | 25.630 | 702,262.000 | |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD | 10,520 | 55.020 | 578,810.400 | |
| EAST MONEY INFORMATION CO LTD | 84,349 | 21.000 | 1,771,329.000 | |
| JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD | 10,300 | 176.800 | 1,821,040.000 | |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD | 22,900 | 195.240 | 4,470,996.000 | |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD | 76,600 | 6.460 | 494,836.000 | |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 218,100 | 3.670 | 800,427.000 | |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD | 45,900 | 13.880 | 637,092.000 | |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI | 18,700 | 34.120 | 638,044.000 | |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD | 42,300 | 9.030 | 381,969.000 | |
| PING AN BANK CO LTD | 128,100 | 14.440 | 1,849,764.000 | |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD | 29,180 | 19.180 | 559,672.400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD | 146,300 | 4.020 | 588,126.000 | |
| CHINA VANKE CO LTD | 55,100 | 18.800 | 1,035,880.000 | |
| ZTE CORP | 19,700 | 25.490 | 502,153.000 | |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD | 28,500 | 5.580 | 159,030.000 | |
| WEICHAI POWER CO LTD | 48,100 | 10.730 | 516,113.000 | |
| LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC | 4,200 | 33.450 | 140,490.000 | |
| GF SECURITIES CO LTD | 38,700 | 16.250 | 628,875.000 | |
| XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | 21,100 | 11.210 | 236,531.000 | |
| BYD CO LTD | 10,400 | 266.590 | 2,772,536.000 | |
| YOUNGY CO LTD | 2,100 | 105.410 | 221,361.000 | |
| CECEP SOLAR ENERGY CO LTD | 30,200 | 7.690 | 232,238.000 | |
| GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD | 34,100 | 4.740 | 161,634.000 | |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD | 9,660 | 47.150 | 455,469.000 | |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD | 5,220 | 50.240 | 262,252.800 | |
| LB GROUP CO LTD | 11,000 | 19.790 | 217,690.000 | |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD | 17,900 | 14.460 | 258,834.000 | |
| SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD | 8,400 | 24.460 | 205,464.000 | |
| YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD | 2,100 | 57.100 | 119,910.000 | |
| ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD | 9,600 | 26.900 | 258,240.000 | |
| SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | 11,700 | 23.560 | 275,652.000 | |
| SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD | 6,400 | 61.100 | 391,040.000 | |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD | 8,000 | 24.500 | 196,000.000 | |
| ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD | 12,700 | 23.280 | 295,656.000 | |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 3,500 | 230.500 | 806,750.000 | |
| INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD | 30,100 | 8.560 | 257,656.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD | 12,800 | 17.710 | 226,688.000 | |
| HUAFON CHEMICAL CO LTD | 34,200 | 7.310 | 250,002.000 | |
| HUNAN VALIN STEEL CO LTD | 57,300 | 4.690 | 268,737.000 | |
| PERFECT WORLD CO LTD/CHINA | 5,550 | 13.790 | 76,534.500 | |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD | 3,300 | 295.760 | 976,008.000 | |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD | 15,600 | 7.200 | 112,320.000 | |
| ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD | 6,600 | 65.510 | 432,366.000 | |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD | 600 | 52.200 | 31,320.000 | |
| NINESTAR CORP | 4,500 | 53.500 | 240,750.000 | |
| YUNDA HOLDING CO LTD | 25,420 | 13.300 | 338,086.000 | |
| GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD | 33,800 | 3.040 | 102,752.000 | |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD | 1,600 | 57.950 | 92,720.000 | |
| HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD | 16,900 | 15.310 | 258,739.000 | |
| SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD | 10,700 | 33.590 | 359,413.000 | |
| ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD | 1,820 | 149.890 | 272,799.800 | |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD | 1,800 | 149.560 | 269,208.000 | |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD | 15,100 | 6.490 | 97,999.000 | |
| SF HOLDING CO LTD | 32,000 | 59.100 | 1,891,200.000 | |
| GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD | 1,800 | 107.330 | 193,194.000 | |
| FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD | 23,600 | 5.750 | 135,700.000 | |
| BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD | 4,000 | 59.690 | 238,760.000 | |
| INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD | 2,500 | 71.810 | 179,525.000 | |
| GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD | 4,700 | 83.340 | 391,698.000 | |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD | 119,490 | 5.930 | 708,575.700 | |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY INC | 38,900 | 6.800 | 264,520.000 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD | 73,000 | 5.220 | 381,060.000 | |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD | 2,300 | 76.250 | 175,375.000 | |
| CSC FINANCIAL CO LTD | 26,100 | 24.710 | 644,931.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD | 12,180 | 53.700 | 654,066.000 | |
| NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD | 9,100 | 19.140 | 174,174.000 | |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD | 33,200 | 15.960 | 529,872.000 | |
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD | 3,100 | 85.790 | 265,949.000 | |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD | 22,500 | 10.160 | 228,600.000 | |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 10,372 | 43.950 | 455,849.400 | |
| SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD | 38,800 | 9.180 | 356,184.000 | |
| CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD | 3,700 | 39.750 | 147,075.000 | |
| CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD | 5,200 | 26.330 | 136,916.000 | |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD | 15,278 | 16.090 | 245,823.020 | |
| SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD | 3,000 | 134.210 | 402,630.000 | |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD | 3,150 | 60.000 | 189,000.000 | |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD | 3,900 | 149.000 | 581,100.000 | |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD | 2,700 | 60.490 | 163,323.000 | |
| JUEWEI FOOD CO LTD | 3,100 | 57.020 | 176,762.000 | |
| OPPEIN HOME GROUP INC | 2,100 | 123.560 | 259,476.000 | |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD | 9,116 | 61.140 | 557,352.240 | |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD | 9,500 | 13.850 | 131,575.000 | |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD | 3,000 | 28.250 | 84,750.000 | |
| SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD | 10,300 | 18.760 | 193,228.000 | |
| JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD | 4,700 | 51.800 | 243,460.000 | |
| HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD | 6,900 | 40.340 | 278,346.000 | |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD | 4,540 | 74.520 | 338,320.800 | |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD | 3,000 | 121.900 | 365,700.000 | |
| ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD | 2,700 | 55.300 | 149,310.000 | |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD | 8,030 | 33.420 | 268,362.600 | |
| BGI GENOMICS CO LTD | 1,300 | 52.990 | 68,887.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD | 3,000 | 66.000 | 198,000.000 | |
| CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD | 11,600 | 34.520 | 400,432.000 | |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD | 3,200 | 34.390 | 110,048.000 | |
| CAITONG SECURITIES CO LTD | 12,700 | 7.460 | 94,742.000 | |
| HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD | 2,400 | 87.530 | 210,072.000 | |
| BANK OF CHENGDU CO LTD | 21,300 | 14.770 | 314,601.000 | |
| SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD | 13,200 | 15.000 | 198,000.000 | |
| BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD | 4,200 | 83.730 | 351,666.000 | |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD | 1,900 | 81.250 | 154,375.000 | |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD | 56,100 | 9.400 | 527,340.000 | |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD | 7,400 | 328.090 | 2,427,866.000 | |
| HUAXI SECURITIES CO LTD | 15,500 | 7.810 | 121,055.000 | |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC | 4,400 | 136.200 | 599,280.000 | |
| SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD | 8,500 | 23.780 | 202,130.000 | |
| OVCTEK CHINA INC | 4,060 | 36.560 | 148,433.600 | |
| SG MICRO CORP | 3,150 | 166.000 | 522,900.000 | |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD | 15,700 | 432.000 | 6,782,400.000 | |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC | 3,016 | 106.380 | 320,842.080 | |
| WUXI APPTEC CO LTD | 17,572 | 89.530 | 1,573,221.160 | |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD | 10,300 | 36.430 | 375,229.000 | |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD | 92,100 | 3.520 | 324,192.000 | |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD | 7,300 | 55.780 | 407,194.000 | |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD | 2,560 | 126.500 | 323,840.000 | |
| NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD | 29,700 | 12.700 | 377,190.000 | |
| PHARMARON BEIJING CO LTD | 4,950 | 73.140 | 362,043.000 | |
| SHENZHEN DYNANONIC CO LTD | 600 | 251.100 | 150,660.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD | 2,900 | 97.990 | 284,171.000 | |
| SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD | 1,100 | 208.010 | 228,811.000 | |
| AMLOGIC SHANGHAI CO LTD | 1,100 | 69.780 | 76,758.000 | |
| BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD | 3,900 | 96.780 | 377,442.000 | |
| WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD | 1,800 | 95.460 | 171,828.000 | |
| ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA | 3,000 | 100.140 | 300,420.000 | |
| MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD | 5,400 | 63.460 | 342,684.000 | |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD | 75,000 | 4.690 | 351,750.000 | |
| NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD | 2,700 | 71.510 | 193,077.000 | |
| ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY INC CO | 3,500 | 46.680 | 163,380.000 | |
| TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD | 8,200 | 33.730 | 276,586.000 | |
| SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD | 26,300 | 11.940 | 314,022.000 | |
| WILL SEMICONDUCTOR LTD | 9,130 | 85.490 | 780,523.700 | |
| WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD | 2,380 | 111.160 | 264,560.800 | |
| JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD | 3,220 | 63.500 | 204,470.000 | |
| MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD | 12,800 | 26.440 | 338,432.000 | |
| BANK OF CHANGSHA CO LTD | 43,700 | 6.820 | 298,034.000 | |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD | 114,300 | 2.920 | 333,756.000 | |
| PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD | 70,700 | 4.950 | 349,965.000 | |
| AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD | 10,700 | 27.660 | 295,962.000 | |
| CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD | 24,800 | 8.550 | 212,040.000 | |
| SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP | 2,200 | 121.440 | 267,168.000 | |
| PROYA COSMETICS CO LTD | 1,260 | 171.230 | 215,749.800 | |
| NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD | 2,900 | 69.450 | 201,405.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD | 800 | 351.000 | 280,800.000 | |
| SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD | 960 | 439.940 | 422,342.400 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD | 185,000 | 4.750 | 878,750.000 | |
| BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD | 21,000 | 10.730 | 225,330.000 | |
| SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD | 2,300 | 64.900 | 149,270.000 | |
| GUOLIAN SECURITIES CO LTD | 32,900 | 11.720 | 385,588.000 | |
| TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD | 43,500 | 8.280 | 360,180.000 | |
| SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TECHNOLOGY CO LTD | 3,900 | 60.370 | 235,443.000 | |
| GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD | 1,400 | 178.700 | 250,180.000 | |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD | 6,100 | 44.890 | 273,829.000 | |
| ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD | 1,600 | 43.210 | 69,136.000 | |
| HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD | 6,300 | 51.680 | 325,584.000 | |
| HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD | 6,000 | 41.250 | 247,500.000 | |
| YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD | 2,200 | 107.300 | 236,060.000 | |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD | 17,380 | 64.830 | 1,126,745.400 | |
| ZHONGTAI SECURITIES CO LTD | 35,600 | 6.490 | 231,044.000 | |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD | 5,055 | 136.320 | 689,097.600 | |
| SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD | 9,100 | 58.390 | 531,349.000 | |
| FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD | 2,600 | 160.700 | 417,820.000 | |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD | 7,500 | 38.520 | 288,900.000 | |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD | 4,600 | 54.500 | 250,700.000 | |
| SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD | 2,900 | 79.980 | 231,942.000 | |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD | 1,600 | 600.240 | 960,384.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD | 2,200 | 77.620 | 170,764.000 | |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC | 3,247 | 272.370 | 884,385.390 | |
| SHANGHAI MEDICILON INC | 800 | 223.400 | 178,720.000 | |
| CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD | 185,600 | 2.300 | 426,880.000 | |
| PETROCHINA CO LTD | 164,900 | 4.960 | 817,904.000 | |
| INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD | 373,700 | 4.300 | 1,606,910.000 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD | 511,200 | 2.910 | 1,487,592.000 | |
| BANK OF CHINA LTD | 196,000 | 3.180 | 623,280.000 | |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP | 227,300 | 4.370 | 993,301.000 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 22,700 | 36.400 | 826,280.000 | |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD | 46,200 | 27.440 | 1,267,728.000 | |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD | 125,100 | 38.250 | 4,785,075.000 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD | 62,600 | 49.210 | 3,080,546.000 | |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD | 129,900 | 17.780 | 2,309,622.000 | |
| SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD | 151,300 | 7.280 | 1,101,464.000 | |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD | 217,700 | 3.430 | 746,711.000 | |
| SAIC MOTOR CORP LTD | 42,500 | 14.490 | 615,825.000 | |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD | 7,900 | 1,854.450 | 14,650,155.000 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD | 225,700 | 4.790 | 1,081,103.000 | |
| CITIC SECURITIES CO LTD | 83,100 | 20.440 | 1,698,564.000 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 40,700 | 24.160 | 983,312.000 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD | 38,300 | 5.240 | 200,692.000 | |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD | 144,800 | 20.630 | 2,987,224.000 | |
| DAQIN RAILWAY CO LTD | 82,600 | 6.530 | 539,378.000 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD | 215,100 | 3.050 | 656,055.000 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD | 271,500 | 5.430 | 1,474,245.000 | |
| HAITONG SECURITIES CO LTD | 55,500 | 8.800 | 488,400.000 | |
| HUAXIA BANK CO LTD | 70,700 | 5.210 | 368,347.000 | |
| INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD | 32,500 | 32.510 | 1,056,575.000 | |
| BANK OF BEIJING CO LTD | 166,400 | 4.230 | 703,872.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD | 191,200 | 4.980 | 952,176.000 | |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD | 169,900 | 5.830 | 990,517.000 | |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD | 23,200 | 28.350 | 657,720.000 | |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD | 59,800 | 13.610 | 813,878.000 | |
| HUANENG POWER INTERNATIONAL INC | 59,000 | 7.380 | 435,420.000 | |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD | 11,700 | 30.240 | 353,808.000 | |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD | 88,000 | 15.900 | 1,399,200.000 | |
| CRRC CORP LTD | 141,700 | 5.130 | 726,921.000 | |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD | 43,252 | 39.380 | 1,703,263.760 | |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD | 30,400 | 26.510 | 805,904.000 | |
| HUATAI SECURITIES CO LTD | 49,500 | 12.110 | 599,445.000 | |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD | 157,500 | 5.540 | 872,550.000 | |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 16,300 | 31.710 | 516,873.000 | |
| HAIER SMART HOME CO LTD | 45,500 | 25.750 | 1,171,625.000 | |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD | 48,200 | 16.880 | 813,616.000 | |
| GD POWER DEVELOPMENT CO LTD | 101,300 | 4.190 | 424,447.000 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK CORP | 56,200 | 5.600 | 314,720.000 | |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 17,400 | 35.770 | 622,398.000 | |
| GUANGHUI ENERGY CO LTD | 26,400 | 9.540 | 251,856.000 | |
| GEMDALE CORP | 39,700 | 10.160 | 403,352.000 | |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD | 20,000 | 90.900 | 1,818,000.000 | |
| SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD | 78,700 | 3.990 | 314,013.000 | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD | 140,200 | 11.410 | 1,599,682.000 | |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD | 32,344 | 26.200 | 847,412.800 | |
| OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD | 29,800 | 6.050 | 180,290.000 | |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD | 11,100 | 231.980 | 2,574,978.000 | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD | 30,900 | 11.460 | 354,114.000 | |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD | 222,500 | 1.910 | 424,975.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TSINGTAO BREWERY CO LTD | 4,400 | 106.890 | 470,316.000 | |
| AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD | 25,000 | 3.270 | 81,750.000 | |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD | 102,000 | 4.770 | 486,540.000 | |
| AIR CHINA LTD | 60,700 | 10.630 | 645,241.000 | |
| TBEA CO LTD | 18,600 | 20.080 | 373,488.000 | |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD | 43,500 | 8.390 | 364,965.000 | |
| METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD | 164,900 | 3.190 | 526,031.000 | |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD | 117,300 | 7.030 | 824,619.000 | |
| CHINA CSSC HOLDINGS LTD | 33,700 | 22.000 | 741,400.000 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD | 10,400 | 58.000 | 603,200.000 | |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD | 6,900 | 29.830 | 205,827.000 | |
| JIANGXI COPPER CO LTD | 14,900 | 18.350 | 273,415.000 | |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LTD | 34,300 | 3.800 | 130,340.000 | |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD | 28,500 | 17.480 | 498,180.000 | |
| SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD | 23,700 | 12.190 | 288,903.000 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD | 11,400 | 18.400 | 209,760.000 | |
| AECC AVIATION POWER CO LTD | 11,200 | 41.810 | 468,272.000 | |
| BANK OF NANJING CO LTD | 57,300 | 10.570 | 605,661.000 | |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 7,600 | 13.450 | 102,220.000 | |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD | 89,670 | 10.190 | 913,737.300 | |
| CMOC GROUP LIMITED | 119,700 | 4.830 | 578,151.000 | |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL CO LTD | 115,800 | 3.100 | 358,980.000 | |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD | 84,800 | 6.230 | 528,304.000 | |
| BEIJING TONGRENTANG CO LTD | 9,000 | 44.320 | 398,880.000 | |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD | 20,120 | 19.900 | 400,388.000 | |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD | 5,200 | 31.320 | 162,864.000 | |
| BBMG CORP | 54,200 | 2.430 | 131,706.000 | |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD | 14,000 | 33.020 | 462,280.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD | 111,500 | 5.400 | 602,100.000 | |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD | 15,019 | 21.880 | 328,615.720 | |
| HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD | 58,000 | 5.920 | 343,360.000 | |
| SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD | 26,400 | 16.820 | 444,048.000 | |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC | 10,264 | 42.980 | 441,146.720 | |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD | 16,250 | 24.120 | 391,950.000 | |
| COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD | 127,500 | 2.430 | 309,825.000 | |
| XIAMEN TUNGSTEN CO LTD | 3,300 | 20.850 | 68,805.000 | |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD | 96,500 | 7.840 | 756,560.000 | |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD | 59,000 | 2.570 | 151,630.000 | |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD | 10,200 | 36.320 | 370,464.000 | |
| XIAMEN C & D INC | 18,900 | 13.250 | 250,425.000 | |
| YOUNGOR GROUP CO LTD | 25,600 | 6.370 | 163,072.000 | |
| AVIC HELICOPTER CO LTD | 4,600 | 45.900 | 211,140.000 | |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD | 16,800 | 6.690 | 112,392.000 | |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD | 15,100 | 25.450 | 384,295.000 | |
| ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD | 49,500 | 5.040 | 249,480.000 | |
| SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD | 14,900 | 14.520 | 216,348.000 | |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD | 39,400 | 4.380 | 172,572.000 | |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD | 19,600 | 6.210 | 121,716.000 | |
| WESTERN MINING CO LTD | 23,300 | 10.860 | 253,038.000 | |
| ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD | 3,900 | 291.640 | 1,137,396.000 | |
| GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | 34,100 | 8.810 | 300,421.000 | |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD | 7,480 | 294.000 | 2,199,120.000 | |
| KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD | 12,600 | 14.900 | 187,740.000 | |
| CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD | 56,800 | 5.750 | 326,600.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD | 25,000 | 7.580 | 189,500.000 | |
| CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD | 6,500 | 61.350 | 398,775.000 | |
| ZHEJIANG JUHUA CO LTD | 20,300 | 16.430 | 333,529.000 | |
| PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD | 19,400 | 10.580 | 205,252.000 | |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD | 135,800 | 3.390 | 460,362.000 | |
| SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD | 31,900 | 10.160 | 324,104.000 | |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD | 12,600 | 16.820 | 211,932.000 | |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD | 26,100 | 11.780 | 307,458.000 | |
| JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD | 4,200 | 37.540 | 157,668.000 | |
| DALIAN PORT PDA CO LTD | 173,200 | 1.600 | 277,120.000 | |
| SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD | 33,900 | 10.710 | 363,069.000 | |
| YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD | 12,700 | 21.210 | 269,367.000 | |
| ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD | 5,830 | 23.960 | 139,686.800 | |
| JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD | 11,800 | 11.600 | 136,880.000 | |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD | 26,800 | 15.010 | 402,268.000 | |
| TONGWEI CO LTD | 29,000 | 39.980 | 1,159,420.000 | |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD | 8,879 | 45.290 | 402,129.910 | |
| JCET GROUP CO LTD | 10,900 | 25.100 | 273,590.000 | |
| HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD | 6,800 | 33.600 | 228,480.000 | |
| CHONGQING BREWERY CO LTD | 2,500 | 127.550 | 318,875.000 | |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD | 5,300 | 56.930 | 301,729.000 | |
| HUAXIN CEMENT CO LTD | 5,600 | 15.280 | 85,568.000 | |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD | 10,490 | 32.810 | 344,176.900 | |
| XIAMEN FARATRONIC CO LTD | 1,700 | 170.620 | 290,054.000 | |
| CHINA JUSHI CO LTD | 20,246 | 14.270 | 288,910.420 | |
| SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD | 62,400 | 3.050 | 190,320.000 | |
| NINGBO SHANSHAN CO LTD | 13,200 | 18.610 | 245,652.000 | |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD | 4,524 | 66.200 | 299,488.800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD | 19,600 | 12.170 | 238,532.000 | |
| HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD | 19,600 | 16.230 | 318,108.000 | |
| SAILUN GROUP CO LTD | 19,700 | 9.960 | 196,212.000 | |
| TONGKUN GROUP CO LTD | 15,700 | 14.550 | 228,435.000 | |
| JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD | 1,700 | 106.400 | 180,880.000 | |
| ANGEL YEAST CO LTD | 4,900 | 43.570 | 213,493.000 | |
| HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD | 5,600 | 29.580 | 165,648.000 | |
| BTG HOTELS GROUP CO LTD | 14,800 | 24.400 | 361,120.000 | |
| SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD | 4,200 | 72.830 | 305,886.000 | |
| CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD | 6,500 | 70.450 | 457,925.000 | |
| YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 900 | 146.300 | 131,670.000 | |
| NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD | 800 | 344.000 | 275,200.000 | |
| HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD | 2,600 | 44.060 | 114,556.000 | |
| BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD | 1,000 | 134.200 | 134,200.000 | |
| GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD | 1,000 | 365.000 | 365,000.000 | |
| CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD | 7,100 | 53.780 | 381,838.000 | |
| TRINA SOLAR CO LTD | 11,100 | 71.410 | 792,651.000 | |
| CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD | 181,700 | 5.870 | 1,066,579.000 | |
| ZANGGE MINING CO LTD | 11,600 | 26.770 | 310,532.000 | |
| SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD | 97,900 | 5.910 | 578,589.000 | |
| PYLON TECHNOLOGIES CO LTD | 1,000 | 325.200 | 325,200.000 | |
| IRAY TECHNOLOGY CO LTD | 600 | 472.600 | 283,560.000 | |
| WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD | 1,600 | 224.040 | 358,464.000 | |
| 3PEAK INC | 1,200 | 262.010 | 314,412.000 | |
| ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY CO LTD | 4,800 | 89.450 | 429,360.000 | |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD | 46,968 | 42.570 | 1,999,427.760 | |
| HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD | 12,700 | 12.950 | 164,465.000 | |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD | 1,800 | 135.840 | 244,512.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD | 10,200 | 27.780 | 283,356.000 | |
| SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD | 63,251 | 19.000 | 1,201,769.000 | |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD | 24,016 | 80.150 | 1,924,882.400 | |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD | 5,000 | 58.350 | 291,750.000 | |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD | 7,000 | 35.000 | 245,000.000 | |
| DONGXING SECURITIES CO LTD | 13,200 | 7.960 | 105,072.000 | |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD | 7,000 | 67.900 | 475,300.000 | |
| JUNEYAO AIRLINES CO LTD | 22,300 | 16.460 | 367,058.000 | |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD | 40,700 | 13.720 | 558,404.000 | |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD | 105,000 | 5.980 | 627,900.000 | |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD | 3,400 | 61.680 | 209,712.000 | |
| ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD | 5,300 | 74.070 | 392,571.000 | |
| SKSHU PAINT CO LTD | 2,000 | 124.940 | 249,880.000 | |
| BANK OF JIANGSU CO LTD | 83,200 | 7.420 | 617,344.000 | |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD | 45,400 | 13.380 | 607,452.000 | |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD | 11,400 | 21.550 | 245,670.000 | |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD | 2,000 | 21.300 | 42,600.000 | |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD | 28,300 | 19.890 | 562,887.000 | |
| JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD | 8,850 | 43.830 | 387,895.500 | |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD | 30,400 | 9.400 | 285,760.000 | |
| TOPCHOICE MEDICAL CORP | 3,200 | 155.000 | 496,000.000 | |
| ENN NATURAL GAS CO LTD | 21,300 | 17.050 | 363,165.000 | |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD | 10,580 | 74.500 | 788,210.000 | |
| TOLY BREAD CO LTD | 7,056 | 15.640 | 110,355.840 | |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD | 2,860 | 63.390 | 181,295.400 | |
| G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD | 1,000 | 364.580 | 364,580.000 | |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD | 2,940 | 48.300 | 142,002.000 | |
| ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD | 11,310 | 19.250 | 217,717.500 | |
| ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA | 49,300 | 10.200 | 502,860.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD | 16,000 | 15.260 | 244,160.000 | |
| | SHANGHAI M&G STATIONERY INC | 4,500 | 54.860 | 246,870.000 | |
| | FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD | 10,700 | 22.280 | 238,396.000 | |
| オフショア・人民元　小計 | | 15,390,647 | | 245,061,336.490<br>(4,781,342,724) | |
| カタール・リアル | QATAR NATIONAL BANK | 482,352 | 19.400 | 9,357,628.800 | |
| | COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC | 312,267 | 5.605 | 1,750,256.530 | |
| | OOREDOO QSC | 86,085 | 9.218 | 793,531.530 | |
| | QATAR FUEL QSC | 67,101 | 18.690 | 1,254,117.690 | |
| | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 49,676 | 17.800 | 884,232.800 | |
| | QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC | 109,350 | 10.630 | 1,162,390.500 | |
| | INDUSTRIES QATAR QSC | 159,428 | 14.000 | 2,231,992.000 | |
| | QATAR ISLAMIC BANK SAQ | 165,252 | 20.850 | 3,445,504.200 | |
| | QATAR GAS TRANSPORT CO LTD | 249,488 | 3.780 | 943,064.640 | |
| | MASRAF AL RAYAN | 554,259 | 3.420 | 1,895,565.780 | |
| | BARWA REAL ESTATE CO | 203,813 | 3.068 | 625,298.280 | |
| | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO | 451,662 | 2.272 | 1,026,176.060 | |
| カタール・リアル　小計 | | 2,890,733 | | 25,369,758.810<br>(918,892,664) | |
| クウェート・ディナール | KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP | 766,665 | 0.820 | 628,665.300 | |
| | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC | 242,238 | 0.559 | 135,411.040 | |
| | GULF BANK KSCP | 185,675 | 0.305 | 56,630.870 | |
| | NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP | 734,176 | 1.090 | 800,251.840 | |
| | AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC | 137,927 | 0.652 | 89,928.400 | |
| | MABANEE CO KPSC | 68,589 | 0.837 | 57,408.990 | |
| | BOUBYAN BANK KSCP | 136,266 | 0.787 | 107,241.340 | |
| クウェート・ディナール　小計 | | 2,271,536 | | 1,875,537.780<br>(813,364,469) | |
| コロンビア・ペソ | INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP | 48,542 | 22,000.000 | 1,067,924,000.000 | |
| | BANCOLOMBIA SA | 29,016 | 43,050.000 | 1,249,138,800.000 | |
| | BANCOLOMBIA SA-PREF | 45,692 | 34,500.000 | 1,576,374,000.000 | |
| コロンビア・ペソ　小計 | | 123,250 | | 3,893,436,800.000<br>(107,610,700) | |
| サウジアラビア・リアル | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO | 26,055 | 41.500 | 1,081,282.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| JARIR MARKETING CO | 6,127 | 151.600 | 928,853.200 | |
| ETIHAD ETISALAT CO | 38,569 | 36.200 | 1,396,197.800 | |
| SAUDI BRITISH BANK | 92,679 | 37.500 | 3,475,462.500 | |
| AL RAJHI BANK | 204,748 | 75.900 | 15,540,373.200 | |
| ARAB NATIONAL BANK | 58,412 | 30.500 | 1,781,566.000 | |
| BANK ALBILAD | 47,980 | 45.050 | 2,161,499.000 | |
| BANK AL-JAZIRA | 41,743 | 19.180 | 800,630.740 | |
| BANQUE SAUDI FRANSI | 62,154 | 39.650 | 2,464,406.100 | |
| RIYAD BANK | 136,011 | 30.750 | 4,182,338.250 | |
| SAUDI INVESTMENT BANK/THE | 52,554 | 18.000 | 945,972.000 | |
| SAUDI TELECOM CO | 157,136 | 37.900 | 5,955,454.400 | |
| SABIC AGRI-NUTRIENTS CO | 21,953 | 144.800 | 3,178,794.400 | |
| SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | 94,642 | 93.500 | 8,849,027.000 | |
| SAUDI ELECTRICITY CO | 87,342 | 23.600 | 2,061,271.200 | |
| SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP | 38,856 | 23.380 | 908,453.280 | |
| SAVOLA GROUP | 30,777 | 28.300 | 870,989.100 | |
| NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO | 24,022 | 12.660 | 304,118.520 | |
| ALMARAI CO JSC | 23,932 | 53.900 | 1,289,934.800 | |
| SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP | 3,987 | 186.000 | 741,582.000 | |
| EMAAR ECONOMIC CITY | 53,833 | 8.420 | 453,273.860 | |
| SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO | 33,939 | 34.500 | 1,170,895.500 | |
| ADVANCED PETROCHEMICAL CO | 14,397 | 44.000 | 633,468.000 | |
| SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 75,912 | 13.700 | 1,039,994.400 | |
| DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO | 59,592 | 12.040 | 717,487.680 | |
| RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO | 52,677 | 11.040 | 581,554.080 | |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA | 53,271 | 10.700 | 569,999.700 | |
| BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO | 8,157 | 144.600 | 1,179,502.200 | |
| ALINMA BANK | 98,225 | 32.300 | 3,172,667.500 | |
| SAUDI ARABIAN MINING CO | 87,447 | 73.300 | 6,409,865.100 | |
| MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 5,036 | 211.800 | 1,066,624.800 | |
| DALLAH HEALTHCARE CO | 4,127 | 144.000 | 594,288.000 | |
| SAUDI ARABIAN OIL CO | 254,633 | 31.850 | 8,110,061.050 | |
| DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO | 8,510 | 223.800 | 1,904,538.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ACWA POWER CO | 7,940 | 161.000 | 1,278,340.000 | |
| | ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO | 2,627 | 242.600 | 637,310.200 | |
| | NAHDI MEDICAL CO | 4,279 | 170.600 | 729,997.400 | |
| | SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO | 5,202 | 185.000 | 962,370.000 | |
| | ELM CO | 2,420 | 331.600 | 802,472.000 | |
| | THE SAUDI NATIONAL BANK | 229,007 | 49.100 | 11,244,243.700 | |
| サウジアラビア・リアル　小計 | | 2,310,910 | | 102,177,159.160<br>(3,610,940,805) | |
| タイ・バーツ | BERLI JUCKER PCL NVDR | 148,800 | 36.500 | 5,431,200.000 | |
| | KRUNG THAI BANK PCL NVDR | 419,600 | 18.100 | 7,594,760.000 | |
| | RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR | 124,300 | 44.500 | 5,531,350.000 | |
| | TRUE CORP PCL NVDR | 1,414,455 | 4.880 | 6,902,540.400 | |
| | KASIKORNBANK PCL NVDR | 66,300 | 155.500 | 10,309,650.000 | |
| | ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR | 29,400 | 177.000 | 5,203,800.000 | |
| | SHIN CORP PCL | 127,600 | 76.000 | 9,697,600.000 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS PCL | 392,200 | 24.000 | 9,412,800.000 | |
| | ADVANCED INFO SERVICE PCL | 118,700 | 203.000 | 24,096,100.000 | |
| | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 666,020 | 15.800 | 10,523,116.000 | |
| | DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR | 31,700 | 832.000 | 26,374,400.000 | |
| | PTT PCL | 1,061,900 | 33.250 | 35,308,175.000 | |
| | THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 265,000 | 16.400 | 4,346,000.000 | |
| | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | 83,100 | 58.750 | 4,882,125.000 | |
| | LAND AND HOUSES PCL NVDR | 826,100 | 9.850 | 8,137,085.000 | |
| | SIAM CEMENT PCL NVDR | 82,050 | 358.000 | 29,373,900.000 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR | 429,100 | 75.250 | 32,289,775.000 | |
| | CENTRAL PATTANA PCL NVDR | 193,400 | 70.000 | 13,538,000.000 | |
| | BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR | 1,097,500 | 30.750 | 33,748,125.000 | |
| | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 62,700 | 225.000 | 14,107,500.000 | |
| | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 328,110 | 33.750 | 11,073,712.500 | |
| | THAI OIL PCL NVDR | 124,700 | 55.500 | 6,920,850.000 | |
| | CP ALL PCL NVDR | 588,600 | 71.000 | 41,790,600.000 | |
| | BTS GROUP HOLDINGS PCL | 866,900 | 8.600 | 7,455,340.000 | |
| | PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR | 138,845 | 169.000 | 23,464,805.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | INDORAMA VENTURES PCL NVDR | 189,722 | 41.250 | 7,826,032.500 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 234,908 | 50.250 | 11,804,127.000 | |
| | JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR | 54,300 | 68.750 | 3,733,125.000 | |
| | ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR | 167,600 | 91.000 | 15,251,600.000 | |
| | BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR | 860,800 | 9.600 | 8,263,680.000 | |
| | B GRIMM POWER PCL NVDR | 98,200 | 41.500 | 4,075,300.000 | |
| | GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR | 291,000 | 55.000 | 16,005,000.000 | |
| | OSOTSPA PCL NVDR | 142,800 | 30.000 | 4,284,000.000 | |
| | ASSET WORLD CORP PCL NVDR | 817,200 | 6.150 | 5,025,780.000 | |
| | CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR | 203,033 | 44.750 | 9,085,726.750 | |
| | SCG PACKAGING PCL NVDR | 143,300 | 58.000 | 8,311,400.000 | |
| | SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR | 69,000 | 53.000 | 3,657,000.000 | |
| | PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR | 295,300 | 24.000 | 7,087,200.000 | |
| | SCB X PCL NVDR | 90,300 | 113.500 | 10,249,050.000 | |
| | CARABAO GROUP PCL NVDR | 32,500 | 102.500 | 3,331,250.000 | |
| | MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR | 55,400 | 41.250 | 2,285,250.000 | |
| | GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR | 74,400 | 74.750 | 5,561,400.000 | |
| タイ・バーツ　小計 | | 13,506,843 | | 513,350,230.150<br>(2,022,599,907) | |
| チェコ・コルナ | KOMERCNI BANKA AS | 8,062 | 725.000 | 5,844,950.000 | |
| | CEZ | 17,008 | 802.000 | 13,640,416.000 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 40,915 | 80.700 | 3,301,840.500 | |
| チェコ・コルナ　小計 | | 65,985 | | 22,787,206.500<br>(135,153,200) | |
| チリ・ペソ | BANCO SANTANDER CHILE | 6,868,510 | 33.450 | 229,751,659.500 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES | 5,709 | 24,300.000 | 138,728,700.000 | |
| | BANCO DE CHILE | 4,614,110 | 83.490 | 385,232,043.900 | |
| | EMPRESAS CMPC SA | 119,258 | 1,469.000 | 175,190,002.000 | |
| | EMPRESAS COPEC SA | 40,423 | 6,150.000 | 248,601,450.000 | |
| | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | 10,516 | 5,615.000 | 59,047,340.000 | |
| | CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA | 1,882,457 | 67.360 | 126,802,303.520 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 2,133,152 | 110.000 | 234,646,720.000 | |
| | SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA | 14,822 | 67,000.000 | 993,074,000.000 | |
| | FALABELLA SA | 80,736 | 1,799.000 | 145,244,064.000 | |
| | CENCOSUD SA | 152,261 | 1,300.000 | 197,939,300.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ENEL CHILE SA | 2,415,702 | 36.900 | 89,139,403.800 | |
| チリ・ペソ　小計 | | 18,337,656 | | 3,023,396,986.720<br>(483,029,996) | |
| トルコ・リラ | AKBANK TAS | 335,192 | 17.030 | 5,708,319.760 | |
| | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 73,827 | 58.150 | 4,293,040.050 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS | 147,123 | 37.860 | 5,570,076.780 | |
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 7,410 | 479.000 | 3,549,390.000 | |
| | HEKTAS TICARET TAS | 121,118 | 34.000 | 4,118,012.000 | |
| | KOC HOLDING AS | 71,598 | 72.250 | 5,172,955.500 | |
| | SASA POLYESTER SANAYI | 46,986 | 101.000 | 4,745,586.000 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS | 144,586 | 40.840 | 5,904,892.240 | |
| | TURK HAVA YOLLARI | 57,648 | 131.200 | 7,563,417.600 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 137,757 | 35.840 | 4,937,210.880 | |
| | TURKIYE IS BANKASI | 315,842 | 11.180 | 3,531,113.560 | |
| | TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE | 13,554 | 475.300 | 6,442,216.200 | |
| | YAPI VE KREDI BANKASI AS | 313,727 | 9.530 | 2,989,818.310 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING AS | 92,361 | 40.180 | 3,711,064.980 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 48,467 | 130.000 | 6,300,710.000 | |
| トルコ・リラ　小計 | | 1,927,196 | | 74,537,823.860<br>(525,417,120) | |
| ハンガリー・フォリント | RICHTER GEDEON NYRT | 13,796 | 8,550.000 | 117,955,800.000 | |
| | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT | 40,781 | 2,680.000 | 109,293,080.000 | |
| | OTP BANK NYRT | 22,296 | 10,920.000 | 243,472,320.000 | |
| ハンガリー・フォリント　小計 | | 76,873 | | 470,721,200.000<br>(168,103,014) | |
| フィリピン・ペソ | AYALA LAND INC | 755,500 | 30.000 | 22,665,000.000 | |
| | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 158,120 | 59.000 | 9,329,080.000 | |
| | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND | 188,130 | 104.500 | 19,659,585.000 | |
| | AYALA CORP | 27,283 | 703.000 | 19,179,949.000 | |
| | GLOBE TELECOM INC | 3,335 | 2,114.000 | 7,050,190.000 | |
| | INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC | 96,370 | 203.000 | 19,563,110.000 | |
| | JG SUMMIT HOLDINGS INC | 318,290 | 56.200 | 17,887,898.000 | |
| | JOLLIBEE FOODS CORP | 46,960 | 241.000 | 11,317,360.000 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 205,155 | 57.200 | 11,734,866.000 | |
| | BDO UNIBANK INC | 230,062 | 110.900 | 25,513,875.800 | |
| | PLDT INC | 8,985 | 1,433.000 | 12,875,505.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 1,194,575 | 37.250 | 44,497,918.750 | |
| | UNIVERSAL ROBINA CORP | 96,820 | 138.000 | 13,361,160.000 | |
| | SM INVESTMENTS CORP | 24,133 | 903.500 | 21,804,165.500 | |
