【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8月10日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　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】	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞
（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

＜基準価額の照会方法等＞
基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）
・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は販売会社にお問い合わせください。

※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2023年8月11日から2024年2月13日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

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

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

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

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

＜ファンドの特色＞

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

＊2023年5月末時点

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

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

4 「隔月分配型」（分配金受取専用）のファンドです。

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

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

•将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ

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

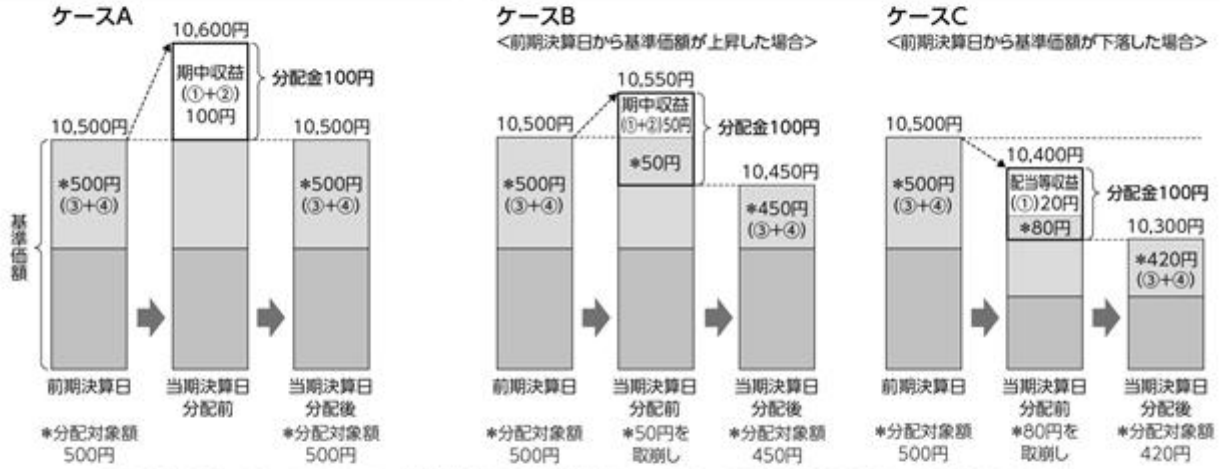
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



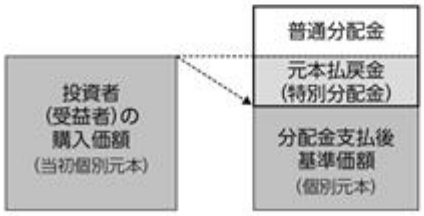
上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

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

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

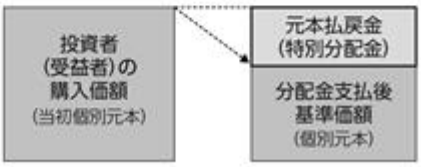
◆投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

○商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

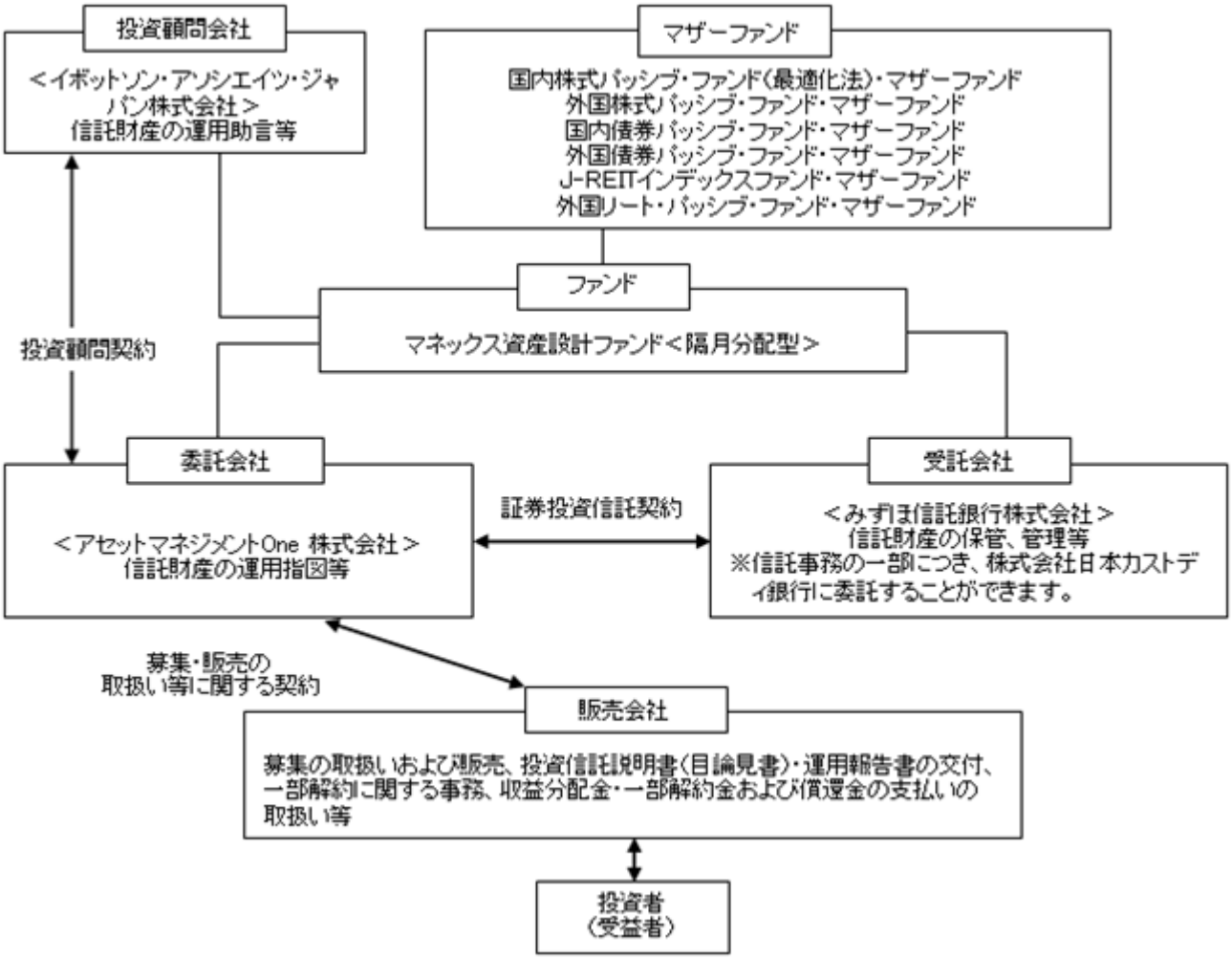
その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年6回（隔月）	目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
グロー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

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

（２）【ファンドの沿革】

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

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

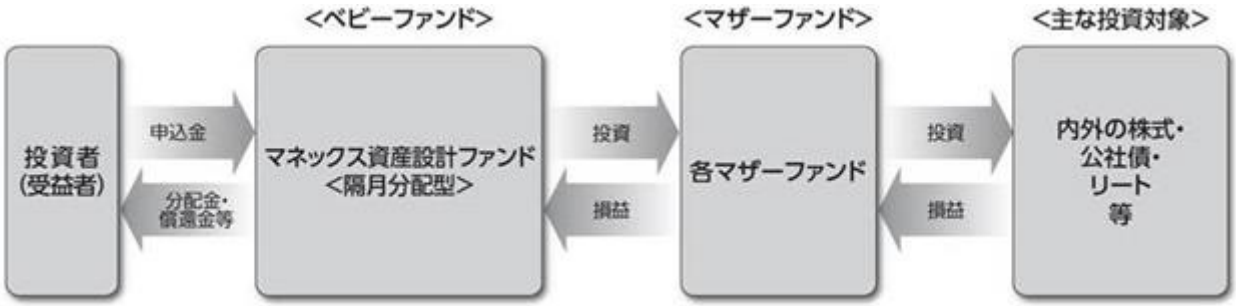
委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

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

資本金の額
20億円（2023年5月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2023年5月31日現在）

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

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

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

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

＜投資対象＞

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

＜投資態度＞

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

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

※投資対象の詳細は、約款をご覧下さい。

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

（２）【投資対象】

1.投資の対象とする資産（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

2.有価証券の指図範囲　（約款第16条第1項）

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

1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

5) Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

6) 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

7) 株券または新株引受権証書

8) 国債証券

9) 地方債証券

10)特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

16)コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

24)外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

28)外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの

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

3.金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

1)預金

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

3)コール・ローン

4)手形割引市場において売買される手形

5)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

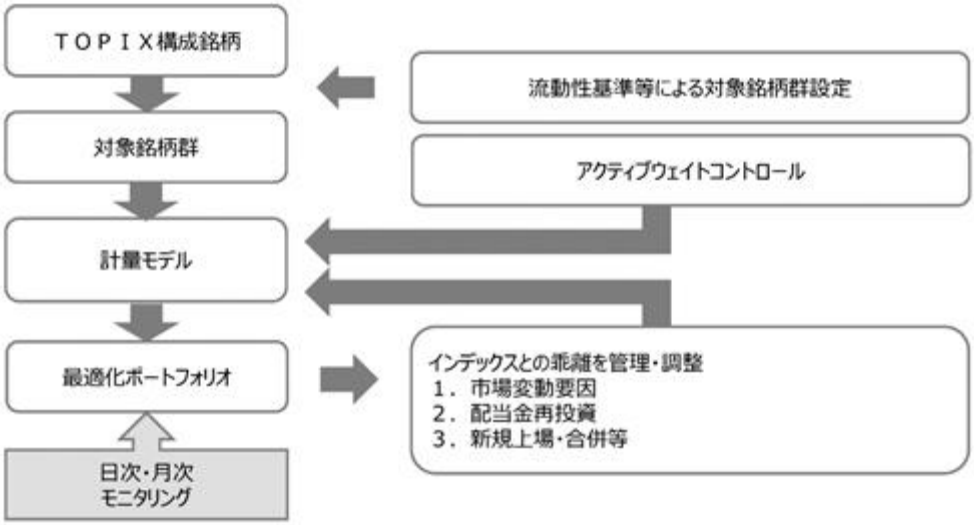
6)外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	**国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド**

基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。 （注）①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。 ②ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。 ⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

投資態度	1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
運用プロセス	 ①流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、ＴＯＰＩＸ採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。 ②最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 ③インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定

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

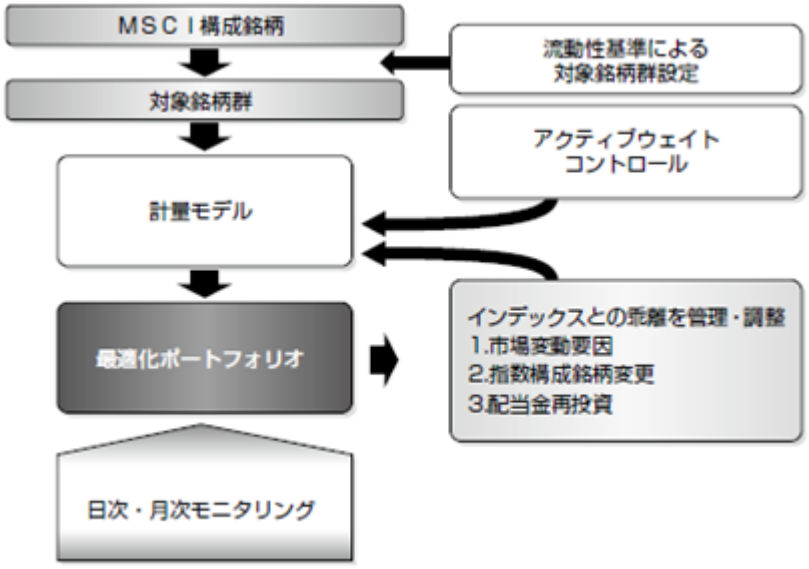
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

投資態度	**①主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。**

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

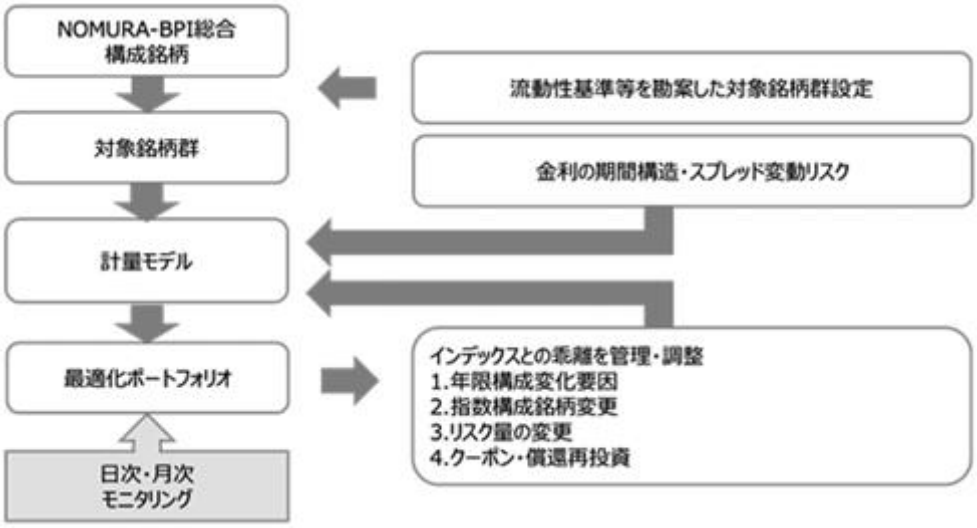
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

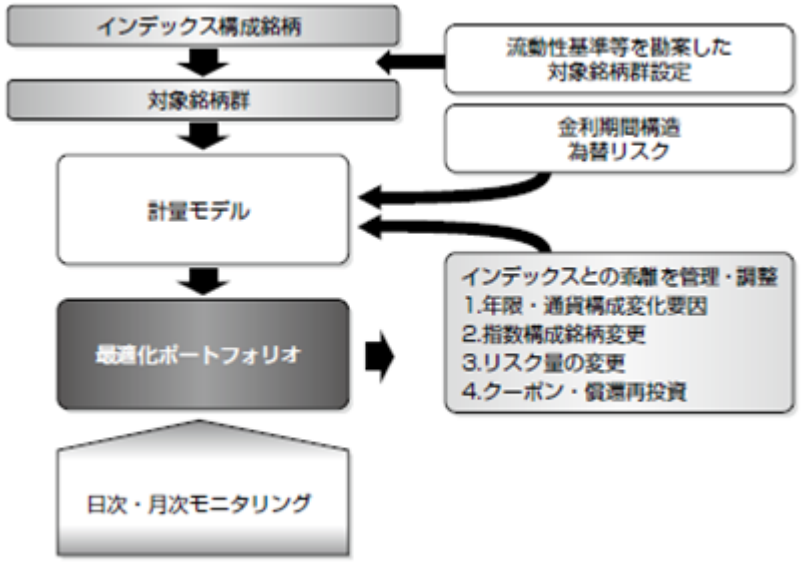
主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④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

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

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

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

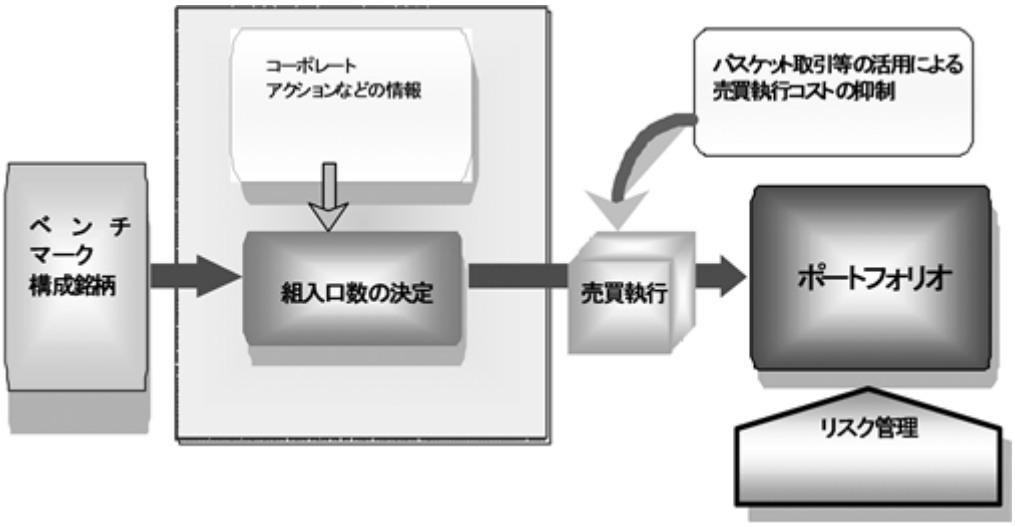
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	①主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 （注）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売ある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

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

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

ファンド名	**Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド**

基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）(注)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 （注）①東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証ＲＥＩＴ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。 ②ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証ＲＥＩＴ指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。 ⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証ＲＥＩＴ指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ②不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 ③但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

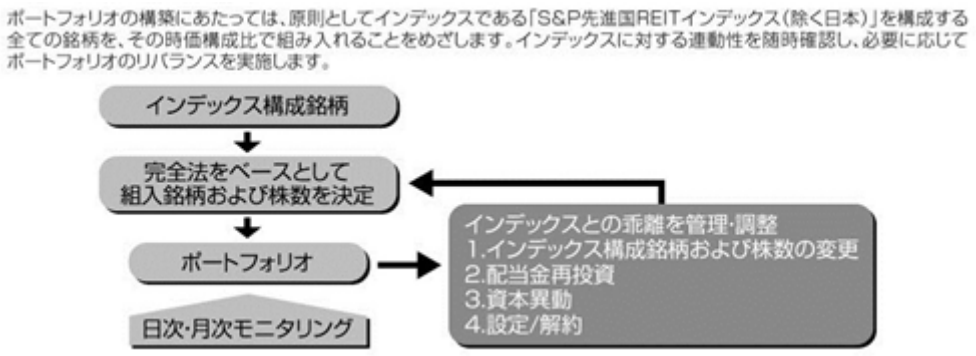
運用プロセス	①原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ②新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ③配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動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

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

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

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

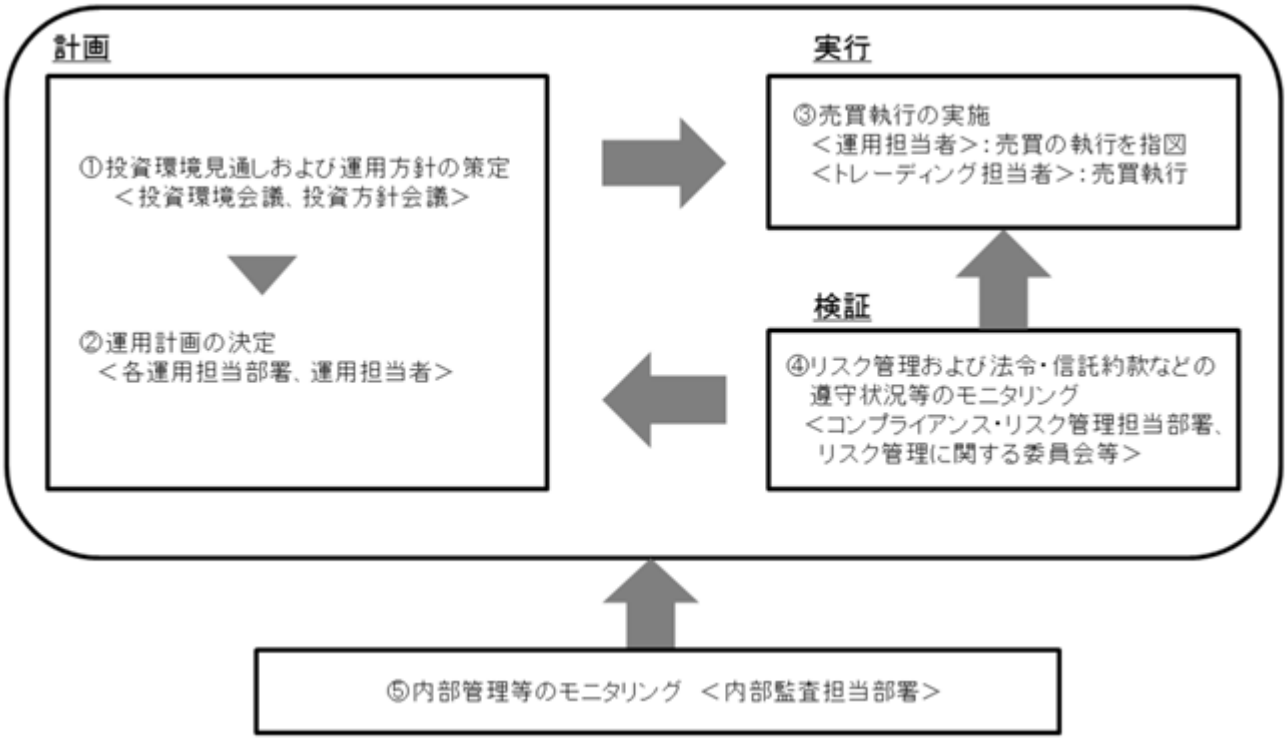
	はＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライ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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2023年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

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

1)分配対象額の範囲

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

2)分配対象額についての分配方針

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

3)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

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

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

2)売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」と言います。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

c.毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

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

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

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

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

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

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

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

⑧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。（約款「運用の基本方針」 2.運用方法 (3)投資制限）

⑨外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。（約款「運用の基本方針」 2.運用方法 (3)投資制限）

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

は、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」 2.運用方法 (3)投資制限）

⑪投資する株式等の範囲（約款第19条）

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

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

⑫信用取引の指図および範囲（約款第22条）

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

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

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

⑬先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

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

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

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

⑭スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

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

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

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

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

⑮金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

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

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

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

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

⑯デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条の2）

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

⑰有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

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

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

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

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

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

⑱公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

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

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

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

⑲公社債の借入れ（約款第28条）

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

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

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

4)上記1)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

⑳特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

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

㉑外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

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

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

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

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

㉒資金の借入れ　（約款第37条）

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

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

3)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

㉓同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

○資産配分リスク

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

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

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

○リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

○為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。
また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。

○信用リスク

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

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

○流動性リスク

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

○当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動

が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

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

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

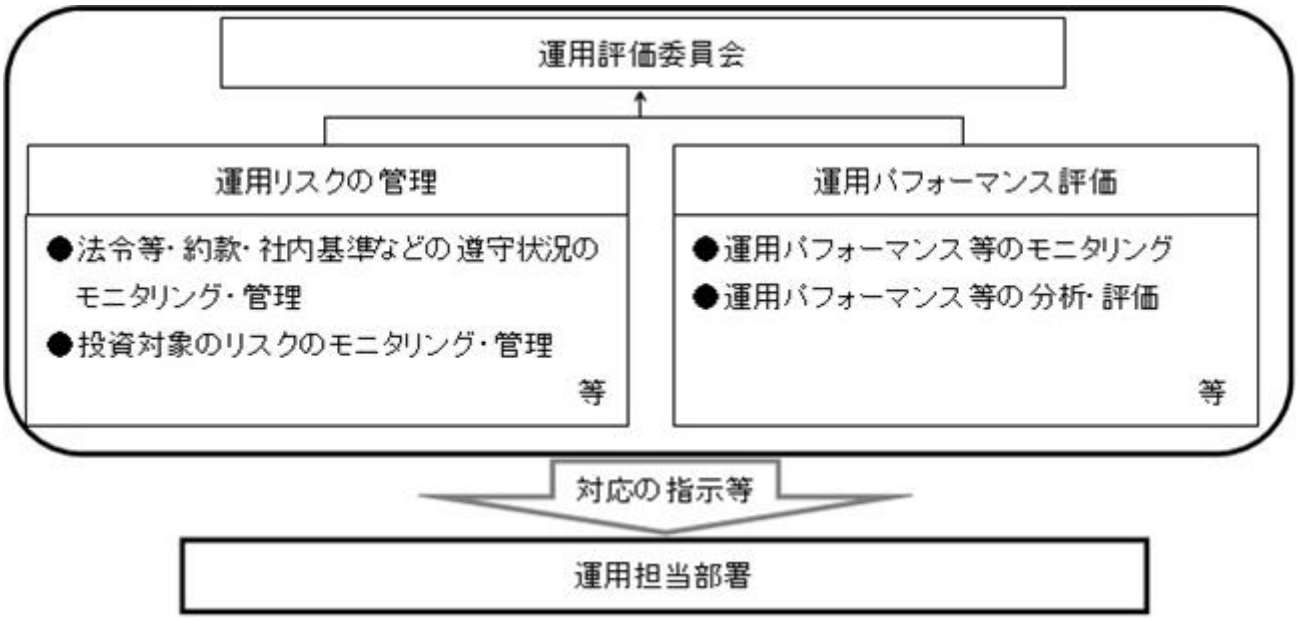
○注意事項

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

＜リスク管理体制＞

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

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



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

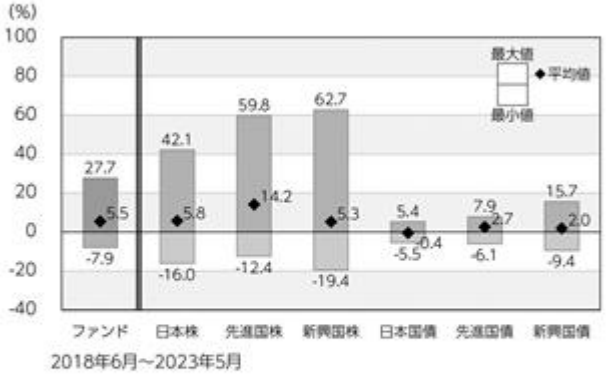
※リスク管理体制は2023年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2018年6月～2023年5月

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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）

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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

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

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

1.信託財産留保額

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

2.その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

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

ＮＩＳＡおよびジュニアＮＩＳＡは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご留意ください。

＜2024年1月1日以降＞

少額投資非課税制度（ＮＩＳＡ）をご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
当ファンドは、ＮＩＳＡの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は、2023年5月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
※課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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

＜個別元本について＞
①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に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。

…（参考情報）ファンドの総経費率

総経費率（①+②）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.56%	0.55%	0.01%

※対象期間:2022年11月12日～2023年5月11日
※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。）を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）です。
※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。
※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。
※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2023年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		435,485,771	99.00
	内　日本	435,485,771	99.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,380,882	1.00
純資産総額		439,866,653	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5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		422,732,527,860	97.27
	内　日本	422,732,527,860	97.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,866,090,400	2.73
純資産総額		434,598,618,260	100.00

その他資産の投資状況

2023年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		12,054,420,000	2.77
	内　日本	12,054,420,000	2.77

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		937,377,321,315	95.96
	内　アメリカ	660,361,870,876	67.60
	内　イギリス	40,236,049,809	4.12
	内　カナダ	33,268,393,651	3.41
	内　フランス	32,451,102,785	3.32
	内　スイス	32,373,881,219	3.31
	内　ドイツ	24,266,000,980	2.48
	内　オーストラリア	19,469,430,630	1.99
	内　オランダ	18,738,070,120	1.92
	内　アイルランド	17,718,322,455	1.81
	内　デンマーク	8,868,326,913	0.91
	内　スウェーデン	8,682,413,822	0.89
	内　スペイン	7,468,811,606	0.76
	内　香港	5,501,234,082	0.56
	内　イタリア	5,222,536,704	0.53
	内　ジャージィー	3,302,265,109	0.34
	内　フィンランド	3,257,394,655	0.33