| | MANILA ELECTRIC COMPANY | 24,720 | 306.000 | 7,564,320.000 | |
| | ACEN CORP | 763,119 | 7.300 | 5,570,768.700 | |
| | MONDE NISSIN CORP | 649,200 | 12.300 | 7,985,160.000 | |
| フィリピン・ペソ　小計 | | 4,790,757 | | 277,559,911.750<br>(669,446,751) | |
| ブラジル・レアル | BRF SA | 54,692 | 9.060 | 495,509.520 | |
| | VALE SA | 396,789 | 93.580 | 37,131,514.620 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 106,600 | 24.010 | 2,559,466.000 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA | 23,950 | 42.190 | 1,010,450.500 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA | 124,000 | 40.900 | 5,071,600.000 | |
| | BANCO DO BRASIL SA | 87,800 | 35.300 | 3,099,340.000 | |
| | ITAUSA SA | 544,626 | 8.720 | 4,749,138.720 | |
| | GERDAU SA | 114,630 | 31.810 | 3,646,380.300 | |
| | PETROLEO BRASILEIRO SA | 388,910 | 27.250 | 10,597,797.500 | |
| | VIBRA ENERGIA SA | 116,600 | 14.890 | 1,736,174.000 | |
| | PETROLEO BRASILEIRO SA | 490,912 | 24.090 | 11,826,070.080 | |
| | CCR SA | 121,020 | 10.870 | 1,315,487.400 | |
| | WEG SA | 171,244 | 37.550 | 6,430,212.200 | |
| | BANCO BRADESCO SA PREF | 545,102 | 15.100 | 8,231,040.200 | |
| | BANCO BRADESCO SA | 176,892 | 13.190 | 2,333,205.480 | |
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 64,606 | 17.120 | 1,106,054.720 | |
| | SUZANO SA | 74,375 | 49.980 | 3,717,262.500 | |
| | CPFL ENERGIA SA | 23,600 | 31.740 | 749,064.000 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 504,947 | 25.900 | 13,078,127.300 | |
| | AMERICANAS SA | 69,171 | 11.910 | 823,826.610 | |
| | BRASKEM SA | 19,900 | 23.050 | 458,695.000 | |
| | ENGIE BRASIL SA | 25,587 | 37.850 | 968,467.950 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR | 79,789 | 53.580 | 4,275,094.620 | |
| | LOJAS RENNER SA | 93,720 | 20.020 | 1,876,274.400 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 66,304 | 12.720 | 843,386.880 | |
| | COSAN SA | 127,900 | 17.050 | 2,180,695.000 | |
| | TOTVS SA | 53,400 | 28.830 | 1,539,522.000 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA | 110,600 | 26.180 | 2,895,508.000 | |
| | JBS SA | 83,500 | 22.650 | 1,891,275.000 | |
| | CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS | 137,962 | 11.220 | 1,547,933.640 | |
| | CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO | 38,498 | 55.190 | 2,124,704.620 | |
| | HYPERA SA | 41,200 | 43.250 | 1,781,900.000 | |
| | B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO | 626,548 | 12.860 | 8,057,407.280 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | MAGAZINE LUIZA SA | 271,500 | 3.050 | 828,075.000 | |
| | HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA | 70,900 | 36.210 | 2,567,289.000 | |
| | TELEFONICA BRASIL SA | 50,528 | 38.500 | 1,945,328.000 | |
| | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 77,500 | 34.200 | 2,650,500.000 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA | 468,661 | 4.310 | 2,019,928.910 | |
| | ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA | 73,400 | 14.700 | 1,078,980.000 | |
| | AMBEV SA | 501,895 | 14.540 | 7,297,553.300 | |
| | NATURA &CO HOLDING SA | 92,700 | 12.590 | 1,167,093.000 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS | 348 | 11.980 | 4,169.040 | |
| | SENDAS DISTRIBUIDORA SA | 88,800 | 19.240 | 1,708,512.000 | |
| | TIM SA | 97,900 | 11.870 | 1,162,073.000 | |
| | REDE D'OR SAO LUIZ SA | 60,700 | 27.100 | 1,644,970.000 | |
| | RUMO SA | 144,300 | 18.130 | 2,616,159.000 | |
| ブラジル・レアル　小計 | | 7,704,506 | | 176,839,216.290<br>(4,496,667,592) | |
| ポーランド・ズロチ | MBANK | 1,344 | 356.000 | 478,464.000 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 15,187 | 150.850 | 2,290,958.950 | |
| | BANK PEKAO SA | 20,059 | 99.800 | 2,001,888.200 | |
| | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 67,889 | 62.000 | 4,209,118.000 | |
| | LPP SA | 112 | 12,530.000 | 1,403,360.000 | |
| | SANTANDER BANK POLSKA SA | 3,927 | 298.800 | 1,173,387.600 | |
| | CD PROJEKT RED SA | 7,001 | 138.160 | 967,258.160 | |
| | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA | 85,944 | 35.000 | 3,008,040.000 | |
| | CYFROWY POLSAT SA | 33,104 | 19.070 | 631,293.280 | |
| | POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA | 113,003 | 6.668 | 753,504.000 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA | 58,500 | 36.920 | 2,159,820.000 | |
| | DINO POLSKA SA | 4,692 | 365.000 | 1,712,580.000 | |
| | ALLEGRO.EU SA | 40,496 | 28.910 | 1,170,739.360 | |
| | PEPCO GROUP NV | 16,587 | 41.560 | 689,355.720 | |
| ポーランド・ズロチ　小計 | | 467,845 | | 22,649,767.270<br>(686,573,335) | |
| マレーシア・リンギット | AMMB HOLDINGS BHD | 210,200 | 4.160 | 874,432.000 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 680,800 | 5.720 | 3,894,176.000 | |
| | DIGI.COM BHD | 338,100 | 3.980 | 1,345,638.000 | |
| | MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD | 88,020 | 7.000 | 616,140.000 | |
| | RHB BANK BHD | 169,380 | 5.720 | 968,853.600 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | HAP SENG CONSOLIDATED BHD | 60,000 | 6.710 | 402,600.000 | |
| | TOP GLOVE CORP BHD | 500,700 | 0.850 | 425,595.000 | |
| | GENTING BHD | 250,100 | 4.800 | 1,200,480.000 | |
| | HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD | 18,056 | 18.580 | 335,480.480 | |
| | HONG LEONG BANK BHD | 65,508 | 20.600 | 1,349,464.800 | |
| | IOI CORP BHD | 276,613 | 3.960 | 1,095,387.480 | |
| | KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 48,500 | 21.960 | 1,065,060.000 | |
| | MALAYAN BANKING BHD | 507,475 | 8.790 | 4,460,705.250 | |
| | MISC BHD | 147,380 | 7.300 | 1,075,874.000 | |
| | NESTLE MALAYSIA BHD | 6,300 | 137.500 | 866,250.000 | |
| | PPB GROUP BHD | 70,260 | 17.520 | 1,230,955.200 | |
| | PETRONAS DAGANGAN BHD | 34,400 | 22.740 | 782,256.000 | |
| | PETRONAS GAS BHD | 79,500 | 17.160 | 1,364,220.000 | |
| | GENTING MALAYSIA BHD | 254,200 | 2.800 | 711,760.000 | |
| | TELEKOM MALAYSIA BHD | 142,900 | 5.200 | 743,080.000 | |
| | TENAGA NASIONAL BHD | 270,750 | 9.530 | 2,580,247.500 | |
| | QL RESOURCES BHD | 115,450 | 5.800 | 669,610.000 | |
| | DIALOG GROUP BHD | 418,344 | 2.550 | 1,066,777.200 | |
| | PUBLIC BANK BHD(LOCAL) | 1,475,450 | 4.300 | 6,344,435.000 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 320,700 | 2.290 | 734,403.000 | |
| | HARTALEGA HOLDINGS BHD | 249,800 | 1.570 | 392,186.000 | |
| | AXIATA GROUP BERHAD | 317,100 | 2.900 | 919,590.000 | |
| | MAXIS BHD | 206,000 | 3.740 | 770,440.000 | |
| | INARI AMERTRON BHD | 330,600 | 2.640 | 872,784.000 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 232,000 | 8.300 | 1,925,600.000 | |
| | IHH HEALTHCARE BHD | 177,700 | 6.030 | 1,071,531.000 | |
| | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD | 376,100 | 4.920 | 1,850,412.000 | |
| | SIME DARBY PLANTATION BHD | 220,800 | 4.370 | 964,896.000 | |
| | MR DIY GROUP M BHD | 259,200 | 2.040 | 528,768.000 | |
| マレーシア・リンギット　小計 | | 8,918,386 | | 45,500,087.510<br>(1,377,019,198) | |
| メキシコ・ペソ | ALFA SAB DE CV | 338,400 | 13.600 | 4,602,240.000 | |
| | GRUPO BIMBO SAB DE CV | 130,400 | 90.380 | 11,785,552.000 | |
| | GRUMA SAB DE CV | 21,700 | 270.430 | 5,868,331.000 | |
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA | 22,660 | 176.490 | 3,999,263.400 | |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV | 48,500 | 87.520 | 4,244,720.000 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV | 268,700 | 153.420 | 41,223,954.000 | |
| | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 121,125 | 38.430 | 4,654,833.750 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 15,975 | 292.750 | 4,676,681.250 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV | 170,000 | 34.910 | 5,934,700.000 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV | 18,755 | 497.440 | 9,329,487.200 | |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV | 313,552 | 82.870 | 25,984,054.240 | |
| | AMERICA MOVIL SAB DE CV | 2,871,978 | 18.820 | 54,050,625.960 | |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA SA | 219,900 | 35.400 | 7,784,460.000 | |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 44,700 | 161.530 | 7,220,391.000 | |
| | WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | 546,700 | 72.170 | 39,455,339.000 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV | 34,865 | 320.090 | 11,159,937.850 | |
| | OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV | 101,400 | 22.650 | 2,296,710.000 | |
| | BANCO DEL BAJIO SA | 85,300 | 65.970 | 5,627,241.000 | |
| メキシコ・ペソ　小計 | | 5,374,610 | | 249,898,521.650<br>(1,736,469,857) | |
| ユーロ | ALPHA BANK A.E. | 235,597 | 1.140 | 268,580.580 | |
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 62,656 | 3.948 | 247,365.880 | |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 20,850 | 14.600 | 304,410.000 | |
| | FF GROUP | 3,130 | 0.000 | 0.000 | |
| | EUROBANK ERGASIAS SERVICES | 240,441 | 1.142 | 274,583.620 | |
| | MYTILINEOS HOLDINGS | 10,944 | 20.060 | 219,536.640 | |
| | OPAP SA | 21,952 | 13.260 | 291,083.520 | |
| | JUMBO SA | 12,011 | 15.840 | 190,254.240 | |
| | PUBLIC POWER CORP | 21,441 | 7.140 | 153,088.740 | |
| | TERNA ENERGY SA | 6,102 | 20.420 | 124,602.840 | |
| ユーロ　小計 | | 635,124 | | 2,073,506.060<br>(294,956,237) | |
| 韓国・ウォン | SKC CO LTD | 2,357 | 92,700.000 | 218,493,900.000 | |
| | CHEIL WORLDWIDE INC | 8,603 | 22,600.000 | 194,427,800.000 | |
| | HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 3,498 | 79,900.000 | 279,490,200.000 | |
| | SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC | 2,979 | 201,000.000 | 598,779,000.000 | |
| | DB INSURANCE CO LTD | 5,051 | 65,400.000 | 330,335,400.000 | |
| | COWAY CO LTD | 5,833 | 55,100.000 | 321,398,300.000 | |
| | KT&G CORP | 11,192 | 91,700.000 | 1,026,306,400.000 | |
| | S-1 CORPORATION | 1,557 | 59,500.000 | 92,641,500.000 | |
| | CJ CORP | 1,958 | 82,800.000 | 162,122,400.000 | |
| | KAKAO CORP | 32,040 | 60,700.000 | 1,944,828,000.000 | |
| | MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | 31,228 | 6,650.000 | 207,666,200.000 | |
| | NCSOFT CORPORATION | 1,670 | 454,000.000 | 758,180,000.000 | |
| | LG UPLUS CORP | 25,277 | 10,850.000 | 274,255,450.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| DOOSAN ENERBILITY | 44,086 | 16,400.000 | 723,010,400.000 | |
| LG H&H CO LTD | 981 | 743,000.000 | 728,883,000.000 | |
| LG CHEM LTD | 5,096 | 629,000.000 | 3,205,384,000.000 | |
| LG CHEM LTD | 733 | 287,000.000 | 210,371,000.000 | |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | 46,638 | 40,900.000 | 1,907,494,200.000 | |
| HYUNDAI MERCHANT MARINE | 25,738 | 20,050.000 | 516,046,900.000 | |
| S-OIL CORP | 4,649 | 81,600.000 | 379,358,400.000 | |
| HANWHA SOLUTIONS CORPORATION | 12,729 | 43,750.000 | 556,893,750.000 | |
| MERITZ SECURITIES CO LTD | 30,993 | 6,100.000 | 189,057,300.000 | |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 6,276 | 34,200.000 | 214,639,200.000 | |
| POSCO CHEMICAL CO LTD | 3,016 | 188,500.000 | 568,516,000.000 | |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 1,896 | 185,500.000 | 351,708,000.000 | |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 3,641 | 83,600.000 | 304,387,600.000 | |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD | 4,383 | 74,900.000 | 328,286,700.000 | |
| HYUNDAI MOBIS | 6,285 | 217,500.000 | 1,366,987,500.000 | |
| SK HYNIX INC | 56,210 | 86,500.000 | 4,862,165,000.000 | |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | 8,580 | 38,350.000 | 329,043,000.000 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 2,064 | 77,800.000 | 160,579,200.000 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 14,554 | 163,000.000 | 2,372,302,000.000 | |
| HYUNDAI MIPO DOCKYARD | 2,694 | 75,300.000 | 202,858,200.000 | |
| HYUNDAI STEEL CO | 9,701 | 33,350.000 | 323,528,350.000 | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 28,033 | 10,150.000 | 284,534,950.000 | |
| KIA CORPORATION | 27,279 | 63,900.000 | 1,743,128,100.000 | |
| KOREA ZINC CO LTD | 943 | 547,000.000 | 515,821,000.000 | |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP | 24,475 | 19,700.000 | 482,157,500.000 | |
| KOREAN AIR CO LTD | 19,941 | 23,700.000 | 472,601,700.000 | |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD | 2,003 | 140,500.000 | 281,421,500.000 | |
| HLB INC | 12,499 | 30,750.000 | 384,344,250.000 | |
| LG ELECTRONICS INC | 10,636 | 95,100.000 | 1,011,483,600.000 | |
| LG CORP | 9,486 | 78,800.000 | 747,496,800.000 | |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 15,290 | 9,190.000 | 140,515,100.000 | |
| NAVER CORP | 13,545 | 193,000.000 | 2,614,185,000.000 | |
| L&F CO LTD | 2,630 | 181,700.000 | 477,871,000.000 | |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD | 4,934 | 59,200.000 | 292,092,800.000 | |
| KANGWON LAND INC | 9,245 | 23,800.000 | 220,031,000.000 | |
| POSCO HOLDINGS INC | 7,980 | 291,000.000 | 2,322,180,000.000 | |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 16,885 | 24,350.000 | 411,149,750.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SAMSUNG SDI CO LTD | 5,633 | 612,000.000 | 3,447,396,000.000 | |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | 5,494 | 146,500.000 | 804,871,000.000 | |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 495,712 | 60,400.000 | 29,941,004,800.000 | |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD | 68,830 | 5,060.000 | 348,279,800.000 | |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD | 86,098 | 55,000.000 | 4,735,390,000.000 | |
| YUHAN CORP | 6,167 | 55,200.000 | 340,418,400.000 | |
| HANON SYSTEMS | 19,141 | 8,680.000 | 166,143,880.000 | |
| GS HOLDINGS CORP | 4,259 | 43,250.000 | 184,201,750.000 | |
| LG DISPLAY CO LTD | 23,742 | 13,450.000 | 319,329,900.000 | |
| CELLTRION INC | 10,474 | 165,000.000 | 1,728,210,000.000 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 29,840 | 49,400.000 | 1,474,096,000.000 | |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 1,928 | 167,500.000 | 322,940,000.000 | |
| CELLTRION PHARM INC | 1,764 | 64,500.000 | 113,778,000.000 | |
| LOTTE SHOPPING CO | 1,025 | 97,300.000 | 99,732,500.000 | |
| MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD | 3,912 | 47,450.000 | 185,624,400.000 | |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD | 7,704 | 71,100.000 | 547,754,400.000 | |
| AMOREPACIFIC CORP | 3,032 | 140,000.000 | 424,480,000.000 | |
| SK INNOVATION CO LTD | 5,862 | 148,500.000 | 870,507,000.000 | |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 890 | 341,500.000 | 303,935,000.000 | |
| STX PAN OCEAN CO LTD | 31,293 | 5,540.000 | 173,363,220.000 | |
| LG INNOTEK CO LTD | 1,436 | 275,500.000 | 395,618,000.000 | |
| SK INC | 3,619 | 189,500.000 | 685,800,500.000 | |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 39,949 | 57,800.000 | 2,309,052,200.000 | |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD | 7,426 | 44,400.000 | 329,714,400.000 | |
| ILJIN MATERIALS CO LTD | 2,508 | 56,200.000 | 140,949,600.000 | |
| HANMI PHARM CO LTD | 810 | 265,000.000 | 214,650,000.000 | |
| E-MART CO LTD | 1,730 | 100,500.000 | 173,865,000.000 | |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD | 7,697 | 32,150.000 | 247,458,550.000 | |
| HD HYUNDAI CO LTD | 5,382 | 56,500.000 | 304,083,000.000 | |
| BGF RETAIL CO LTD | 715 | 189,500.000 | 135,492,500.000 | |
| ORION CORP REPUBLIC OF KOREA | 2,129 | 122,000.000 | 259,738,000.000 | |
| NETMARBLE CORP | 2,597 | 54,000.000 | 140,238,000.000 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 55,475 | 12,700.000 | 704,532,500.000 | |
| ECOPRO BM CO LTD | 5,510 | 96,500.000 | 531,715,000.000 | |
| SD BIOSENSOR INC | 4,288 | 30,300.000 | 129,926,400.000 | |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 2,949 | 73,800.000 | 217,636,200.000 | |
| KRAFTON INC | 3,153 | 171,500.000 | 540,739,500.000 | |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD | 2,064 | 106,500.000 | 219,816,000.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SK IE TECHNOLOGY CO LTD | 2,720 | 58,500.000 | 159,120,000.000 | |
| | SK SQUARE CO LTD | 10,144 | 35,150.000 | 356,561,600.000 | |
| | SK BIOSCIENCE CO LTD | 2,779 | 77,200.000 | 214,538,800.000 | |
| | KAKAO GAMES CORP | 3,264 | 43,550.000 | 142,147,200.000 | |
| | HYBE CO LTD | 1,920 | 170,500.000 | 327,360,000.000 | |
| | LOTTE CHEMICAL CORP-RTS | 366 | 45,550.000 | 16,671,300.000 | |
| | LG ENERGY SOLUTION | 3,656 | 473,500.000 | 1,731,116,000.000 | |
| | KAKAOBANK CORP | 15,775 | 28,350.000 | 447,221,250.000 | |
| | F&F CO LTD / NEW | 1,875 | 134,000.000 | 251,250,000.000 | |
| | SAMSUNG SDS CO LTD | 3,640 | 124,500.000 | 453,180,000.000 | |
| | SAMSUNG C&T CORP | 8,441 | 117,500.000 | 991,817,500.000 | |
| | SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 1,858 | 799,000.000 | 1,484,542,000.000 | |
| | PEARL ABYSS CORP | 3,427 | 41,800.000 | 143,248,600.000 | |
| | DOOSAN BOBCAT INC | 4,600 | 34,200.000 | 157,320,000.000 | |
| | CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | 9,033 | 57,100.000 | 515,784,300.000 | |
| **韓国・ウォン　小計** | | 1,665,725 | | 100,215,798,250.000<br>(10,662,960,934) | |
| **香港・ドル** | JIANGXI COPPER CO LTD | 131,000 | 12.640 | 1,655,840.000 | |
| | JIANGSU EXPRESS | 144,000 | 7.210 | 1,038,240.000 | |
| | CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD | 206,000 | 5.490 | 1,130,940.000 | |
| | ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD | 12,000 | 135.590 | 1,627,080.000 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD | 123,000 | 29.250 | 3,597,750.000 | |
| | BEIJING ENTERPRISES | 58,000 | 26.600 | 1,542,800.000 | |
| | HUANENG POWER INTERNATIONAL IN | 390,000 | 4.150 | 1,618,500.000 | |
| | ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY | 496,000 | 7.670 | 3,804,320.000 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD | 154,000 | 23.950 | 3,688,300.000 | |
| | HENGAN INTERNATIONAL GROUP | 67,500 | 40.950 | 2,764,125.000 | |
| | CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 897,600 | 8.650 | 7,764,240.000 | |
| | CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME | 384,620 | 22.000 | 8,461,640.000 | |
| | CHINA RESOURCES LAND LTD | 326,888 | 37.850 | 12,372,710.800 | |
| | CITIC LTD | 572,000 | 8.380 | 4,793,360.000 | |
| | BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL | 234,000 | 6.350 | 1,485,900.000 | |
| | LENOVO GROUP LTD | 772,000 | 6.440 | 4,971,680.000 | |
| | PETRO CHINA CO LTD | 2,136,000 | 3.580 | 7,646,880.000 | |
| | CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD | 170,790 | 10.360 | 1,769,384.400 | |
| | SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONIC | 29,000 | 33.900 | 983,100.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR | 2,577,200 | 3.840 | 9,896,448.000 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 106,000 | 17.800 | 1,886,800.000 | |
| KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD | 257,000 | 16.940 | 4,353,580.000 | |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 80,400 | 119.700 | 9,623,880.000 | |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD | 358,000 | 6.090 | 2,180,220.000 | |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 216,000 | 6.420 | 1,386,720.000 | |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 152,200 | 10.960 | 1,668,112.000 | |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD | 162,000 | 11.600 | 1,879,200.000 | |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD | 380,000 | 3.760 | 1,428,800.000 | |
| SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING | 130,500 | 7.810 | 1,019,205.000 | |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 287,800 | 11.940 | 3,436,332.000 | |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD | 73,500 | 27.500 | 2,021,250.000 | |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD | 627,000 | 12.360 | 7,749,720.000 | |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | 88,200 | 34.200 | 3,016,440.000 | |
| BYD CO LTD | 87,000 | 207.200 | 18,026,400.000 | |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD | 200,000 | 9.700 | 1,940,000.000 | |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP | 411,592 | 3.530 | 1,452,919.760 | |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | 300,000 | 7.270 | 2,181,000.000 | |
| ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL | 13,000 | 138.800 | 1,804,400.000 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H | 723,788 | 7.350 | 5,319,841.800 | |
| AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY | 219,000 | 3.690 | 808,110.000 | |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS | 193,200 | 17.100 | 3,303,720.000 | |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD | 314,000 | 10.680 | 3,353,520.000 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 753,000 | 14.240 | 10,722,720.000 | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD | 571,000 | 12.420 | 7,091,820.000 | |
| SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H | 256,000 | 13.020 | 3,333,120.000 | |
| WEICHAI POWER CO LTD | 189,440 | 11.280 | 2,136,883.200 | |
| TINGYI HOLDING CORP | 202,000 | 13.380 | 2,702,760.000 | |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD | 66,000 | 80.200 | 5,293,200.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GUANGDONG INVESTMENTS LTD | 332,000 | 8.730 | 2,898,360.000 | |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD | 316,000 | 3.930 | 1,241,880.000 | |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS | 167,333 | 60.000 | 10,039,980.000 | |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD | 100,000 | 6.450 | 645,000.000 | |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 1,022,250 | 4.770 | 4,876,132.500 | |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 323,000 | 37.400 | 12,080,200.000 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 648,100 | 362.400 | 234,871,440.000 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 659,000 | 56.750 | 37,398,250.000 | |
| LI NING CO LTD | 244,000 | 74.150 | 18,092,600.000 | |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD | 522,000 | 2.070 | 1,080,540.000 | |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 543,000 | 3.670 | 1,992,810.000 | |
| AIR CHINA / HONG KONG | 196,000 | 7.280 | 1,426,880.000 | |
| ZTE CORP | 91,288 | 18.000 | 1,643,184.000 | |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD | 339,000 | 23.250 | 7,881,750.000 | |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD | 354,250 | 7.980 | 2,826,915.000 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS | 906,205 | 4.720 | 4,277,287.600 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD | 216,250 | 8.480 | 1,833,800.000 | |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 85,000 | 17.300 | 1,470,500.000 | |
| BAIDU INC | 229,350 | 130.600 | 29,953,110.000 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK | 9,981,530 | 4.990 | 49,807,834.700 | |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD | 85,600 | 97.200 | 8,320,320.000 | |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 334,000 | 4.600 | 1,536,400.000 | |
| MINTH GROUP LTD | 82,000 | 22.000 | 1,804,000.000 | |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD | 162,000 | 7.740 | 1,253,880.000 | |
| CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL | 370,000 | 7.010 | 2,593,700.000 | |
| BANK OF CHINA LTD | 8,265,200 | 2.900 | 23,969,080.000 | |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD | 84,000 | 12.320 | 1,034,880.000 | |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD | 410,470 | 46.250 | 18,984,237.500 | |
| IND & COMM BK OF CHINA - H | 5,857,235 | 4.140 | 24,248,952.900 | |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD | 137,000 | 9.420 | 1,290,540.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING | 112,500 | 8.730 | 982,125.000 | |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES | 285,600 | 3.060 | 873,936.000 | |
| CHINA COAL ENERGY CO | 209,000 | 6.260 | 1,308,340.000 | |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 74,000 | 22.000 | 1,628,000.000 | |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD | 53,500 | 40.250 | 2,153,375.000 | |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD | 1,280,142 | 2.900 | 3,712,411.800 | |
| CMOC GROUP LIMITED | 393,000 | 3.890 | 1,528,770.000 | |
| CHINA CITIC BANK-H | 987,800 | 3.610 | 3,565,958.000 | |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 72,700 | 95.650 | 6,953,755.000 | |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 125,000 | 108.000 | 13,500,000.000 | |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 35,000 | 24.700 | 864,500.000 | |
| FOSUN INTERNATIONAL | 288,028 | 6.810 | 1,961,470.680 | |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD | 558,000 | 1.830 | 1,021,140.000 | |
| BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 392,000 | 4.300 | 1,685,600.000 | |
| KINGSOFT CORP LTD | 98,800 | 29.550 | 2,919,540.000 | |
| GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD | 2,145,000 | 2.110 | 4,525,950.000 | |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD | 469,000 | 4.180 | 1,960,420.000 | |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD | 152,000 | 7.830 | 1,190,160.000 | |
| DONGYUE GROUP | 159,000 | 9.330 | 1,483,470.000 | |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD | 71,000 | 25.300 | 1,796,300.000 | |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 492,000 | 5.380 | 2,646,960.000 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 282,200 | 18.640 | 5,260,208.000 | |
| CRRC CORP LTD - H | 487,000 | 3.350 | 1,631,450.000 | |
| XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS | 154,500 | 9.390 | 1,450,755.000 | |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD | 143,000 | 13.220 | 1,890,460.000 | |
| SINOPHARM GROUP CO | 140,400 | 19.840 | 2,785,536.000 | |
| CHINA RESOURCES CEMENT | 192,000 | 4.490 | 862,080.000 | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD | 290,527 | 5.640 | 1,638,572.280 | |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 257,500 | 8.160 | 2,101,200.000 | |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP | 344,000 | 11.300 | 3,887,200.000 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD | 61,300 | 13.840 | 848,392.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD | 210,600 | 16.940 | 3,567,564.000 | |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD | 99,000 | 8.250 | 816,750.000 | |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 196,000 | 26.050 | 5,105,800.000 | |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 88,300 | 21.600 | 1,907,280.000 | |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD | 628,156 | 2.820 | 1,771,399.920 | |
| XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | 62,200 | 7.820 | 486,404.000 | |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD | 106,000 | 9.100 | 964,600.000 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD | 227,000 | 2.450 | 556,150.000 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA | 3,054,000 | 2.750 | 8,398,500.000 | |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD | 61,500 | 47.650 | 2,930,475.000 | |
| FAR EAST HORIZON LTD | 188,000 | 6.570 | 1,235,160.000 | |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | 61,200 | 22.050 | 1,349,460.000 | |
| CITIC SECURITIES CO LTD | 219,500 | 17.060 | 3,744,670.000 | |
| HAITONG SECURITIES CO LTD | 343,200 | 5.150 | 1,767,480.000 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD | 836,000 | 2.650 | 2,215,400.000 | |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 46,000 | 26.300 | 1,209,800.000 | |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD | 348,000 | 4.050 | 1,409,400.000 | |
| HANERGY THIN FILM POWER GROUP | 986,000 | 0.000 | 0.000 | |
| CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD | 323,000 | 0.000 | 0.000 | |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD | 176,000 | 5.720 | 1,006,720.000 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD | 834,000 | 5.330 | 4,445,220.000 | |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD | 57,000 | 31.950 | 1,821,150.000 | |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 114,000 | 25.700 | 2,929,800.000 | |
| KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD | 42,500 | 62.350 | 2,649,875.000 | |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD | 228,000 | 20.750 | 4,731,000.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD | 56,100 | 23.350 | 1,309,935.000 | |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD | 88,000 | 15.460 | 1,360,480.000 | |
| CHINA TOWER CORP LTD | 4,292,000 | 0.890 | 3,819,880.000 | |
| XIAOMI CORP | 1,560,400 | 11.980 | 18,693,592.000 | |
| BEIGENE LTD | 63,000 | 150.100 | 9,456,300.000 | |
| WUXI APPTEC CO LTD | 36,912 | 93.200 | 3,440,198.400 | |
| MEITUAN | 526,110 | 178.500 | 93,910,635.000 | |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD | 128,000 | 18.820 | 2,408,960.000 | |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD | 124,000 | 24.050 | 2,982,200.000 | |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 490,000 | 9.800 | 4,802,000.000 | |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 103,000 | 37.600 | 3,872,800.000 | |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD | 997,000 | 1.160 | 1,156,520.000 | |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD | 44,000 | 18.160 | 799,040.000 | |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD | 176,500 | 16.440 | 2,901,660.000 | |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 152,000 | 7.470 | 1,135,440.000 | |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 128,000 | 17.700 | 2,265,600.000 | |
| CHINA FEIHE LTD | 374,000 | 8.250 | 3,085,500.000 | |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 1,538,668 | 109.500 | 168,484,146.000 | |
| PHARMARON BEIJING CO LTD | 19,300 | 58.500 | 1,129,050.000 | |
| HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS LTD | 351,000 | 1.780 | 624,780.000 | |
| JD.COM INC | 223,735 | 250.000 | 55,933,750.000 | |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 184,000 | 14.000 | 2,576,000.000 | |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD | 7,600 | 251.400 | 1,910,640.000 | |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 69,000 | 22.900 | 1,580,100.000 | |
| KUAISHOU TECHNOLOGY | 182,100 | 77.750 | 14,158,275.000 | |
| HAIER SMART HOME CO LTD | 228,400 | 28.900 | 6,600,760.000 | |
| BILIBILI INC | 19,420 | 214.400 | 4,163,648.000 | |
| NETEASE INC | 202,700 | 127.100 | 25,763,170.000 | |
| GDS HOLDINGS LTD | 90,500 | 23.400 | 2,117,700.000 | |
| NONGFU SPRING CO LTD | 177,000 | 44.250 | 7,832,250.000 | |
| LI AUTO INC | 116,000 | 88.550 | 10,271,800.000 | |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 112,850 | 73.300 | 8,271,905.000 | |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD | 38,400 | 59.250 | 2,275,200.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD | 69,200 | 44.200 | 3,058,640.000 | |
| | HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD | 12,600 | 94.900 | 1,195,740.000 | |
| | CHINA VANKE CO LTD-H | 174,661 | 17.000 | 2,969,237.000 | |
| | NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC | 150,400 | 31.400 | 4,722,560.000 | |
| | POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD | 49,600 | 25.300 | 1,254,880.000 | |
| | XPENG INC | 93,600 | 40.650 | 3,804,840.000 | |
| | SUPER HI INTERNATIONAL HOLDING LTD | 12,400 | 13.920 | 172,608.000 | |
| | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 65,000 | 30.200 | 1,963,000.000 | |
| | CGN POWER CO LTD | 1,043,000 | 1.890 | 1,971,270.000 | |
| | GF SECURITIES CO LTD | 106,000 | 11.940 | 1,265,640.000 | |
| | FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD | 61,600 | 35.250 | 2,171,400.000 | |
| | HUATAI SECURITIES CO LTD | 149,400 | 9.470 | 1,414,818.000 | |
| | 3SBIO INC | 146,500 | 8.590 | 1,258,435.000 | |
| | CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 182,500 | 5.850 | 1,067,625.000 | |
| | CHINA LITERATURE LTD | 38,600 | 39.350 | 1,518,910.000 | |
| | FLAT GLASS GROUP CO LTD | 43,000 | 23.050 | 991,150.000 | |
| | DALI FOODS GROUP CO LTD | 261,500 | 3.640 | 951,860.000 | |
| | CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD | 145,000 | 10.460 | 1,516,700.000 | |
| | BOC AVIATION LTD | 23,600 | 65.400 | 1,543,440.000 | |
| | ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD | 61,700 | 26.100 | 1,610,370.000 | |
| | YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 124,000 | 15.620 | 1,936,880.000 | |
| | CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD | 144,000 | 16.340 | 2,352,960.000 | |
| | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 376,500 | 67.400 | 25,376,100.000 | |
| | HENGTEN NETWORKS GROUP LTD | 436,000 | 2.030 | 885,080.000 | |
| | GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD | 37,240 | 61.650 | 2,295,846.000 | |
| | C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD | 70,000 | 23.750 | 1,662,500.000 | |
| 香港・ドル　小計 | | 87,680,228 | | 1,384,772,852.240<br>(23,471,899,847) | |
| 台湾・ドル | ACCTON TECHNOLOGY CORP | 48,906 | 253.000 | 12,373,218.000 | |
| | ACER INC | 257,385 | 24.000 | 6,177,240.000 | |
| | ASUSTEK COMPUTER INC | 76,387 | 269.500 | 20,586,296.500 | |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 46,734 | 323.500 | 15,118,449.000 | |
| | ASIA CEMENT CORP | 236,105 | 41.800 | 9,869,189.000 | |
| | TAIWAN BUSINESS BANK | 665,088 | 13.350 | 8,878,924.800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP | 96,000 | 91.700 | 8,803,200.000 | |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD | 70,000 | 126.500 | 8,855,000.000 | |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | 133,577 | 126.500 | 16,897,490.500 | |
| QUANTA COMPUTER INC | 288,704 | 74.000 | 21,364,096.000 | |
| EVA AIRWAYS CORP | 255,000 | 28.300 | 7,216,500.000 | |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 65,760 | 177.500 | 11,672,400.000 | |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 435,421 | 17.550 | 7,641,638.550 | |
| CHINA AIRLINES | 290,000 | 19.100 | 5,539,000.000 | |
| CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO | 178,169 | 34.850 | 6,209,189.650 | |
| CHINA STEEL CORP | 1,208,550 | 30.850 | 37,283,767.500 | |
| ADVANTECH CO LTD | 46,107 | 346.000 | 15,953,022.000 | |
| COMPAL ELECTRONICS INC | 390,291 | 23.250 | 9,074,265.750 | |
| DELTA ELECTRONICS INC | 198,397 | 283.500 | 56,245,549.500 | |
| NANYA TECHNOLOGY CORP | 134,000 | 56.500 | 7,571,000.000 | |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 396,170 | 115.000 | 45,559,550.000 | |
| AUO CORP | 618,649 | 16.000 | 9,898,384.000 | |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 168,100 | 98.300 | 16,524,230.000 | |
| EVERGREEN MARINE CORP | 108,427 | 155.500 | 16,860,398.500 | |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 301,339 | 32.300 | 9,733,249.700 | |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 44,768 | 210.000 | 9,401,280.000 | |
| ECLAT TEXTILE CO LTD | 19,322 | 487.000 | 9,409,814.000 | |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 58,144 | 347.000 | 20,175,968.000 | |
| FORMOSA PLASTICS CORP | 428,320 | 88.900 | 38,077,648.000 | |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO | 357,733 | 72.500 | 25,935,642.500 | |
| GIANT MANUFACTURING | 31,244 | 201.000 | 6,280,044.000 | |
| MEDIATEK INC | 158,073 | 694.000 | 109,702,662.000 | |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD | 769,272 | 59.200 | 45,540,902.400 | |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 926,468 | 23.500 | 21,771,998.000 | |
| HOTAI MOTOR CO LTD | 31,875 | 637.000 | 20,304,375.000 | |
| FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD | 165,000 | 68.000 | 11,220,000.000 | |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,054,424 | 22.600 | 23,829,982.400 | |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 895,649 | 41.700 | 37,348,563.300 | |
| CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING | 1,644,723 | 13.000 | 21,381,399.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,305,380 | 24.500 | 31,981,810.000 | |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 1,303,150 | 99.400 | 129,533,110.000 | |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,163,734 | 31.750 | 36,948,554.500 | |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 10,527 | 2,180.000 | 22,948,860.000 | |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 1,169,529 | 15.700 | 18,361,605.300 | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO | 1,245,381 | 8.970 | 11,171,067.570 | |
| INVENTEC CO LTD | 270,005 | 26.550 | 7,168,632.750 | |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 191,335 | 66.100 | 12,647,243.500 | |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 1,095,163 | 17.400 | 19,055,836.200 | |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,823,942 | 23.150 | 42,224,257.300 | |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,068,224 | 27.100 | 28,948,870.400 | |
| NAN YA PLASTICS CORP | 494,529 | 74.500 | 36,842,410.500 | |
| POU CHEN CORP | 233,990 | 34.250 | 8,014,157.500 | |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP | 497,113 | 67.100 | 33,356,282.300 | |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 60,771 | 276.000 | 16,772,796.000 | |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 112,706 | 82.600 | 9,309,515.600 | |
| E INK HOLDINGS INC | 83,920 | 173.500 | 14,560,120.000 | |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 174,336 | 43.300 | 7,548,748.800 | |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP | 151,509 | 60.100 | 9,105,690.900 | |
| TAIWAN CEMENT CORP | 656,781 | 34.600 | 22,724,622.600 | |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR | 2,555,294 | 486.000 | 1,241,872,884.000 | |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 1,230,318 | 45.000 | 55,364,310.000 | |
| WAN HAI LINES LTD | 78,747 | 76.500 | 6,024,145.500 | |
| WALSIN LIHWA CORP | 246,163 | 47.200 | 11,618,893.600 | |
| WINBOND ELECTRONICS CORP | 258,059 | 20.900 | 5,393,433.100 | |
| YAGEO CORP | 37,651 | 535.000 | 20,143,285.000 | |
| YANG MING MARINE TRANSPORT | 165,608 | 62.900 | 10,416,743.200 | |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 193,000 | 29.300 | 5,654,900.000 | |
| INNOLUX CORPORATION | 910,742 | 11.750 | 10,701,218.500 | |
| WPG HOLDINGS CO LTD | 165,203 | 48.000 | 7,929,744.000 | |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP | 26,098 | 236.500 | 6,172,177.000 | |
| EMEMORY TECHNOLOGY INC | 6,995 | 1,505.000 | 10,527,475.000 | |
| PEGATRON CORP | 191,880 | 64.500 | 12,376,260.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 14,928 | 982.000 | 14,659,296.000 | |
| | WIN SEMICONDUCTORS CORP | 39,402 | 176.000 | 6,934,752.000 | |
| | CHAILEASE HOLDING CO LTD | 145,886 | 233.000 | 33,991,438.000 | |
| | PARADE TECHNOLOGIES LTD | 8,000 | 957.000 | 7,656,000.000 | |
| | ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD | 72,362 | 108.000 | 7,815,096.000 | |
| | TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING | 1,002,944 | 27.000 | 27,079,488.000 | |
| | SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD | 383,437 | 46.150 | 17,695,617.550 | |
| | VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP | 7,029 | 1,650.000 | 11,597,850.000 | |
| | WIWYNN CORP | 10,133 | 776.000 | 7,863,208.000 | |
| | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | 332,527 | 101.500 | 33,751,490.500 | |
| | SILERGY CORP | 33,108 | 519.000 | 17,183,052.000 | |
| | POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP | 326,209 | 34.000 | 11,091,106.000 | |
| | PHARMAESSENTIA CORP | 20,576 | 457.500 | 9,413,520.000 | |
| | MOMO.COM INC | 6,600 | 737.000 | 4,864,200.000 | |
| | GLOBALWAFERS CO LTD | 23,884 | 470.000 | 11,225,480.000 | |
| | NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 20,508 | 308.000 | 6,316,464.000 | |
| 台湾・ドル　小計 | | 34,923,597 | | 2,944,843,246.220<br>(12,792,104,577) | |
| 南アフリカ・ランド | AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 10,000 | 311.800 | 3,118,000.000 | |
| | BIDVEST GROUP LTD | 27,847 | 220.590 | 6,142,769.730 | |
| | CLICKS GROUP LTD | 24,286 | 282.780 | 6,867,595.080 | |
| | DISCOVERY LTD | 49,120 | 131.940 | 6,480,892.800 | |
| | GOLD FIELDS LTD | 89,222 | 205.500 | 18,335,121.000 | |
| | REMGRO LTD | 54,645 | 135.650 | 7,412,594.250 | |
| | THE FOSCHINI GROUP LTD | 32,991 | 108.000 | 3,563,028.000 | |
| | HARMONY GOLD MINING CO LTD | 60,894 | 67.730 | 4,124,350.620 | |
| | EXXARO RESOURCES LTD | 24,734 | 221.590 | 5,480,807.060 | |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 8,969 | 1,895.930 | 17,004,596.170 | |
| | MTN GROUP LTD | 174,803 | 128.900 | 22,532,106.700 | |
| | ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 44,096 | 371.780 | 16,394,010.880 | |
| | FIRSTRAND LTD | 529,869 | 63.020 | 33,392,344.380 | |
| | NASPERS LTD | 22,668 | 3,236.010 | 73,353,874.680 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 48,729 | 213.650 | 10,410,950.850 | |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 5,841 | 1,473.750 | 8,608,173.750 | |
| | SASOL LTD | 58,516 | 280.030 | 16,386,235.480 | |
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 52,979 | 238.800 | 12,651,385.200 | |
| | MR PRICE GROUP LTD | 26,025 | 168.410 | 4,382,870.250 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 142,458 | 169.780 | 24,186,519.240 | |
| | SPAR GROUP LTD/THE | 21,004 | 128.510 | 2,699,224.040 | |
| | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 99,816 | 69.250 | 6,912,258.000 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD | 38,563 | 139.860 | 5,393,421.180 | |
| | ABSA GROUP LTD | 86,956 | 198.470 | 17,258,157.320 | |
| | SANLAM LTD | 189,923 | 52.340 | 9,940,569.820 | |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 88,373 | 232.430 | 20,540,536.390 | |
| | KUMBA IRON ORE LTD | 7,079 | 539.000 | 3,815,581.000 | |
| | VODACOM GROUP PTY LTD | 69,076 | 123.520 | 8,532,267.520 | |
| | NEPI ROCKCASTLE NV | 51,129 | 105.450 | 5,391,553.050 | |
| | OLD MUTUAL LTD | 479,238 | 11.280 | 5,405,804.640 | |
| | REINET INVESTMENTS SCA | 12,515 | 332.970 | 4,167,119.550 | |
| | PEPKOR HOLDINGS LTD | 166,142 | 20.530 | 3,410,895.260 | |
| | MULTICHOICE GROUP LTD | 34,585 | 120.860 | 4,179,943.100 | |
| | SIBANYE STILLWATER LTD | 280,877 | 51.420 | 14,442,695.340 | |
| | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD | 32,404 | 204.430 | 6,624,349.720 | |
| | BID CORP LTD | 35,633 | 350.730 | 12,497,562.090 | |
| 南アフリカ・ランド　小計 | | 3,182,005 | | 432,040,164.140<br>(3,365,592,879) | |
| 合計 | | 573,310,273 | | 91,379,149,211<br>(91,379,149,211) | |