	内　シンガポール	3,098,112,933	0.32
	内　ベルギー	2,156,308,946	0.22
	内　イスラエル	1,817,269,758	0.19
	内　ノルウェー	1,774,758,998	0.18
	内　ケイマン諸島	1,645,078,437	0.17
	内　バミューダ	1,471,937,905	0.15
	内　オランダ領キュラソー	1,195,574,166	0.12
	内　ニュージーランド	801,389,966	0.08
	内　ルクセンブルグ	510,094,246	0.05
	内　オーストリア	508,304,350	0.05
	内　ポルトガル	467,123,730	0.05
	内　リベリア	357,100,690	0.04
	内　パナマ	210,419,762	0.02
	内　マン島	177,742,012	0.02
投資信託受益証券		1,550,867,875	0.16
	内　オーストラリア	1,114,910,402	0.11
	内　シンガポール	435,957,473	0.04
投資証券		18,093,371,943	1.85
	内　アメリカ	16,875,437,820	1.73
	内　イギリス	434,390,452	0.04
	内　フランス	336,075,236	0.03
	内　香港	294,932,785	0.03
	内　ベルギー	79,376,255	0.01
	内　カナダ	73,159,395	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		19,791,014,703	2.03
純資産総額		976,812,575,836	100.00

その他資産の投資状況

2023年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		19,853,189,380	2.03
	内　アメリカ	14,522,068,057	1.49
	内　ドイツ	3,331,660,706	0.34
	内　イギリス	888,948,893	0.09
	内　カナダ	683,061,019	0.07
	内　オーストラリア	427,450,705	0.04

（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5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		506,060,076,750	84.99
	内　日本	506,060,076,750	84.99
地方債証券		32,084,570,028	5.39
	内　日本	32,084,570,028	5.39
特殊債券		30,070,195,149	5.05
	内　日本	30,070,195,149	5.05

社債券		25,598,713,800	4.30
	内　日本	25,004,138,800	4.20
	内　フランス	594,575,000	0.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,644,081,868	0.28
純資産総額		595,457,637,595	100.00

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		215,547,476,683	98.79
	内　アメリカ	107,163,841,349	49.11
	内　フランス	18,099,787,391	8.30
	内　イタリア	16,444,464,468	7.54
	内　ドイツ	14,050,999,836	6.44
	内　中国	11,046,966,463	5.06
	内　スペイン	11,014,002,552	5.05
	内　イギリス	9,966,269,037	4.57
	内　カナダ	4,352,606,379	1.99
	内　ベルギー	4,012,516,233	1.84
	内　オランダ	3,400,437,276	1.56
	内　オーストラリア	3,292,929,726	1.51
	内　オーストリア	2,654,120,192	1.22
	内　メキシコ	1,990,244,425	0.91
	内　アイルランド	1,279,931,889	0.59
	内　マレーシア	1,180,643,126	0.54
	内　フィンランド	1,073,109,884	0.49
	内　ポーランド	1,015,641,557	0.47
	内　シンガポール	953,147,140	0.44
	内　デンマーク	695,034,715	0.32
	内　イスラエル	625,454,287	0.29
	内　ニュージーランド	487,682,232	0.22
	内　スウェーデン	430,585,363	0.20
	内　ノルウェー	317,061,163	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,645,805,070	1.21
純資産総額		218,193,281,753	100.00

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		202,271,064,900	97.88
	内　日本	202,271,064,900	97.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,383,714,889	2.12
純資産総額		206,654,779,789	100.00

その他資産の投資状況

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）

不動産投信指数先物取引（買建）		4,394,728,500	2.13
	内　日本	4,394,728,500	2.13

（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5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		8,262,200,621	10.64
	内　オーストラリア	5,283,638,916	6.80
	内　シンガポール	2,906,714,317	3.74
	内　香港	71,847,388	0.09
投資証券		69,224,814,398	89.11
	内　アメリカ	59,664,361,875	76.80
	内　イギリス	3,694,661,755	4.76
	内　カナダ	1,343,805,200	1.73
	内　フランス	1,309,238,705	1.69
	内　香港	1,083,556,703	1.39
	内　ベルギー	827,649,686	1.07
	内　ニュージーランド	309,703,942	0.40
	内　スペイン	303,922,461	0.39
	内　韓国	193,756,186	0.25
	内　ガーンジィ	176,012,585	0.23
	内　オランダ	149,062,449	0.19
	内　イスラエル	96,451,362	0.12
	内　ドイツ	35,158,092	0.05
	内　アイルランド	29,732,376	0.04
	内　イタリア	7,741,021	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		196,952,891	0.25
純資産総額		77,683,967,910	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5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	17,883,685	6.3556 113,663,336	6.6369 118,692,228	－ －	26.98
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	29,168,729	3.5889 104,686,568	3.6715 107,092,988	－ －	24.35

3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	76,877,550	1.2693 97,588,361	1.2668 97,388,480	－ －	22.14
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	24,213,150	2.0813 50,397,250	2.1198 51,327,035	－ －	11.67
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	18,689,774	1.6355 30,568,994	1.6341 30,540,959	－ －	6.94
6	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	12,819,640	2.3415 30,018,469	2.3748 30,444,081	－ －	6.92

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年5月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

（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5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,617,700	1,894.35 14,430,615,371	1,908.50 14,538,380,450	－ －	3.35
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	981,400	12,034.32 11,810,488,319	13,160.00 12,915,224,000	－ －	2.97
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	138,800	61,137.19 8,485,842,259	67,800.00 9,410,640,000	－ －	2.17
4	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,557,100	932.20 7,977,013,147	932.50 7,979,495,750	－ －	1.84
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,782,900	3,868.89 6,897,859,721	3,955.00 7,051,369,500	－ －	1.62
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	293,600	15,598.10 4,579,603,351	19,315.00 5,670,884,000	－ －	1.30
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	998,500	5,622.33 5,613,899,415	5,678.00 5,669,483,000	－ －	1.30
8	第一三共 日本	株式 医薬品	1,212,100	4,128.06 5,003,633,205	4,540.00 5,502,934,000	－ －	1.27
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	681,300	7,049.43 4,802,779,462	8,046.00 5,481,739,800	－ －	1.26

10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,231,400	4,197.10 5,168,316,907	4,421.00 5,444,019,400	－ －	1.25
11	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	296,300	14,240.05 4,219,327,087	17,565.00 5,204,509,500	－ －	1.20
12	任天堂 日本	株式 その他製品	875,900	5,594.72 4,900,417,000	5,936.00 5,199,342,400	－ －	1.20
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	907,900	4,614.21 4,189,244,994	5,586.00 5,071,529,400	－ －	1.17
14	信越化学工業 日本	株式 化学	1,155,100	3,871.11 4,471,523,848	4,297.00 4,963,464,700	－ －	1.14
15	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,075,200	3,977.72 4,276,850,788	4,291.00 4,613,683,200	－ －	1.06
16	三井物産 日本	株式 卸売業	1,041,800	3,927.13 4,091,284,361	4,404.00 4,588,087,200	－ －	1.06
17	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,055,900	4,270.68 4,509,413,977	4,290.00 4,529,811,000	－ －	1.04
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,127,700	3,293.88 3,714,514,601	4,005.00 4,516,438,500	－ －	1.04
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	167,200	22,984.52 3,843,012,750	26,560.00 4,440,832,000	－ －	1.02
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	904,400	4,077.14 3,687,373,117	4,721.00 4,269,672,400	－ －	0.98
21	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,350,600	2,718.84 3,672,075,040	3,144.00 4,246,286,400	－ －	0.98
22	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,976,100	2,066.62 4,083,856,338	2,053.00 4,056,933,300	－ －	0.93
23	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	754,700	4,341.62 3,276,623,142	5,227.00 3,944,816,900	－ －	0.91
24	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	686,400	6,161.17 4,229,031,740	5,475.00 3,758,040,000	－ －	0.86
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	420,800	7,720.02 3,248,585,164	8,199.00 3,450,139,200	－ －	0.79
26	ＳＭＣ 日本	株式 機械	45,400	67,968.26 3,085,759,188	75,080.00 3,408,632,000	－ －	0.78
27	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,235,300	1,529.28 3,418,403,130	1,485.50 3,320,538,150	－ －	0.76
28	ファナック 日本	株式 電気機器	680,800	4,622.44 3,146,963,442	4,798.00 3,266,478,400	－ －	0.75
29	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	505,900	5,948.64 3,009,417,217	5,845.00 2,956,985,500	－ －	0.68
30	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,314,400	1,914.61 2,516,575,130	2,207.50 2,901,538,000	－ －	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5月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.27
合計	97.27

（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5月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	18.21
情報・通信業		8.09
輸送用機器		7.17
卸売業		6.11
化学		5.92
銀行業		5.85
医薬品		5.34
機械		5.33
サービス業		4.83
小売業		4.30
食料品		3.45
陸運業		2.94
精密機器		2.62
その他製品		2.29
保険業		2.21
建設業		1.96
不動産業		1.79
電気・ガス業		1.25
その他金融業		1.08
鉄鋼		0.81
ゴム製品		0.75
ガラス・土石製品		0.66
証券、商品先物取引業		0.66
非鉄金属		0.64
海運業		0.53
金属製品		0.51
空運業		0.48
繊維製品		0.42
石油・石炭製品		0.41
鉱業		0.28
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業		0.08
合計		97.27

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	2,149,820	21,559.39 46,348,811,596	24,781.22 53,275,164,530	－ －	5.45
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	956,655	38,116.24 36,464,098,649	46,293.22 44,286,642,005	－ －	4.53
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小売り	1,240,262	13,939.18 17,288,241,865	17,004.41 21,089,933,725	－ －	2.16
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	332,062	32,783.38 10,886,115,432	56,063.14 18,616,439,955	－ －	1.91
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	803,970	13,343.40 10,727,694,838	17,285.35 13,896,907,582	－ －	1.42
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	742,419	13,379.45 9,933,160,297	17,420.93 12,933,631,508	－ －	1.32
7	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	303,449	25,534.92 7,748,546,668	36,692.42 11,134,278,277	－ －	1.14
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	362,277	29,002.21 10,506,836,805	28,116.13 10,185,828,387	－ －	1.04
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	126,297	68,835.17 8,693,676,043	67,068.63 8,470,567,331	－ －	0.87

10	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	556,010	16,243.21 9,031,391,033	14,541.67 8,085,314,381	－ －	0.83
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	175,639	43,441.72 7,630,060,335	45,032.49 7,909,462,617	－ －	0.81
12	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	353,492	22,549.53 7,971,081,358	21,576.29 7,627,047,636	－ －	0.78
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	395,707	19,872.65 7,863,750,475	19,212.78 7,602,633,197	－ －	0.78
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	219,836	32,020.64 7,039,290,171	30,978.62 6,810,216,521	－ －	0.70
15	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	109,033	48,465.62 5,284,352,213	59,715.33 6,510,942,099	－ －	0.67
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	320,215	19,596.41 6,275,065,699	20,012.26 6,408,228,589	－ －	0.66
17	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	56,286	84,612.99 4,762,527,287	112,282.83 6,319,951,470	－ －	0.65
18	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	371,943	17,159.54 6,382,373,295	16,717.94 6,218,122,765	－ －	0.64
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	116,035	51,607.26 5,988,248,522	51,365.47 5,960,192,891	－ －	0.61
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	137,588	44,120.96 6,070,515,344	40,868.74 5,623,049,299	－ －	0.58
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	54,297	92,875.78 5,042,876,685	102,492.32 5,565,025,716	－ －	0.57
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	248,161	24,007.87 5,957,818,284	21,401.58 5,311,038,089	－ －	0.54
23	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	342,191	15,200.69 5,201,539,665	15,258.69 5,221,386,697	－ －	0.53
24	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	223,550	20,237.27 4,524,043,028	22,487.40 5,027,058,270	－ －	0.51
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	186,384	24,649.16 4,594,209,114	25,383.62 4,731,102,438	－ －	0.48
26	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・アパレル・贅沢品	37,297	122,109.84 4,554,330,778	125,433.43 4,678,291,011	－ －	0.48

27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	555,881	8,367.34 4,651,248,521	8,355.45 4,644,636,234	－ －	0.48
28	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	238,853	21,437.46 5,120,402,931	19,070.21 4,554,978,971	－ －	0.47
29	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	59,677	70,150.06 4,186,345,694	71,007.35 4,237,505,810	－ －	0.43
30	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	94,934	42,684.38 4,052,199,762	44,425.84 4,217,523,548	－ －	0.43

（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5月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.96
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.85
合計	97.97

（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5月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	8.07
半導体・半導体製造装置		6.00
コンピュータ・周辺機器		5.67
医薬品		5.24
銀行		5.21
石油・ガス・消耗燃料		4.59
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.01
保険		3.02
金融サービス		3.01
資本市場		2.94
大規模小売り		2.58
ヘルスケア機器・用品		2.37
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.11
ホテル・レストラン・レジャー		2.06
化学		1.91
バイオテクノロジー		1.90
飲料		1.77
電力		1.75
生活必需品流通・小売り		1.73
機械		1.72
自動車		1.71
食品		1.66
航空宇宙・防衛		1.65
専門小売り		1.58

金属・鉱業	1.48
繊維・アパレル・贅沢品	1.36
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.33
情報技術サービス	1.27
家庭用品	1.12
娯楽	1.11
専門サービス	1.04
各種電気通信サービス	1.02
陸上運輸	0.98
コングロマリット	0.92
電気設備	0.88
総合公益事業	0.76
メディア	0.72
通信機器	0.69
パーソナルケア用品	0.60
タバコ	0.60
航空貨物・物流サービス	0.56
建設関連製品	0.55
商業サービス・用品	0.53
電子装置・機器・部品	0.51
商社・流通業	0.39
消費者金融	0.37
建設・土木	0.30
不動産管理・開発	0.29
家庭用耐久財	0.29
建設資材	0.28
無線通信サービス	0.25
エネルギー設備・サービス	0.24
容器・包装	0.22
自動車用部品	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.14
ガス	0.12
運送インフラ	0.12
水道	0.10
販売	0.10
紙製品・林産品	0.09
海上運輸	0.06
旅客航空輸送	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.02
合計	95.96

（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5月31日現在

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

1	３３５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	9,410,000,000	100.82 9,487,981,000	100.79 9,484,339,000	0.5 2024/9/20	1.59
2	１３７回　利付国庫債券 （２０年） 日本	国債証券	6,680,000,000	111.47 7,446,852,000	111.84 7,471,179,200	1.7 2032/6/20	1.25
3	３４１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,620,000,000	100.90 6,680,216,000	100.92 6,680,904,000	0.3 2025/12/20	1.12
4	３３９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,480,000,000	100.99 6,544,740,000	100.96 6,542,532,000	0.4 2025/6/20	1.10
5	１５３回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	6,510,000,000	99.67 6,488,798,000	100.00 6,510,000,000	0.005 2027/6/20	1.09
6	３３８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,230,000,000	100.90 6,286,098,000	100.85 6,283,328,800	0.4 2025/3/20	1.06
7	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,930,000,000	100.04 5,932,957,000	100.38 5,952,771,200	0.1 2027/6/20	1.00
8	３６１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,920,000,000	97.99 5,801,232,000	98.70 5,843,336,000	0.1 2030/12/20	0.98
9	１５０回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,720,000,000	99.91 5,715,320,000	100.10 5,726,063,200	0.005 2026/12/20	0.96
10	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,560,000,000	99.60 5,537,945,000	100.11 5,566,616,400	0.1 2028/3/20	0.93
11	３６０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,600,000,000	98.48 5,515,256,000	98.92 5,539,744,000	0.1 2030/9/20	0.93
12	１４６回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,500,000,000	100.34 5,518,995,000	100.40 5,522,495,000	0.1 2025/12/20	0.93
13	１５４回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,500,000,000	99.94 5,497,175,000	100.32 5,517,710,000	0.1 2027/9/20	0.93
14	３６５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,630,000,000	97.21 5,473,457,000	97.96 5,515,373,200	0.1 2031/12/20	0.93
15	３６３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,570,000,000	97.49 5,430,605,000	98.31 5,475,922,700	0.1 2031/6/20	0.92
16	３５８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,350,000,000	98.74 5,282,647,000	99.32 5,314,101,500	0.1 2030/3/20	0.89
17	３４４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,270,000,000	100.32 5,286,921,000	100.46 5,294,400,100	0.1 2026/9/20	0.89

18	３５４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,200,000,000	99.28 5,162,979,000	99.79 5,189,496,000	0.1 2029/3/20	0.87
19	３６４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,250,000,000	97.26 5,106,334,000	98.10 5,150,302,500	0.1 2031/9/20	0.86
20	１４９回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,010,000,000	100.06 5,013,073,000	100.14 5,017,414,800	0.005 2026/9/20	0.84
21	３４９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,950,000,000	99.80 4,940,452,000	100.22 4,961,236,500	0.1 2027/12/20	0.83
22	３６６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,980,000,000	98.17 4,889,030,000	98.67 4,914,114,600	0.2 2032/3/20	0.83
23	３５３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,910,000,000	99.73 4,896,830,000	99.88 4,904,549,900	0.1 2028/12/20	0.82
24	１３８回　利付国庫債券 （２０年） 日本	国債証券	4,420,000,000	109.92 4,858,750,000	110.09 4,865,978,000	1.5 2032/6/20	0.82
25	３５２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,860,000,000	99.43 4,832,304,000	99.94 4,857,424,200	0.1 2028/9/20	0.82
26	３５９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,870,000,000	98.40 4,792,236,000	99.13 4,827,728,400	0.1 2030/6/20	0.81
27	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,740,000,000	100.16 4,747,609,000	100.44 4,761,045,600	0.1 2026/12/20	0.80
28	３５１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,680,000,000	99.52 4,657,573,000	100.02 4,681,170,000	0.1 2028/6/20	0.79
29	１４４回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,530,000,000	100.32 4,544,681,000	100.34 4,545,809,700	0.1 2025/6/20	0.76
30	１５１回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,500,000,000	99.90 4,495,850,000	100.05 4,502,565,000	0.005 2027/3/20	0.76

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年5月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	84.99
地方債証券	5.39
特殊債券	5.05
社債券	4.30
合計	99.72

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 1.5 11/30/24 アメリカ	国債証券	1,257,930,000	94.46 1,188,265,836	95.28 1,198,620,562	1.5 2024/11/30	0.55
2	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,160,091,000	103.25 1,197,797,696	103.32 1,198,609,639	4.125 2032/11/15	0.55
3	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,125,148,500	92.10 1,036,268,411	93.72 1,054,519,057	2.875 2032/5/15	0.48
4	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,242,555,300	81.59 1,013,830,290	83.31 1,035,252,416	1.125 2031/2/15	0.47
5	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,095,796,800	91.93 1,007,430,095	92.63 1,015,110,199	2.75 2032/8/15	0.47
6	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,210,408,200	81.24 983,450,372	82.91 1,003,598,604	1.25 2031/8/15	0.46
7	US T N/B 0.25 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,048,275,000	94.39 989,555,214	95.37 999,797,900	0.25 2024/5/15	0.46
8	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,151,704,800	84.64 974,899,938	85.92 989,656,338	1.625 2031/5/15	0.45
9	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証券	975,437,100	99.64 971,982,969	100.03 975,755,775	2.26 2025/2/24	0.45
10	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,157,295,600	80.50 931,622,958	81.98 948,846,766	0.875 2030/11/15	0.43
11	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,116,762,300	81.96 915,396,097	83.29 930,184,473	1.375 2031/11/15	0.43
12	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,151,704,800	79.49 915,498,289	80.67 929,191,836	0.625 2030/8/15	0.43
13	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,017,525,600	85.28 867,798,294	86.55 880,676,351	1.875 2032/2/15	0.40
14	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	886,141,800	93.75 830,809,680	95.21 843,773,145	2.75 2028/2/15	0.39
15	US T N/B 1.375 12/31/28 アメリカ	国債証券	922,482,000	87.73 809,339,029	87.81 810,108,552	1.375 2028/12/31	0.37
16	US T N/B 3.875 01/15/26 アメリカ	国債証券	810,666,000	98.44 798,076,357	99.17 804,016,008	3.875 2026/1/15	0.37
17	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証券	893,130,300	86.43 771,979,768	88.20 787,803,720	1.125 2028/2/29	0.36
18	US T N/B 0.875 09/30/26 アメリカ	国債証券	853,994,700	88.61 756,801,581	90.26 770,846,973	0.875 2026/9/30	0.35
19	US T N/B 4.25 12/31/24 アメリカ	国債証券	768,735,000	99.03 761,339,769	99.21 762,729,257	4.25 2024/12/31	0.35
20	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	799,484,400	90.88 726,574,251	91.14 728,655,077	0.75 2026/3/31	0.33
21	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	689,703,000	101.56 700,510,646	101.95 703,192,280	3.03 2026/3/11	0.32

22	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	766,704,400	90.07 690,599,787	91.05 698,123,840	0.75 2028/5/25	0.32
23	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	712,827,000	97.06 691,887,706	97.41 694,398,068	2.5 2024/5/15	0.32
24	US T N/B 4.0 11/15/52 アメリカ	国債証券	679,282,200	101.44 689,108,833	101.89 692,124,876	4 2052/11/15	0.32
25	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	715,622,400	94.71 677,785,349	95.33 682,245,325	2.25 2025/11/15	0.31
26	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	682,682,000	98.19 670,333,647	98.67 673,644,586	2.5 2030/5/25	0.31
27	US T N/B 0.375 11/30/25 アメリカ	国債証券	725,406,300	90.35 655,448,668	90.94 659,751,363	0.375 2025/11/30	0.30
28	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32 中国	国債証券	656,203,140	99.24 651,229,092	100.32 658,326,547	2.8 2032/11/15	0.30
29	US T N/B 0.5 02/28/26 アメリカ	国債証券	722,610,900	89.32 645,494,766	90.59 654,626,197	0.5 2026/2/28	0.30
30	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	679,282,200	94.52 642,080,879	95.64 649,683,006	2.875 2028/5/15	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5月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.79
合計	98.79

（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
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5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	22,263	667,149.83 14,852,756,803	558,000.00 12,422,754,000	－ －	6.01
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	19,569	613,557.82 12,006,713,010	530,000.00 10,371,570,000	－ －	5.02
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	61,713	165,010.89 10,183,317,532	163,900.00 10,114,760,700	－ －	4.89
4	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	64,340	160,472.74 10,324,816,576	147,800.00 9,509,452,000	－ －	4.60
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	96,289	105,016.83 10,111,966,042	98,600.00 9,494,095,400	－ －	4.59
6	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	32,168	329,662.74 10,604,591,137	292,200.00 9,399,489,600	－ －	4.55

7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	28,766	305,656.82 8,792,524,252	292,500.00 8,414,055,000	－ －	4.07
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	38,024	183,851.26 6,990,760,556	186,600.00 7,095,278,400	－ －	3.43
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	19,081	349,860.77 6,675,693,411	358,000.00 6,830,998,000	－ －	3.31
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	42,689	147,539.09 6,298,296,532	148,000.00 6,317,972,000	－ －	3.06
11	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	83,996	45,466.83 3,819,031,864	59,300.00 4,980,962,800	－ －	2.41
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	61,542	70,784.16 4,356,199,100	79,100.00 4,867,972,200	－ －	2.36
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	13,051	395,935.39 5,167,352,777	359,000.00 4,685,309,000	－ －	2.27
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	29,118	172,970.73 5,036,561,753	160,100.00 4,661,791,800	－ －	2.26
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	57,345	78,670.20 4,511,342,788	79,500.00 4,558,927,500	－ －	2.21
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	6,590	651,073.16 4,290,572,140	678,000.00 4,468,020,000	－ －	2.16
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	12,868	319,573.07 4,112,266,370	326,500.00 4,201,402,000	－ －	2.03
18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	10,075	411,980.62 4,150,704,797	393,500.00 3,964,512,500	－ －	1.92
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	23,362	169,856.81 3,968,195,024	167,900.00 3,922,479,800	－ －	1.90
20	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	7,539	521,461.65 3,931,299,449	502,000.00 3,784,578,000	－ －	1.83
21	イオンリート投資法人 日本	投資証券	21,908	153,246.52 3,357,324,908	160,600.00 3,518,424,800	－ －	1.70
22	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	11,104	328,426.50 3,646,847,966	316,000.00 3,508,864,000	－ －	1.70
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	7,081	518,973.56 3,674,851,840	493,000.00 3,490,933,000	－ －	1.69
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	22,441	153,367.13 3,441,711,953	154,100.00 3,458,158,100	－ －	1.67
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	26,445	115,449.23 3,053,054,937	119,100.00 3,149,599,500	－ －	1.52

26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	9,126	327,087.74 2,985,002,787	338,500.00 3,089,151,000	－ －	1.49
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	13,995	212,669.12 2,976,304,472	213,800.00 2,992,131,000	－ －	1.45
28	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	6,556	444,756.85 2,915,825,955	434,500.00 2,848,582,000	－ －	1.38
29	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	17,855	161,652.19 2,886,299,996	158,700.00 2,833,588,500	－ －	1.37
30	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	35,519	71,576.78 2,542,335,846	71,900.00 2,553,816,100	－ －	1.24

（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5月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.88
合計	97.88

（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5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	418,630	16,391.48 6,861,967,827	17,374.80 7,273,616,166	－ －	9.36
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	41,975	92,332.14 3,875,641,784	102,662.46 4,309,256,871	－ －	5.55
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	71,610	42,213.88 3,022,936,456	40,379.55 2,891,579,790	－ －	3.72
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	284,584	9,007.96 2,563,523,511	8,235.24 2,343,619,930	－ －	3.02
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	214,427	10,299.72 2,208,539,654	10,221.38 2,191,739,870	－ －	2.82
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	148,371	15,003.65 2,226,107,882	14,467.59 2,146,571,196	－ －	2.76
7	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	455,521	4,408.27 2,008,063,417	4,265.78 1,943,152,553	－ －	2.50
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	130,501	15,642.69 2,041,387,924	14,060.86 1,834,956,551	－ －	2.36
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	63,509	25,160.57 1,597,923,190	24,142.47 1,533,264,260	－ －	1.97

10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	773,775	1,676.80 1,297,470,588	1,825.95 1,412,877,169	－ －	1.82
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	154,652	9,204.53 1,423,499,540	8,388.99 1,297,374,916	－ －	1.67
12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	60,814	22,722.72 1,381,860,089	20,430.18 1,242,441,021	－ －	1.60
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	263,764	4,591.73 1,211,133,663	4,694.87 1,238,338,824	－ －	1.59
14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	71,538	19,129.10 1,368,458,050	15,725.52 1,124,972,442	－ －	1.45
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	181,678	6,483.65 1,177,937,220	6,031.07 1,095,713,734	－ －	1.41
16	MID AMERICA アメリカ	投資証券	52,453	22,310.94 1,170,275,784	20,562.96 1,078,589,066	－ －	1.39
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	56,171	20,525.81 1,152,955,385	17,809.49 1,000,377,053	－ －	1.29
18	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	131,379	7,023.15 922,695,532	7,463.71 980,575,807	－ －	1.26
19	LINK REIT 香港	投資証券	1,144,220	997.62 1,141,504,818	843.83 965,529,451	－ －	1.24
20	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	95,164	11,243.21 1,069,949,680	9,595.21 913,118,612	－ －	1.18
21	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	29,186	32,895.27 960,081,517	29,982.06 875,056,481	－ －	1.13
22	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	116,314	6,857.00 797,565,792	6,643.26 772,705,085	－ －	0.99
23	UDR INC アメリカ	投資証券	139,679	5,946.97 830,668,009	5,478.98 765,299,006	－ －	0.99
24	SEGRO PLC イギリス	投資証券	549,740	1,523.09 837,307,959	1,386.04 761,965,037	－ －	0.98
25	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	323,885	2,337.87 757,204,237	2,318.78 751,019,453	－ －	0.97
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	49,992	16,690.45 834,389,143	14,559.84 727,875,566	－ －	0.94
27	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	280,757	2,778.44 780,067,703	2,536.82 712,231,516	－ －	0.92
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	79,418	9,474.14 752,417,587	8,901.95 706,975,168	－ －	0.91
29	LIFE STORAGE INC アメリカ	投資証券	38,586	16,145.85 623,003,836	18,055.48 696,689,083	－ －	0.90
30	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	248,242	3,369.63 836,484,964	2,784.21 691,159,944	－ －	0.89