（２）株式以外の有価証券

2023年1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 | ブラジル・レアル | BANCO BTG PACTUAL SA | 126,200.000 | 2,983,368.000 | |
| | | BANCO SANTANDER BRASIL SA | 38,000.000 | 1,162,800.000 | |
| | | ENERGISA SA | 24,300.000 | 1,008,207.000 | |
| | | KLABIN SA | 78,200.000 | 1,584,332.000 | |
| | ブラジル・レアル　小計 | | 266,700.000 | 6,738,707.000<br>(171,351,842) | |
| | メキシコ・ペソ | CEMEX SAB DE CV | 1,625,775.000 | 13,997,922.750 | |
| | | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 54,600.000 | 7,147,686.000 | |
| | | FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV | 199,700.000 | 30,685,902.000 | |
| | | GRUPO TELEVISA SAB | 246,900.000 | 4,841,709.000 | |
| | メキシコ・ペソ　小計 | | 2,126,975.000 | 56,673,219.750<br>(393,805,202) | |
| 投資信託受益証券　合計 | | | 2,393,675 | 565,157,044<br>(565,157,044) | |
| 投資証券 | メキシコ・ペソ | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 296,300.000 | 7,229,720.000 | |
| | メキシコ・ペソ　小計 | | 296,300.000 | 7,229,720.000<br>(50,237,154) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 南アフリカ・ランド | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 380,859.000 | 5,598,627.300 | |
| | 南アフリカ・ランド　小計 | | 380,859.000 | 5,598,627.300<br>(43,613,307) | |
| 投資証券　合計 | | | 677,159 | 93,850,461<br>(93,850,461) | |
| 合計 | | | | 659,007,505<br>(659,007,505) | |

（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　49銘柄 | 2.90 | － | － | 3.11 |
| アラブ首長国連邦・ディルハム | 株式　11銘柄 | 1.19 | － | － | 1.27 |
| インド・ルピー | 株式　113銘柄 | 12.81 | － | － | 13.74 |
| インドネシア・ルピア | 株式　22銘柄 | 1.60 | － | － | 1.72 |
| オフショア・人民元 | 株式　467銘柄 | 4.84 | － | － | 5.19 |
| カタール・リアル | 株式　12銘柄 | 0.93 | － | － | 1.00 |
| クウェート・ディナール | 株式　7銘柄 | 0.82 | － | － | 0.88 |
| コロンビア・ペソ | 株式　3銘柄 | 0.11 | － | － | 0.12 |
| サウジアラビア・リアル | 株式　40銘柄 | 3.66 | － | － | 3.92 |
| タイ・バーツ | 株式　42銘柄 | 2.05 | － | － | 2.20 |
| チェコ・コルナ | 株式　3銘柄 | 0.14 | － | － | 0.15 |
| チリ・ペソ | 株式　12銘柄 | 0.49 | － | － | 0.52 |
| トルコ・リラ | 株式　15銘柄 | 0.53 | － | － | 0.57 |
| ハンガリー・フォリント | 株式　3銘柄 | 0.17 | － | － | 0.18 |
| フィリピン・ペソ | 株式　17銘柄 | 0.68 | － | － | 0.73 |
| ブラジル・レアル | 株式　46銘柄 | 4.56 | － | － | 5.07 |
| | 投資信託受益証券　4銘柄 | － | 0.17 | － | |
| ポーランド・ズロチ | 株式　14銘柄 | 0.70 | － | － | 0.75 |
| マレーシア・リンギット | 株式　34銘柄 | 1.40 | － | － | 1.50 |
| メキシコ・ペソ | 株式　18銘柄 | 1.76 | － | － | 2.37 |
| | 投資信託受益証券　4銘柄 | － | 0.40 | － | |
| | 投資証券　1銘柄 | － | － | 0.05 | |
| ユーロ | 株式　10銘柄 | 0.30 | － | － | 0.32 |
| 韓国・ウォン | 株式　103銘柄 | 10.80 | － | － | 11.59 |
| 香港・ドル | 株式　193銘柄 | 23.78 | － | － | 25.50 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 台湾・ドル | 株式 | 88銘柄 | 12.96 | － | － | 13.90 |
| 南アフリカ・ランド | 株式 | 36銘柄 | 3.41 | － | － | 3.70 |
| | 投資証券 | 1銘柄 | － | － | 0.04 | |

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

**第２　信用取引契約残高明細表**

該当事項はありません。

**第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表**

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

**エマージング債券パッシブ・マザーファンド**

**貸借対照表**

（単位：円）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 2,127,451,838 |
| コール・ローン | 810,654,563 |
| 国債証券 | 122,130,500,602 |
| 派生商品評価勘定 | 39,891 |
| 未収利息 | 1,343,309,463 |
| 前払費用 | 425,433,351 |
| 流動資産合計 | 126,837,389,708 |
| 資産合計 | 126,837,389,708 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 1,640,780,240 |
| 未払解約金 | 250,000 |
| 流動負債合計 | 1,641,030,240 |
| 負債合計 | 1,641,030,240 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 64,251,853,316 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 60,944,506,152 |
| 元本等合計 | 125,196,359,468 |
| 純資産合計 | 125,196,359,468 |
| 負債純資産合計 | 126,837,389,708 |

**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1月12日<br>至　2023年1月11日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>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<br>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<br>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 | 2023年1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 | 67,295,763,529円 |
| 同期中追加設定元本額 | 153,491,081,451円 |
| 同期中一部解約元本額 | 156,534,991,664円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ＤＩＡＭ新興国債券インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ） | 107,018,143円 |
| たわらノーロード　バランス（８資産均等型） | 2,373,212,341円 |
| たわらノーロード　バランス（堅実型） | 173,454,767円 |
| たわらノーロード　バランス（標準型） | 492,673,649円 |
| たわらノーロード　バランス（積極型） | 207,461,235円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（保守型） | 911,954円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定型） | 5,330,034円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型） | 61,222,562円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（成長型） | 4,316,537円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（積極型） | 6,078,135円 |
| マネックス資産設計ファンド　エボリューション | 57,598,674円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０） | 250,043,672円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０） | 387,327,305円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０） | 706,275,379円 |
| 投資のソムリエ | 20,358,266,706円 |
| クルーズコントロール | 53,995,128円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞ | 1,471,362,128円 |
| ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ | 305,966,961円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型 | 1,609,338,476円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド | 6,987,721,193円 |
| ワールドアセットバランス（基本コース） | 441,610,114円 |
| ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） | 288,731,174円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５） | 61,411,967円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５） | 30,826,286円 |

| | |
|---|---|
| リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ） | 11,066,622円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５） | 236,029,689円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 787,878,174円 |
| ９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 231,359,150円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０） | 79,069,288円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０） | 32,668,247円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０） | 20,411,537円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５） | 4,283,630円 |
| エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定） | 20,904,918,138円 |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定） | 538,630,768円 |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定） | 1,097,273,451円 |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド２（適格機関投資家限定） | 381,680,377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） | 10,734,230円 |
| しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定） | 18,762,551円 |
| エマージング債券パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用） | 7,546,061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） | 156,503,579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） | 70,307,786円 |
| ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定） | 3,220,575,518円 |
| 計 | 64,251,853,316円 |
| ２．　受益権の総数 | 64,251,853,316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1月12日<br>至　2023年1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。<br>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 | 2023年1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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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 | 2023年1月11日現在<br>当期の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|
| 国債証券 | 56,433,719 |
| 合計 | 56,433,719 |

（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4月19日から2023年1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 | 2023年1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 | 1,100,000,000 | － | 1,100,039,891 | 39,891 |
| アメリカ・ドル | 1,100,000,000 | － | 1,100,039,891 | 39,891 |
| 合計 | 1,100,000,000 | － | 1,100,039,891 | 39,891 |

（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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.9485円<br>(19,485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