（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5月31日現在

種類	投資比率（%）

投資信託受益証券	10.64
投資証券	89.11
合計	99.75

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０５０６月	買建	567	11,820,678,110	12,054,420,000	2.77

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Jun23	買建	493	14,363,546,164	14,522,068,057	1.49
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun23	買建	517	3,351,811,078	3,331,660,706	0.34

	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun23	買建	68	920,751,532	888,948,893	0.09
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun23	買建	28	709,834,356	683,061,019	0.07
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Jun23	買建	26	431,751,486	427,450,705	0.04

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０５０６月	買建	2,337	4,213,377,300	4,394,728,500	2.13

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

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

第21特定期間末 (2017年5月11日)	492	493	1.0090	1.0105
第22特定期間末 (2017年11月13日)	477	478	1.0570	1.0585
第23特定期間末 (2018年5月11日)	448	449	1.0565	1.0580
第24特定期間末 (2018年11月12日)	428	428	1.0434	1.0449
第25特定期間末 (2019年5月13日)	411	411	1.0361	1.0376
第26特定期間末 (2019年11月11日)	430	431	1.0940	1.0955
第27特定期間末 (2020年5月11日)	370	371	0.9993	1.0008
第28特定期間末 (2020年11月11日)	401	401	1.1046	1.1061
第29特定期間末 (2021年5月11日)	421	421	1.2325	1.2340
第30特定期間末 (2021年11月11日)	433	433	1.3083	1.3098
第31特定期間末 (2022年5月11日)	418	419	1.2591	1.2606
第32特定期間末 (2022年11月11日)	434	434	1.3015	1.3030
第33特定期間末 (2023年5月11日)	432	433	1.3207	1.3222
2022年5月末日	427	－	1.2862	－
6月末日	423	－	1.2669	－
7月末日	433	－	1.2981	－
8月末日	436	－	1.3010	－
9月末日	417	－	1.2485	－
10月末日	434	－	1.3024	－
11月末日	431	－	1.2935	－
12月末日	407	－	1.2415	－
2023年1月末日	416	－	1.2664	－
2月末日	423	－	1.2871	－
3月末日	422	－	1.2900	－
4月末日	431	－	1.3154	－
5月末日	439	－	1.3464	－

②【分配の推移】

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

第21特定期間	0.0045
第22特定期間	0.0045
第23特定期間	0.0045
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045
第32特定期間	0.0045
第33特定期間	0.0045

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第14特定期間	△0.8
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.9
第17特定期間	8.2
第18特定期間	△1.0
第19特定期間	△5.5
第20特定期間	△1.1
第21特定期間	10.1
第22特定期間	5.2
第23特定期間	0.4
第24特定期間	△0.8
第25特定期間	△0.3
第26特定期間	6.0
第27特定期間	△8.2
第28特定期間	11.0
第29特定期間	12.0
第30特定期間	6.5
第31特定期間	△3.4
第32特定期間	3.7
第33特定期間	1.8

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

（４）【設定及び解約の実績】

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

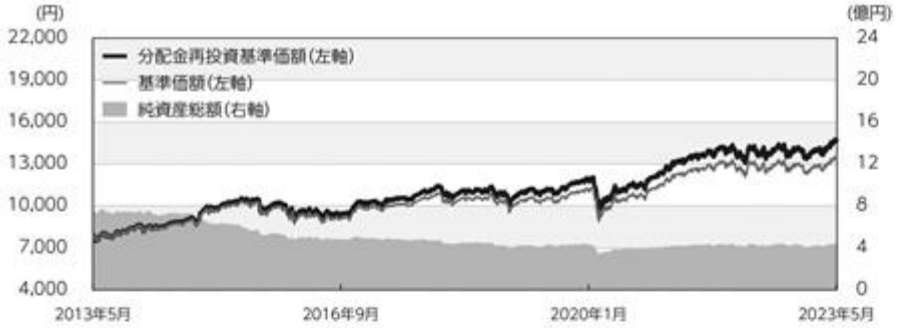
第22特定期間	6,636,994	43,222,568
第23特定期間	4,576,025	31,482,595
第24特定期間	6,951,749	21,627,662
第25特定期間	6,012,015	19,263,147
第26特定期間	13,077,272	16,654,903
第27特定期間	11,204,748	33,518,095
第28特定期間	4,242,197	12,089,221
第29特定期間	7,387,321	28,854,017
第30特定期間	7,665,051	18,275,352
第31特定期間	8,633,053	7,395,440
第32特定期間	8,745,065	7,360,714
第33特定期間	5,725,706	11,750,355

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2023年5月31日

基準価額・純資産の推移 〈2013年5月31日～2023年5月31日〉



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

分配の推移(税引前)

2022年 9月	15円
2022年11月	15円
2023年 1月	15円
2023年 3月	15円
2023年 5月	15円
直近1年間累計	90円
設定来累計	1,965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	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.98
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	24.35
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	22.14
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.67
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.94
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.92

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.35
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.97
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.17
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.84
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.62

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.45
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.53
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.16
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.91
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.42

○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5月31日

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	335回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2024/9/20	1.59
2	137回　利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.7	2032/6/20	1.25
3	341回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.3	2025/12/20	1.12
4	339回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	1.10
5	153回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2027/6/20	1.09

■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 1.5 11/30/24	国債証券	アメリカ	1.5	2024/11/30	0.55
2	US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	アメリカ	4.125	2032/11/15	0.55
3	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	0.48
4	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.47
5	US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	アメリカ	2.75	2032/8/15	0.47

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.01
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.02
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.89
4	GLP投資法人	投資証券	日本	4.60
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.59

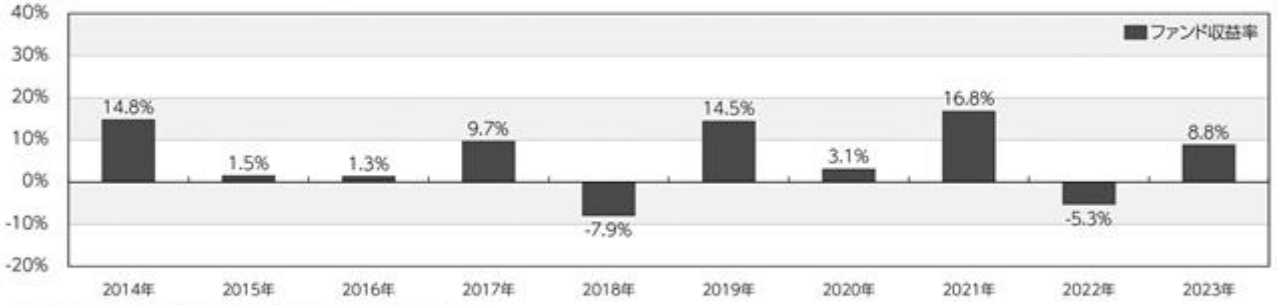
■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	9.36
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.55
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.72
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.02
5	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.82

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。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

・解約価額

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

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社への問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

信託期間は2007年1月26日から無期限です。

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

（4）【計算期間】

a.計算期間は原則として毎奇数月の12日から翌奇数月の11日までとします。

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

（５）【その他】

イ.償還規定

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ロ.信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

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

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ.運用報告書

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

4【受益者の権利等】

①収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。
受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。
収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

②償還金請求権

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

③一部解約請求権

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

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

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

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2022年11月12日から2023年5月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2022年11月11日現在	当期 2023年5月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,558,262	7,121,028
親投資信託受益証券	429,805,093	426,922,978
流動資産合計	435,363,355	434,044,006
資産合計	435,363,355	434,044,006
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	500,740	491,703
未払解約金	7,903	257,547
未払受託者報酬	30,878	30,060
未払委託者報酬	355,240	345,863
その他未払費用	2,717	2,641
流動負債合計	897,478	1,127,814
負債合計	897,478	1,127,814
純資産の部		
元本等		
元本	333,826,735	327,802,086
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	100,639,142	105,114,106
（分配準備積立金）	111,935,227	110,353,104
元本等合計	434,465,877	432,916,192
純資産合計	434,465,877	432,916,192
負債純資産合計	435,363,355	434,044,006

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2022年5月12日 至　2022年11月11日	当期 自　2022年11月12日 至　2023年5月11日
営業収益		
受取利息	32	24
有価証券売買等損益	16,808,786	8,633,585
営業収益合計	16,808,818	8,633,609
営業費用		
支払利息	1,204	1,301
受託者報酬	94,832	91,833
委託者報酬	1,090,897	1,056,540
その他費用	8,349	8,070
営業費用合計	1,195,282	1,157,744
営業利益又は営業損失（△）	15,613,536	7,475,865
経常利益又は経常損失（△）	15,613,536	7,475,865
当期純利益又は当期純損失（△）	15,613,536	7,475,865
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（△）	△18,626	△250,185
期首剰余金又は期首欠損金（△）	86,125,544	100,639,142
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,499,888	1,597,534
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,499,888	1,597,534
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,114,265	3,370,307
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,114,265	3,370,307
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	1,504,187	1,478,313
期末剰余金又は期末欠損金（△）	100,639,142	105,114,106

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	当期 自　2022年11月12日 至　2023年5月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	前期 2022年11月11日現在	当期 2023年5月11日現在
１．　期首元本額	332,442,384円	333,826,735円
期中追加設定元本額	8,745,065円	5,725,706円
期中一部解約元本額	7,360,714円	11,750,355円
２．　受益権の総数	333,826,735口	327,802,086口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自　2022年5月12日 至　2022年11月11日	当期 自　2022年11月12日 至　2023年5月11日
１．　分配金の計算過程	（自2022年5月12日　至2022年7月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,031,361円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（18,380,896円）及び分配準備積立金（109,598,654円）より分配対象収益は129,010,911円（1万口当たり3,866.38円）であり、うち500,510円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （自2022年7月12日　至2022年9月12日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,047,941円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（1,822,287円）、信託約款に規定される収益調整金（19,486,153円）及び分配準備積立金（109,650,115円）より分配対象収益は132,006,496円（1万口当たり3,937.06円）であり、うち502,937円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	（自2022年11月12日　至2023年1月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（652,934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（20,117,956円）及び分配準備積立金（109,459,272円）より分配対象収益は130,230,162円（1万口当たり3,969.61円）であり、うち492,101円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （自2023年1月12日　至2023年3月13日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（982,930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（21,253,585円）及び分配準備積立金（109,121,553円）より分配対象収益は131,358,068円（1万口当たり3,984.49円）であり、うち494,509円（1万口当たり15円）を分配金額としております。

	（自2022年9月13日　至2022年11月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,418,514円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（19,915,359円）及び分配準備積立金（111,017,453円）より分配対象収益は132,351,326円（1万口当たり3,964.67円）であり、うち500,740円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	（自2023年3月14日　至2023年5月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,181,608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（21,458,778円）及び分配準備積立金（108,663,199円）より分配対象収益は132,303,585円（1万口当たり4,036.08円）であり、うち491,703円（1万口当たり15円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自　2022年5月12日 至　2022年11月11日	当期 自　2022年11月12日 至　2023年5月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 2022年11月11日現在	当期 2023年5月11日現在

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

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	前期 2022年11月11日現在	当期 2023年5月11日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△5,582,459	17,670,586
合計	△5,582,459	17,670,586

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	前期 2022年11月11日現在	当期 2023年5月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3015円 (13,015円)	1.3207円 (13,207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5月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	29,168,729	104,686,568	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	76,877,550	97,588,361	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	12,819,640	30,018,469	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	17,883,685	113,663,336	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	24,213,150	50,397,250	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	18,689,774	30,568,994	
親投資信託受益証券　合計		179,652,528	426,922,978	
合計			426,922,978	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年5月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,370,143,735
株式	416,736,177,780
派生商品評価勘定	308,055,150
未収配当金	4,543,481,401
差入委託証拠金	449,625,000
流動資産合計	429,407,483,066
資産合計	429,407,483,066
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	182,970
前受金	338,210,000
未払解約金	846,232,000
流動負債合計	1,184,624,970
負債合計	1,184,624,970
純資産の部	
元本等	
元本	119,316,793,450
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	308,906,064,646
元本等合計	428,222,858,096
純資産合計	428,222,858,096
負債純資産合計	429,407,483,066

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11月12日 至　2023年5月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年5月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	112,340,543,501円
同期中追加設定元本額	33,541,091,292円
同期中一部解約元本額	26,564,841,343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	2,612,091,880円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,268,713,818円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	25,881,917,420円
ＤＩAM国内株式パッシブ・ファンド	4,598,953,796円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,919,058円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	12,695,470円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	29,741,680円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	25,579,473円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	26,252,146円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	25,005,856円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,798,233,072円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,523,554,059円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	53,649,267円
たわらノーロード　バランス（標準型）	355,699,895円
たわらノーロード　バランス（積極型）	567,613,512円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	3,035,598円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	172,327,816円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	439,581,334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）	340,498,937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）	452,269,529円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	397,799円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,690,119円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	34,078,224円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,302,340円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,713,429円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,309,995,849円
Ｏｎｅグローバルバランス	17,167,565円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,042,254,288円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,578,861,903円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,953,125,569円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	333,204,785円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,060,259,081円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,123,763,139円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	29,168,729円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,079,733,764円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	14,869,106円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	315,035,192円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	351,109,262円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	566,577,160円
投資のソムリエ	9,196,036,090円
クルーズコントロール	452,265,594円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	716,784,816円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	362,007,850円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	930,546,095円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	733,910,233円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,930,898,203円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	37,067,302円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	18,335,254円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,254,799円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	94,353,123円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	500,990,483円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,484,643,474円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	262,933,027円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	43,863,574円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	20,229,926円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	12,154,806円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	404,573,192円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	2,657,065円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,949,928円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	44,575,506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）	55,891,882円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	57,225,511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）	40,272,351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）	35,136,605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）	55,226,539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）	139,105,012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）	198,117,875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）	50,019,791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）	174,360,992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）	463,170,806円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	244,415,180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）	29,803,715円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,555,014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）	197,723,450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）	93,198,630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）	3,778,231円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	8,245,298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）	42,380,134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）	87,744,623円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,977,625円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,056,286円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,980,420円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	89,050円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,627,092円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,890,331円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	383,918,840円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	491,887,783円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,459,239,358円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	13,124,691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）	19,684,313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）	201,900,154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）	39,693,270円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	63,348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）	257,593,292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）	15,470,729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）	50,813,938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）	115,047,613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）	162,001,951円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,245,784円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,496,340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）	567,298,181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）	44,458,208円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	28,995,654円
コア資産形成ファンド	19,523,044円
ＭＨＡＭトピックスファンド	766,343,729円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	48,096,243円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	3,561,338,508円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,467,959,145円

計	119,316,793,450円
２．　受益権の総数	119,316,793,450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11月12日 至　2023年5月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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5月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	19,518,604,471
合計	19,518,604,471

（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（2023年2月8日から2023年5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2023年5月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち１年超		
市場取引 先物取引 買建	11,226,225,000	－	11,534,280,000	308,055,000
合計	11,226,225,000	－	11,534,280,000	308,055,000

（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5月11日現在
1口当たり純資産額	3.5890円
（1万口当たり純資産額）	(35,890円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年5月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,400	3,560.00	26,344,000	
ニッスイ	196,100	587.00	115,110,700	
マルハニチロ	29,100	2,576.00	74,961,600	
雪国まいたけ	16,700	1,037.00	17,317,900	
カネコ種苗	6,000	1,590.00	9,540,000	
サカタのタネ	22,300	3,995.00	89,088,500	
ホクト	17,500	1,859.00	32,532,500	
ホクリヨウ	2,200	779.00	1,713,800	
ショーボンドホールディングス	26,700	5,800.00	154,860,000	
ミライト・ワン	64,900	1,693.00	109,875,700	

タマホーム	12,300	3,885.00	47,785,500	
サンヨーホームズ	1,900	717.00	1,362,300	
日本アクア	6,400	910.00	5,824,000	
ファーストコーポレーション	3,900	941.00	3,669,900	
ベステラ	3,300	922.00	3,042,600	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	33,400	234.00	7,815,600	
キャンディル	2,800	572.00	1,601,600	
住石ホールディングス	23,700	336.00	7,963,200	
日鉄鉱業	7,900	3,835.00	30,296,500	
三井松島ホールディングス	8,900	3,130.00	27,857,000	
ＩＮＰＥＸ	725,300	1,476.00	1,070,542,800	
石油資源開発	22,700	4,555.00	103,398,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8,900	2,308.00	20,541,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	933.00	2,892,300	
第一カッター興業	5,000	1,292.00	6,460,000	
明豊ファシリティワークス	5,600	793.00	4,440,800	
安藤・間	113,600	907.00	103,035,200	
東急建設	55,800	741.00	41,347,800	
コムシスホールディングス	66,400	2,661.00	176,690,400	
ビーアールホールディングス	31,200	390.00	12,168,000	
高松コンストラクショングループ	12,800	2,321.00	29,708,800	
東建コーポレーション	5,600	7,690.00	43,064,000	
ソネック	1,700	975.00	1,657,500	
ヤマウラ	10,000	1,207.00	12,070,000	
オリエンタル白石	70,400	331.00	23,302,400	
大成建設	128,400	4,730.00	607,332,000	
大林組	490,500	1,089.00	534,154,500	
清水建設	412,400	827.00	341,054,800	
飛島建設	15,100	1,149.00	17,349,900	
長谷工コーポレーション	141,600	1,659.00	234,914,400	
松井建設	12,800	718.00	9,190,400	
錢高組	1,400	3,590.00	5,026,000	
鹿島建設	304,100	1,813.00	551,333,300	
不動テトラ	9,500	1,815.00	17,242,500	
大末建設	3,900	1,276.00	4,976,400	
鉄建建設	9,800	2,015.00	19,747,000	
西松建設	23,300	3,300.00	76,890,000	
三井住友建設	110,600	380.00	42,028,000	
大豊建設	5,700	3,980.00	22,686,000	
佐田建設	6,800	490.00	3,332,000	
ナカノフドー建設	7,600	410.00	3,116,000	
奥村組	22,200	3,490.00	77,478,000	
東鉄工業	18,900	2,750.00	51,975,000	
イチケン	2,400	1,954.00	4,689,600	
富士ピー・エス	4,900	442.00	2,165,800	
淺沼組	11,000	3,145.00	34,595,000	
戸田建設	168,800	822.00	138,753,600	
熊谷組	23,000	2,880.00	66,240,000	
北野建設	2,000	3,310.00	6,620,000	
植木組	3,100	1,344.00	4,166,400	

矢作建設工業	18,700	1,036.00	19,373,200	
ピーエス三菱	17,400	684.00	11,901,600	
日本ハウスホールディングス	27,200	392.00	10,662,400	
大東建託	50,500	13,070.00	660,035,000	
新日本建設	19,300	1,055.00	20,361,500	
東亜道路工業	5,500	4,535.00	24,942,500	
日本道路	2,800	8,000.00	22,400,000	
東亜建設工業	11,800	3,020.00	35,636,000	
日本国土開発	41,100	623.00	25,605,300	
若築建設	6,100	4,400.00	26,840,000	
東洋建設	44,400	972.00	43,156,800	
五洋建設	194,500	675.00	131,287,500	
世紀東急工業	17,700	1,290.00	22,833,000	
福田組	5,200	4,845.00	25,194,000	
日本ドライケミカル	2,600	1,795.00	4,667,000	
住友林業	105,200	2,952.00	310,550,400	
日本基礎技術	6,500	551.00	3,581,500	
巴コーポレーション	12,000	478.00	5,736,000	
大和ハウス工業	383,300	3,464.00	1,327,751,200	
ライト工業	25,400	2,037.00	51,739,800	
積水ハウス	429,700	2,796.00	1,201,441,200	
日特建設	13,100	990.00	12,969,000	
北陸電気工事	9,500	866.00	8,227,000	
ユアテック	30,300	853.00	25,845,900	
日本リーテック	12,100	1,325.00	16,032,500	
四電工	5,800	1,955.00	11,339,000	
中電工	21,300	2,246.00	47,839,800	
関電工	75,300	1,072.00	80,721,600	
きんでん	96,600	1,856.00	179,289,600	
東京エネシス	13,700	953.00	13,056,100	
トーエネック	4,500	3,650.00	16,425,000	
住友電設	13,100	2,875.00	37,662,500	
日本電設工業	22,600	1,972.00	44,567,200	
エクシオグループ	63,200	2,563.00	161,981,600	
新日本空調	7,600	2,084.00	15,838,400	
日本工営	8,700	3,795.00	33,016,500	
九電工	33,400	3,570.00	119,238,000	
三機工業	30,500	1,514.00	46,177,000	
日揮ホールディングス	135,700	1,652.00	224,176,400	
中外炉工業	4,500	1,835.00	8,257,500	
ヤマト	8,900	988.00	8,793,200	
太平電業	8,500	4,180.00	35,530,000	
高砂熱学工業	33,100	2,357.00	78,016,700	
三晃金属工業	1,300	3,945.00	5,128,500	
ＮＥＣネッツエスアイ	46,900	1,858.00	87,140,200	
朝日工業社	5,700	2,501.00	14,255,700	
明星工業	23,600	917.00	21,641,200	
大氣社	15,800	3,740.00	59,092,000	
ダイダン	9,000	2,501.00	22,509,000	
日比谷総合設備	11,800	2,265.00	26,727,000	

ニップン	37,100	1,775.00	65,852,500	
日清製粉グループ本社	127,400	1,715.00	218,491,000	
日東富士製粉	2,300	4,595.00	10,568,500	
昭和産業	12,000	2,654.00	31,848,000	
鳥越製粉	8,500	632.00	5,372,000	
中部飼料	19,100	1,087.00	20,761,700	
フィード・ワン	20,100	749.00	15,054,900	
東洋精糖	2,000	931.00	1,862,000	
日本甜菜製糖	8,000	1,704.00	13,632,000	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	13,700	2,309.00	31,633,300	
塩水港精糖	12,900	203.00	2,618,700	
ウェルネオシュガー	7,100	1,754.00	12,453,400	
ＬＩＦＵＬＬ	49,100	219.00	10,752,900	
ＭＩＸＩ	32,700	2,885.00	94,339,500	
ジェイエイシーリクルートメント	13,000	2,541.00	33,033,000	
日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	246,700	1,013.00	249,907,100	
メンバーズ	4,200	1,471.00	6,178,200	
中広	1,000	396.00	396,000	
ＵＴグループ	21,100	2,659.00	56,104,900	
アイティメディア	5,500	1,280.00	7,040,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	8,400	1,616.00	13,574,400	
オープンアップグループ	43,100	1,937.00	83,484,700	
コシダカホールディングス	43,100	1,125.00	48,487,500	
アルトナー	2,700	1,424.00	3,844,800	
パソナグループ	17,500	1,867.00	32,672,500	
ＣＤＳ	2,800	1,847.00	5,171,600	
リンクアンドモチベーション	41,400	480.00	19,872,000	
エス・エム・エス	54,700	3,070.00	167,929,000	
サニーサイドアップグループ	3,300	756.00	2,494,800	
パーソルホールディングス	161,000	2,819.00	453,859,000	
リニカル	6,400	708.00	4,531,200	
クックパッド	39,300	189.00	7,427,700	
エスクリ	4,500	463.00	2,083,500	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,500	661.00	3,635,500	
森永製菓	25,200	4,095.00	103,194,000	
中村屋	3,400	3,135.00	10,659,000	
江崎グリコ	39,400	3,570.00	140,658,000	
名糖産業	5,400	1,741.00	9,401,400	
井村屋グループ	7,500	2,321.00	17,407,500	
不二家	9,400	2,483.00	23,340,200	
山崎製パン	92,200	1,938.00	178,683,600	
第一屋製パン	2,100	401.00	842,100	
モロゾフ	4,400	3,725.00	16,390,000	
亀田製菓	8,800	4,280.00	37,664,000	
寿スピリッツ	14,700	9,930.00	145,971,000	
カルビー	63,000	2,789.00	175,707,000	
森永乳業	25,000	5,070.00	126,750,000	
六甲バター	10,100	1,408.00	14,220,800	
ヤクルト本社	98,400	9,940.00	978,096,000	
明治ホールディングス	170,700	3,235.00	552,214,500	

雪印メグミルク	33,300	1,968.00	65,534,400	
プリマハム	18,500	2,263.00	41,865,500	
日本ハム	53,800	3,805.00	204,709,000	
林兼産業	3,300	487.00	1,607,100	
丸大食品	13,900	1,514.00	21,044,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	15,200	3,080.00	46,816,000	
柿安本店	5,400	2,265.00	12,231,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	105,200	735.00	77,322,000	
学情	6,500	1,650.00	10,725,000	
スタジオアリス	7,200	2,161.00	15,559,200	
クロスキャット	8,000	1,278.00	10,224,000	
シミックホールディングス	6,900	1,992.00	13,744,800	
エプコ	2,400	738.00	1,771,200	
システナ	235,800	295.00	69,561,000	
ＮＪＳ	2,700	2,264.00	6,112,800	
デジタルアーツ	8,900	5,530.00	49,217,000	
日鉄ソリューションズ	23,900	3,980.00	95,122,000	
綜合警備保障	53,400	3,890.00	207,726,000	
キューブシステム	8,300	1,189.00	9,868,700	
いちご	158,600	248.00	39,332,800	
日本駐車場開発	145,800	242.00	35,283,600	
コア	6,200	1,733.00	10,744,600	
カカクコム	105,500	1,967.00	207,518,500	
アイロムグループ	5,200	1,841.00	9,573,200	
セントケア・ホールディング	9,200	784.00	7,212,800	
サイネックス	1,900	572.00	1,086,800	
ルネサンス	10,100	932.00	9,413,200	
ディップ	25,200	3,465.00	87,318,000	
ＳＢＳホールディングス	12,500	3,165.00	39,562,500	
デジタルホールディングス	11,200	1,082.00	12,118,400	
新日本科学	15,200	2,294.00	34,868,800	
キャリアデザインセンター	2,300	1,665.00	3,829,500	
ベネフィット・ワン	66,600	1,933.00	128,737,800	
エムスリー	284,100	3,046.00	865,368,600	
ツカダ・グローバルホールディング	7,200	468.00	3,369,600	
ブラス	1,300	1,108.00	1,440,400	
アウトソーシング	85,600	1,423.00	121,808,800	
ウェルネット	8,500	632.00	5,372,000	
ワールドホールディングス	6,500	2,792.00	18,148,000	
ディー・エヌ・エー	57,500	1,954.00	112,355,000	
博報堂ＤＹホールディングス	183,400	1,623.00	297,658,200	
ぐるなび	26,400	368.00	9,715,200	
タカミヤ	19,600	459.00	8,996,400	
ジャパンベストレスキューシステム	7,200	736.00	5,299,200	
ファンコミュニケーションズ	28,300	417.00	11,801,100	
ライク	5,400	1,846.00	9,968,400	
ビジネス・ブレークスルー	4,200	433.00	1,818,600	
エスプール	41,300	612.00	25,275,600	
ＷＤＢホールディングス	7,400	2,060.00	15,244,000	
手間いらず	2,400	4,510.00	10,824,000	

ティア	6,600	464.00	3,062,400	
ＣＤＧ	1,200	1,357.00	1,628,400	
アドウェイズ	19,800	710.00	14,058,000	
バリューコマース	10,800	1,378.00	14,882,400	
インフォマート	149,300	296.00	44,192,800	
サッポロホールディングス	45,300	3,710.00	168,063,000	
アサヒグループホールディングス	318,200	5,231.00	1,664,504,200	
キリンホールディングス	621,500	2,098.50	1,304,217,750	
宝ホールディングス	94,000	1,057.00	99,358,000	
オエノンホールディングス	41,200	326.00	13,431,200	
養命酒製造	4,500	1,851.00	8,329,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	107,900	1,483.00	160,015,700	
サントリー食品インターナショナル	97,000	5,000.00	485,000,000	
ダイドーグループホールディングス	7,800	5,050.00	39,390,000	
伊藤園	46,700	4,070.00	190,069,000	
キーコーヒー	15,400	2,087.00	32,139,800	
ユニカフェ	3,600	908.00	3,268,800	
ジャパンフーズ	1,700	1,108.00	1,883,600	
日清オイリオグループ	19,400	3,320.00	64,408,000	
不二製油グループ本社	32,100	2,048.00	65,740,800	
かどや製油	1,200	3,580.00	4,296,000	
Ｊ－オイルミルズ	14,000	1,600.00	22,400,000	
ローソン	36,700	6,260.00	229,742,000	
サンエー	11,300	4,680.00	52,884,000	
カワチ薬品	11,600	2,192.00	25,427,200	
エービーシー・マート	21,600	7,800.00	168,480,000	
ハードオフコーポレーション	4,600	1,416.00	6,513,600	
高千穂交易	4,100	2,353.00	9,647,300	
アスクル	30,600	1,774.00	54,284,400	
ゲオホールディングス	14,500	1,693.00	24,548,500	
アダストリア	17,900	2,627.00	47,023,300	
ジーフット	7,000	277.00	1,939,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,500	482.00	723,000	
オルバヘルスケアホールディングス	1,700	1,794.00	3,049,800	
伊藤忠食品	3,300	5,290.00	17,457,000	
くら寿司	17,300	3,185.00	55,100,500	
キャンドゥ	5,300	2,462.00	13,048,600	
エレマテック	13,300	1,818.00	24,179,400	
ＩＫホールディングス	3,600	400.00	1,440,000	
パルグループホールディングス	14,500	3,290.00	47,705,000	
エディオン	58,600	1,366.00	80,047,600	
あらた	11,300	4,310.00	48,703,000	
サーラコーポレーション	31,100	774.00	24,071,400	
ワッツ	5,600	707.00	3,959,200	
トーメンデバイス	2,100	5,540.00	11,634,000	
ハローズ	6,700	3,220.00	21,574,000	
ＪＰホールディングス	41,300	312.00	12,885,600	
フジオフードグループ本社	16,400	1,455.00	23,862,000	
あみやき亭	3,600	3,655.00	13,158,000	

東京エレクトロン　デバイス	5,500	8,100.00	44,550,000	
ひらまつ	24,700	299.00	7,385,300	
円谷フィールズホールディングス	25,400	1,740.00	44,196,000	
双日	157,100	2,827.00	444,121,700	
アルフレッサ　ホールディングス	148,500	2,014.00	299,079,000	
大黒天物産	4,500	5,290.00	23,805,000	
ハニーズホールディングス	11,700	1,600.00	18,720,000	
ファーマライズホールディングス	2,600	636.00	1,653,600	
キッコーマン	91,300	7,710.00	703,923,000	
味の素	332,500	4,832.00	1,606,640,000	
ブルドックソース	7,300	2,058.00	15,023,400	
キユーピー	74,000	2,289.00	169,386,000	
ハウス食品グループ本社	42,200	3,170.00	133,774,000	
カゴメ	64,200	3,350.00	215,070,000	
焼津水産化学工業	4,200	830.00	3,486,000	
アリアケジャパン	12,000	5,380.00	64,560,000	
ピエトロ	1,600	1,817.00	2,907,200	
エバラ食品工業	3,700	3,055.00	11,303,500	
やまみ	1,000	1,412.00	1,412,000	
ニチレイ	63,100	2,975.00	187,722,500	
横浜冷凍	40,300	1,108.00	44,652,400	
東洋水産	69,600	5,950.00	414,120,000	
イートアンドホールディングス	5,800	2,261.00	13,113,800	
大冷	1,300	1,911.00	2,484,300	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,700	928.00	8,073,600	
日清食品ホールディングス	48,400	12,040.00	582,736,000	
永谷園ホールディングス	6,800	2,156.00	14,660,800	
一正蒲鉾	4,600	798.00	3,670,800	
フジッコ	14,100	1,917.00	27,029,700	
ロック・フィールド	15,400	1,490.00	22,946,000	
日本たばこ産業	906,600	2,964.00	2,687,162,400	
ケンコーマヨネーズ	9,500	1,244.00	11,818,000	
わらべや日洋ホールディングス	10,100	2,290.00	23,129,000	
なとり	8,700	1,947.00	16,938,900	
イフジ産業	1,900	1,067.00	2,027,300	
ファーマフーズ	19,800	1,749.00	34,630,200	
北の達人コーポレーション	59,000	286.00	16,874,000	
ユーグレナ	89,000	893.00	79,477,000	
紀文食品	10,700	1,103.00	11,802,100	
ピックルスホールディングス	8,100	1,188.00	9,622,800	
スター・マイカ・ホールディングス	12,400	643.00	7,973,200	
ＳＲＥホールディングス	6,800	3,660.00	24,888,000	
ＡＤワークスグループ	26,900	185.00	4,976,500	
片倉工業	12,900	1,791.00	23,103,900	
グンゼ	10,000	4,670.00	46,700,000	
ヒューリック	321,300	1,162.00	373,350,600	
神栄	1,500	1,134.00	1,701,000	
ラサ商事	5,300	1,443.00	7,647,900	
アルペン	12,200	2,007.00	24,485,400	
ハブ	3,800	825.00	3,135,000	

ラクーンホールディングス	11,600	720.00	8,352,000	
クオールホールディングス	20,400	1,245.00	25,398,000	
アルコニックス	19,500	1,410.00	27,495,000	
神戸物産	114,500	3,975.00	455,137,500	
ソリトンシステムズ	7,200	1,043.00	7,509,600	
ジンズホールディングス	8,800	3,025.00	26,620,000	
ビックカメラ	78,700	1,116.00	87,829,200	
ＤＣＭホールディングス	90,300	1,331.00	120,189,300	
ペッパーフードサービス	33,900	168.00	5,695,200	
ハイパー	2,200	454.00	998,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	209,800	1,951.00	409,319,800	
東京一番フーズ	2,700	499.00	1,347,300	
ＤＤホールディングス	7,400	1,229.00	9,094,600	
あい　ホールディングス	23,700	2,384.00	56,500,800	
ディーブイエックス	3,200	1,003.00	3,209,600	
きちりホールディングス	2,700	857.00	2,313,900	
アークランドサービスホールディングス	12,100	3,020.00	36,542,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	184,000	1,434.00	263,856,000	
ドトール・日レスホールディングス	26,200	2,069.00	54,207,800	
マツキヨココカラ＆カンパニー	89,700	7,240.00	649,428,000	
ブロンコビリー	7,900	2,760.00	21,804,000	
ＺＯＺＯ	97,800	2,931.00	286,651,800	
トレジャー・ファクトリー	7,100	1,654.00	11,743,400	
物語コーポレーション	24,700	3,005.00	74,223,500	
三越伊勢丹ホールディングス	249,100	1,454.00	362,191,400	
東洋紡	60,500	1,045.00	63,222,500	
ユニチカ	42,200	212.00	8,946,400	
富士紡ホールディングス	5,500	3,245.00	17,847,500	
日清紡ホールディングス	115,000	1,037.00	119,255,000	
倉敷紡績	10,500	2,398.00	25,179,000	
ダイワボウホールディングス	60,500	2,654.00	160,567,000	
シキボウ	6,000	1,008.00	6,048,000	
日東紡績	15,800	1,868.00	29,514,400	
トヨタ紡織	58,900	2,163.00	127,400,700	
マクニカホールディングス	35,000	4,360.00	152,600,000	
Ｈａｍｅｅ	5,100	995.00	5,074,500	
マーケットエンタープライズ	1,200	1,370.00	1,644,000	
ラクト・ジャパン	5,700	2,048.00	11,673,600	
ウエルシアホールディングス	76,800	2,924.00	224,563,200	
クリエイトＳＤホールディングス	24,500	3,355.00	82,197,500	
グリムス	6,200	2,140.00	13,268,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,600	935.00	20,196,000	
八洲電機	12,000	1,286.00	15,432,000	
メディアスホールディングス	9,500	825.00	7,837,500	
レスターホールディングス	14,200	2,177.00	30,913,400	
ジューテックホールディングス	2,700	1,151.00	3,107,700	
丸善ＣＨＩホールディングス	13,600	359.00	4,882,400	
大光	4,800	627.00	3,009,600	

ＯＣＨＩホールディングス	2,600	1,248.00	3,244,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	73,100	879.00	64,254,900	
黒谷	3,300	604.00	1,993,200	
ミサワ	2,100	622.00	1,306,200	
ティーライフ	1,600	1,355.00	2,168,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,300	773.00	1,777,900	
エー・ピーホールディングス	2,400	784.00	1,881,600	
三洋貿易	16,700	1,258.00	21,008,600	
チムニー	3,600	1,379.00	4,964,400	
シュッピン	11,000	971.00	10,681,000	
ビューティガレージ	2,300	3,855.00	8,866,500	
オイシックス・ラ・大地	19,900	2,628.00	52,297,200	
ウイン・パートナーズ	10,800	1,005.00	10,854,000	
ネクステージ	33,800	2,291.00	77,435,800	
ジョイフル本田	44,000	1,775.00	78,100,000	
鳥貴族ホールディングス	5,500	2,417.00	13,293,500	
ホットランド	11,300	1,629.00	18,407,700	
すかいらーくホールディングス	202,300	1,842.00	372,636,600	
ＳＦＰホールディングス	8,100	2,033.00	16,467,300	
綿半ホールディングス	11,500	1,411.00	16,226,500	
日本毛織	37,000	1,023.00	37,851,000	
ダイトウボウ	17,600	94.00	1,654,400	
トーア紡コーポレーション	4,300	356.00	1,530,800	
ダイドーリミテッド	15,700	291.00	4,568,700	
ヨシックスホールディングス	2,300	2,363.00	5,434,900	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	48,200	1,164.00	56,104,800	
三栄建築設計	6,700	1,482.00	9,929,400	
野村不動産ホールディングス	86,100	3,340.00	287,574,000	
三重交通グループホールディングス	29,500	557.00	16,431,500	
サムティ	21,900	2,199.00	48,158,100	
ディア・ライフ	23,500	724.00	17,014,000	
コーセーアールイー	3,400	772.00	2,624,800	
地主	10,500	1,954.00	20,517,000	
プレサンスコーポレーション	21,700	2,032.00	44,094,400	
フィル・カンパニー	2,400	870.00	2,088,000	
ＴＨＥグローバル社	6,200	232.00	1,438,400	
ハウスコム	1,700	1,054.00	1,791,800	
ＪＰＭＣ	7,000	1,147.00	8,029,000	
サンセイランディック	3,100	869.00	2,693,900	
エストラスト	1,400	633.00	886,200	
フージャースホールディングス	21,200	847.00	17,956,400	
オープンハウスグループ	50,500	5,720.00	288,860,000	
東急不動産ホールディングス	414,100	726.00	300,636,600	
飯田グループホールディングス	120,700	2,448.00	295,473,600	
イーグランド	1,600	1,470.00	2,352,000	
ムゲンエステート	7,200	648.00	4,665,600	
帝国繊維	15,800	1,736.00	27,428,800	
日本コークス工業	126,700	93.00	11,783,100	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	923.00	6,184,100	

ミタチ産業	2,900	1,372.00	3,978,800	
ＢＥＥＮＯＳ	6,300	1,952.00	12,297,600	
あさひ	12,300	1,303.00	16,026,900	
日本調剤	10,100	1,124.00	11,352,400	
コスモス薬品	14,600	14,370.00	209,802,000	
シップヘルスケアホールディングス	53,200	2,441.00	129,861,200	
トーエル	5,100	760.00	3,876,000	
ソフトクリエイトホールディングス	11,500	1,718.00	19,757,000	
セブン&アイ・ホールディングス	510,000	6,270.00	3,197,700,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	111,300	1,002.00	111,522,600	
明治電機工業	5,500	1,212.00	6,666,000	
ツルハホールディングス	31,100	9,000.00	279,900,000	
デリカフーズホールディングス	4,500	611.00	2,749,500	
スターティアホールディングス	2,200	1,516.00	3,335,200	
サンマルクホールディングス	11,900	1,888.00	22,467,200	
フェリシモ	2,600	1,010.00	2,626,000	
トリドールホールディングス	36,800	2,958.00	108,854,400	
帝人	134,600	1,413.00	190,189,800	
東レ	938,700	754.30	708,061,410	
クラレ	222,800	1,239.00	276,049,200	
旭化成	874,900	959.90	839,816,510	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	15,200	442.00	6,718,400	
稲葉製作所	7,500	1,479.00	11,092,500	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	3,985.00	15,940,000	
トーカロ	39,700	1,316.00	52,245,200	
アルファ	4,100	1,030.00	4,223,000	
ＳＵＭＣＯ	274,700	1,887.00	518,358,900	
川田テクノロジーズ	3,400	4,035.00	13,719,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	9,600	3,020.00	28,992,000	
ジェイテックコーポレーション	1,500	2,390.00	3,585,000	
信和	6,200	720.00	4,464,000	
ビーロット	7,300	608.00	4,438,400	
ファーストブラザーズ	2,200	905.00	1,991,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	8,200	1,035.00	8,487,000	
シーアールイー	7,700	1,274.00	9,809,800	
プロパティエージェント	1,300	1,043.00	1,355,900	
ケイアイスター不動産	6,600	4,270.00	28,182,000	
アグレ都市デザイン	1,900	1,560.00	2,964,000	
グッドコムアセット	12,800	780.00	9,984,000	
ジェイ・エス・ビー	3,400	4,290.00	14,586,000	
ロードスターキャピタル	7,800	1,421.00	11,083,800	
テンポイノベーション	3,200	1,203.00	3,849,600	
グローバル・リンク・マネジメント	2,000	1,175.00	2,350,000	
フェイスネットワーク	2,900	808.00	2,343,200	
住江織物	2,200	2,349.00	5,167,800	
日本フエルト	6,100	421.00	2,568,100	
イチカワ	1,400	1,361.00	1,905,400	
エコナックホールディングス	19,300	110.00	2,123,000	
日東製網	1,100	1,405.00	1,545,500	

芦森工業	2,000	1,491.00	2,982,000	
アツギ	6,300	422.00	2,658,600	
ウイルプラスホールディングス	1,800	1,052.00	1,893,600	
ＪＭホールディングス	11,200	1,994.00	22,332,800	
コメダホールディングス	36,200	2,614.00	94,626,800	
サツドラホールディングス	5,200	835.00	4,342,000	
アレンザホールディングス	11,100	994.00	11,033,400	
串カツ田中ホールディングス	3,900	1,706.00	6,653,400	
バロックジャパンリミテッド	9,600	860.00	8,256,000	
クスリのアオキホールディングス	13,200	6,600.00	87,120,000	
ダイニック	2,800	737.00	2,063,600	
共和レザー	6,300	540.00	3,402,000	
ピーバンドットコム	1,600	509.00	814,400	
力の源ホールディングス	6,600	1,373.00	9,061,800	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	78,900	3,300.00	260,370,000	
アセンテック	5,000	563.00	2,815,000	
セーレン	27,000	2,253.00	60,831,000	
ソトー	3,500	804.00	2,814,000	
東海染工	1,100	1,143.00	1,257,300	
小松マテーレ	20,300	677.00	13,743,100	
ワコールホールディングス	27,000	2,680.00	72,360,000	
ホギメディカル	18,800	3,390.00	63,732,000	
クラウディアホールディングス	2,500	581.00	1,452,500	
ＴＳＩホールディングス	47,200	703.00	33,181,600	
マツオカコーポレーション	3,000	1,402.00	4,206,000	
ワールド	18,000	1,597.00	28,746,000	
ＴＩＳ	153,400	3,880.00	595,192,000	
ＪＮＳホールディングス	5,000	417.00	2,085,000	
グリー	37,600	711.00	26,733,600	
GMOペパボ	2,000	1,695.00	3,390,000	
コーエーテクモホールディングス	87,900	2,415.00	212,278,500	
三菱総合研究所	6,900	5,070.00	34,983,000	
ボルテージ	3,100	313.00	970,300	
電算	900	1,800.00	1,620,000	
ＡＧＳ	4,600	726.00	3,339,600	
ファインデックス	11,100	636.00	7,059,600	
ブレインパッド	10,500	710.00	7,455,000	
ＫＬａｂ	27,900	390.00	10,881,000	
ポールトゥウィンホールディングス	24,000	936.00	22,464,000	
ネクソン	363,300	2,970.00	1,079,001,000	
アイスタイル	40,800	527.00	21,501,600	
エムアップホールディングス	17,200	1,215.00	20,898,000	
エイチーム	8,300	688.00	5,710,400	
エニグモ	17,800	415.00	7,387,000	
テクノスジャパン	9,000	581.00	5,229,000	
ｅｎｉｓｈ	8,200	526.00	4,313,200	
コロプラ	54,400	661.00	35,958,400	
オルトプラス	8,200	201.00	1,648,200	
ブロードリーフ	81,900	442.00	36,199,800	

クロス・マーケティンググループ	6,600	680.00	4,488,000	
デジタルハーツホールディングス	8,800	1,511.00	13,296,800	
システム情報	11,100	788.00	8,746,800	
メディアドゥ	5,700	1,352.00	7,706,400	
じげん	40,900	617.00	25,235,300	
ブイキューブ	16,800	524.00	8,803,200	
エンカレッジ・テクノロジ	2,600	530.00	1,378,000	
サイバーリンクス	3,500	902.00	3,157,000	
ディー・エル・イー	7,800	242.00	1,887,600	
フィックスターズ	15,800	1,440.00	22,752,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,600	1,464.00	9,662,400	
オプティム	11,500	947.00	10,890,500	
セレス	5,600	1,132.00	6,339,200	
ＳＨＩＦＴ	9,300	24,810.00	230,733,000	
特種東海製紙	6,300	3,060.00	19,278,000	
ティーガイア	14,700	1,656.00	24,343,200	
セック	1,500	3,255.00	4,882,500	
テクマトリックス	25,600	1,816.00	46,489,600	
プロシップ	6,100	1,383.00	8,436,300	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,100	2,685.00	110,353,500	
GMOペイメントゲートウェイ	28,000	10,770.00	301,560,000	
ザッパラス	3,000	355.00	1,065,000	
システムリサーチ	4,400	2,253.00	9,913,200	
インターネットイニシアティブ	78,300	2,820.00	220,806,000	
さくらインターネット	15,700	683.00	10,723,100	
ヴィンクス	3,200	1,445.00	4,624,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,300	4,165.00	17,909,500	
ＳＲＡホールディングス	7,200	3,085.00	22,212,000	
システムインテグレータ	3,300	428.00	1,412,400	
朝日ネット	15,100	593.00	8,954,300	
ｅＢＡＳＥ	19,700	735.00	14,479,500	
アバントグループ	17,700	1,367.00	24,195,900	
アドソル日進	5,900	1,861.00	10,979,900	
ＯＤＫソリューションズ	2,400	594.00	1,425,600	
フリービット	7,400	1,551.00	11,477,400	
コムチュア	18,600	2,065.00	38,409,000	
サイバーコム	1,800	1,562.00	2,811,600	
アステリア	11,000	633.00	6,963,000	
アイル	6,600	2,775.00	18,315,000	
王子ホールディングス	583,600	551.00	321,563,600	
日本製紙	73,000	1,114.00	81,322,000	
三菱製紙	13,100	486.00	6,366,600	
北越コーポレーション	88,500	927.00	82,039,500	
中越パルプ工業	4,400	1,073.00	4,721,200	
巴川製紙所	3,400	691.00	2,349,400	
大王製紙	61,900	1,141.00	70,627,900	
阿波製紙	2,600	587.00	1,526,200	
マークラインズ	7,600	2,320.00	17,632,000	

メディカル・データ・ビジョン	20,900	856.00	17,890,400	
ｇｕｍｉ	20,600	729.00	15,017,400	
ショーケース	2,500	307.00	767,500	
モバイルファクトリー	2,300	905.00	2,081,500	
テラスカイ	6,000	2,580.00	15,480,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,100	1,647.00	13,340,700	
ＰＣＩホールディングス	4,100	1,052.00	4,313,200	
アイビーシー	1,700	602.00	1,023,400	
ネオジャパン	4,700	933.00	4,385,100	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,500	1,412.00	4,942,000	
ラクス	66,300	2,066.00	136,975,800	
ランドコンピュータ	2,600	1,139.00	2,961,400	
ダブルスタンダード	5,700	2,086.00	11,890,200	
オープンドア	9,800	1,453.00	14,239,400	
マイネット	3,500	333.00	1,165,500	
アカツキ	6,700	2,269.00	15,202,300	
ベネフィットジャパン	700	1,197.00	837,900	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,300	2,449.00	10,530,700	
カナミックネットワーク	15,100	499.00	7,534,900	
ノムラシステムコーポレーション	10,300	114.00	1,174,200	
レンゴー	127,600	871.00	111,139,600	
トーモク	8,100	1,905.00	15,430,500	
ザ・パック	10,400	3,130.00	32,552,000	
チェンジホールディングス	34,300	2,321.00	79,610,300	
シンクロ・フード	6,900	480.00	3,312,000	
オークネット	6,900	1,728.00	11,923,200	
キャピタル・アセット・プランニング	2,100	711.00	1,493,100	
セグエグループ	3,000	957.00	2,871,000	
エイトレッド	1,700	1,450.00	2,465,000	
マクロミル	27,500	900.00	24,750,000	
ビーグリー	1,800	1,241.00	2,233,800	
オロ	4,200	2,490.00	10,458,000	
ユーザーローカル	5,000	2,016.00	10,080,000	
テモナ	2,400	285.00	684,000	
ニーズウェル	3,000	1,102.00	3,306,000	
マネーフォワード	33,800	5,460.00	184,548,000	
サインポスト	4,200	576.00	2,419,200	
レゾナック・ホールディングス	135,400	2,184.00	295,713,600	
住友化学	1,039,300	450.00	467,685,000	
住友精化	5,800	4,390.00	25,462,000	
日産化学	66,500	6,020.00	400,330,000	
ラサ工業	5,400	2,219.00	11,982,600	
クレハ	12,000	8,610.00	103,320,000	
多木化学	5,400	4,335.00	23,409,000	
テイカ	9,500	1,242.00	11,799,000	
石原産業	25,300	1,211.00	30,638,300	
片倉コープアグリ	2,200	1,709.00	3,759,800	
日本曹達	15,000	4,595.00	68,925,000	
東ソー	187,000	1,774.00	331,738,000	

トクヤマ	45,200	2,133.00	96,411,600	
セントラル硝子	22,500	2,895.00	65,137,500	
東亞合成	70,300	1,219.00	85,695,700	
大阪ソーダ	8,400	4,270.00	35,868,000	
関東電化工業	27,100	1,029.00	27,885,900	
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	9,900	1,144.00	11,325,600	
デンカ	51,000	2,699.00	137,649,000	
イビデン	81,000	6,120.00	495,720,000	
信越化学工業	1,164,500	3,982.00	4,637,039,000	
日本カーバイド工業	4,100	1,345.00	5,514,500	
電算システムホールディングス	6,800	2,673.00	18,176,400	
堺化学工業	10,700	1,871.00	20,019,700	
第一稀元素化学工業	12,800	1,003.00	12,838,400	
エア・ウォーター	132,200	1,825.00	241,265,000	
日本酸素ホールディングス	135,900	2,532.00	344,098,800	
日本化学工業	4,700	1,858.00	8,732,600	
東邦アセチレン	2,300	1,382.00	3,178,600	
日本パーカライジング	69,400	1,046.00	72,592,400	
高圧ガス工業	20,400	767.00	15,646,800	
チタン工業	1,300	1,441.00	1,873,300	
四国化成ホールディングス	16,700	1,421.00	23,730,700	
戸田工業	3,200	2,461.00	7,875,200	
ステラ　ケミファ	8,300	2,823.00	23,430,900	
保土谷化学工業	4,000	3,190.00	12,760,000	
日本触媒	21,300	5,390.00	114,807,000	
大日精化工業	9,700	1,864.00	18,080,800	
カネカ	32,000	3,690.00	118,080,000	
協和キリン	169,500	2,619.00	443,920,500	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	53,100	1,471.00	78,110,100	
三菱瓦斯化学	104,600	1,973.00	206,375,800	
三井化学	115,500	3,470.00	400,785,000	
ＪＳＲ	130,800	3,060.00	400,248,000	
東京応化工業	24,500	7,320.00	179,340,000	
大阪有機化学工業	10,500	2,093.00	21,976,500	
三菱ケミカルグループ	945,500	794.30	751,010,650	
ＫＨネオケム	23,300	2,300.00	53,590,000	
ダイセル	206,000	1,148.00	236,488,000	
住友ベークライト	20,800	5,080.00	105,664,000	
積水化学工業	286,500	1,905.00	545,782,500	
日本ゼオン	84,000	1,462.00	122,808,000	
アイカ工業	35,400	3,010.00	106,554,000	
ＵＢＥ	72,200	2,161.00	156,024,200	
積水樹脂	20,400	2,136.00	43,574,400	
タキロンシーアイ	30,700	523.00	16,056,100	
旭有機材	9,300	3,265.00	30,364,500	
ニチバン	8,700	2,012.00	17,504,400	
リケンテクノス	30,200	604.00	18,240,800	
大倉工業	6,500	2,116.00	13,754,000	
積水化成品工業	19,600	426.00	8,349,600	
群栄化学工業	2,800	2,659.00	7,445,200	