2023年1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 | ABU DHABI GOVT INT'L 0.75 09/02/23 | 3,000,000.000 | 2,916,390.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28 | 7,000,000.000 | 6,146,700.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31 | 6,000,000.000 | 4,954,056.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31 | 7,000,000.000 | 5,796,301.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 | 9,000,000.000 | 8,624,340.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 | 12,000,000.000 | 11,491,200.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29 | 10,000,000.000 | 8,995,200.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70 | 3,000,000.000 | 1,869,936.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30 | 10,000,000.000 | 9,265,980.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49 | 10,000,000.000 | 7,400,580.000 | |
| | | ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50 | 9,000,000.000 | 7,595,730.000 | |
| | | BRAZIL 2.875 06/06/25 | 9,000,000.000 | 8,566,945.290 | |
| | | BRAZIL 3.75 09/12/31 | 7,000,000.000 | 5,982,250.820 | |
| | | BRAZIL 3.875 06/12/30 | 13,000,000.000 | 11,490,150.490 | |
| | | BRAZIL 4.5 05/30/29 | 8,000,000.000 | 7,536,800.000 | |
| | | BRAZIL 4.75 01/14/50 | 15,000,000.000 | 10,773,561.750 | |
| | | BRAZIL 5.625 01/07/41 | 2,100,000.000 | 1,801,606.210 | |
| | | BRAZIL 6.0 04/07/26 | 4,800,000.000 | 5,001,800.060 | |
| | | CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30 | 2,000,000.000 | 1,663,435.500 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26 | 4,000,000.000 | 3,629,179.440 | |
| | | CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24 | 1,000,000.000 | 956,860.000 | |
| | | COLOMBIA 3.0 01/30/30 | 7,000,000.000 | 5,395,316.430 | |
| | | COLOMBIA 3.125 04/15/31 | 11,000,000.000 | 8,233,436.750 | |
| | | COLOMBIA 3.25 04/22/32 | 9,000,000.000 | 6,563,286.180 | |
| | | COLOMBIA 4.125 05/15/51 | 5,000,000.000 | 3,024,657.550 | |
| | | COLOMBIA 4.5 01/28/26 | 5,000,000.000 | 4,729,851.750 | |
| | | COLOMBIA 4.5 03/15/29 | 9,000,000.000 | 7,820,819.730 | |
| | | COLOMBIA 5.2 05/15/49 | 11,000,000.000 | 7,715,400.000 | |
| | | COLOMBIA 5.625 02/26/44 | 2,000,000.000 | 1,484,544.060 | |
| | | COLOMBIA 8.0 04/20/33 | 6,000,000.000 | 6,046,597.020 | |
| | | DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 | 18,000,000.000 | 16,676,022.060 | |
| | | DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 | 19,000,000.000 | 14,148,725.250 | |
| | | DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 | 26,200,000.000 | 23,871,941.090 | |
| | | HUNGARY 2.125 09/22/31 | 13,000,000.000 | 9,621,066.000 | |
| | | HUNGARY 3.125 09/21/51 | 12,000,000.000 | 7,193,160.000 | |
| | | HUNGARY 5.25 06/16/29 | 8,000,000.000 | 7,618,982.320 | |
| | | HUNGARY 5.375 03/25/24 | 4,380,000.000 | 4,396,092.120 | |
| | | HUNGARY 7.625 03/29/41 | 2,400,000.000 | 2,628,496.800 | |
| | | INDONESIA 1.85 03/12/31 | 3,200,000.000 | 2,585,762.910 | |
| | | INDONESIA 2.85 02/14/30 | 2,000,000.000 | 1,796,899.260 | |
| | | INDONESIA 3.05 03/12/51 | 5,000,000.000 | 3,681,732.000 | |
| | | INDONESIA 3.4 09/18/29 | 2,200,000.000 | 2,014,779.640 | |
| | | INDONESIA 3.5 01/11/28 | 4,200,000.000 | 3,994,476.400 | |
| | | INDONESIA 3.85 10/15/30 | 6,400,000.000 | 6,016,023.160 | |
| | | INDONESIA 4.1 04/24/28 | 3,000,000.000 | 2,946,153.240 | |
| | | INDONESIA 4.125 01/15/25 | 3,200,000.000 | 3,180,924.700 | |
| | | INDONESIA 4.2 10/15/50 | 7,000,000.000 | 5,813,599.750 | |
| | | INDONESIA 4.35 01/08/27 | 4,600,000.000 | 4,558,879.260 | |
| | | INDONESIA 4.35 01/11/48 | 6,600,000.000 | 5,716,448.490 | |
| | | INDONESIA 4.75 01/08/26 | 2,000,000.000 | 2,013,189.080 | |
| | | INDONESIA 5.25 01/17/42 | 1,500,000.000 | 1,457,589.090 | |
| | | INDONESIA 7.75 01/17/38 | 2,500,000.000 | 3,031,311.000 | |
| | | OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28 | 12,000,000.000 | 11,863,200.000 | |
| | | OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 | 11,000,000.000 | 11,083,600.000 | |
| | | OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31 | 11,000,000.000 | 11,120,120.000 | |
| | | OMAN GOV INTERNTL BOND 6.75 01/17/48 | 8,000,000.000 | 7,587,200.000 | |
| | | PANAMA 2.252 09/29/32 | 14,000,000.000 | 10,491,286.540 | |
| | | PANAMA 3.16 01/23/30 | 8,000,000.000 | 6,932,800.000 | |
| | | PANAMA 3.87 07/23/60 | 13,000,000.000 | 8,444,301.320 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | PANAMA 4.5 01/19/63 | 5,000,000.000 | 3,566,668.550 | |
| | | PANAMA 4.5 04/01/56 | 11,000,000.000 | 8,135,324.010 | |
| | | PANAMA 4.5 04/16/50 | 9,300,000.000 | 7,072,456.000 | |
| | | PANAMA 6.4 02/14/35 | 7,000,000.000 | 7,165,248.440 | |
| | | PANAMA 7.125 01/29/26 | 1,000,000.000 | 1,056,661.490 | |
| | | PERU 2.392 01/23/26 | 2,000,000.000 | 1,845,498.760 | |
| | | PERU 2.78 12/01/60 | 8,000,000.000 | 4,689,542.320 | |
| | | PERU 2.783 01/23/31 | 16,000,000.000 | 13,321,492.640 | |
| | | PERU 3.0 01/15/34 | 13,000,000.000 | 10,350,870.530 | |
| | | PERU 3.55 03/10/51 | 9,000,000.000 | 6,459,016.140 | |
| | | PHILIPPINES 1.648 06/10/31 | 3,600,000.000 | 2,865,780.030 | |
| | | PHILIPPINES 2.457 05/05/30 | 3,800,000.000 | 3,292,696.420 | |
| | | PHILIPPINES 2.65 12/10/45 | 7,000,000.000 | 4,699,038.330 | |
| | | PHILIPPINES 3.0 02/01/28 | 9,000,000.000 | 8,365,749.660 | |
| | | PHILIPPINES 3.2 07/06/46 | 7,000,000.000 | 5,090,678.110 | |
| | | PHILIPPINES 3.7 02/02/42 | 2,000,000.000 | 1,625,621.200 | |
| | | PHILIPPINES 3.75 01/14/29 | 7,200,000.000 | 6,876,268.700 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31 | 6,200,000.000 | 5,192,803.110 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32 | 7,200,000.000 | 5,952,947.540 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33 | 8,000,000.000 | 6,326,433.360 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27 | 8,200,000.000 | 7,595,029.740 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61 | 5,000,000.000 | 3,170,366.650 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41 | 11,000,000.000 | 8,024,023.590 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28 | 7,600,000.000 | 7,129,560.000 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50 | 6,000,000.000 | 4,350,880.440 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34 | 6,200,000.000 | 5,338,316.680 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53 | 4,000,000.000 | 2,876,576.280 | |
| | | REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42 | 9,000,000.000 | 7,727,598.540 | |
| | | REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 | 13,000,000.000 | 12,975,151.930 | |
| | | REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55 | 13,000,000.000 | 12,577,200.480 | |
| | | ROMANIA 3.0 02/14/31 | 4,000,000.000 | 3,210,252.000 | |
| | | ROMANIA 4.0 02/14/51 | 10,000,000.000 | 6,706,780.000 | |
| | | ROMANIA 5.125 06/15/48 | 4,600,000.000 | 3,709,440.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | ROMANIA 6.125 01/22/44 | 6,600,000.000 | 6,081,867.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33 | 8,000,000.000 | 6,453,344.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25 | 9,000,000.000 | 8,613,900.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 | 10,200,000.000 | 9,303,664.800 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61 | 4,000,000.000 | 2,846,920.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55 | 6,400,000.000 | 5,010,400.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25 | 13,000,000.000 | 12,857,000.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 | 18,000,000.000 | 17,790,390.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30 | 12,000,000.000 | 11,870,616.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60 | 6,000,000.000 | 5,308,590.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49 | 9,000,000.000 | 8,449,290.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50 | 7,000,000.000 | 6,834,079.000 | |
| | | SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 | 8,000,000.000 | 8,424,800.000 | |
| | | SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 | 12,000,000.000 | 10,982,928.000 | |
| | | SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26 | 2,400,000.000 | 2,349,000.000 | |
| | | SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 | 17,000,000.000 | 13,048,146.000 | |
| | | SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30 | 4,000,000.000 | 3,821,760.000 | |
| | | SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 | 12,000,000.000 | 10,833,600.000 | |
| | | STATE OF QATAR 3.375 03/14/24 | 7,000,000.000 | 6,872,600.000 | |
| | | STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 | 7,000,000.000 | 6,801,900.000 | |
| | | STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 | 12,000,000.000 | 11,604,000.000 | |
| | | STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 | 12,000,000.000 | 11,817,216.000 | |
| | | STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 | 13,000,000.000 | 11,950,900.000 | |
| | | STATE OF QATAR 4.5 04/23/28 | 10,000,000.000 | 10,103,000.000 | |
| | | STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 | 16,000,000.000 | 15,588,800.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | STATE OF QATAR 5.103 04/23/48 | 16,000,000.000 | 16,116,800.000 | |
| | | UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61 | 6,000,000.000 | 4,441,200.000 | |
| | | UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32 | 5,000,000.000 | 4,941,960.000 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 | 9,000,000.000 | 7,387,073.910 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30 | 6,000,000.000 | 5,320,646.220 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34 | 9,000,000.000 | 7,382,757.330 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28 | 5,200,000.000 | 4,955,288.670 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71 | 7,000,000.000 | 4,574,317.930 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61 | 7,000,000.000 | 4,650,620.030 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25 | 2,600,000.000 | 2,578,979.540 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 | 2,400,000.000 | 2,360,848.200 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41 | 10,000,000.000 | 7,955,011.200 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52 | 7,000,000.000 | 5,363,981.840 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50 | 5,000,000.000 | 3,943,115.400 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 | 9,000,000.000 | 8,704,971.270 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 | 2,000,000.000 | 1,614,414.320 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32 | 8,000,000.000 | 7,611,330.240 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33 | 7,000,000.000 | 6,561,707.250 | |
| | | UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51 | 6,000,000.000 | 5,052,425.820 | |
| | アメリカ・ドル　小計 | | 1,064,980,000.000<br>(141,003,352,000) | 922,435,805.150<br>(122,130,500,602) | |
| 国債証券　合計 | | | 141,003,352,000<br>(141,003,352,000) | 122,130,500,602<br>(122,130,500,602) | |
| 合計 | | | | 122,130,500,602<br>(122,130,500,602) | |

（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 136銘柄 | 97.55 | 100.00 |

（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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,606,570,356 |
| 投資証券 | 192,505,859,750 |
| 未収配当金 | 1,446,669,125 |
| 前払金 | 172,213,530 |
| 差入委託証拠金 | 279,271,500 |
| 流動資産合計 | 198,010,584,261 |
| 資産合計 | 198,010,584,261 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 170,133,600 |
| 未払金 | 578,780,165 |
| 未払解約金 | 472,631,000 |
| 流動負債合計 | 1,221,544,765 |
| 負債合計 | 1,221,544,765 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 85,187,544,308 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 111,601,495,188 |
| 元本等合計 | 196,789,039,496 |
| 純資産合計 | 196,789,039,496 |
| 負債純資産合計 | 198,010,584,261 |

**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1月12日<br>至　2023年1月11日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br>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<br>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<br>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 | 2023年1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 | 83,254,722,505円 |
| 同期中追加設定元本額 | 82,347,723,741円 |
| 同期中一部解約元本額 | 80,414,901,938円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型） | 185,528円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型） | 1,165,609円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型） | 3,727,398円 |
| グローバル８資産ラップファンド（安定型） | 2,340,411円 |
| グローバル８資産ラップファンド（中立型） | 1,613,877円 |
| グローバル８資産ラップファンド（積極型） | 2,377,391円 |
| たわらノーロード　国内リート | 5,451,203,249円 |
| たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞ | 1,144,350,754円 |
| たわらノーロード　バランス（８資産均等型） | 2,005,553,931円 |
| たわらノーロード　バランス（堅実型） | 36,480,623円 |
| たわらノーロード　バランス（標準型） | 689,991,569円 |
| たわらノーロード　バランス（積極型） | 756,356,526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） | 148,068,532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） | 395,464,235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） | 237,163,760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） | 299,443,271円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定型） | 2,395,316円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型） | 40,275,413円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（成長型） | 4,438,028円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（積極型） | 11,100,497円 |
| マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞ | 12,188,511円 |
| マネックス資産設計ファンド＜育成型＞ | 442,338,302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） | 192,913,663円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０） | 355,658,204円 |
| 投資のソムリエ | 12,328,088,200円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞ | 890,956,658円 |
| ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ | 154,914,085円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型 | 796,599,142円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド | 3,460,018,291円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５） | 32,047,173円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５） | 16,065,715円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ） | 5,483,172円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５） | 101,950,974円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 157,939,723円 |
| ９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 113,374,981円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０） | 43,369,508円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０） | 17,202,404円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０） | 10,618,723円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５） | 2,227,670円 |
| Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ） | 63,535,821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） | 704,411,388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） | 88,046,327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） | 9,767,562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） | 181,945,946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） | 65,457,891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） | 228,060,645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） | 87,061,891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） | 65,399,918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） | 86,814,018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 |
| ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け） | 3,536,664,731円 |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定） | 329,779,722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） | 51,846,803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） | 94,350,960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） | 6,500,426円 |
| しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定） | 9,276,636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） | 1,156,979,171円 |
| ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉 | 7,807,907,095円 |
| ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型） | 37,034,342,906円 |
| ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型） | 2,659,539,140円 |
| ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ファンドラップ） | 90,460,138円 |
| 計 | 85,187,544,308円 |
| ２．　受益権の総数 | 85,187,544,308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1月12日<br>至　2023年1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。<br>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 | 2023年1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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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 | 2023年1月11日現在<br>当期の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|
| 投資証券 | △13,232,326,470 |
| 合計 | △13,232,326,470 |

（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2023年1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 | 2023年1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<br>　先物取引<br>　　買建 | 4,474,630,530 | － | 4,304,754,000 | △169,876,530 |
| 合計 | 4,474,630,530 | － | 4,304,754,000 | △169,876,530 |

（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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 2.3101円<br>(23,101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**

**2023年1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 | 7,155 | 1,304,356,500 | |
| | ＧＬＰ投資法人 | 59,625 | 8,597,925,000 | |
| | ＮＴＴ都市開発リート投資法人 | 17,758 | 2,400,881,600 | |
| | Ｏｎｅリート投資法人 | 3,222 | 781,979,400 | |
| | ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人 | 9,189 | 1,232,244,900 | |
| | いちごオフィスリート投資法人 | 15,137 | 1,288,158,700 | |
| | いちごホテルリート投資法人 | 3,060 | 332,928,000 | |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 9,753 | 3,930,459,000 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 18,471 | 6,233,962,500 | |
| | アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 8,052 | 1,143,384,000 | |
| | イオンリート投資法人 | 20,449 | 3,075,529,600 | |
| | インヴィンシブル投資法人 | 81,310 | 4,211,858,000 | |
| | エスコンジャパンリート投資法人 | 3,755 | 447,596,000 | |
| | オリックス不動産投資法人 | 36,808 | 6,621,759,200 | |
| | グローバル・ワン不動産投資法人 | 13,594 | 1,455,917,400 | |
| | ケネディクス・オフィス投資法人 | 10,749 | 3,364,437,000 | |
| | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 13,548 | 2,727,212,400 | |
| | ケネディクス商業リート投資法人 | 8,031 | 1,986,869,400 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 8,594 | 2,506,869,800 | |
| | サムティ・レジデンシャル投資法人 | 4,802 | 552,230,000 | |
| | サンケイリアルエステート投資法人 | 5,918 | 520,192,200 | |
| | ザイマックス・リート投資法人 | 2,996 | 351,131,200 | |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 59,574 | 4,652,729,400 | |
| | ジャパンエクセレント投資法人 | 16,947 | 2,211,583,500 | |
| | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 18,474 | 10,696,446,000 | |
| | スターアジア不動産投資法人 | 23,066 | 1,245,564,000 | |
| | スターツプロシード投資法人 | 3,202 | 743,184,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | タカラレーベン不動産投資法人 | 8,091 | 793,727,100 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 4,098 | 542,575,200 | |
| | ヒューリックリート投資法人 | 17,284 | 2,748,156,000 | |
| | フロンティア不動産投資法人 | 6,854 | 3,447,562,000 | |
| | ヘルスケア＆メディカル投資法人 | 4,555 | 814,434,000 | |
| | マリモ地方創生リート投資法人 | 2,307 | 300,140,700 | |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 41,324 | 6,227,526,800 | |
| | ラサールロジポート投資法人 | 22,615 | 3,523,417,000 | |
| | 阪急阪神リート投資法人 | 8,344 | 1,230,740,000 | |
| | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 7,298 | 3,411,815,000 | |
| | 三菱地所物流リート投資法人 | 6,347 | 2,621,311,000 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 27,607 | 4,074,793,200 | |
| | 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 4,334 | 568,187,400 | |
| | 森トラスト総合リート投資法人 | 13,203 | 1,889,349,300 | |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 21,723 | 3,321,446,700 | |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 3,231 | 2,313,396,000 | |
| | 積水ハウス・リート投資法人 | 55,512 | 4,130,092,800 | |
| | 大江戸温泉リート投資法人 | 2,982 | 185,778,600 | |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 27,846 | 7,969,525,200 | |
| | 大和証券オフィス投資法人 | 3,827 | 2,391,875,000 | |
| | 大和証券リビング投資法人 | 25,599 | 2,920,845,900 | |
| | 投資法人みらい | 22,443 | 1,002,079,950 | |
| | 東海道リート投資法人 | 2,240 | 271,936,000 | |
| | 東急リアル・エステート投資法人 | 12,386 | 2,541,607,200 | |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 6,379 | 3,801,884,000 | |
| | 日本ビルファンド投資法人 | 21,551 | 12,478,029,000 | |
| | 日本プライムリアルティ投資法人 | 12,634 | 4,567,191,000 | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 31,139 | 9,279,422,000 | |
| | 日本リート投資法人 | 6,000 | 2,037,000,000 | |
| | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 12,456 | 3,848,904,000 | |
| | 日本都市ファンド投資法人 | 93,209 | 9,628,489,700 | |
| | 福岡リート投資法人 | 9,554 | 1,594,562,600 | |
| | 平和不動産リート投資法人 | 12,625 | 1,900,062,500 | |
| | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 59,740 | 9,510,608,000 | |
| 投資証券　合計 | | 1,100,576 | 192,505,859,750 | |
| 合計 | | | 192,505,859,750 | |

（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）

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 337,210,094 |
| コール・ローン | 83,736,774 |
| 投資信託受益証券 | 6,836,619,284 |
| 投資証券 | 58,832,299,902 |
| 派生商品評価勘定 | 35,452 |
| 未収配当金 | 241,647,845 |
| 流動資産合計 | 66,331,549,351 |
| 資産合計 | 66,331,549,351 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,775 |
| 未払金 | 799,958,085 |
| 未払解約金 | 15,170,000 |
| 流動負債合計 | 815,129,860 |
| 負債合計 | 815,129,860 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 41,342,647,392 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 24,173,772,099 |
| 元本等合計 | 65,516,419,491 |
| 純資産合計 | 65,516,419,491 |
| 負債純資産合計 | 66,331,549,351 |