タイガースポリマー	5,100	514.00	2,621,400	
ミライアル	3,300	1,508.00	4,976,400	
ダイキアクシス	4,000	736.00	2,944,000	
ダイキョーニシカワ	31,000	682.00	21,142,000	
竹本容器	3,700	795.00	2,941,500	
森六ホールディングス	7,100	1,933.00	13,724,300	
恵和	9,100	1,359.00	12,366,900	
日本化薬	107,000	1,249.00	133,643,000	
カーリットホールディングス	12,600	697.00	8,782,200	
ソルクシーズ	8,800	390.00	3,432,000	
ＣＬホールディングス	4,000	937.00	3,748,000	
プレステージ・インターナショナル	60,500	593.00	35,876,500	
フェイス	3,100	509.00	1,577,900	
プロトコーポレーション	17,500	1,176.00	20,580,000	
ハイマックス	4,400	1,431.00	6,296,400	
アミューズ	7,800	1,844.00	14,383,200	
野村総合研究所	279,500	3,490.00	975,455,000	
ドリームインキュベータ	4,400	2,762.00	12,152,800	
サイバネットシステム	11,800	838.00	9,888,400	
クイック	11,000	1,973.00	21,703,000	
ＴＡＣ	5,500	206.00	1,133,000	
ＣＥホールディングス	5,600	575.00	3,220,000	
日本システム技術	4,500	2,080.00	9,360,000	
電通グループ	141,300	4,890.00	690,957,000	
インテージホールディングス	15,900	1,605.00	25,519,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,800	1,357.00	5,156,600	
東邦システムサイエンス	3,100	1,130.00	3,503,000	
ぴあ	4,800	3,410.00	16,368,000	
イオンファンタジー	6,200	3,220.00	19,964,000	
ソースネクスト	71,300	229.00	16,327,700	
シーティーエス	15,900	740.00	11,766,000	
ネクシィーズグループ	3,500	661.00	2,313,500	
インフォコム	18,100	2,221.00	40,200,100	
メディカルシステムネットワーク	12,800	398.00	5,094,400	
日本精化	8,000	2,536.00	20,288,000	
扶桑化学工業	13,000	3,705.00	48,165,000	
トリケミカル研究所	18,700	2,230.00	41,701,000	
シンプレクス・ホールディングス	24,000	2,429.00	58,296,000	
ＨＥＲＯＺ	4,700	1,311.00	6,161,700	
ラクスル	33,600	1,321.00	44,385,600	
メルカリ	84,500	2,649.00	223,840,500	
ＩＰＳ	4,600	2,545.00	11,707,000	
ＦＩＧ	12,600	291.00	3,666,600	
システムサポート	5,400	1,905.00	10,287,000	
ＡＤＥＫＡ	48,900	2,305.00	112,714,500	
日油	43,300	6,060.00	262,398,000	
ミヨシ油脂	3,800	1,001.00	3,803,800	
新日本理化	15,000	212.00	3,180,000	
ハリマ化成グループ	7,600	862.00	6,551,200	
イーソル	9,000	1,002.00	9,018,000	

アルテリア・ネットワークス	13,100	1,285.00	16,833,500	
東海ソフト	1,600	1,049.00	1,678,400	
ウイングアーク１ｓｔ	14,500	2,190.00	31,755,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,800	1,578.00	5,996,400	
サーバーワークス	2,800	1,982.00	5,549,600	
東名	800	1,991.00	1,592,800	
ヴィッツ	1,100	1,127.00	1,239,700	
トビラシステムズ	2,700	962.00	2,597,400	
Ｓａｎｓａｎ	45,900	1,715.00	78,718,500	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,600	992.00	2,579,200	
ギフティ	15,200	2,401.00	36,495,200	
花王	341,100	5,037.00	1,718,120,700	
第一工業製薬	5,000	1,900.00	9,500,000	
石原ケミカル	6,400	1,520.00	9,728,000	
日華化学	4,400	847.00	3,726,800	
ニイタカ	2,000	2,240.00	4,480,000	
三洋化成工業	8,600	4,235.00	36,421,000	
メドレー	18,800	3,770.00	70,876,000	
ベース	4,800	6,120.00	29,376,000	
ＪＭＤＣ	23,000	5,640.00	129,720,000	
武田薬品工業	1,241,400	4,565.00	5,666,991,000	
アステラス製薬	1,325,100	2,102.00	2,785,360,200	
住友ファーマ	104,000	788.00	81,952,000	
塩野義製薬	176,800	6,074.00	1,073,883,200	
わかもと製薬	10,200	252.00	2,570,400	
日本新薬	33,100	6,160.00	203,896,000	
中外製薬	439,100	3,532.00	1,550,901,200	
科研製薬	24,000	3,640.00	87,360,000	
エーザイ	170,600	7,929.00	1,352,687,400	
理研ビタミン	11,900	2,015.00	23,978,500	
ロート製薬	135,900	2,779.00	377,666,100	
小野薬品工業	270,600	2,561.00	693,006,600	
久光製薬	31,200	3,740.00	116,688,000	
有機合成薬品工業	8,100	296.00	2,397,600	
持田製薬	16,100	3,550.00	57,155,000	
参天製薬	255,600	1,158.00	295,984,800	
扶桑薬品工業	4,400	1,997.00	8,786,800	
日本ケミファ	1,100	1,819.00	2,000,900	
ツムラ	44,200	2,691.00	118,942,200	
テルモ	430,200	4,132.00	1,777,586,400	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	42,100	2,762.00	116,280,200	
キッセイ薬品工業	21,700	2,846.00	61,758,200	
生化学工業	26,800	833.00	22,324,400	
栄研化学	22,800	1,574.00	35,887,200	
鳥居薬品	7,500	3,375.00	25,312,500	
ＪＣＲファーマ	47,500	1,430.00	67,925,000	
東和薬品	21,600	1,916.00	41,385,600	
富士製薬工業	10,400	1,246.00	12,958,400	
ゼリア新薬工業	19,500	2,414.00	47,073,000	

そーせいグループ	48,200	2,805.00	135,201,000	
第一三共	1,222,000	4,515.00	5,517,330,000	
杏林製薬	30,400	1,720.00	52,288,000	
大幸薬品	25,500	380.00	9,690,000	
ダイト	9,800	2,500.00	24,500,000	
大塚ホールディングス	320,900	4,696.00	1,506,946,400	
大正製薬ホールディングス	31,200	5,410.00	168,792,000	
ペプチドリーム	68,000	1,865.00	126,820,000	
大日本塗料	17,100	918.00	15,697,800	
日本ペイントホールディングス	619,900	1,235.00	765,576,500	
関西ペイント	128,300	2,057.00	263,913,100	
神東塗料	9,400	137.00	1,287,800	
中国塗料	23,000	1,112.00	25,576,000	
日本特殊塗料	6,900	1,012.00	6,982,800	
藤倉化成	18,900	435.00	8,221,500	
太陽ホールディングス	21,300	2,601.00	55,401,300	
ＤＩＣ	54,800	2,513.00	137,712,400	
サカタインクス	31,200	1,097.00	34,226,400	
東洋インキＳＣホールディングス	27,500	2,187.00	60,142,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	12,500	1,143.00	14,287,500	
アルプス技研	12,500	2,559.00	31,987,500	
サニックス	23,000	289.00	6,647,000	
日本空調サービス	15,600	737.00	11,497,200	
オリエンタルランド	760,900	4,955.00	3,770,259,500	
フォーカスシステムズ	10,200	1,035.00	10,557,000	
ダスキン	32,000	3,340.00	106,880,000	
パーク２４	107,400	2,119.00	227,580,600	
明光ネットワークジャパン	17,400	656.00	11,414,400	
ファルコホールディングス	6,500	2,007.00	13,045,500	
クレスコ	10,800	1,921.00	20,746,800	
フジ・メディア・ホールディングス	134,700	1,306.00	175,918,200	
秀英予備校	2,500	409.00	1,022,500	
田谷	1,700	510.00	867,000	
ラウンドワン	120,200	632.00	75,966,400	
リゾートトラスト	56,800	2,252.00	127,913,600	
オービック	46,900	21,600.00	1,013,040,000	
ジャストシステム	20,200	4,065.00	82,113,000	
ＴＤＣソフト	11,800	1,526.00	18,006,800	
Ｚホールディングス	1,996,300	357.30	713,277,990	
ビー・エム・エル	17,800	3,085.00	54,913,000	
トレンドマイクロ	81,000	6,660.00	539,460,000	
りらいあコミュニケーションズ	23,700	1,460.00	34,602,000	
ＩＤホールディングス	9,500	1,132.00	10,754,000	
リソー教育	65,300	283.00	18,479,900	
日本オラクル	26,800	10,600.00	284,080,000	
早稲田アカデミー	8,000	1,433.00	11,464,000	
アルファシステムズ	4,400	4,290.00	18,876,000	
フューチャー	34,900	1,680.00	58,632,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,600	1,723.00	14,817,800	
ＳＢテクノロジー	6,000	2,518.00	15,108,000	

トーセ	3,100	741.00	2,297,100	
ユー・エス・エス	147,900	2,314.00	342,240,600	
オービックビジネスコンサルタント	27,600	5,120.00	141,312,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	75,300	3,490.00	262,797,000	
アイティフォー	18,500	882.00	16,317,000	
東京個別指導学院	17,000	541.00	9,197,000	
東計電算	2,000	6,060.00	12,120,000	
サイバーエージェント	317,600	1,153.00	366,192,800	
楽天グループ	666,300	693.00	461,745,900	
エックスネット	1,600	1,005.00	1,608,000	
クリーク・アンド・リバー社	8,400	2,102.00	17,656,800	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	23,500	504.00	11,844,000	
テー・オー・ダブリュー	28,300	331.00	9,367,300	
大塚商会	79,500	5,070.00	403,065,000	
サイボウズ	19,300	2,677.00	51,666,100	
山田コンサルティンググループ	7,300	1,872.00	13,665,600	
セントラルスポーツ	5,400	2,572.00	13,888,800	
パラカ	4,900	1,959.00	9,599,100	
電通国際情報サービス	17,000	5,020.00	85,340,000	
ＡＣＣＥＳＳ	16,600	852.00	14,143,200	
デジタルガレージ	24,900	4,910.00	122,259,000	
イーエムシステムズ	23,400	792.00	18,532,800	
ウェザーニューズ	4,300	6,910.00	29,713,000	
ＣＩＪ	23,300	548.00	12,768,400	
ビジネスエンジニアリング	2,300	3,590.00	8,257,000	
日本エンタープライズ	11,200	144.00	1,612,800	
WOWOW	10,600	1,286.00	13,631,600	
スカラ	13,000	759.00	9,867,000	
インテリジェント　ウェイブ	5,800	699.00	4,054,200	
フルキャストホールディングス	13,700	2,484.00	34,030,800	
エン・ジャパン	26,000	2,438.00	63,388,000	
あすか製薬ホールディングス	14,400	1,289.00	18,561,600	
サワイグループホールディングス	32,100	3,840.00	123,264,000	
富士フイルムホールディングス	269,200	7,659.00	2,061,802,800	
コニカミノルタ	315,500	523.00	165,006,500	
資生堂	292,900	6,515.00	1,908,243,500	
ライオン	168,300	1,402.00	235,956,600	
高砂香料工業	9,500	2,603.00	24,728,500	
マンダム	30,300	1,573.00	47,661,900	
ミルボン	20,800	5,600.00	116,480,000	
ファンケル	61,400	2,312.00	141,956,800	
コーセー	28,500	15,130.00	431,205,000	
コタ	12,900	1,623.00	20,936,700	
シーボン	1,400	1,609.00	2,252,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	71,900	2,044.00	146,963,600	
ノエビアホールディングス	12,500	5,270.00	65,875,000	
アジュバンホールディングス	2,600	925.00	2,405,000	
新日本製薬	8,000	1,357.00	10,856,000	
アクシージア	7,100	1,195.00	8,484,500	

エステー	10,900	1,574.00	17,156,600	
アグロ　カネショウ	5,600	1,799.00	10,074,400	
コニシ	23,400	2,196.00	51,386,400	
長谷川香料	26,800	3,205.00	85,894,000	
星光ＰＭＣ	5,600	579.00	3,242,400	
小林製薬	40,800	8,110.00	330,888,000	
荒川化学工業	11,900	996.00	11,852,400	
メック	11,500	2,533.00	29,129,500	
日本高純度化学	3,500	2,471.00	8,648,500	
タカラバイオ	37,800	1,737.00	65,658,600	
ＪＣＵ	15,700	3,395.00	53,301,500	
新田ゼラチン	6,700	881.00	5,902,700	
ＯＡＴアグリオ	4,500	1,650.00	7,425,000	
デクセリアルズ	40,500	2,750.00	111,375,000	
アース製薬	12,700	5,020.00	63,754,000	
北興化学工業	14,100	907.00	12,788,700	
大成ラミック	4,400	2,928.00	12,883,200	
クミアイ化学工業	55,700	899.00	50,074,300	
日本農薬	25,700	662.00	17,013,400	
富士興産	2,600	1,203.00	3,127,800	
ニチレキ	16,600	1,745.00	28,967,000	
ユシロ化学工業	7,300	878.00	6,409,400	
ビーピー・カストロール	4,200	907.00	3,809,400	
富士石油	28,600	261.00	7,464,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	3,600	1,150.00	4,140,000	
出光興産	155,800	2,881.00	448,859,800	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,379,500	506.00	1,204,027,000	
コスモエネルギーホールディングス	55,500	4,410.00	244,755,000	
テスホールディングス	14,800	1,170.00	17,316,000	
インフロニア・ホールディングス	143,700	1,216.00	174,739,200	
横浜ゴム	79,800	2,923.00	233,255,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	80,600	1,599.00	128,879,400	
ブリヂストン	447,900	5,422.00	2,428,513,800	
住友ゴム工業	137,600	1,254.00	172,550,400	
藤倉コンポジット	7,700	890.00	6,853,000	
オカモト	7,800	4,075.00	31,785,000	
アキレス	8,900	1,456.00	12,958,400	
フコク	7,400	1,075.00	7,955,000	
ニッタ	14,300	3,115.00	44,544,500	
クリエートメディック	3,600	903.00	3,250,800	
住友理工	27,300	799.00	21,812,700	
三ツ星ベルト	20,500	3,920.00	80,360,000	
バンドー化学	22,300	1,118.00	24,931,400	
ＡＧＣ	142,800	5,140.00	733,992,000	
日本板硝子	71,500	632.00	45,188,000	
石塚硝子	1,700	1,555.00	2,643,500	
有沢製作所	22,800	1,273.00	29,024,400	
日本山村硝子	4,100	710.00	2,911,000	
日本電気硝子	57,300	2,512.00	143,937,600	
オハラ	6,600	1,158.00	7,642,800	

住友大阪セメント	19,800	3,530.00	69,894,000	
太平洋セメント	89,300	2,370.00	211,641,000	
リソルホールディングス	1,000	4,795.00	4,795,000	
日本ヒューム	12,300	736.00	9,052,800	
日本コンクリート工業	27,400	264.00	7,233,600	
三谷セキサン	5,900	5,140.00	30,326,000	
アジアパイルホールディングス	21,900	623.00	13,643,700	
東海カーボン	117,600	1,241.00	145,941,600	
日本カーボン	8,000	4,315.00	34,520,000	
東洋炭素	8,800	4,510.00	39,688,000	
ノリタケカンパニーリミテド	7,000	4,805.00	33,635,000	
ＴＯＴＯ	92,600	4,550.00	421,330,000	
日本碍子	163,100	1,731.00	282,326,100	
日本特殊陶業	106,800	2,561.00	273,514,800	
ダントーホールディングス	7,700	647.00	4,981,900	
ＭＡＲＵＷＡ	5,200	17,510.00	91,052,000	
品川リフラクトリーズ	4,000	4,695.00	18,780,000	
黒崎播磨	2,900	5,930.00	17,197,000	
ヨータイ	9,400	1,427.00	13,413,800	
東京窯業	10,000	352.00	3,520,000	
ニッカトー	4,900	617.00	3,023,300	
フジミインコーポレーテッド	11,200	7,780.00	87,136,000	
クニミネ工業	3,200	932.00	2,982,400	
エーアンドエーマテリアル	2,000	1,044.00	2,088,000	
ニチアス	35,500	2,790.00	99,045,000	
日本製鉄	646,200	2,870.00	1,854,594,000	
神戸製鋼所	290,300	1,020.00	296,106,000	
中山製鋼所	29,700	835.00	24,799,500	
合同製鐵	7,200	3,110.00	22,392,000	
ＪＦＥホールディングス	385,700	1,792.00	691,174,400	
東京製鐵	40,600	1,287.00	52,252,200	
共英製鋼	16,500	1,784.00	29,436,000	
大和工業	23,800	5,450.00	129,710,000	
東京鐵鋼	6,900	2,539.00	17,519,100	
大阪製鐵	6,700	1,287.00	8,622,900	
淀川製鋼所	16,500	2,849.00	47,008,500	
中部鋼鈑	11,900	2,043.00	24,311,700	
丸一鋼管	44,000	3,065.00	134,860,000	
モリ工業	2,600	3,190.00	8,294,000	
大同特殊鋼	18,200	5,170.00	94,094,000	
日本高周波鋼業	4,000	340.00	1,360,000	
日本冶金工業	10,500	4,355.00	45,727,500	
山陽特殊製鋼	14,300	2,592.00	37,065,600	
愛知製鋼	8,400	2,748.00	23,083,200	
日本金属	2,500	944.00	2,360,000	
大平洋金属	10,300	1,644.00	16,933,200	
新日本電工	92,300	345.00	31,843,500	
栗本鐵工所	6,900	2,082.00	14,365,800	
虹　技	1,400	1,155.00	1,617,000	
日本鋳鉄管	1,200	1,064.00	1,276,800	

日本製鋼所	38,900	2,471.00	96,121,900	
三菱製鋼	9,100	1,199.00	10,910,900	
日亜鋼業	11,700	321.00	3,755,700	
日本精線	2,000	4,485.00	8,970,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,700	594.00	4,573,800	
大紀アルミニウム工業所	20,600	1,403.00	28,901,800	
日本軽金属ホールディングス	39,000	1,409.00	54,951,000	
三井金属鉱業	42,000	3,150.00	132,300,000	
東邦亜鉛	8,500	1,849.00	15,716,500	
三菱マテリアル	96,300	2,230.00	214,749,000	
住友金属鉱山	167,300	4,466.00	747,161,800	
ＤＯＷＡホールディングス	32,400	4,395.00	142,398,000	
古河機械金属	21,300	1,328.00	28,286,400	
エス・サイエンス	68,000	26.00	1,768,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	21,200	2,746.00	58,215,200	
東邦チタニウム	26,100	1,734.00	45,257,400	
ＵＡＣＪ	20,200	2,655.00	53,631,000	
ＣＫサンエツ	2,700	4,280.00	11,556,000	
古河電気工業	48,000	2,487.00	119,376,000	
住友電気工業	498,300	1,733.50	863,803,050	
フジクラ	154,800	918.00	142,106,400	
ＳＷＣＣ	16,100	1,779.00	28,641,900	
タツタ電線	29,400	715.00	21,021,000	
カナレ電気	1,700	1,365.00	2,320,500	
平河ヒューテック	8,300	1,397.00	11,595,100	
いよぎんホールディングス	163,900	794.00	130,136,600	
しずおかフィナンシャルグループ	311,300	1,029.00	320,327,700	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	116,000	897.00	104,052,000	
リョービ	15,400	1,491.00	22,961,400	
アーレスティ	12,400	583.00	7,229,200	
アサヒホールディングス	58,400	1,992.00	116,332,800	
東洋製罐グループホールディングス	95,500	1,971.00	188,230,500	
ホッカンホールディングス	7,800	1,401.00	10,927,800	
コロナ	8,100	911.00	7,379,100	
横河ブリッジホールディングス	18,100	2,239.00	40,525,900	
駒井ハルテック	1,800	1,835.00	3,303,000	
高田機工	600	2,826.00	1,695,600	
三和ホールディングス	132,900	1,504.00	199,881,600	
文化シヤッター	41,600	1,134.00	47,174,400	
三協立山	16,500	686.00	11,319,000	
アルインコ	11,000	989.00	10,879,000	
東洋シヤッター	2,300	550.00	1,265,000	
ＬＩＸＩＬ	210,200	1,988.00	417,877,600	
日本フイルコン	7,400	475.00	3,515,000	
ノーリツ	21,300	1,842.00	39,234,600	
長府製作所	14,600	2,434.00	35,536,400	
リンナイ	78,500	3,300.00	259,050,000	
ユニプレス	25,100	940.00	23,594,000	
ダイニチ工業	5,600	739.00	4,138,400	
日東精工	20,900	609.00	12,728,100	

三洋工業	1,300	1,915.00	2,489,500	
岡部	23,200	783.00	18,165,600	
ジーテクト	16,100	1,486.00	23,924,600	
東プレ	25,400	1,382.00	35,102,800	
高周波熱錬	22,300	733.00	16,345,900	
東京製綱	8,500	1,138.00	9,673,000	
サンコール	10,000	578.00	5,780,000	
モリテックスチール	8,300	294.00	2,440,200	
パイオラックス	19,900	2,087.00	41,531,300	
エイチワン	14,800	660.00	9,768,000	
日本発条	127,700	998.00	127,444,600	
中央発條	10,700	709.00	7,586,300	
アドバネクス	1,400	1,045.00	1,463,000	
三浦工業	59,000	3,640.00	214,760,000	
タクマ	43,400	1,464.00	63,537,600	
テクノプロ・ホールディングス	85,100	3,430.00	291,893,000	
アトラグループ	2,600	184.00	478,400	
インターワークス	3,000	372.00	1,116,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,500	2,197.00	16,477,500	
ＫｅｅＰｅｒ技研	8,900	5,780.00	51,442,000	
ファーストロジック	1,300	849.00	1,103,700	
三機サービス	1,700	1,146.00	1,948,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	11,400	581.00	6,623,400	
デザインワン・ジャパン	2,800	180.00	504,000	
イー・ガーディアン	5,400	2,269.00	12,252,600	
リブセンス	5,100	294.00	1,499,400	
ジャパンマテリアル	44,000	2,064.00	90,816,000	
ベクトル	22,600	1,308.00	29,560,800	
ウチヤマホールディングス	4,900	279.00	1,367,100	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,000	1,125.00	13,500,000	
キャリアリンク	5,300	2,327.00	12,333,100	
ＩＢＪ	8,800	648.00	5,702,400	
アサンテ	7,100	1,642.00	11,658,200	
バリューＨＲ	12,600	1,524.00	19,202,400	
M&Aキャピタルパートナーズ	11,600	3,295.00	38,222,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,100	1,095.00	5,584,500	
ＥＲＩホールディングス	2,900	1,419.00	4,115,100	
アビスト	1,800	3,115.00	5,607,000	
シグマクシス・ホールディングス	21,800	1,204.00	26,247,200	
ウィルグループ	12,000	1,108.00	13,296,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,800	144.00	1,699,200	
メドピア	12,600	1,145.00	14,427,000	
レアジョブ	2,200	1,269.00	2,791,800	
リクルートホールディングス	1,064,500	3,857.00	4,105,776,500	
エラン	19,000	1,010.00	19,190,000	
ツガミ	31,400	1,378.00	43,269,200	
オークマ	14,100	6,100.00	86,010,000	
芝浦機械	14,100	3,205.00	45,190,500	

アマダ	225,400	1,279.00	288,286,600	
アイダエンジニアリング	29,100	890.00	25,899,000	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	2,900	1,329.00	3,854,100	
ＦＵＪＩ	61,400	2,318.00	142,325,200	
牧野フライス製作所	15,600	4,805.00	74,958,000	
オーエスジー	67,400	1,927.00	129,879,800	
ダイジェット工業	1,100	861.00	947,100	
旭ダイヤモンド工業	39,400	921.00	36,287,400	
ＤＭＧ森精機	85,600	2,176.00	186,265,600	
ソディック	38,900	756.00	29,408,400	
ディスコ	68,000	16,800.00	1,142,400,000	
日東工器	6,900	2,035.00	14,041,500	
日進工具	11,800	1,158.00	13,664,400	
パンチ工業	9,900	551.00	5,454,900	
冨士ダイス	5,100	737.00	3,758,700	
土木管理総合試験所	4,700	337.00	1,583,900	
日本郵政	1,884,300	1,122.00	2,114,184,600	
ベルシステム２４ホールディングス	19,300	1,420.00	27,406,000	
鎌倉新書	16,300	900.00	14,670,000	
ＳＭＮ	2,700	463.00	1,250,100	
一蔵	1,400	579.00	810,600	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,100	676.00	1,419,600	
エアトリ	10,500	2,654.00	27,867,000	
アトラエ	8,500	832.00	7,072,000	
ストライク	6,100	3,550.00	21,655,000	
ソラスト	39,600	661.00	26,175,600	
セラク	4,400	1,679.00	7,387,600	
インソース	31,200	1,251.00	39,031,200	
豊田自動織機	102,300	7,950.00	813,285,000	
豊和工業	6,000	846.00	5,076,000	
石川製作所	2,800	1,373.00	3,844,400	
東洋機械金属	7,600	666.00	5,061,600	
津田駒工業	2,000	496.00	992,000	
エンシュウ	2,300	698.00	1,605,400	
島精機製作所	22,500	1,765.00	39,712,500	
オプトラン	20,900	2,047.00	42,782,300	
ＮＣホールディングス	2,200	1,977.00	4,349,400	
イワキ	9,400	1,302.00	12,238,800	
フリュー	14,800	1,152.00	17,049,600	
ヤマシンフィルタ	33,700	334.00	11,255,800	
日阪製作所	13,700	947.00	12,973,900	
やまびこ	23,100	1,354.00	31,277,400	
野村マイクロ・サイエンス	4,800	4,475.00	21,480,000	
平田機工	6,800	6,930.00	47,124,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	15,600	616.00	9,609,600	
マルマエ	6,100	1,642.00	10,016,200	
タツモ	7,700	1,881.00	14,483,700	
ナブテスコ	88,600	3,140.00	278,204,000	
三井海洋開発	17,700	1,407.00	24,903,900	
レオン自動機	14,900	1,263.00	18,818,700	

ＳＭＣ	45,800	69,800.00	3,196,840,000	
ホソカワミクロン	9,900	2,945.00	29,155,500	
ユニオンツール	6,200	3,290.00	20,398,000	
オイレス工業	19,800	1,726.00	34,174,800	
日精エー・エス・ビー機械	5,600	4,235.00	23,716,000	
サトーホールディングス	20,100	2,313.00	46,491,300	
技研製作所	13,300	2,126.00	28,275,800	
日本エアーテック	7,100	1,115.00	7,916,500	
カワタ	3,200	1,018.00	3,257,600	
日精樹脂工業	10,500	1,018.00	10,689,000	
オカダアイヨン	3,400	1,854.00	6,303,600	
ワイエイシイホールディングス	4,600	2,941.00	13,528,600	
小松製作所	661,900	3,298.00	2,182,946,200	
住友重機械工業	83,600	3,245.00	271,282,000	
日立建機	56,300	3,275.00	184,382,500	
日工	20,900	639.00	13,355,100	
巴工業	6,100	2,439.00	14,877,900	
井関農機	13,200	1,204.00	15,892,800	
ＴＯＷＡ	14,400	2,123.00	30,571,200	
丸山製作所	1,900	1,756.00	3,336,400	
北川鉄工所	5,500	1,228.00	6,754,000	
シンニッタン	12,100	245.00	2,964,500	
ローツェ	7,400	10,030.00	74,222,000	
タカキタ	3,100	452.00	1,401,200	
クボタ	747,500	2,097.50	1,567,881,250	
荏原実業	6,800	2,954.00	20,087,200	
東洋エンジニアリング	18,200	594.00	10,810,800	
三菱化工機	4,500	2,433.00	10,948,500	
月島ホールディングス	19,100	1,132.00	21,621,200	
帝国電機製作所	9,900	2,409.00	23,849,100	
東京機械製作所	2,600	549.00	1,427,400	
新東工業	28,500	1,011.00	28,813,500	
澁谷工業	13,300	2,597.00	34,540,100	
アイチコーポレーション	19,700	836.00	16,469,200	
小森コーポレーション	32,700	1,048.00	34,269,600	
鶴見製作所	10,800	2,357.00	25,455,600	
日本ギア工業	3,700	476.00	1,761,200	
酒井重工業	1,800	4,605.00	8,289,000	
荏原製作所	57,800	6,130.00	354,314,000	
石井鐵工所	1,000	2,316.00	2,316,000	
酉島製作所	12,200	1,629.00	19,873,800	
北越工業	14,200	1,291.00	18,332,200	
ダイキン工業	168,600	25,480.00	4,295,928,000	
オルガノ	19,400	3,285.00	63,729,000	
トーヨーカネツ	5,400	2,735.00	14,769,000	
栗田工業	79,000	5,550.00	438,450,000	
椿本チエイン	20,000	3,450.00	69,000,000	
大同工業	4,400	729.00	3,207,600	
日機装	32,600	941.00	30,676,600	
木村化工機	10,800	724.00	7,819,200	

レイズネクスト	19,900	1,419.00	28,238,100	
アネスト岩田	24,000	1,053.00	25,272,000	
ダイフク	218,500	2,583.00	564,385,500	
サムコ	3,800	5,240.00	19,912,000	
加藤製作所	5,200	1,304.00	6,780,800	
油研工業	1,700	1,991.00	3,384,700	
タダノ	74,500	1,039.00	77,405,500	
フジテック	49,500	3,625.00	179,437,500	
ＣＫＤ	39,100	2,089.00	81,679,900	
平和	47,000	2,654.00	124,738,000	
理想科学工業	12,600	2,308.00	29,080,800	
ＳＡＮＫＹＯ	27,800	5,760.00	160,128,000	
日本金銭機械	15,500	1,317.00	20,413,500	
マースグループホールディングス	8,300	2,910.00	24,153,000	
フクシマガリレイ	10,400	5,270.00	54,808,000	
オーイズミ	4,100	585.00	2,398,500	
ダイコク電機	7,700	2,856.00	21,991,200	
竹内製作所	25,600	3,680.00	94,208,000	
アマノ	40,100	2,859.00	114,645,900	
ＪＵＫＩ	21,900	599.00	13,118,100	
サンデン	16,300	223.00	3,634,900	
ジャノメ	14,300	626.00	8,951,800	
ブラザー工業	188,700	2,028.00	382,683,600	
マックス	17,400	2,228.00	38,767,200	
モリタホールディングス	24,600	1,598.00	39,310,800	
グローリー	33,900	2,772.00	93,970,800	
新晃工業	14,200	1,810.00	25,702,000	
大和冷機工業	21,600	1,449.00	31,298,400	
セガサミーホールディングス	113,600	2,763.00	313,876,800	
日本ピストンリング	3,700	1,361.00	5,035,700	
リケン	5,600	2,696.00	15,097,600	
ＴＰＲ	16,100	1,406.00	22,636,600	
ツバキ・ナカシマ	34,900	973.00	33,957,700	
ホシザキ	90,900	5,200.00	472,680,000	
大豊工業	12,200	762.00	9,296,400	
日本精工	259,500	778.00	201,891,000	
ＮＴＮ	278,400	306.00	85,190,400	
ジェイテクト	125,700	1,151.00	144,680,700	
不二越	10,400	3,820.00	39,728,000	
ミネベアミツミ	245,700	2,563.00	629,729,100	
日本トムソン	34,600	578.00	19,998,800	
ＴＨＫ	81,500	2,971.00	242,136,500	
ユーシン精機	11,200	726.00	8,131,200	
前澤給装工業	9,900	1,081.00	10,701,900	
イーグル工業	15,600	1,485.00	23,166,000	
前澤工業	6,300	785.00	4,945,500	
日本ピラー工業	13,100	3,780.00	49,518,000	
キッツ	52,000	933.00	48,516,000	
日立製作所	686,900	7,814.00	5,367,436,600	
東芝	271,900	4,404.00	1,197,447,600	

三菱電機	1,460,000	1,747.50	2,551,350,000	
富士電機	85,900	5,720.00	491,348,000	
東洋電機製造	3,500	1,052.00	3,682,000	
安川電機	167,400	5,640.00	944,136,000	
シンフォニア　テクノロジー	15,600	1,731.00	27,003,600	
明電舎	21,400	1,892.00	40,488,800	
オリジン	2,500	1,287.00	3,217,500	
山洋電気	6,100	6,900.00	42,090,000	
デンヨー	10,800	1,927.00	20,811,600	
ＰＨＣホールディングス	19,700	1,384.00	27,264,800	
ソシオネクスト	19,400	11,480.00	222,712,000	
ベイカレント・コンサルティング	113,800	5,240.00	596,312,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,100	1,556.00	4,823,600	
アイモバイル	6,400	1,297.00	8,300,800	
キャリアインデックス	3,800	349.00	1,326,200	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,700	1,044.00	3,862,800	
船場	1,500	788.00	1,182,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	51,200	2,000.00	102,400,000	
フルテック	1,600	1,127.00	1,803,200	
グリーンズ	3,800	1,508.00	5,730,400	
ツナググループ・ホールディングス	3,100	714.00	2,213,400	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	3,300	367.00	1,211,100	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,300	619.00	804,700	
ウェルビー	10,500	704.00	7,392,000	
エル・ティー・エス	1,800	2,610.00	4,698,000	
ミダックホールディングス	8,700	2,020.00	17,574,000	
日総工産	10,800	799.00	8,629,200	
キュービーネットホールディングス	6,800	1,413.00	9,608,400	
ＲＰＡホールディングス	19,500	372.00	7,254,000	
三櫻工業	21,300	679.00	14,462,700	
マキタ	175,700	3,670.00	644,819,000	
東芝テック	21,100	3,715.00	78,386,500	
芝浦メカトロニクス	2,700	15,520.00	41,904,000	
マブチモーター	35,100	3,900.00	136,890,000	
ニデック	343,700	6,897.00	2,370,498,900	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	10,400	514.00	5,345,600	
トレックス・セミコンダクター	6,600	2,281.00	15,054,600	
東光高岳	8,500	2,107.00	17,909,500	
ダブル・スコープ	46,200	1,155.00	53,361,000	
宮越ホールディングス	6,300	806.00	5,077,800	
ダイヘン	12,800	4,855.00	62,144,000	
ヤーマン	24,400	1,149.00	28,035,600	
ＪＶＣケンウッド	128,600	509.00	65,457,400	
ミマキエンジニアリング	13,400	665.00	8,911,000	
Ｉ－ＰＥＸ	7,800	1,409.00	10,990,200	
大崎電気工業	33,500	590.00	19,765,000	
オムロン	129,400	8,099.00	1,048,010,600	
日東工業	19,000	2,765.00	52,535,000	

ＩＤＥＣ	20,900	3,410.00	71,269,000	
正興電機製作所	4,100	1,016.00	4,165,600	
不二電機工業	2,200	1,115.00	2,453,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	46,400	2,461.00	114,190,400	
サクサホールディングス	2,300	2,221.00	5,108,300	
メルコホールディングス	3,600	3,390.00	12,204,000	
テクノメディカ	3,400	1,785.00	6,069,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,800	928.00	4,454,400	
日本電気	199,800	6,180.00	1,234,764,000	
富士通	140,800	17,830.00	2,510,464,000	
沖電気工業	63,900	754.00	48,180,600	
岩崎通信機	4,800	825.00	3,960,000	
電気興業	5,700	2,279.00	12,990,300	
サンケン電気	13,100	10,900.00	142,790,000	
ナカヨ	1,800	1,152.00	2,073,600	
アイホン	8,600	2,217.00	19,066,200	
ルネサスエレクトロニクス	921,700	1,888.00	1,740,169,600	
セイコーエプソン	181,200	2,030.00	367,836,000	
ワコム	107,400	740.00	79,476,000	
アルバック	33,600	5,460.00	183,456,000	
アクセル	4,100	1,391.00	5,703,100	
ＥＩＺＯ	10,300	4,380.00	45,114,000	
ジャパンディスプレイ	542,400	40.00	21,696,000	
日本信号	32,200	1,079.00	34,743,800	
京三製作所	29,600	426.00	12,609,600	
能美防災	19,100	1,809.00	34,551,900	
ホーチキ	10,600	1,585.00	16,801,000	
星和電機	4,400	480.00	2,112,000	
エレコム	33,800	1,337.00	45,190,600	
パナソニック　ホールディングス	1,668,600	1,374.50	2,293,490,700	
シャープ	170,100	990.00	168,399,000	
アンリツ	99,500	1,222.00	121,589,000	
富士通ゼネラル	40,000	3,405.00	136,200,000	
ソニーグループ	989,400	12,555.00	12,421,917,000	
ＴＤＫ	223,700	4,865.00	1,088,300,500	
帝国通信工業	6,400	1,537.00	9,836,800	
タムラ製作所	60,600	806.00	48,843,600	
アルプスアルパイン	126,200	1,215.00	153,333,000	
池上通信機	3,500	582.00	2,037,000	
日本電波工業	16,900	1,189.00	20,094,100	
鈴木	7,600	1,022.00	7,767,200	
メイコー	15,400	2,533.00	39,008,200	
日本トリム	3,200	2,990.00	9,568,000	
ローランド　ディー．ジー．	7,700	3,495.00	26,911,500	
フォスター電機	13,100	1,191.00	15,602,100	
ＳＭＫ	3,400	2,383.00	8,102,200	
ヨコオ	11,200	2,037.00	22,814,400	
ティアック	16,900	119.00	2,011,100	
ホシデン	33,000	1,847.00	60,951,000	

ヒロセ電機	23,400	18,540.00	433,836,000	
日本航空電子工業	29,000	2,462.00	71,398,000	
ＴＯＡ	16,100	863.00	13,894,300	
マクセル	28,600	1,473.00	42,127,800	
古野電気	18,400	943.00	17,351,200	
スミダコーポレーション	12,900	1,623.00	20,936,700	
アイコム	5,400	2,857.00	15,427,800	
リオン	5,800	1,873.00	10,863,400	
横河電機	154,500	2,460.00	380,070,000	
新電元工業	5,400	3,505.00	18,927,000	
アズビル	97,700	3,910.00	382,007,000	
東亜ディーケーケー	5,200	828.00	4,305,600	
日本光電工業	64,600	3,805.00	245,803,000	
チノー	5,800	2,114.00	12,261,200	
共和電業	10,200	355.00	3,621,000	
日本電子材料	9,200	1,414.00	13,008,800	
堀場製作所	31,100	7,610.00	236,671,000	
アドバンテスト	110,200	11,740.00	1,293,748,000	
小野測器	4,100	449.00	1,840,900	
エスペック	11,200	2,025.00	22,680,000	
キーエンス	139,900	63,800.00	8,925,620,000	
日置電機	7,300	9,170.00	66,941,000	
シスメックス	120,600	9,005.00	1,086,003,000	
日本マイクロニクス	23,000	1,276.00	29,348,000	
メガチップス	11,500	3,335.00	38,352,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,700	3,925.00	30,222,500	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	11,700	617.00	7,218,900	
澤藤電機	1,300	1,152.00	1,497,600	
デンソー	288,500	8,123.00	2,343,485,500	
原田工業	4,800	815.00	3,912,000	
コーセル	16,800	1,124.00	18,883,200	
イリソ電子工業	12,900	4,325.00	55,792,500	
オプテックスグループ	25,700	1,985.00	51,014,500	
千代田インテグレ	4,900	2,324.00	11,387,600	
レーザーテック	64,100	17,960.00	1,151,236,000	
スタンレー電気	99,500	2,939.00	292,430,500	
ウシオ電機	71,100	1,751.00	124,496,100	
岡谷電機産業	8,400	311.00	2,612,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	10,000	867.00	8,670,000	
エノモト	2,800	1,668.00	4,670,400	
日本セラミック	14,200	2,778.00	39,447,600	
遠藤照明	4,900	1,365.00	6,688,500	
古河電池	10,300	1,105.00	11,381,500	
双信電機	4,400	378.00	1,663,200	
山一電機	12,200	1,818.00	22,179,600	
図研	12,200	3,485.00	42,517,000	
日本電子	35,000	4,105.00	143,675,000	
カシオ計算機	104,200	1,337.00	139,315,400	
ファナック	686,400	4,598.00	3,156,067,200	
日本シイエムケイ	29,700	476.00	14,137,200	

エンプラス	4,100	4,200.00	17,220,000	
大真空	17,000	693.00	11,781,000	
ローム	64,600	11,000.00	710,600,000	
浜松ホトニクス	112,200	7,420.00	832,524,000	
三井ハイテック	14,400	8,550.00	123,120,000	
新光電気工業	49,500	4,260.00	210,870,000	
京セラ	217,300	7,202.00	1,564,994,600	
協栄産業	1,100	1,975.00	2,172,500	
太陽誘電	68,100	4,045.00	275,464,500	
村田製作所	424,200	7,707.00	3,269,309,400	
双葉電子工業	26,600	524.00	13,938,400	
日東電工	101,800	9,360.00	952,848,000	
北陸電気工業	4,100	1,215.00	4,981,500	
東海理化電機製作所	39,400	1,876.00	73,914,400	
ニチコン	28,600	1,347.00	38,524,200	
日本ケミコン	13,800	1,991.00	27,475,800	
ＫＯＡ	21,200	1,690.00	35,828,000	
三井Ｅ＆Ｓ	65,700	552.00	36,266,400	
日立造船	115,700	838.00	96,956,600	
三菱重工業	247,000	5,340.00	1,318,980,000	
川崎重工業	105,400	2,799.00	295,014,600	
ＩＨＩ	89,000	3,420.00	304,380,000	
名村造船所	27,900	410.00	11,439,000	
サノヤスホールディングス	14,600	135.00	1,971,000	
スプリックス	3,200	946.00	3,027,200	
マネジメントソリューションズ	7,900	3,210.00	25,359,000	
プロレド・パートナーズ	3,400	493.00	1,676,200	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	3,300	383.00	1,263,900	
テノ．ホールディングス	1,400	764.00	1,069,600	
フロンティア・マネジメント	4,800	936.00	4,492,800	
ピアラ	1,800	549.00	988,200	
コプロ・ホールディングス	1,800	1,487.00	2,676,600	
ギークス	1,600	1,186.00	1,897,600	
アンビスホールディングス	15,400	2,903.00	44,706,200	
カーブスホールディングス	39,300	781.00	30,693,300	
フォーラムエンジニアリング	8,400	856.00	7,190,400	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	4,900	1,828.00	8,957,200	
日本車輌製造	5,400	2,053.00	11,086,200	
三菱ロジスネクスト	22,300	1,181.00	26,336,300	
近畿車輌	1,500	1,520.00	2,280,000	
一家ホールディングス	2,600	639.00	1,661,400	
フルサト・マルカホールディングス	14,700	2,811.00	41,321,700	
ヤマエグループホールディングス	8,400	2,329.00	19,563,600	
ジャパンクラフトホールディングス	3,400	575.00	1,955,000	
ＦＰＧ	46,600	1,093.00	50,933,800	
島根銀行	3,700	482.00	1,783,400	
じもとホールディングス	9,500	393.00	3,733,500	
全国保証	36,000	4,965.00	178,740,000	
めぶきフィナンシャルグループ	683,400	341.00	233,039,400	

ジャパンインベストメントアドバイザー	11,300	1,148.00	12,972,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,600	3,005.00	52,888,000	
九州フィナンシャルグループ	242,300	495.00	119,938,500	
かんぽ生命保険	167,200	2,245.00	375,364,000	
ゆうちょ銀行	386,000	1,078.00	416,108,000	
あんしん保証	5,300	266.00	1,409,800	
富山第一銀行	45,700	624.00	28,516,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	759,300	523.00	397,113,900	
ジェイリース	3,600	2,174.00	7,826,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	85,500	1,103.00	94,306,500	
イントラスト	4,100	959.00	3,931,900	
日本モーゲージサービス	5,900	602.00	3,551,800	
ＣＡＳＡ	4,200	868.00	3,645,600	
アルヒ	17,000	1,097.00	18,649,000	
プレミアグループ	23,200	1,622.00	37,630,400	
日産自動車	1,986,800	505.80	1,004,923,440	
いすゞ自動車	406,600	1,631.00	663,164,600	
トヨタ自動車	7,679,900	1,916.00	14,714,688,400	
日野自動車	180,300	536.00	96,640,800	
三菱自動車工業	545,600	462.00	252,067,200	
エフテック	7,500	769.00	5,767,500	
レシップホールディングス	4,300	476.00	2,046,800	
ＧＭＢ	2,100	1,921.00	4,034,100	
ファルテック	1,800	613.00	1,103,400	
武蔵精密工業	34,200	1,789.00	61,183,800	
日産車体	24,700	886.00	21,884,200	
新明和工業	43,900	1,272.00	55,840,800	
極東開発工業	23,100	1,765.00	40,771,500	
トピー工業	11,300	1,937.00	21,888,100	
ティラド	3,500	2,454.00	8,589,000	
曙ブレーキ工業	85,300	147.00	12,539,100	
タチエス	22,100	1,249.00	27,602,900	
ＮＯＫ	54,300	1,804.00	97,957,200	
フタバ産業	37,500	450.00	16,875,000	
ＫＹＢ	13,500	4,340.00	58,590,000	
市光工業	20,100	522.00	10,492,200	
大同メタル工業	27,400	502.00	13,754,800	
プレス工業	62,500	541.00	33,812,500	
ミクニ	12,500	348.00	4,350,000	
太平洋工業	32,100	1,184.00	38,006,400	
河西工業	14,400	207.00	2,980,800	
アイシン	107,900	3,915.00	422,428,500	
マツダ	462,600	1,192.00	551,419,200	
今仙電機製作所	6,900	727.00	5,016,300	
本田技研工業	1,136,900	3,582.00	4,072,375,800	
スズキ	256,900	4,788.00	1,230,037,200	
ＳＵＢＡＲＵ	442,500	2,217.50	981,243,750	

安永	4,700	1,018.00	4,784,600	
ヤマハ発動機	219,800	3,425.00	752,815,000	
小糸製作所	168,200	2,672.00	449,430,400	
ＴＢＫ	10,800	290.00	3,132,000	
エクセディ	22,900	2,066.00	47,311,400	
ミツバ	26,200	699.00	18,313,800	
豊田合成	40,800	2,327.00	94,941,600	
愛三工業	23,100	958.00	22,129,800	
盟和産業	1,500	960.00	1,440,000	
日本プラスト	8,500	438.00	3,723,000	
ヨロズ	13,100	884.00	11,580,400	
エフ・シー・シー	24,800	1,679.00	41,639,200	
新家工業	2,400	2,049.00	4,917,600	
シマノ	57,200	21,295.00	1,218,074,000	
テイ・エス　テック	64,000	1,864.00	119,296,000	
三十三フィナンシャルグループ	12,300	1,583.00	19,470,900	
第四北越フィナンシャルグループ	21,600	3,030.00	65,448,000	
ひろぎんホールディングス	179,700	682.00	122,555,400	
マーキュリアホールディングス	6,300	732.00	4,611,600	
おきなわフィナンシャルグループ	13,100	2,039.00	26,710,900	
ダイレクトマーケティングミックス	17,200	1,330.00	22,876,000	
ポピンズ	2,100	1,723.00	3,618,300	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	11,200	2,599.00	29,108,800	
十六フィナンシャルグループ	17,800	2,980.00	53,044,000	
北國フィナンシャルホールディングス	15,500	4,835.00	74,942,500	
ネットプロテクションズホールディングス	45,600	510.00	23,256,000	
プロクレアホールディングス	16,900	2,157.00	36,453,300	
あいちフィナンシャルグループ	19,300	2,152.00	41,533,600	
ジャムコ	5,900	1,422.00	8,389,800	
小野建	14,600	1,557.00	22,732,200	
はるやまホールディングス	4,800	519.00	2,491,200	
南陽	2,200	2,348.00	5,165,600	
ノジマ	48,300	1,488.00	71,870,400	
佐鳥電機	7,200	1,698.00	12,225,600	
カッパ・クリエイト	23,300	1,517.00	35,346,100	
エコートレーディング	2,200	773.00	1,700,600	
伯東	8,500	4,515.00	38,377,500	
コンドーテック	11,400	1,023.00	11,662,200	
中山福	6,100	347.00	2,116,700	
ライトオン	8,700	581.00	5,054,700	
ナガイレーベン	18,700	2,147.00	40,148,900	
三菱食品	13,700	3,530.00	48,361,000	
良品計画	161,500	1,432.00	231,268,000	
パリミキホールディングス	14,400	328.00	4,723,200	
松田産業	11,300	2,295.00	25,933,500	
第一興商	57,300	2,488.00	142,562,400	
メディパルホールディングス	141,500	2,084.00	294,886,000	
アドヴァングループ	14,100	966.00	13,620,600	
ＳＰＫ	6,600	1,711.00	11,292,600	

萩原電気ホールディングス	5,700	3,535.00	20,149,500	
アルビス	4,900	2,473.00	12,117,700	
アズワン	21,100	5,850.00	123,435,000	
スズデン	5,200	2,186.00	11,367,200	
尾家産業	2,700	1,246.00	3,364,200	
シモジマ	10,200	1,110.00	11,322,000	
ドウシシャ	15,700	2,038.00	31,996,600	
小津産業	2,500	1,788.00	4,470,000	
コナカ	12,400	358.00	4,439,200	
高速	7,700	2,138.00	16,462,600	
ハウス　オブ　ローゼ	1,500	1,614.00	2,421,000	
Ｇ－７ホールディングス	18,400	1,414.00	26,017,600	
たけびし	5,600	1,657.00	9,279,200	
イオン北海道	21,900	827.00	18,111,300	
コジマ	24,400	566.00	13,810,400	
ヒマラヤ	3,600	954.00	3,434,400	
コーナン商事	20,000	3,660.00	73,200,000	
ネットワンシステムズ	52,300	3,285.00	171,805,500	
エコス	5,500	1,870.00	10,285,000	
ワタミ	17,900	958.00	17,148,200	
マルシェ	3,800	432.00	1,641,600	
リックス	2,400	2,869.00	6,885,600	
システムソフト	48,700	80.00	3,896,000	
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	298,700	2,526.00	754,516,200	
丸文	13,200	1,258.00	16,605,600	
西松屋チェーン	32,800	1,650.00	54,120,000	
ゼンショーホールディングス	81,000	4,385.00	355,185,000	
ハピネット	12,600	1,982.00	24,973,200	
幸楽苑ホールディングス	9,600	1,067.00	10,243,200	
ハークスレイ	4,000	726.00	2,904,000	
橋本総業ホールディングス	5,900	1,130.00	6,667,000	
日本ライフライン	43,400	1,022.00	44,354,800	
サイゼリヤ	21,900	3,400.00	74,460,000	
タカショー	12,900	726.00	9,365,400	
ＶＴホールディングス	56,200	542.00	30,460,400	
アルゴグラフィックス	12,900	3,980.00	51,342,000	
魚力	4,600	2,179.00	10,023,400	
ＩＤＯＭ	44,700	832.00	37,190,400	
日本エム・ディ・エム	8,300	937.00	7,777,100	
ポプラ	3,000	267.00	801,000	
フジ・コーポレーション	8,400	1,321.00	11,096,400	
ユナイテッドアローズ	15,800	2,293.00	36,229,400	
進和	9,100	2,147.00	19,537,700	
エスケイジャパン	2,800	553.00	1,548,400	
ダイトロン	5,800	2,698.00	15,648,400	
ハイデイ日高	22,000	2,306.00	50,732,000	
シークス	21,100	1,342.00	28,316,200	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,800	199.00	1,353,200	

コロワイド	68,200	2,110.00	143,902,000	
ピーシーデポコーポレーション	16,500	300.00	4,950,000	
田中商事	3,300	655.00	2,161,500	
オーハシテクニカ	7,200	1,640.00	11,808,000	
壱番屋	11,700	5,300.00	62,010,000	
白銅	5,400	2,687.00	14,509,800	
トップカルチャー	3,800	194.00	737,200	
ＰＬＡＮＴ	2,700	720.00	1,944,000	
スギホールディングス	29,800	5,830.00	173,734,000	
ダイコー通産	1,200	1,249.00	1,498,800	
薬王堂ホールディングス	8,300	2,417.00	20,061,100	
島津製作所	170,300	4,290.00	730,587,000	
ＪＭＳ	13,000	533.00	6,929,000	
クボテック	2,600	206.00	535,600	
長野計器	10,200	1,292.00	13,178,400	
ブイ・テクノロジー	6,800	3,065.00	20,842,000	
スター精密	26,600	1,766.00	46,975,600	
東京計器	10,700	1,235.00	13,214,500	
愛知時計電機	5,500	1,538.00	8,459,000	
インターアクション	6,600	1,344.00	8,870,400	
オーバル	9,600	430.00	4,128,000	
東京精密	30,700	5,190.00	159,333,000	
マニー	55,900	1,686.00	94,247,400	
ニコン	202,200	1,458.00	294,807,600	
トプコン	73,600	1,966.00	144,697,600	
オリンパス	860,900	2,381.00	2,049,802,900	
理研計器	8,700	5,160.00	44,892,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	23,900	11,560.00	276,284,000	
キヤノン電子	15,500	1,871.00	29,000,500	
タムロン	10,500	3,470.00	36,435,000	
ＨＯＹＡ	298,700	14,860.00	4,438,682,000	
シード	5,600	588.00	3,292,800	
ノーリツ鋼機	13,300	2,309.00	30,709,700	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	20,400	1,320.00	26,928,000	
朝日インテック	156,300	2,494.00	389,812,200	
キヤノン	767,400	3,200.00	2,455,680,000	
リコー	350,700	1,031.00	361,571,700	
シチズン時計	153,800	775.00	119,195,000	
リズム	3,400	2,038.00	6,929,200	
大研医器	8,100	499.00	4,041,900	
メニコン	48,000	2,926.00	140,448,000	
シンシア	1,000	602.00	602,000	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	16,100	146.00	2,350,600	
中本パックス	3,300	1,582.00	5,220,600	
スノーピーク	23,900	2,105.00	50,309,500	
パラマウントベッドホールディングス	32,300	2,431.00	78,521,300	
トランザクション	9,200	1,734.00	15,952,800	
粧美堂	3,000	383.00	1,149,000	
ニホンフラッシュ	13,100	1,083.00	14,187,300	
前田工繊	11,800	3,210.00	37,878,000	

永大産業	11,600	221.00	2,563,600	
アートネイチャー	14,400	777.00	11,188,800	
バンダイナムコホールディングス	383,200	3,218.00	1,233,137,600	
アイフィスジャパン	3,100	614.00	1,903,400	
ＳＨＯＥＩ	31,600	2,528.00	79,884,800	
フランスベッドホールディングス	17,400	1,119.00	19,470,600	
マーベラス	22,800	680.00	15,504,000	
パイロットコーポレーション	21,900	4,370.00	95,703,000	
萩原工業	9,300	1,271.00	11,820,300	
エイベックス	23,800	1,520.00	36,176,000	
フジシールインターナショナル	28,300	1,528.00	43,242,400	
タカラトミー	64,600	1,590.00	102,714,000	
広済堂ホールディングス	7,300	2,616.00	19,096,800	
エステールホールディングス	2,600	609.00	1,583,400	
レック	20,000	852.00	17,040,000	
タカノ	4,100	737.00	3,021,700	
三光合成	17,600	539.00	9,486,400	
プロネクサス	11,600	1,002.00	11,623,200	
ホクシン	8,200	136.00	1,115,200	
ウッドワン	3,600	1,125.00	4,050,000	
大建工業	8,500	2,407.00	20,459,500	
きもと	16,000	187.00	2,992,000	
凸版印刷	182,900	2,844.00	520,167,600	
大日本印刷	152,900	3,925.00	600,132,500	
共同印刷	3,900	2,817.00	10,986,300	
ＮＩＳＳＨＡ	26,600	1,825.00	48,545,000	
光村印刷	600	1,239.00	743,400	
藤森工業	11,100	3,200.00	35,520,000	
ヴィア・ホールディングス	17,100	90.00	1,539,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	9,000	2,437.00	21,933,000	
前澤化成工業	9,000	1,615.00	14,535,000	
未来工業	5,000	2,301.00	11,505,000	
アシックス	129,100	3,720.00	480,252,000	
ツツミ	2,500	2,243.00	5,607,500	
ウェーブロックホールディングス	3,200	603.00	1,929,600	
ＪＳＰ	9,900	1,603.00	15,869,700	
ニチハ	17,600	2,974.00	52,342,400	
ローランド	10,300	4,215.00	43,414,500	
エフピコ	26,500	3,060.00	81,090,000	
小松ウオール工業	5,100	2,385.00	12,163,500	
ヤマハ	88,200	5,310.00	468,342,000	
河合楽器製作所	3,800	3,275.00	12,445,000	
クリナップ	15,700	709.00	11,131,300	
ピジョン	89,100	2,100.00	187,110,000	
天馬	11,900	2,369.00	28,191,100	
キングジム	12,400	922.00	11,432,800	
象印マホービン	41,800	1,773.00	74,111,400	
リンテック	28,100	2,210.00	62,101,000	
信越ポリマー	25,900	1,346.00	34,861,400	
東リ	24,500	307.00	7,521,500	