**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1月12日<br>至　2023年1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<br>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。<br><br>投資証券<br>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<br>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<br>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<br>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 | 2023年1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 | 46,542,419,917円 |
| 同期中追加設定元本額 | 82,189,071,015円 |
| 同期中一部解約元本額 | 87,388,843,540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） | 74,856,900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） | 24,449,599円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型） | 3,099,653円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型） | 19,487,977円 |
| ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型） | 62,551,453円 |
| グローバル８資産ラップファンド（安定型） | 39,100,979円 |
| グローバル８資産ラップファンド（中立型） | 27,070,555円 |
| グローバル８資産ラップファンド（積極型） | 39,566,588円 |
| たわらノーロード　先進国リート | 14,763,810,090円 |
| たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞ | 1,812,024,801円 |
| たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞ | 320,652,518円 |
| たわらノーロード　バランス（８資産均等型） | 2,961,774,991円 |
| たわらノーロード　バランス（堅実型） | 27,055,041円 |

| | |
|---|---|
| たわらノーロード　バランス（標準型） | 512,301,106円 |
| たわらノーロード　バランス（積極型） | 1,035,475,457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） | 222,633,767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） | 237,642,056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） | 405,677,178円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定型） | 598,976円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型） | 30,224,478円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（成長型） | 6,006,832円 |
| たわらノーロード　最適化バランス（積極型） | 22,817,302円 |
| Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド | 1,558,733,524円 |
| マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞ | 14,049,798円 |
| マネックス資産設計ファンド＜育成型＞ | 511,767,802円 |
| マネックス資産設計ファンド　エボリューション | 41,237,895円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０） | 185,757,051円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０） | 288,624,187円 |
| ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０） | 529,206,361円 |
| 投資のソムリエ | 8,434,526,260円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞ | 609,837,865円 |
| ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ | 231,792,328円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型 | 537,024,354円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド | 2,330,232,379円 |
| ワールドアセットバランス（基本コース） | 347,351,219円 |
| ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） | 234,283,572円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５） | 25,934,555円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５） | 13,019,485円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ） | 3,689,293円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５） | 84,888,057円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 239,536,644円 |
| ９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 172,960,853円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０） | 37,554,612円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０） | 13,793,656円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０） | 8,621,171円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５） | 1,803,168円 |
| ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド | 255,573,651円 |
| ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞ | 293,784,187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） | 223,271,265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） | 3,615,759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） | 4,443,460円 |
| しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定） | 6,255,668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） | 77,198,966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） | 193,831,515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） | 1,171,136,561円 |
| 計 | 41,342,647,392円 |
| ２．　受益権の総数 | 41,342,647,392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1月12日<br>至　2023年1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。<br>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 | 2023年1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<br>「（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。<br>(２)デリバティブ取引<br>「（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。<br>(３)上記以外の金融商品<br>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 | 2023年1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 | △101,876,032 |
| 投資証券 | △1,964,153,262 |
| 合計 | △2,066,029,294 |

（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2023年1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 | 2023年1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 | 668,474,342 | － | 668,508,019 | 33,677 |
| アメリカ・ドル | 503,033,360 | － | 503,053,120 | 19,760 |
| イギリス・ポンド | 35,409,990 | － | 35,413,928 | 3,938 |
| オーストラリア・ドル | 47,477,040 | － | 47,482,448 | 5,408 |
| カナダ・ドル | 13,800,640 | － | 13,800,864 | 224 |
| シンガポール・ドル | 25,844,000 | － | 25,848,108 | 4,108 |
| ニュージーランド・ドル | 4,217,700 | － | 4,217,530 | △170 |
| ユーロ | 27,023,757 | － | 27,025,771 | 2,014 |
| 韓国・ウォン | 3,193,200 | － | 3,192,000 | △1,200 |
| 香港・ドル | 8,474,655 | － | 8,474,250 | △405 |
| 合計 | 668,474,342 | － | 668,508,019 | 33,677 |

（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）**

| | 2023年1月11日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.5847円<br>(15,847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**

2023年1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 | 144,600.000 | 81,699.000 | |
| | | EAGLE HOSPITALITY TRUST | 72,700.000 | 0.000 | |
| | | KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 309,900.000 | 148,752.000 | |
| | | MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 645,800.000 | 177,595.000 | |
| | | PRIME US REIT | 238,000.000 | 90,440.000 | |
| | アメリカ・ドル　小計 | | 1,411,000.000 | 498,486.000<br>(65,999,546) | |
| | オーストラリア・ドル | ABACUS PROPERTY GROUP | 162,893.000 | 423,521.800 | |
| | | ARENA REIT | 137,166.000 | 513,000.840 | |
| | | BWP TRUST | 181,749.000 | 707,003.610 | |
| | | CENTURIA CAPITAL GROUP | 277,234.000 | 487,931.840 | |
| | | CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 211,587.000 | 664,383.180 | |
| | | CENTURIA OFFICE REIT | 170,806.000 | 259,625.120 | |
| | | CHARTER HALL GROUP | 183,512.000 | 2,237,011.280 | |
| | | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 254,913.000 | 1,142,010.240 | |
| | | CHARTER HALL RETAIL REIT | 194,587.000 | 737,484.730 | |
| | | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 122,555.000 | 400,754.850 | |
| | | CROMWELL PROPERTY GROUP | 516,778.000 | 346,241.260 | |
| | | DEXUS | 416,200.000 | 3,258,846.000 | |
| | | DEXUS INDUSTRIA REIT | 78,918.000 | 227,283.840 | |
| | | GDI PROPERTY GROUP | 210,436.000 | 157,827.000 | |
| | | GOODMAN GROUP | 662,814.000 | 11,824,601.760 | |
| | | GPT GROUP | 741,360.000 | 3,180,434.400 | |
| | | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 107,003.000 | 328,499.210 | |
| | | HEALTHCO REIT | 92,113.000 | 162,579.440 | |
| | | HMC CAPITAL LTD | 75,942.000 | 331,107.120 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | HOMECO DAILY NEEDS REIT | 584,130.000 | 741,845.100 | |
| | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 73,699.000 | 261,631.450 | |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 145,143.000 | 654,594.930 | |
| | MIRVAC GROUP | 1,526,781.000 | 3,313,114.770 | |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 423,078.000 | 964,617.840 | |
| | RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND | 140,343.000 | 105,257.250 | |
| | REGION RE LTD | 442,491.000 | 1,146,051.690 | |
| | RURAL FUNDS GROUP | 141,590.000 | 335,568.300 | |
| | SCENTRE GROUP | 2,003,467.000 | 5,769,984.960 | |
| | STOCKLAND | 923,539.000 | 3,380,152.740 | |
| | VICINITY CENTRES | 1,497,919.000 | 2,965,879.620 | |
| | WAYPOINT REIT LTD | 281,772.000 | 766,419.840 | |
| **オーストラリア・ドル　小計** | | 12,982,518.000 | 47,795,266.010<br>(4,365,141,644) | |
| **シンガポール・ドル** | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 201,395.000 | 249,729.800 | |
| | CAPITALAND ASCOTT TRUST | 812,816.000 | 845,328.640 | |
| | CAPITALAND CHINA TRUST | 454,580.000 | 531,858.600 | |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 1,945,509.000 | 3,891,018.000 | |
| | CAPLAND ASCENDAS REIT | 1,299,160.000 | 3,546,706.800 | |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 307,200.000 | 384,000.000 | |
| | DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST | 224,800.000 | 146,120.000 | |
| | EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 112,400.000 | 50,018.000 | |
| | ESR LOGOS REIT | 2,103,640.000 | 788,865.000 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 393,900.000 | 248,157.000 | |
| | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 389,500.000 | 101,270.000 | |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 423,000.000 | 867,150.000 | |
| | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 1,127,964.000 | 1,297,158.600 | |
| | KEPPEL DC REIT | 511,500.000 | 941,160.000 | |
| | KEPPEL REIT | 780,800.000 | 698,816.000 | |
| | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 744,500.000 | 498,815.000 | |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 777,320.000 | 1,748,970.000 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,250,220.000 | 2,037,858.600 | |
| | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL | 896,200.000 | 1,541,464.000 | |
| | OUE COMMERCIAL REIT | 910,555.000 | 314,141.470 | |
| | PARAGON REIT | 394,200.000 | 356,751.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | PARKWAY LIFE REIT | 153,300.000 | 574,875.000 | |
| | | SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 207,400.000 | 160,735.000 | |
| | | STARHILL GLOBAL REIT | 553,000.000 | 301,385.000 | |
| | | SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 874,890.000 | 1,172,352.600 | |
| | シンガポール・ドル　小計 | | 17,849,749.000 | 23,294,704.110<br>(2,316,425,377) | |
| | ユーロ | CROMWELL REIT EUR | 133,740.000 | 197,935.200 | |
| | ユーロ　小計 | | 133,740.000 | 197,935.200<br>(28,156,282) | |
| | 香港・ドル | FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 573,000.000 | 3,592,710.000 | |
| | 香港・ドル　小計 | | 573,000.000 | 3,592,710.000<br>(60,896,435) | |
| 投資信託受益証券　合計 | | | 32,950,007 | 6,836,619,284<br>(6,836,619,284) | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ACADIA REALTY TRUST | 35,926.000 | 502,245.480 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 34,792.000 | 2,482,757.120 | |
| | | ALEXANDER & BALDWIN INC | 28,607.000 | 540,958.370 | |
| | | ALEXANDER'S INC. | 801.000 | 179,215.740 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 58,447.000 | 8,630,284.020 | |
| | | ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC | 4,698.000 | 90,530.460 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 20,483.000 | 545,462.290 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT | 120,371.000 | 3,724,278.740 | |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST | 105,726.000 | 3,113,630.700 | |
| | | APARTMENT INCOME REIT CORP | 58,046.000 | 2,025,805.400 | |
| | | APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 60,135.000 | 442,593.600 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 82,638.000 | 1,323,034.380 | |
| | | ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 25,069.000 | 290,299.020 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 11,922.000 | 58,894.680 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 54,756.000 | 8,924,680.440 | |
| | | BLUEROCK HOMES TRUST INC | 1,188.000 | 25,827.120 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 55,944.000 | 3,770,066.160 | |
| | | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 20,173.000 | 91,383.690 | |
| | | BRANDYWINE REALTY TRUST | 65,995.000 | 403,889.400 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 117,776.000 | 2,549,850.400 | |
| | | BROADSTONE NET LEASE INC | 67,356.000 | 1,167,953.040 | |
| | | BRT APARTMENTS CORP | 4,220.000 | 82,247.800 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 41,747.000 | 4,733,692.330 | |
| | | CARETRUST REIT INC | 38,168.000 | 717,176.720 | |
| | | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC | 9,033.000 | 209,475.270 | |
| | | CENTERSPACE | 5,508.000 | 327,285.360 | |
| | | CHATHAM LODGING TRUST | 19,111.000 | 232,580.870 | |
| | | CITY OFFICE REIT INC | 15,657.000 | 128,230.830 | |
| | | CLIPPER REALTY INC | 5,086.000 | 35,652.860 | |
| | | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 8,646.000 | 325,867.740 | |
| | | CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 43,815.000 | 1,139,628.150 | |
| | | COUSINS PROPERTIES INC | 58,757.000 | 1,430,732.950 | |
| | | CTO REALTY GROUTH INC | 6,628.000 | 122,750.560 | |
| | | CUBESMART | 88,085.000 | 3,529,565.950 | |
| | | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 82,077.000 | 666,465.240 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 112,502.000 | 11,511,204.640 | |
| | | DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 80,900.000 | 67,632.400 | |
| | | DOUGLAS EMMETT INC | 68,568.000 | 1,041,547.920 | |
| | | EAST GROUP | 17,114.000 | 2,574,459.020 | |
| | | EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 34,578.000 | 519,015.780 | |
| | | ELME COMMUNITIES | 34,355.000 | 620,107.750 | |
| | | EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 50,759.000 | 351,252.280 | |
| | | EPR PROPERTIES | 29,194.000 | 1,092,731.420 | |
| | | EQUINIX INC | 36,187.000 | 25,155,393.050 | |
| | | EQUITY COMMONWEALTH | 42,581.000 | 1,076,873.490 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 68,568.000 | 4,490,518.320 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 133,152.000 | 7,822,680.000 | |
| | | ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 55,312.000 | 1,277,707.200 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 25,368.000 | 5,430,274.080 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 52,428.000 | 7,679,653.440 | |
| | | FARMLAND PARTNERS INC | 17,744.000 | 222,864.640 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 28,688.000 | 2,921,299.040 | |
| | | FIRST INDUSTRIAL RT | 51,900.000 | 2,525,454.000 | |
| | | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 32,805.000 | 895,904.550 | |
| | | FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 33,176.000 | 92,892.800 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 100,896.000 | 5,159,821.440 | |
| | | GETTY REALTY CORP | 16,720.000 | 575,836.800 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 14,534.000 | 282,540.960 | |
| | | GLADSTONE LAND CORP | 11,727.000 | 221,640.300 | |
| | | GLOBAL MEDICAL REIT INC | 22,924.000 | 222,821.280 | |
| | | GLOBAL NET LEASE INC | 41,493.000 | 558,910.710 | |
| | | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 149,347.000 | 3,063,106.970 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 210,573.000 | 5,506,483.950 | |
| | | HERSHA HOSPITALITY TRUST | 13,525.000 | 111,310.750 | |
| | | HIGHWOODS PROPERTIES INC | 40,908.000 | 1,157,696.400 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 280,240.000 | 4,609,948.000 | |
| | | HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 50,905.000 | 490,724.200 | |
| | | INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 86,856.000 | 1,450,495.200 | |
| | | INDUS REALTY TRUST INC | 2,126.000 | 134,341.940 | |
| | | INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 26,881.000 | 107,255.190 | |
| | | INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 10,909.000 | 1,120,136.120 | |
| | | INVENTRUST PROPERTIES CORP | 26,466.000 | 618,510.420 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 227,441.000 | 6,780,016.210 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 113,873.000 | 5,711,869.680 | |
| | | ISTAR INC | 31,134.000 | 252,185.400 | |
| | | JBG SMITH PROPERTIES | 38,727.000 | 747,043.830 | |
| | | KILROY REALTY CORP | 40,791.000 | 1,541,899.800 | |
| | | KIMCO REALTY | 242,318.000 | 4,938,440.840 | |
| | | KITE REALTY GROUP TRUST | 84,873.000 | 1,698,308.730 | |
| | | LIFE STORAGE INC | 33,347.000 | 3,268,339.470 | |
| | | LTC PROPERTIES INC | 15,922.000 | 569,370.720 | |
| | | LXP INDUSTRIAL TRUST | 107,271.000 | 1,142,436.150 | |
| | | MEDICAL PROPERTIES TRUST | 234,736.000 | 2,931,852.640 | |
| | | MID AMERICA | 45,215.000 | 6,995,664.800 | |
| | | NATIONAL HEALTH INVS INC | 16,958.000 | 886,564.240 | |
| | | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 70,126.000 | 3,223,692.220 | |
| | | NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 32,859.000 | 1,184,895.540 | |
| | | NETSTREIT CORP | 20,589.000 | 383,778.960 | |
| | | NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST | 11,872.000 | 132,610.240 | |
| | | NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 8,811.000 | 361,955.880 | |
| | | OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 17,765.000 | 279,443.450 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 91,971.000 | 2,478,618.450 | |
| | | ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 5,609.000 | 129,231.360 | |
| | | ORION OFFICE REIT INC | 21,073.000 | 178,277.580 | |
| | | PARAMOUNT GROUP INC | 65,642.000 | 370,877.300 | |
| | | PARK HOTELS & RESORTS INC | 87,740.000 | 1,057,267.000 | |
| | | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 51,524.000 | 703,302.600 | |
| | | PHILLIPS EDISON & CO INC | 45,439.000 | 1,441,779.470 | |
| | | PHYSICIANS REALTY TRUST | 88,668.000 | 1,330,906.680 | |
| | | PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 47,250.000 | 438,007.500 | |
| | | PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 15,621.000 | 306,796.440 | |
| | | POSTAL REALTY TRUST INC | 7,309.000 | 107,661.570 | |
| | | PROLOGIS INC | 360,896.000 | 41,881,980.800 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 61,828.000 | 17,384,797.040 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 245,318.000 | 15,734,696.520 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 60,395.000 | 3,746,301.850 | |
| | | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 48,965.000 | 716,357.950 | |
| | | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 71,941.000 | 4,019,343.670 | |
| | | RLJ LODGING TRUST | 63,507.000 | 686,510.670 | |
| | | RPT REALTY | 31,140.000 | 293,027.400 | |
| | | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 21,377.000 | 1,754,624.160 | |
| | | SABRA HEALTH CARE REIT INC | 89,832.000 | 1,137,273.120 | |
| | | SAFEHOLD INC | 8,894.000 | 270,021.840 | |
| | | SAUL CENTERS INC | 4,804.000 | 189,854.080 | |
| | | SERVICE PROPERTIES TRUST | 62,996.000 | 489,478.920 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 127,893.000 | 14,944,297.050 | |
| | | SITE CENTERS CORP | 72,024.000 | 908,942.880 | |
| | | SL GREEN | 25,224.000 | 894,443.040 | |
| | | SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 54,044.000 | 2,180,675.400 | |
| | | STAG INDUSTRIAL INC | 69,838.000 | 2,316,526.460 | |
| | | STORE CAPITAL CORP | 104,247.000 | 3,347,371.170 | |
| | | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 38,921.000 | 288,015.400 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 48,509.000 | 6,973,168.750 | |
| | | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 82,660.000 | 790,229.600 | |
| | | TANGER FACTORY OUTLET | 41,032.000 | 726,676.720 | |
| | | TERRENO REALTY CORP | 25,970.000 | 1,511,973.400 | |
| | | THE MACERICH COMPANY | 83,863.000 | 959,392.720 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | THE NECESSITY RETAIL REIT INC | 51,710.000 | 326,290.100 | |
| | UDR INC | 119,929.000 | 4,628,060.110 | |
| | UMH PROPERTIES INC | 20,807.000 | 340,610.590 | |
| | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 4,699.000 | 231,660.700 | |
| | URBAN EDGE PROPERTIES | 46,764.000 | 662,645.880 | |
| | URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 11,191.000 | 199,199.800 | |
| | VENTAS INC | 156,492.000 | 7,478,752.680 | |
| | VERIS RESIDENTIAL INC | 31,286.000 | 515,906.140 | |
| | VICI PROPERTIES INC | 376,820.000 | 12,201,431.600 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 62,559.000 | 1,365,037.380 | |
| | WELLTOWER INC | 184,867.000 | 12,753,974.330 | |
| | WHITESTONE REIT | 16,382.000 | 160,543.600 | |
| | WP CAREY INC | 81,464.000 | 6,546,447.040 | |
| | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 44,849.000 | 574,067.200 | |
| アメリカ・ドル　小計 | | 8,608,707.000 | 381,029,741.840<br>(50,448,337,820) | |
| イギリス・ポンド | ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI | 162,134.000 | 103,441.490 | |
| | AEW UK REIT PLC | 58,660.000 | 59,715.880 | |
| | ASSURA PLC | 1,162,717.000 | 644,145.210 | |
| | BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 307,797.000 | 265,628.810 | |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 68,187.000 | 780,741.150 | |
| | BRITISH LAND CO PLC | 369,097.000 | 1,514,035.890 | |
| | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC | 336,778.000 | 355,974.340 | |
| | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 232,446.000 | 141,559.610 | |
| | CLS HOLDINGS PLC | 66,862.000 | 100,560.440 | |
| | CUSTODIAN REIT PLC | 166,617.000 | 149,622.060 | |
| | DERWENT LONDON PLC | 43,623.000 | 1,053,931.680 | |
| | EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC | 74,836.000 | 46,997.000 | |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 221,510.000 | 195,371.820 | |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 99,629.000 | 523,052.250 | |
| | HAMMERSON PLC | 1,603,383.000 | 402,449.130 | |
| | HOME REIT PLC | 286,621.000 | 108,915.980 | |
| | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 160,660.000 | 165,801.120 | |
| | INTU PROPERTIES PLC | 231,040.000 | 0.000 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 295,183.000 | 1,967,689.870 | |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 385,555.000 | 685,516.790 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | LXI REIT PLC | 669,863.000 | 771,682.170 | |
| | | NEWRIVER REIT PLC | 124,025.000 | 103,064.770 | |
| | | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 213,675.000 | 166,666.500 | |
| | | PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 523,160.000 | 593,263.440 | |
| | | PRS REIT PLC/THE | 206,206.000 | 171,769.590 | |
| | | REGIONAL REIT LTD | 168,230.000 | 101,779.150 | |
| | | SAFESTORE HOLDINGS LTD | 82,584.000 | 777,528.360 | |
| | | SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD | 206,528.000 | 90,872.320 | |
| | | SEGRO PLC | 473,952.000 | 3,748,960.320 | |
| | | SHAFTESBURY PLC | 113,640.000 | 405,694.800 | |
| | | SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 487,963.000 | 484,059.290 | |
| | | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC | 153,569.000 | 91,834.260 | |
| | | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 726,105.000 | 1,042,686.780 | |
| | | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | 316,742.000 | 178,325.740 | |
| | | UNITE GROUP PLC | 157,519.000 | 1,459,413.530 | |
| | | URBAN LOGISTICS REIT PLC | 191,976.000 | 253,408.320 | |
| | | WAREHOUSE REIT PLC | 156,027.000 | 163,204.240 | |
| | | WORKSPACE GROUP PLC | 56,124.000 | 261,537.840 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | | 11,361,223.000 | 20,130,901.940<br>(3,240,873,903) | |
| イスラエル・シュケル | | MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 237,208.000 | 409,658.210 | |
| | | REIT 1 LTD | 76,692.000 | 1,349,779.200 | |
| | | SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD | 84,874.000 | 713,281.090 | |
| イスラエル・シュケル　小計 | | | 398,774.000 | 2,472,718.500<br>(94,500,625) | |
| カナダ・ドル | | ALLIED PROPERTIES REIT | 24,754.000 | 693,112.000 | |
| | | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 23,627.000 | 221,148.720 | |
| | | AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 8,337.000 | 102,461.730 | |
| | | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 9,095.000 | 452,658.150 | |
| | | BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7,285.000 | 127,560.350 | |
| | | BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 15,423.000 | 58,607.400 | |
| | | CANADIAN APT PPTYS REIT | 32,471.000 | 1,464,766.810 | |
| | | CHOICE PROPERTIES REIT | 62,701.000 | 943,650.050 | |
| | | CROMBIE REAL ESTATE INV | 18,845.000 | 303,592.950 | |
| | | CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 19,186.000 | 307,359.720 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | DREAM INDUSTRIAL REIT | 47,425.000 | 584,276.000 | |
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | 9,013.000 | 146,641.510 | |
| | EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 17,876.000 | 56,488.160 | |
| | FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 41,257.000 | 716,221.520 | |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 12,246.000 | 871,057.980 | |
| | H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 51,480.000 | 634,748.400 | |
| | INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 4,643.000 | 19,639.890 | |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 28,263.000 | 384,942.060 | |
| | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 23,270.000 | 390,703.300 | |
| | MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 8,096.000 | 119,416.000 | |
| | MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 6,458.000 | 110,754.700 | |
| | NEXUS INDUSTRIAL REIT | 12,304.000 | 121,194.400 | |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 46,773.000 | 459,310.860 | |
| | PRIMARIS REIT | 18,329.000 | 272,552.230 | |
| | PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 10,243.000 | 63,404.170 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 57,982.000 | 1,260,528.680 | |
| | SLATE GROCERY REIT | 11,204.000 | 174,446.280 | |
| | SLATE OFFICE REIT | 17,818.000 | 78,933.740 | |
| | SMARTCENTRES REIT | 27,873.000 | 764,835.120 | |
| | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 35,650.000 | 809,255.000 | |
| | TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 14,758.000 | 88,990.740 | |
| カナダ・ドル　小計 | | 724,685.000 | 12,803,258.620<br>(1,262,273,267) | |
| ニュージーランド・ドル | ARGOSY PROPERTY LTD | 329,282.000 | 386,906.350 | |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 400,978.000 | 822,004.900 | |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 625,672.000 | 581,874.960 | |
| | PRECINCT PROPERTIES | 504,991.000 | 641,338.570 | |
| | STRIDE STAPLED GROUP | 200,290.000 | 286,414.700 | |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 190,316.000 | 432,017.320 | |
| ニュージーランド・ドル　小計 | | 2,251,529.000 | 3,150,556.800<br>(265,812,477) | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ユーロ | AEDIFICA | 15,481.000 | 1,219,902.800 | |
| | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 3,939.000 | 31,315.050 | |
| | ALTAREA | 1,720.000 | 220,160.000 | |
| | CARE PROPERTY INVEST NV | 10,525.000 | 168,400.000 | |
| | CARMILA SA | 21,980.000 | 302,884.400 | |
| | COFINIMMO SA | 11,672.000 | 1,031,804.800 | |
| | COVIVIO | 18,058.000 | 1,055,490.100 | |
| | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 16,907.000 | 397,990.780 | |
| | GECINA SA | 21,362.000 | 2,149,017.200 | |
| | HAMBORNER REIT AG | 25,669.000 | 178,142.860 | |
| | ICADE | 12,223.000 | 531,700.500 | |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 19,492.000 | 63,641.380 | |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 117,417.000 | 736,204.590 | |
| | INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 9,928.000 | 198,560.000 | |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC | 155,162.000 | 173,160.790 | |
| | KLEPIERRE | 76,589.000 | 1,684,958.000 | |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 22,349.000 | 95,877.210 | |
| | MERCIALYS | 30,882.000 | 312,525.840 | |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 129,615.000 | 1,157,461.950 | |
| | MONTEA SCA | 4,768.000 | 325,654.400 | |
| | NSI NV | 6,797.000 | 161,088.900 | |
| | RETAIL ESTATES | 4,371.000 | 271,876.200 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 41,974.000 | 2,219,585.120 | |
| | VASTNED RETAIL | 6,847.000 | 142,417.600 | |
| | WAREHOUSES DE PAUW | 61,002.000 | 1,709,276.040 | |
| | WERELDHAVE NV | 16,132.000 | 219,395.200 | |
| | XIOR STUDENT HOUSING NV | 8,862.000 | 254,339.400 | |
| ユーロ　小計 | | 871,723.000 | 17,012,831.110<br>(2,420,075,225) | |
| 韓国・ウォン | D&D PLATFORM REIT CO LTD | 16,294.000 | 58,902,810.000 | |
| | E KOCREF CR-REIT CO LTD | 11,135.000 | 58,904,150.000 | |
| | ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | 60,102.000 | 242,812,080.000 | |
| | IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 11,032.000 | 54,718,720.000 | |
| | JR REIT XXVII | 55,330.000 | 243,175,350.000 | |
| | KORAMCO ENERGY PLUS REIT | 14,110.000 | 76,194,000.000 | |
| | LOTTE REIT CO LTD | 46,445.000 | 187,405,575.000 | |
| | MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT | 39,605.000 | 161,984,450.000 | |
| | NH ALL-ONE REIT CO LTD | 20,887.000 | 74,671,025.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 23,249.000 | 161,580,550.000 | |
| | | SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD | 9,851.000 | 39,009,960.000 | |
| | | SK REITS CO LTD | 29,445.000 | 162,536,400.000 | |
| | 韓国・ウォン　小計 | | 337,485.000 | 1,521,895,070.000<br>(161,929,635) | |
| | 香港・ドル | CHAMPION REIT | 696,070.000 | 2,213,502.600 | |
| | | LINK REIT | 815,620.000 | 48,896,419.000 | |
| | | PROSPERITY REIT | 475,000.000 | 978,500.000 | |
| | | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 385,000.000 | 1,282,050.000 | |
| | | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 892,000.000 | 1,998,080.000 | |
| | 香港・ドル　小計 | | 3,263,690.000 | 55,368,551.600<br>(938,496,950) | |
| 投資証券　合計 | | | 27,817,816 | 58,832,299,902<br>(58,832,299,902) | |
| 合計 | | | | 65,668,919,186<br>(65,668,919,186) | |