イトーキ	28,700	855.00	24,538,500	
任天堂	883,000	5,631.00	4,972,173,000	
三菱鉛筆	19,900	1,794.00	35,700,600	
松風	6,300	2,107.00	13,274,100	
タカラスタンダード	25,800	1,746.00	45,046,800	
コクヨ	67,400	2,013.00	135,676,200	
ナカバヤシ	15,100	477.00	7,202,700	
ニフコ	50,600	3,880.00	196,328,000	
立川ブラインド工業	6,500	1,274.00	8,281,000	
グローブライド	11,300	2,472.00	27,933,600	
オカムラ	42,100	1,755.00	73,885,500	
バルカー	11,700	3,500.00	40,950,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,500	1,740.00	2,610,000	
伊藤忠商事	911,800	4,621.00	4,213,427,800	
丸紅	1,154,800	1,943.00	2,243,776,400	
スクロール	22,000	892.00	19,624,000	
高島	1,800	3,115.00	5,607,000	
ヨンドシーホールディングス	12,700	1,782.00	22,631,400	
三陽商会	4,200	1,647.00	6,917,400	
長瀬産業	67,900	2,339.00	158,818,100	
ナイガイ	3,700	268.00	991,600	
蝶理	7,900	2,614.00	20,650,600	
豊田通商	129,600	5,910.00	765,936,000	
オンワードホールディングス	90,800	380.00	34,504,000	
三共生興	21,300	578.00	12,311,400	
兼松	57,500	1,887.00	108,502,500	
美津濃	13,900	3,395.00	47,190,500	
ツカモトコーポレーション	1,700	1,457.00	2,476,900	
ルックホールディングス	3,100	2,268.00	7,030,800	
三井物産	1,050,300	4,283.00	4,498,434,900	
日本紙パルプ商事	7,900	5,510.00	43,529,000	
東京エレクトロン	296,000	15,885.00	4,701,960,000	
カメイ	15,700	1,538.00	24,146,600	
東都水産	600	6,580.00	3,948,000	
ＯＵＧホールディングス	1,700	2,471.00	4,200,700	
スターゼン	11,300	2,360.00	26,668,000	
セイコーグループ	21,700	2,702.00	58,633,400	
山善	39,900	1,041.00	41,535,900	
椿本興業	2,300	4,040.00	9,292,000	
住友商事	916,400	2,572.00	2,356,980,800	
ＢＩＰＲＯＧＹ	51,600	3,555.00	183,438,000	
内田洋行	6,000	5,300.00	31,800,000	
三菱商事	915,300	5,350.00	4,896,855,000	
第一実業	5,200	5,700.00	29,640,000	
キヤノンマーケティングジャパン	34,300	3,320.00	113,876,000	
西華産業	5,800	2,268.00	13,154,400	
佐藤商事	10,300	1,396.00	14,378,800	
菱洋エレクトロ	12,600	2,565.00	32,319,000	
東京産業	13,500	922.00	12,447,000	
ユアサ商事	13,300	4,020.00	53,466,000	

神鋼商事	3,700	5,440.00	20,128,000	
トルク	6,200	212.00	1,314,400	
阪和興業	26,600	4,290.00	114,114,000	
正栄食品工業	9,800	3,975.00	38,955,000	
カナデン	9,900	1,214.00	12,018,600	
ＲＹＯＤＥＮ	11,900	2,018.00	24,014,200	
ニプロ	116,600	1,002.00	116,833,200	
岩谷産業	33,700	6,600.00	222,420,000	
ナイス	3,100	1,361.00	4,219,100	
ニチモウ	1,400	3,200.00	4,480,000	
極東貿易	8,800	1,528.00	13,446,400	
アステナホールディングス	25,600	452.00	11,571,200	
三愛オブリ	39,100	1,479.00	57,828,900	
稲畑産業	29,900	2,920.00	87,308,000	
ＧＳＩクレオス	8,600	1,909.00	16,417,400	
明和産業	19,700	669.00	13,179,300	
クワザワホールディングス	3,700	477.00	1,764,900	
キムラタン	64,300	22.00	1,414,600	
ゴールドウイン	24,800	12,060.00	299,088,000	
ユニ・チャーム	292,200	5,223.00	1,526,160,600	
デサント	24,100	4,335.00	104,473,500	
キング	4,800	575.00	2,760,000	
ワキタ	27,200	1,381.00	37,563,200	
ヤマトインターナショナル	8,600	281.00	2,416,600	
東邦ホールディングス	36,900	2,736.00	100,958,400	
サンゲツ	37,100	2,281.00	84,625,100	
ミツウロコグループホールディングス	18,900	1,324.00	25,023,600	
シナネンホールディングス	4,800	3,785.00	18,168,000	
伊藤忠エネクス	36,700	1,230.00	45,141,000	
サンリオ	41,900	6,080.00	254,752,000	
サンワ　テクノス	7,600	2,047.00	15,557,200	
リョーサン	15,700	3,370.00	52,909,000	
新光商事	19,900	1,222.00	24,317,800	
トーホー	6,300	2,348.00	14,792,400	
三信電気	6,000	2,327.00	13,962,000	
東陽テクニカ	15,000	1,395.00	20,925,000	
モスフードサービス	21,800	3,155.00	68,779,000	
加賀電子	12,000	5,010.00	60,120,000	
三益半導体工業	11,100	2,695.00	29,914,500	
都築電気	7,400	1,526.00	11,292,400	
ソーダニッカ	8,400	783.00	6,577,200	
立花エレテック	10,800	2,112.00	22,809,600	
木曽路	22,400	2,410.00	53,984,000	
ＳＲＳホールディングス	24,400	1,016.00	24,790,400	
千趣会	27,200	420.00	11,424,000	
タカキュー	8,100	79.00	639,900	
リテールパートナーズ	22,000	1,586.00	34,892,000	
ケーヨー	23,900	820.00	19,598,000	
上新電機	13,200	1,930.00	25,476,000	
日本瓦斯	79,300	2,006.00	159,075,800	

ロイヤルホールディングス	28,700	2,826.00	81,106,200	
東天紅	600	797.00	478,200	
いなげや	14,400	1,578.00	22,723,200	
チヨダ	14,100	848.00	11,956,800	
ライフコーポレーション	12,900	2,989.00	38,558,100	
リンガーハット	19,100	2,393.00	45,706,300	
ＭｒＭａｘＨＤ	20,700	627.00	12,978,900	
テンアライド	12,800	266.00	3,404,800	
ＡＯＫＩホールディングス	27,500	906.00	24,915,000	
オークワ	23,700	895.00	21,211,500	
コメリ	22,800	3,060.00	69,768,000	
青山商事	31,600	950.00	30,020,000	
しまむら	17,400	12,520.00	217,848,000	
はせがわ	5,400	347.00	1,873,800	
高島屋	111,600	1,960.00	218,736,000	
松屋	25,100	1,168.00	29,316,800	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	72,000	1,581.00	113,832,000	
近鉄百貨店	6,400	2,513.00	16,083,200	
丸井グループ	109,100	2,453.00	267,622,300	
クレディセゾン	87,300	1,900.00	165,870,000	
アクシアル　リテイリング	10,100	3,400.00	34,340,000	
井筒屋	5,400	321.00	1,733,400	
イオン	501,600	2,767.00	1,387,927,200	
イズミ	22,500	3,200.00	72,000,000	
フォーバル	5,600	1,092.00	6,115,200	
平和堂	24,700	2,058.00	50,832,600	
フジ	22,700	1,768.00	40,133,600	
ヤオコー	16,700	7,220.00	120,574,000	
ゼビオホールディングス	20,000	1,232.00	24,640,000	
ケーズホールディングス	104,600	1,289.00	134,829,400	
ＰＡＬＴＡＣ	23,300	5,080.00	118,364,000	
三谷産業	25,900	313.00	8,106,700	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	4,300	533.00	2,291,900	
日産東京販売ホールディングス	14,700	349.00	5,130,300	
ＳＢＩ新生銀行	32,200	2,486.00	80,049,200	
あおぞら銀行	86,600	2,476.00	214,421,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,626,900	870.20	7,507,128,380	
りそなホールディングス	1,741,100	672.10	1,170,193,310	
三井住友トラスト・ホールディングス	250,300	5,071.00	1,269,271,300	
三井住友フィナンシャルグループ	1,006,600	5,697.00	5,734,600,200	
千葉銀行	383,900	892.00	342,438,800	
群馬銀行	267,400	482.00	128,886,800	
武蔵野銀行	17,700	2,182.00	38,621,400	
千葉興業銀行	25,000	539.00	13,475,000	
筑波銀行	60,400	206.00	12,442,400	
七十七銀行	44,100	2,241.00	98,828,100	
秋田銀行	9,200	1,744.00	16,044,800	
山形銀行	15,300	1,067.00	16,325,100	
岩手銀行	9,400	2,144.00	20,153,600	
東邦銀行	108,800	226.00	24,588,800	

東北銀行	5,200	979.00	5,090,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	110,000	2,561.00	281,710,000	
スルガ銀行	121,400	523.00	63,492,200	
八十二銀行	282,600	584.00	165,038,400	
山梨中央銀行	14,100	1,111.00	15,665,100	
大垣共立銀行	26,200	1,832.00	47,998,400	
福井銀行	12,300	1,475.00	18,142,500	
清水銀行	5,500	1,449.00	7,969,500	
富山銀行	1,600	1,635.00	2,616,000	
滋賀銀行	22,900	2,838.00	64,990,200	
南都銀行	20,700	2,450.00	50,715,000	
百五銀行	129,700	389.00	50,453,300	
京都銀行	43,600	6,770.00	295,172,000	
紀陽銀行	49,300	1,634.00	80,556,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	87,500	1,046.00	91,525,000	
山陰合同銀行	86,200	770.00	66,374,000	
鳥取銀行	3,400	1,180.00	4,012,000	
百十四銀行	12,600	1,843.00	23,221,800	
四国銀行	21,900	861.00	18,855,900	
阿波銀行	19,300	2,022.00	39,024,600	
大分銀行	8,300	2,053.00	17,039,900	
宮崎銀行	9,000	2,405.00	21,645,000	
佐賀銀行	8,100	1,669.00	13,518,900	
琉球銀行	31,600	905.00	28,598,000	
セブン銀行	493,400	289.00	142,592,600	
みずほフィナンシャルグループ	1,992,200	2,016.50	4,017,271,300	
高知銀行	3,600	681.00	2,451,600	
山口フィナンシャルグループ	152,100	843.00	128,220,300	
芙蓉総合リース	12,700	9,860.00	125,222,000	
みずほリース	20,500	3,905.00	80,052,500	
東京センチュリー	25,700	4,640.00	119,248,000	
ＳＢＩホールディングス	199,400	2,670.00	532,398,000	
日本証券金融	55,200	1,050.00	57,960,000	
アイフル	228,100	367.00	83,712,700	
日本アジア投資	8,500	256.00	2,176,000	
長野銀行	3,300	1,488.00	4,910,400	
名古屋銀行	9,100	3,400.00	30,940,000	
北洋銀行	208,700	285.00	59,479,500	
大光銀行	3,200	1,098.00	3,513,600	
愛媛銀行	18,600	849.00	15,791,400	
トマト銀行	3,500	1,026.00	3,591,000	
京葉銀行	63,000	556.00	35,028,000	
栃木銀行	63,100	268.00	16,910,800	
北日本銀行	4,800	2,038.00	9,782,400	
東和銀行	25,300	540.00	13,662,000	
福島銀行	11,100	225.00	2,497,500	
大東銀行	4,200	646.00	2,713,200	
リコーリース	13,100	4,010.00	52,531,000	
イオンフィナンシャルサービス	79,100	1,228.00	97,134,800	
アコム	245,800	339.00	83,326,200	

ジャックス	14,700	4,650.00	68,355,000	
オリエントコーポレーション	36,000	1,139.00	41,004,000	
オリックス	904,200	2,343.50	2,118,992,700	
三菱ＨＣキャピタル	537,000	718.00	385,566,000	
ジャフコ　グループ	46,000	1,715.00	78,890,000	
九州リースサービス	5,000	773.00	3,865,000	
トモニホールディングス	111,300	369.00	41,069,700	
大和証券グループ本社	985,000	630.00	620,550,000	
野村ホールディングス	2,536,800	489.80	1,242,524,640	
岡三証券グループ	121,000	434.00	52,514,000	
丸三証券	45,900	416.00	19,094,400	
東洋証券	45,700	324.00	14,806,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	150,000	360.00	54,000,000	
光世証券	2,500	407.00	1,017,500	
水戸証券	37,000	295.00	10,915,000	
いちよし証券	25,400	592.00	15,036,800	
松井証券	81,400	768.00	62,515,200	
ＳＯＭＰＯホールディングス	236,400	5,707.00	1,349,134,800	
日本取引所グループ	387,100	2,212.50	856,458,750	
マネックスグループ	148,400	510.00	75,684,000	
極東証券	17,200	625.00	10,750,000	
岩井コスモホールディングス	15,700	1,331.00	20,896,700	
アイザワ証券グループ	19,900	746.00	14,845,400	
フィデアホールディングス	14,200	1,330.00	18,886,000	
池田泉州ホールディングス	176,300	235.00	41,430,500	
アニコム　ホールディングス	46,800	526.00	24,616,800	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	280,300	4,558.00	1,277,607,400	
マネーパートナーズグループ	11,200	265.00	2,968,000	
スパークス・グループ	15,400	1,391.00	21,421,400	
小林洋行	2,900	238.00	690,200	
第一生命ホールディングス	673,000	2,522.00	1,697,306,000	
東京海上ホールディングス	1,361,600	2,759.50	3,757,335,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,100	462.00	2,356,200	
イー・ギャランティ	22,400	2,101.00	47,062,400	
アサックス	4,900	622.00	3,047,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	6,800	2,780.00	18,904,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	369,700	1,747.00	645,865,900	
アドバンスクリエイト	8,000	1,110.00	8,880,000	
三井不動産	595,300	2,624.00	1,562,067,200	
三菱地所	831,200	1,658.50	1,378,545,200	
平和不動産	22,400	3,865.00	86,576,000	
東京建物	131,300	1,705.00	223,866,500	
京阪神ビルディング	23,200	1,197.00	27,770,400	
住友不動産	249,000	3,120.00	776,880,000	
太平洋興発	4,000	762.00	3,048,000	
テーオーシー	24,900	631.00	15,711,900	
東京楽天地	2,300	4,240.00	9,752,000	
レオパレス２１	155,000	370.00	57,350,000	

スターツコーポレーション	19,800	2,583.00	51,143,400	
フジ住宅	19,300	701.00	13,529,300	
空港施設	16,700	566.00	9,452,200	
明和地所	5,100	834.00	4,253,400	
ゴールドクレスト	13,100	1,766.00	23,134,600	
リログループ	80,000	2,083.00	166,640,000	
エスリード	6,500	2,223.00	14,449,500	
日神グループホールディングス	22,100	469.00	10,364,900	
日本エスコン	31,000	857.00	26,567,000	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	69,600	386.00	26,865,600	
ＡＶＡＮＴＩＡ	6,000	834.00	5,004,000	
イオンモール	71,400	1,845.00	131,733,000	
毎日コムネット	4,000	826.00	3,304,000	
ファースト住建	4,300	1,100.00	4,730,000	
ランド	829,100	9.00	7,461,900	
カチタス	37,000	2,681.00	99,197,000	
東祥	10,000	1,334.00	13,340,000	
トーセイ	22,900	1,623.00	37,166,700	
穴吹興産	2,100	2,363.00	4,962,300	
サンフロンティア不動産	23,000	1,313.00	30,199,000	
ＦＪネクストホールディングス	14,500	1,036.00	15,022,000	
インテリックス	2,600	574.00	1,492,400	
ランドビジネス	4,000	278.00	1,112,000	
サンネクスタグループ	3,200	1,006.00	3,219,200	
グランディハウス	9,000	560.00	5,040,000	
東武鉄道	153,600	3,575.00	549,120,000	
相鉄ホールディングス	46,200	2,676.00	123,631,200	
東急	392,200	1,966.00	771,065,200	
京浜急行電鉄	158,700	1,328.00	210,753,600	
小田急電鉄	212,000	2,071.00	439,052,000	
京王電鉄	74,000	5,160.00	381,840,000	
京成電鉄	90,200	5,010.00	451,902,000	
富士急行	17,200	5,570.00	95,804,000	
東日本旅客鉄道	237,200	7,950.00	1,885,740,000	
西日本旅客鉄道	178,700	6,039.00	1,079,169,300	
東海旅客鉄道	107,700	16,710.00	1,799,667,000	
西武ホールディングス	169,200	1,570.00	265,644,000	
鴻池運輸	23,900	1,644.00	39,291,600	
西日本鉄道	37,400	2,516.00	94,098,400	
ハマキョウレックス	11,000	3,540.00	38,940,000	
サカイ引越センター	6,700	4,850.00	32,495,000	
近鉄グループホールディングス	139,600	4,695.00	655,422,000	
阪急阪神ホールディングス	186,200	4,340.00	808,108,000	
南海電気鉄道	66,700	3,235.00	215,774,500	
京阪ホールディングス	77,000	3,615.00	278,355,000	
神戸電鉄	3,800	3,190.00	12,122,000	
名古屋鉄道	154,300	2,238.00	345,323,400	
山陽電気鉄道	10,500	2,394.00	25,137,000	
アルプス物流	11,200	1,223.00	13,697,600	
トランコム	4,100	6,780.00	27,798,000	

ヤマトホールディングス	178,800	2,504.00	447,715,200	
山九	35,500	5,030.00	178,565,000	
日新	10,600	2,225.00	23,585,000	
丸運	5,600	245.00	1,372,000	
丸全昭和運輸	8,700	3,595.00	31,276,500	
センコーグループホールディングス	74,100	967.00	71,654,700	
トナミホールディングス	2,500	4,605.00	11,512,500	
ニッコンホールディングス	44,700	2,686.00	120,064,200	
日本石油輸送	900	2,697.00	2,427,300	
福山通運	10,600	3,685.00	39,061,000	
セイノーホールディングス	86,900	1,513.00	131,479,700	
エスライン	3,200	808.00	2,585,600	
神奈川中央交通	4,000	3,210.00	12,840,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	33,700	1,960.00	66,052,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	13,500	1,228.00	16,578,000	
日本郵船	373,600	3,135.00	1,171,236,000	
商船三井	246,100	3,205.00	788,750,500	
川崎汽船	104,900	3,385.00	355,086,500	
ＮＳユナイテッド海運	7,500	3,555.00	26,662,500	
明治海運	10,600	610.00	6,466,000	
飯野海運	51,300	815.00	41,809,500	
共栄タンカー	2,000	912.00	1,824,000	
九州旅客鉄道	98,700	3,085.00	304,489,500	
ＳＧホールディングス	268,000	2,158.00	578,344,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	52,100	8,290.00	431,909,000	
日本航空	342,900	2,644.00	906,627,600	
ＡＮＡホールディングス	379,900	3,001.00	1,140,079,900	
ビーウィズ	3,600	2,022.00	7,279,200	
パスコ	2,100	1,575.00	3,307,500	
ＴＲＥホールディングス	30,300	1,210.00	36,663,000	
人・夢・技術グループ	5,400	1,554.00	8,391,600	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,800	4,000.00	15,200,000	
シルバーライフ	2,800	1,289.00	3,609,200	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	2,220.00	1,998,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,500	3,995.00	25,967,500	
コーア商事ホールディングス	8,300	720.00	5,976,000	
ＫＰＰグループホールディングス	34,500	664.00	22,908,000	
ナルミヤ・インターナショナル	1,900	955.00	1,814,500	
ブックオフグループホールディングス	7,500	1,332.00	9,990,000	
ギフトホールディングス	3,100	5,050.00	15,655,000	
三菱倉庫	30,000	3,385.00	101,550,000	
三井倉庫ホールディングス	13,000	3,625.00	47,125,000	
住友倉庫	37,700	2,262.00	85,277,400	
澁澤倉庫	5,600	2,346.00	13,137,600	
ヤマタネ	6,600	1,685.00	11,121,000	
東陽倉庫	14,600	284.00	4,146,400	
乾汽船	17,700	1,629.00	28,833,300	
日本トランスシティ	28,200	680.00	19,176,000	

ケイヒン	2,000	1,699.00	3,398,000	
中央倉庫	6,800	1,074.00	7,303,200	
川西倉庫	1,900	1,017.00	1,932,300	
安田倉庫	9,700	976.00	9,467,200	
ファイズホールディングス	2,000	1,324.00	2,648,000	
大栄環境	36,600	1,888.00	69,100,800	
日本管財ホールディングス	15,100	2,686.00	40,558,600	
東洋埠頭	3,200	1,454.00	4,652,800	
上組	67,000	3,015.00	202,005,000	
サンリツ	2,500	749.00	1,872,500	
キムラユニティー	5,200	1,156.00	6,011,200	
キユーソー流通システム	6,600	1,020.00	6,732,000	
東海運	6,600	305.00	2,013,000	
エーアイテイー	8,800	1,632.00	14,361,600	
内外トランスライン	5,100	2,530.00	12,903,000	
ショーエイコーポレーション	3,200	564.00	1,804,800	
日本コンセプト	4,400	1,684.00	7,409,600	
ＴＢＳホールディングス	71,800	2,096.00	150,492,800	
日本テレビホールディングス	124,200	1,238.00	153,759,600	
朝日放送グループホールディングス	13,200	660.00	8,712,000	
テレビ朝日ホールディングス	34,000	1,565.00	53,210,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	124,500	562.00	69,969,000	
テレビ東京ホールディングス	10,100	2,505.00	25,300,500	
日本ＢＳ放送	3,900	889.00	3,467,100	
ビジョン	18,500	1,632.00	30,192,000	
スマートバリュー	2,700	447.00	1,206,900	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	15,700	2,980.00	46,786,000	
ワイヤレスゲート	4,700	237.00	1,113,900	
日本通信	129,400	292.00	37,784,800	
クロップス	1,800	1,140.00	2,052,000	
日本電信電話	1,797,400	4,189.00	7,529,308,600	
ＫＤＤＩ	1,084,000	4,312.00	4,674,208,000	
ソフトバンク	2,253,500	1,521.00	3,427,573,500	
光通信	16,500	18,350.00	302,775,000	
エムティーアイ	9,600	513.00	4,924,800	
ＧＭＯインターネットグループ	51,800	2,715.00	140,637,000	
ファイバーゲート	7,500	1,280.00	9,600,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,600	289.00	751,400	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	74,200	2,873.00	213,176,600	
学研ホールディングス	23,300	881.00	20,527,300	
ゼンリン	24,000	939.00	22,536,000	
昭文社ホールディングス	4,700	298.00	1,400,600	
インプレスホールディングス	9,600	224.00	2,150,400	
東京電力ホールディングス	1,260,800	486.00	612,748,800	
中部電力	515,400	1,582.00	815,362,800	
関西電力	540,100	1,473.00	795,567,300	
中国電力	222,700	729.00	162,348,300	
北陸電力	132,000	657.00	86,724,000	

東北電力	341,900	720.00	246,168,000	
四国電力	119,400	830.00	99,102,000	
九州電力	322,400	835.00	269,204,000	
北海道電力	135,100	524.00	70,792,400	
沖縄電力	32,800	1,110.00	36,408,000	
電源開発	105,300	2,105.00	221,656,500	
エフオン	9,100	666.00	6,060,600	
イーレックス	24,800	1,760.00	43,648,000	
レノバ	37,200	1,660.00	61,752,000	
東京瓦斯	295,700	2,902.00	858,121,400	
大阪瓦斯	283,300	2,213.00	626,942,900	
東邦瓦斯	55,100	2,555.00	140,780,500	
北海道瓦斯	8,400	2,074.00	17,421,600	
広島ガス	29,500	377.00	11,121,500	
西部ガスホールディングス	13,100	1,941.00	25,427,100	
静岡ガス	31,900	1,139.00	36,334,100	
メタウォーター	17,500	1,784.00	31,220,000	
アイネット	8,500	1,445.00	12,282,500	
松竹	8,000	12,260.00	98,080,000	
東宝	87,800	5,420.00	475,876,000	
エイチ・アイ・エス	37,600	1,984.00	74,598,400	
東映	3,900	18,100.00	70,590,000	
ラックランド	6,000	3,190.00	19,140,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	440,200	1,895.00	834,179,000	
共立メンテナンス	24,600	5,360.00	131,856,000	
イチネンホールディングス	15,200	1,343.00	20,413,600	
建設技術研究所	7,400	3,395.00	25,123,000	
スペース	10,400	1,054.00	10,961,600	
アインホールディングス	20,400	5,500.00	112,200,000	
燦ホールディングス	6,100	2,281.00	13,914,100	
ピー・シー・エー	8,100	1,143.00	9,258,300	
スバル興業	600	9,600.00	5,760,000	
東京テアトル	4,100	1,145.00	4,694,500	
タナベコンサルティンググループ	4,400	930.00	4,092,000	
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,930.00	11,580,000	
ナガワ	3,900	6,400.00	24,960,000	
東京都競馬	12,000	4,215.00	50,580,000	
常磐興産	3,900	1,249.00	4,871,100	
カナモト	26,300	2,239.00	58,885,700	
ＤＴＳ	29,900	3,290.00	98,371,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	70,500	6,550.00	461,775,000	
シーイーシー	19,700	1,431.00	28,190,700	
カプコン	139,400	5,220.00	727,668,000	
ニシオホールディングス	13,400	3,210.00	43,014,000	
アイ・エス・ビー	7,200	1,525.00	10,980,000	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	62,500	26.00	1,625,000	
日本空港ビルデング	48,700	6,490.00	316,063,000	
トランス・コスモス	17,900	3,345.00	59,875,500	