（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<br>投資信託受益証券<br>時価比率<br>(%) | 組入<br>投資証券<br>時価比率<br>(%) | 有価証券の合計金額に対する比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資信託受益証券　5銘柄<br>投資証券　141銘柄 | 0.10<br>－ | －<br>77.00 | 76.92 |
| イギリス・ポンド | 投資証券　38銘柄 | － | 4.95 | 4.94 |
| イスラエル・シュケル | 投資証券　3銘柄 | － | 0.14 | 0.14 |
| オーストラリア・ドル | 投資信託受益証券　31銘柄 | 6.66 | － | 6.65 |
| カナダ・ドル | 投資証券　31銘柄 | － | 1.93 | 1.92 |
| シンガポール・ドル | 投資信託受益証券　25銘柄 | 3.54 | － | 3.53 |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券　6銘柄 | － | 0.41 | 0.40 |
| ユーロ | 投資信託受益証券　1銘柄<br>投資証券　27銘柄 | 0.04<br>－ | －<br>3.69 | 3.73 |
| 韓国・ウォン | 投資証券　12銘柄 | － | 0.25 | 0.25 |
| 香港・ドル | 投資信託受益証券　1銘柄<br>投資証券　5銘柄 | 0.09<br>－ | －<br>1.43 | 1.52 |

（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】

2023年1月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 12,160,790,649円 |
| Ⅱ　負債総額 | 21,273,097円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 12,139,517,552円 |
| Ⅳ　発行済数量 | 8,978,278,123口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.3521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

2023年1月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 393,671,022,265円 |
| Ⅱ　負債総額 | 9,089,626,373円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 384,581,395,892円 |
| Ⅳ　発行済数量 | 114,413,471,080口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 3.3613円 |

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 403,120,588,516円 |
| Ⅱ　負債総額 | 895,818,000円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 402,224,770,516円 |
| Ⅳ　発行済数量 | 325,931,703,612口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.2341円 |

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 822,406,574,455円 |
| Ⅱ　負債総額 | 82,299,750円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 822,324,274,705円 |
| Ⅳ　発行済数量 | 137,257,450,597口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 5.9911円 |

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 190,822,665,837円 |
| Ⅱ　負債総額 | 3,681,438,896円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 187,141,226,941円 |
| Ⅳ　発行済数量 | 93,486,904,382口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.0018円 |

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年1月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 101,634,115,011円 |
| Ⅱ　負債総額 | 15,360,587円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 101,618,754,424円 |
| Ⅳ　発行済数量 | 71,134,790,439口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.4285円 |

**エマージング債券パッシブ・マザーファンド**

**2023年1月31日現在**

| | |
|---|---|
| **Ⅰ　資産総額** | **140,703,948,426円** |
| **Ⅱ　負債総額** | **7,152,170,914円** |
| **Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）** | **133,551,777,512円** |
| **Ⅳ　発行済数量** | **68,033,401,700口** |
| **Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）** | **1.9630円** |

**Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド**

**2023年1月31日現在**

| | |
|---|---|
| **Ⅰ　資産総額** | **197,552,982,976円** |
| **Ⅱ　負債総額** | **1,769,159,390円** |
| **Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）** | **195,783,823,586円** |
| **Ⅳ　発行済数量** | **86,012,553,753口** |
| **Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）** | **2.2762円** |

**外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド**

**2023年1月31日現在**

| | |
|---|---|
| **Ⅰ　資産総額** | **72,913,793,053円** |
| **Ⅱ　負債総額** | **1,313,319,447円** |
| **Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）** | **71,600,473,606円** |
| **Ⅳ　発行済数量** | **42,834,243,528口** |
| **Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）** | **1.6716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（2023年1月31日現在）

| | |
|---|---|
| 資本金の額 | 20億円 |
| 発行する株式総数※ | 100,000株<br>（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<br>（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（2023年1月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

| 基本的性格 | 本数 | 純資産総額（単位：円） |
|---|---|---|
| 追加型公社債投資信託 | 26 | 1,454,101,154,791 |
| 追加型株式投資信託 | 799 | 14,530,011,226,224 |
| 単位型公社債投資信託 | 24 | 46,366,500,374 |
| 単位型株式投資信託 | 215 | 1,136,549,215,059 |
| 合計 | 1,064 | 17,167,028,096,448 |

## 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<br>（2021年3月31日現在） | | 第37期<br>（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<br>（2021年3月31日現在） | 第37期<br>（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<br>（自　2020年4月1日<br>至　2021年3月31日） | | 第37期<br>（自　2021年4月1日<br>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<br>（自　2020年4月1日<br>至　2021年3月31日） | | 第37期<br>（自　2021年4月1日<br>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<br>移動平均法による原価法<br>(2) その他有価証券<br>市場価格のない株式等以外のもの<br>決算日の市場価格等に基づく時価法<br>（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）<br>市場価格のない株式等<br>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<br>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。<br>なお、主な耐用年数は次のとおりであります。<br>建物　…　8～18年<br>器具備品　…　2～20年<br>(2) 無形固定資産<br>定額法を採用しております。<br>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<br>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。<br>(2) 役員賞与引当金<br>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。<br>(3) 退職給付引当金<br>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。<br>①退職給付見込額の期間帰属方法<br>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。<br>②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br>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。<br>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。<br>(4) 時効後支払損引当金<br>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。**<br>**(1) 委託者報酬**<br>**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。**<br>**(2) 運用受託報酬**<br>**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。**<br>**(3) 投資助言報酬**<br>**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。**<br>**(4) 成功報酬**<br>**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<br>（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<br>（2021年3月31日現在） | 第37期<br>（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<br>（自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日） | 第37期<br>（自 2021年4月 1日<br>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<br>定時株主総会 | 普通株式<br>A種種類株式 | 12,000 | 300,000 | 2020年3月31日 | 2020年6月18日 |

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

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

**第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）**

**1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項**

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

**2. 配当に関する事項**

**（1）配当金支払額**

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

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

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

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

**（金融商品関係）**

**1. 金融商品の状況に関する事項**

**（1）金融商品に対する取組方針**

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

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

**（2）金融商品の内容及びそのリスク**

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

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

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

**営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。**

**（3）金融商品に係るリスク管理体制**

**①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理**

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

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

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

**②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理**

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

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

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

**（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明**

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

**2. 金融商品の時価等に関する事項**

**貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。**

**第36期（2021年3月31日現在）**

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

**第37期（2022年3月31日現在）**

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

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

**（注2）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額**

**第36期（2021年3月31日現在）**

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

**第37期（2022年3月31日現在）**

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

**3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項**

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

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

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

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

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

**時価で貸借対照表に計上している金融商品**

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

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

**（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明**

**金銭の信託**

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

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

**（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。**

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

**（百万円）**

| | 第36期<br>（2021年3月31日現在） | 第37期<br>（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<br>（自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日） | 第37期<br>（自 2021年4月1日<br>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<br>（2021年3月31日現在） | 第37期<br>（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<br>(2021年3月31日現在) | 第37期<br>(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<br>（存続会社） | MHAM<br>（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<br>（2021年3月31日現在） | 第37期<br>（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<br>（自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日） | 第37期<br>（自 2021年4月1日<br>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<br>（自 2021年4月1日<br>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<br>（自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日） | 第37期<br>（自 2021年4月1日<br>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<br>（自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日） | 第37期<br>（自 2021年4月1日<br>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<br>（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<br>（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<br>（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<br>（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<br>移動平均法による原価法<br>(2) その他有価証券<br>市場価格のない株式等以外のもの<br>中間決算日の市場価格等に基づく時価法<br>（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）<br>市場価格のない株式等<br>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)<br>定率法を採用しております。<br>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。<br>なお、主な耐用年数は次のとおりであります。<br>建物　…　8～18年<br>器具備品　…　2～20年<br>(2) 無形固定資産(リース資産を除く)<br>定額法を採用しております。<br>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。<br>(3) リース資産<br>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<br>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。<br>(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。<br>(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。<br>①退職給付見込額の期間帰属方法<br>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。<br>②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br>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。<br>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。<br>(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。<br>(1) 委託者報酬<br>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。<br>(2) 運用受託報酬<br>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。<br>(3) 投資助言報酬<br>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。<br>(4) 成功報酬<br>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<br>（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<br>器具備品　…　975百万円<br>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<br>（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<br>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<br>定時株主総会 | 普通株式<br>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<br>（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<br>計上額（百万円） | 取得原価<br>（百万円） | 差額<br>（百万円） |
|---|---|---|---|
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの<br>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<br>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<br>（存続会社） | MHAM<br>（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<br>（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<br>（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<br>（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通りです。

| 名　　称 | 資本金の額<br>(単位:百万円) | 事 業 の 内 容 |
|---|---|---|
| 株式会社みずほ銀行 | 1,404,065 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |

（注）資本金の額は2022年3月末日現在

## ２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い
(2)追加設定の申込事務
(3)信託契約の一部解約事務
(4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
(5)受益者に対する収益分配金の再投資
(6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
(7)その他上記に付帯する業務

## ３【資本関係】

該当事項はありません。
※持株比率5%以上を記載します。

## 第３【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

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

・目論見書の使用開始日

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

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

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

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

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

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

# 独立監査人の監査報告書

２０２２年5月２６日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 丘本　正彦 |
| 指定有限責任社員<br>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3月１０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ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞の２０２２年1月１２日から２０２３年1月１１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞の２０２３年1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計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

**利害関係**

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

**以　上**

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

# 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<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 丘本　正彦 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 長谷川　敬 |
| 指定有限責任社員<br>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。**