乃村工藝社	62,700	932.00	58,436,400	
ジャステック	8,600	1,235.00	10,621,000	
ＳＣＳＫ	114,500	2,134.00	244,343,000	
藤田観光	6,400	3,540.00	22,656,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,600	1,526.00	13,123,600	
トーカイ	12,700	2,049.00	26,022,300	
白洋舎	1,400	2,255.00	3,157,000	
セコム	146,400	8,878.00	1,299,739,200	
ＮＳＷ	5,500	2,165.00	11,907,500	
セントラル警備保障	7,800	2,767.00	21,582,600	
アイネス	9,900	1,419.00	14,048,100	
丹青社	27,900	814.00	22,710,600	
メイテック	56,100	2,273.00	127,515,300	
ＴＫＣ	22,400	3,640.00	81,536,000	
富士ソフト	15,900	8,360.00	132,924,000	
応用地質	13,400	2,060.00	27,604,000	
船井総研ホールディングス	29,900	2,589.00	77,411,100	
ＮＳＤ	50,100	2,615.00	131,011,500	
進学会ホールディングス	3,700	296.00	1,095,200	
丸紅建材リース	900	2,130.00	1,917,000	
オオバ	7,000	777.00	5,439,000	
コナミグループ	60,000	6,730.00	403,800,000	
いであ	2,500	1,613.00	4,032,500	
学究社	5,700	2,221.00	12,659,700	
ベネッセホールディングス	53,700	1,958.00	105,144,600	
イオンディライト	15,900	3,030.00	48,177,000	
ナック	6,400	960.00	6,144,000	
福井コンピュータホールディングス	9,700	2,668.00	25,879,600	
ダイセキ	29,300	4,025.00	117,932,500	
ステップ	5,200	1,804.00	9,380,800	
泉州電業	7,400	3,130.00	23,162,000	
元気寿司	4,200	3,465.00	14,553,000	
トラスコ中山	31,100	2,257.00	70,192,700	
ヤマダホールディングス	606,700	440.00	266,948,000	
オートバックスセブン	51,500	1,552.00	79,928,000	
モリト	10,600	1,077.00	11,416,200	
アークランズ	21,600	1,615.00	34,884,000	
ニトリホールディングス	59,900	18,405.00	1,102,459,500	
グルメ杵屋	12,000	1,076.00	12,912,000	
愛眼	8,700	171.00	1,487,700	
ケーユーホールディングス	8,700	1,440.00	12,528,000	
吉野家ホールディングス	57,900	2,501.00	144,807,900	
加藤産業	18,300	3,810.00	69,723,000	
北恵	2,600	756.00	1,965,600	
イノテック	9,300	1,383.00	12,861,900	
イエローハット	26,100	1,886.00	49,224,600	
松屋フーズホールディングス	7,000	4,315.00	30,205,000	
ＪＢＣＣホールディングス	10,200	2,215.00	22,593,000	
ＪＫホールディングス	11,400	1,077.00	12,277,800	
サガミホールディングス	23,800	1,340.00	31,892,000	

日伝	8,800	2,092.00	18,409,600	
関西フードマーケット	13,400	1,561.00	20,917,400	
ミロク情報サービス	12,700	1,734.00	22,021,800	
北沢産業	6,100	473.00	2,885,300	
杉本商事	6,600	1,997.00	13,180,200	
因幡電機産業	38,400	3,080.00	118,272,000	
王将フードサービス	9,700	6,210.00	60,237,000	
ミニストップ	10,800	1,434.00	15,487,200	
アークス	27,100	2,515.00	68,156,500	
バローホールディングス	28,200	2,087.00	58,853,400	
東テク	4,900	4,090.00	20,041,000	
ミスミグループ本社	223,300	3,355.00	749,171,500	
アルテック	6,400	262.00	1,676,800	
ベルク	7,400	6,080.00	44,992,000	
大　庄	6,200	1,184.00	7,340,800	
タキヒヨー	2,800	1,020.00	2,856,000	
ファーストリテイリング	66,600	31,140.00	2,073,924,000	
ソフトバンクグループ	692,000	5,138.00	3,555,496,000	
蔵王産業	1,900	2,275.00	4,322,500	
スズケン	43,300	3,880.00	168,004,000	
サンドラッグ	56,200	3,810.00	214,122,000	
サックスバー　ホールディングス	14,100	998.00	14,071,800	
ジェコス	8,900	870.00	7,743,000	
ヤマザワ	2,100	1,298.00	2,725,800	
やまや	2,400	2,709.00	6,501,600	
グローセル	13,800	413.00	5,699,400	
ベルーナ	35,600	755.00	26,878,000	
合計	165,544,500		416,736,177,780	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年5月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	7,930,376,496
コール・ローン	612,243,551
株式	898,419,769,336
投資信託受益証券	1,576,190,178
投資証券	18,212,050,034
派生商品評価勘定	40,734,668
未収入金	73,547,486
未収配当金	952,446,899
差入委託証拠金	6,929,008,103
流動資産合計	934,746,366,751
資産合計	934,746,366,751
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,756,516
未払解約金	763,041,000
流動負債合計	838,797,516
負債合計	838,797,516
純資産の部	
元本等	
元本	146,939,276,979
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	786,968,292,256
元本等合計	933,907,569,235
純資産合計	933,907,569,235
負債純資産合計	934,746,366,751

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11月12日 至　2023年5月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年5月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	129,749,605,564円
同期中追加設定元本額	32,949,625,028円
同期中一部解約元本額	15,759,953,613円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,278,148,934円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,230,953円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	10,077,678円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	26,413,429円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	29,753,043円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	20,907,437円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	22,185,586円
たわらノーロード　先進国株式	46,299,237,098円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	340,472,796円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	3,047,361,815円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	851,745,187円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	89,207,273円
たわらノーロード　バランス（標準型）	771,019,946円
たわらノーロード　バランス（積極型）	976,608,165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）	1,335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）	72,271,601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）	287,323,506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）	257,569,366円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	429,734,098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）	629,938円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	21,170,622円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,515,542円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,710,035円
たわらノーロード　全世界株式	725,701,636円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	55,536,276,494円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	2,897,489,037円
Ｏｎｅグローバルバランス	9,575,832円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	156,476,894円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	804,843,555円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,045,744,601円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	93,451,385円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	254,386,950円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	250,235,496円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,883,685円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	662,291,338円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	122,553,509円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	173,762,943円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	197,254,038円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	315,085,692円
投資のソムリエ	8,703,567,758円
クルーズコントロール	124,641,391円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	678,329,908円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	202,708,678円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	249,072,977円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	717,227,766円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,865,121,961円
ワールドアセットバランス（基本コース）	141,819,504円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	353,661,381円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	48,414,493円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	23,946,299円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,135,491円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	110,777,724円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	140,558,358円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	695,249,413円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	147,808,852円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	47,729,102円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	26,421,048円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	15,876,566円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	112,890,717円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,471,385円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	41,071,425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）	319,011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）	341,688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）	178,485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）	305,114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）	823,988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）	300,781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）	357,837,503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）	40,292,434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）	1,117,797,619円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	201,241,723円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,283,392,848円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	231,184,354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）	363,221円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,843,976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）	570,140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）	3,572,693円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	8,058,737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）	23,709,257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）	49,090,086円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,666,350円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,641,465円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,113,207円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,270円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,149,288円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,737,799円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	143,187,953円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	240,850,481円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	816,636,054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）	35,716,023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）	32,385,241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）	226,227,510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）	7,425,395円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	156,338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）	96,085,143円

ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,657,740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）	28,379,458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）	42,901,426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）	90,661,366円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	11,694,657円
コア資産形成ファンド	7,812,638円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,243,682,838円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	138,179,392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）	6,287,002円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,437,313,157円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,390,660,018円
計	146,939,276,979円
２．　受益権の総数	146,939,276,979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11月12日 至　2023年5月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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5月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	887,066,727
投資信託受益証券	20,271,056
投資証券	△1,184,975,957
合計	△277,638,174

（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（2023年2月16日から2023年5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年5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	275,978,239	－	274,238,338	1,739,901
アメリカ・ドル	157,549,920	－	156,430,560	1,119,360
イギリス・ポンド	6,654,531	－	6,611,595	42,936
オーストラリア・ドル	3,198,825	－	3,187,800	11,025
カナダ・ドル	6,159,780	－	6,122,990	36,790
ユーロ	102,415,183	－	101,885,393	529,790
買建	815,786,205	－	815,786,967	762
アメリカ・ドル	625,710,600	－	625,710,600	－
イギリス・ポンド	42,365,750	－	42,365,625	△125
オーストラリア・ドル	20,213,988	－	20,213,100	△888
カナダ・ドル	33,010,544	－	33,011,037	493
ユーロ	94,485,323	－	94,486,605	1,282
合計	1,091,764,444	－	1,090,025,305	1,740,663

（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5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	16,372,906,667	－	16,336,144,156	△36,762,511
合計	16,372,906,667	－	16,336,144,156	△36,762,511

（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5月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	6.3557円 (63,557円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年5月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,240,262	110.190	136,664,469.780	
	ABBOTT LABORATORIES	235,405	110.690	26,056,979.450	
	AES CORP	90,680	22.640	2,052,995.200	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	121,909	122.020	14,875,336.180	
	ADVANCED MICRO DEVICES	216,444	97.020	20,999,396.880	
	ADOBE INC	62,483	344.020	21,495,401.660	

CHUBB LTD	55,721	200.470	11,170,388.870	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	30,190	280.950	8,481,880.500	
ALLSTATE CORP	36,651	117.670	4,312,723.170	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	90,469	197.340	17,853,152.460	
AMGEN INC	71,881	234.110	16,828,060.910	
HESS CORP	36,375	135.240	4,919,355.000	
AMERICAN EXPRESS CO	85,374	148.680	12,693,406.320	
AMERICAN ELECTRIC POWER	67,905	91.720	6,228,246.600	
AFLAC INC	77,524	66.720	5,172,401.280	
AMERICAN INTL GROUP	101,141	52.610	5,321,028.010	
ANALOG DEVICES	68,039	181.430	12,344,315.770	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	93,288	62.300	5,811,842.400	
VALERO ENERGY CORP	52,681	111.010	5,848,117.810	
ANSYS INC	12,049	295.810	3,564,214.690	
APPLE INC	2,149,820	173.555	373,112,010.100	
APPLIED MATERIALS INC	114,199	115.410	13,179,706.590	
ALBEMARLE CORP	15,528	194.510	3,020,351.280	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	75,031	74.640	5,600,313.840	
AMEREN CORP	32,830	89.800	2,948,134.000	
ARROW ELECTRONICS INC	9,826	118.830	1,167,623.580	
AUTODESK INC	29,554	196.320	5,802,041.280	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	55,700	215.010	11,976,057.000	
AUTOZONE INC	2,591	2,733.650	7,082,887.150	
AVERY DENNISON CORP	11,542	172.510	1,991,110.420	
BALL CORP	45,691	56.630	2,587,481.330	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	175,639	322.990	56,729,640.610	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	104,946	41.020	4,304,884.920	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	43.840	3,127,414.080	
BECTON DICKINSON & CO	38,402	251.050	9,640,822.100	
AMETEK INC	30,909	144.680	4,471,914.120	
VERIZON COMM INC	569,032	37.630	21,412,674.160	
WR BERKLEY CORP	30,631	58.990	1,806,922.690	
BEST BUY CO INC	29,593	72.220	2,137,206.460	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	365.690	1,104,749.490	
YUM! BRANDS INC	38,365	137.740	5,284,395.100	
FIRSTENERGY CORP	75,630	39.570	2,992,679.100	
BOEING CO	76,014	200.840	15,266,651.760	
ROBERT HALF INTL INC	14,456	67.540	976,358.240	
BORGWARNER INC	29,975	44.310	1,328,192.250	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	193,284	53.220	10,286,574.480	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	100.660	1,734,673.780	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	22,659	124.740	2,826,483.660	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,083	1,372.150	4,230,338.450	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	287,363	68.490	19,681,491.870	
ONEOK INC	58,247	63.210	3,681,792.870	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	115.480	1,121,195.320	
UNITED RENTALS INC	9,015	336.050	3,029,490.750	
SEMPRA ENERGY	41,946	155.590	6,526,378.140	
FEDEX CORP	33,799	226.330	7,649,727.670	
VERISIGN INC	13,302	222.940	2,965,547.880	
AMPHENOL CORP	80,212	75.460	6,052,797.520	
BROWN-FORMAN CORP	43,429	64.230	2,789,444.670	
QUANTA SERVICES INC	19,621	171.430	3,363,628.030	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	3.420	348,036.300	
CSX CORP	285,564	31.810	9,083,790.840	
COTERRA ENERGY INC	112,611	24.460	2,754,465.060	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	54.350	1,466,254.300	
CONSTELLATION BRANDS INC	22,672	226.190	5,128,179.680	
CARDINAL HEALTH INC	34,421	85.180	2,931,980.780	
CARLISLE COS INC	7,522	208.390	1,567,509.580	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	10.490	1,387,732.590	
CATERPILLAR INC	69,997	213.170	14,921,260.490	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	120.890	1,526,961.590	
JPMORGAN CHASE & CO	395,707	136.480	54,006,091.360	
CHURCH & DWIGHT CO INC	31,461	96.210	3,026,862.810	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19,878	104.500	2,077,251.000	
CINTAS CORP	11,988	473.030	5,670,683.640	
CISCO SYSTEMS INC	552,313	46.710	25,798,540.230	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	14.860	1,030,853.060	
CLOROX COMPANY	16,085	168.530	2,710,805.050	
COCA-COLA CO/THE	555,881	63.500	35,298,443.500	
COPART INC	58,789	80.000	4,703,120.000	
COGNEX CORP	25,772	50.380	1,298,393.360	
COLGATE-PALMOLIVE CO	107,989	81.100	8,757,907.900	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	36,790	175.630	6,461,427.700	
MOLINA HEALTHCARE INC	7,515	292.120	2,195,281.800	
NRG ENERGY, INC.	28,364	32.150	911,902.600	
COMCAST CORP-CL A	582,232	39.860	23,207,767.520	
CONAGRA BRANDS INC	60,680	36.750	2,229,990.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	48,354	99.410	4,806,871.140	
CMS ENERGY CORP	36,631	61.860	2,265,993.660	

COOPER COS INC	6,342	390.900	2,479,087.800	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	64.440	1,629,107.640	
CORNING INC	107,051	31.290	3,349,625.790	
WOLFSPEED INC	15,684	40.810	640,064.040	
SEALED AIR CORP	17,610	42.220	743,494.200	
HEICO CORP-CL A	9,463	134.660	1,274,287.580	
CUMMINS INC	19,320	215.550	4,164,426.000	
DARLING INTERNATIONAL INC	20,032	63.340	1,268,826.880	
DR HORTON INC	44,965	108.770	4,890,843.050	
DANAHER CORP	93,159	233.430	21,746,105.370	
MOODY'S CORP	22,447	310.580	6,971,589.260	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	70,798	62.560	4,429,122.880	
TARGET CORP	62,648	157.730	9,881,469.040	
DEERE & CO	38,577	380.390	14,674,305.030	
MORGAN STANLEY	170,897	83.720	14,307,496.840	
REPUBLIC SERVICES INC	30,250	148.090	4,479,722.500	
COSTAR GROUP INC	53,950	75.450	4,070,527.500	
THE WALT DISNEY CO	245,462	101.140	24,826,026.680	
DOLLAR TREE INC	30,183	154.120	4,651,803.960	
DOVER CORP	17,510	140.970	2,468,384.700	
OMNICOM GROUP	26,570	91.140	2,421,589.800	
DTE ENERGY CO	27,080	113.970	3,086,307.600	
DUKE ENERGY CORP	104,098	99.140	10,320,275.720	
DARDEN RESTAURANTS INC	15,676	149.060	2,336,664.560	
EBAY INC	75,181	45.820	3,444,793.420	
BANK OF AMERICA CORP	972,706	27.320	26,574,327.920	
CITIGROUP INC	259,721	46.370	12,043,262.770	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	79.350	1,332,286.500	
EATON CORP PLC	53,791	169.110	9,096,596.010	
CADENCE DESIGN SYS INC	37,427	204.190	7,642,219.130	
DISH NETWORK CORP	24,416	6.285	153,454.560	
ECOLAB INC	35,033	174.930	6,128,322.690	
PERKINELMER INC	17,972	124.550	2,238,412.600	
ELECTRONIC ARTS INC	37,893	124.740	4,726,772.820	
SALESFORCE INC	134,432	204.850	27,538,395.200	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	232.780	784,934.160	
EMERSON ELECTRIC CO	80,180	82.480	6,613,246.400	
ATMOS ENERGY CORP	17,504	119.310	2,088,402.240	
ENTERGY CORP	26,546	107.600	2,856,349.600	
EOG RESOURCES INC	80,746	112.160	9,056,471.360	
EQUIFAX INC	17,053	203.400	3,468,580.200	
EQT CORP	40,996	32.200	1,320,071.200	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	31,545	201.190	6,346,538.550	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	20,309	114.030	2,315,835.270	
EXXON MOBIL CORP	556,010	107.740	59,904,517.400	
FMC CORP	17,711	110.580	1,958,482.380	
NEXTERA ENERGY INC	267,991	76.890	20,605,827.990	

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	404.390	2,188,558.680	
FAIR ISAAC CORP	3,376	757.900	2,558,670.400	
ASSURANT INC	8,276	129.210	1,069,341.960	
FASTENAL CO	78,930	54.590	4,308,788.700	
FIFTH THIRD BANCORP	87,493	24.240	2,120,830.320	
M&T BANK CORP	24,502	114.860	2,814,299.720	
FIRST HORIZON CORP	69,634	10.120	704,696.080	
FISERV INC	81,733	118.350	9,673,100.550	
FORD MOTOR CO	538,775	11.890	6,406,034.750	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	25.000	947,900.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	187,677	36.240	6,801,414.480	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	1,175.350	1,865,280.450	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	27,730	217.320	6,026,283.600	
DENTSPLY SIRONA INC	33,798	41.030	1,386,731.940	
GENERAL DYNAMICS CORP	32,087	211.530	6,787,363.110	
GENERAL MILLS INC	78,625	89.570	7,042,441.250	
GENUINE PARTS CO	17,649	173.690	3,065,454.810	
GILEAD SCIENCES INC	168,328	78.110	13,148,100.080	
GARTNER INC	10,481	304.520	3,191,674.120	
MCKESSON CORP	19,309	394.460	7,616,628.140	
NVIDIA CORP	332,062	288.850	95,916,108.700	
GRACO INC	23,985	78.130	1,873,948.050	
GENERAL ELECTRIC CO	146,590	99.540	14,591,568.600	
WW GRAINGER INC	6,276	681.460	4,276,842.960	
HALLIBURTON CO	125,763	29.560	3,717,554.280	
MONSTER BEVERAGE CORP	106,953	59.110	6,321,991.830	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	45,599	322.550	14,707,957.450	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	26,202	189.020	4,952,702.040	
HASBRO INC	21,174	59.980	1,270,016.520	
HENRY SCHEIN INC	17,431	76.220	1,328,590.820	
HEICO CORP	6,878	170.680	1,173,937.040	
HERSHEY FOODS CORP	20,089	274.120	5,506,796.680	
HP INC	138,109	29.860	4,123,934.740	
F5 INC	8,981	135.260	1,214,770.060	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	82.640	1,266,210.080	
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,222	212.240	1,320,557.280	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	29.070	1,270,795.050	
HOLOGIC INC	34,146	82.070	2,802,362.220	
HOME DEPOT INC	137,588	289.030	39,767,059.640	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	95.140	2,503,989.660	
HORMEL FOODS CORP	38,851	40.130	1,559,090.630	
CENTERPOINT ENERGY INC	80,118	30.280	2,425,973.040	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,776	288.090	1,375,917.840	
HUBBELL INC	6,903	272.190	1,878,927.570	
HUMANA INC	17,317	529.630	9,171,602.710	

JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,380	176.610	1,833,211.800	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	182,806	9.580	1,751,281.480	
BIOGEN INC	19,778	313.260	6,195,656.280	
IDEX CORP	9,332	207.700	1,938,256.400	
ILLINOIS TOOL WORKS	41,288	228.750	9,444,630.000	
INTUIT INC	35,622	431.520	15,371,605.440	
IDEXX LABORATORIES INC	11,400	485.110	5,530,254.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	31,231	178.680	5,580,355.080	
INTEL CORP	555,519	29.970	16,648,904.430	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	35,897	86.750	3,114,064.750	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	31.890	1,408,039.170	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	35.860	1,938,699.180	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9,506	153.300	1,457,269.800	
INCYTE CORP	24,449	63.920	1,562,780.080	
JOHNSON & JOHNSON	353,492	161.650	57,141,981.800	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	44,033	69.880	3,077,026.040	
KLA CORPORATION	19,222	386.380	7,426,996.360	
DEVON ENERGY CORP	86,347	48.110	4,154,154.170	
KELLOGG CO	32,655	70.550	2,303,810.250	
KEYCORP	118,955	9.320	1,108,660.600	
KIMBERLY-CLARK CORP	46,140	143.410	6,616,937.400	
BLACKROCK INC/NEW YORK	20,163	629.180	12,686,156.340	
KROGER CO	93,167	49.120	4,576,363.040	
LAM RESEARCH CORP	18,529	527.300	9,770,341.700	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	413.900	2,715,597.900	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,551	133.280	1,806,077.280	
AKAMAI TECHNOLOGIES	19,837	85.540	1,696,856.980	
PLUG POWER INC	74,825	7.830	585,879.750	
LENNAR CORP	32,795	114.140	3,743,221.300	
ELI LILLY & CO	109,033	435.920	47,529,665.360	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	31.830	896,205.480	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	98,414	171.570	16,884,889.980	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	40,493	128.060	5,185,533.580	
LOCKHEED MARTIN CORP	31,757	453.150	14,390,684.550	
LOEWS CORP	29,698	58.490	1,737,036.020	
LOWE'S COS INC	81,444	204.320	16,640,638.080	
DOMINION ENERGY INC	114,318	56.350	6,441,819.300	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	42.880	1,732,394.880	
MCCORMICK & CO INC	35,510	89.020	3,161,100.200	

MCDONALD'S CORPORATION	98,911	296.570	29,334,035.270	
S&P GLOBAL INC	44,553	362.180	16,136,205.540	
EVEREST RE GROUP LTD	5,666	385.980	2,186,962.680	
MARKEL CORPORATION	1,713	1,366.620	2,341,020.060	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	82,034	88.850	7,288,720.900	
MARSH & MCLENNAN COS	66,743	180.520	12,048,446.360	
MASCO CORP	28,937	53.240	1,540,605.880	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	8,614	400.930	3,453,611.020	
METLIFE INC	90,251	51.820	4,676,806.820	
MEDTRONIC PLC	179,327	89.410	16,033,627.070	
ACTIVISION BLIZZARD INC	106,328	76.000	8,080,928.000	
CVS HEALTH CORP	177,420	69.710	12,367,948.200	
MERCK & CO.INC.	342,191	117.900	40,344,318.900	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,157	79.870	4,724,869.590	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,455	223.510	2,560,307.050	
MICROSOFT CORP	956,655	312.310	298,772,923.050	
MICRON TECH INC	147,693	59.990	8,860,103.070	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	74,690	74.170	5,539,757.300	
3M CO	75,232	100.900	7,590,908.800	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	97.930	618,036.230	
ENTEGRIS INC	20,987	78.110	1,639,294.570	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	6,445	186.300	1,200,703.500	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,690	289.550	6,569,889.500	
ILLUMINA INC	21,684	209.490	4,542,581.160	
XCEL ENERGY INC	74,522	69.300	5,164,374.600	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,755	96.740	1,427,398.700	
NETAPP INC	28,265	63.270	1,788,326.550	
NEWELL BRANDS INC	41,984	9.510	399,267.840	
NEWMONT CORP	107,944	47.810	5,160,802.640	
NVR INC	405	5,836.510	2,363,786.550	
NIKE INC-CL B	169,660	123.510	20,954,706.600	
NORDSON CORP	6,447	216.400	1,395,130.800	
NORFOLK SOUTHERN CORP	31,621	208.500	6,592,978.500	
EVERSOURCE ENERGY	48,081	76.980	3,701,275.380	
NISOURCE INC	53,270	28.890	1,538,970.300	
NORTHERN TRUST CORP	28,092	71.410	2,006,049.720	
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,567	443.030	8,668,768.010	
WELLS FARGO & CO	512,918	38.280	19,634,501.040	
NUCOR CORP	34,996	137.620	4,816,149.520	
CHENIERE ENERGY INC	30,839	148.270	4,572,498.530	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	52,546	87.040	4,573,603.840	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,019	56.850	5,629,230.150	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13,006	314.410	4,089,216.460	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,516	954.770	8,130,821.320	
ORACLE CORP	218,251	97.520	21,283,837.520	
PACCAR INC	71,053	72.330	5,139,263.490	
PTC INC	15,968	130.390	2,082,067.520	
EXELON CORP	134,582	42.920	5,776,259.440	
PARKER HANNIFIN CORP	17,462	326.880	5,707,978.560	
PAYCHEX INC	44,228	108.620	4,804,045.360	
ALIGN TECHNOLOGY INC	9,713	305.260	2,964,990.380	
PPL CORPORATION	102,363	28.760	2,943,959.880	
PEPSICO INC	186,384	194.270	36,208,819.680	
PENTAIR PLC	25,821	58.410	1,508,204.610	
PFIZER INC	758,190	38.300	29,038,677.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	42.970	1,409,244.120	
CONOCOPHILLIPS	167,119	100.470	16,790,445.930	
PG&E CORP	197,651	17.370	3,433,197.870	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	31,078	209.110	6,498,720.580	
ALTRIA GROUP INC	243,422	45.940	11,182,806.680	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	55,104	113.970	6,280,202.880	
BROWN & BROWN INC	30,650	65.590	2,010,333.500	
GARMIN LTD	19,911	103.830	2,067,359.130	
PPG INDUSTRIES INC	31,297	136.860	4,283,307.420	
COSTCO WHOLESALE CORP	59,677	499.660	29,818,209.820	
T ROWE PRICE GROUP INC	31,190	105.845	3,301,305.550	
QUEST DIAGNOSTICS	14,536	132.430	1,925,002.480	
PROCTER & GAMBLE CO	320,215	154.030	49,322,716.450	
PROGRESSIVE CORP	78,404	134.380	10,535,929.520	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68,538	64.140	4,396,027.320	
PULTE GROUP INC	29,050	67.800	1,969,590.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,196	103.760	3,859,456.960	
QUALCOMM INC	151,084	106.460	16,084,402.640	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	25,844	85.600	2,212,246.400	
EXACT SCIENCES CORP	23,386	78.730	1,841,179.780	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	7,931	240.650	1,908,595.150	
REGENERON PHARMACEUTICALS	14,366	749.590	10,768,609.940	
REPLIGEN CORP	6,730	154.840	1,042,073.200	
RESMED INC	20,171	233.500	4,709,928.500	
US BANCORP	192,993	29.450	5,683,643.850	
SEAGEN INC	18,653	199.990	3,730,413.470	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	46,675	77.220	3,604,243.500	

ROSS STORES INC	47,578	101.950	4,850,577.100	
ROLLINS INC	25,920	42.270	1,095,638.400	
ROPER TECHNOLOGIES INC	14,373	459.300	6,601,518.900	
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,768	270.090	4,258,779.120	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	31,833	77.160	2,456,234.280	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	80.880	1,331,850.960	
ACCENTURE PLC-CL A	84,849	268.890	22,815,047.610	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	182,912	77.890	14,247,015.680	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,340	228.070	3,270,523.800	
AXON ENTERPRISE INC	9,177	192.730	1,768,683.210	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	31,733	183.160	5,812,216.280	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	82,528	55.140	4,550,593.920	
BOOKING HOLDINGS INC	5,209	2,645.920	13,782,597.280	
SCHLUMBERGER LTD	193,046	45.860	8,853,089.560	
SCHWAB (CHARLES) CORP	197,863	47.550	9,408,385.650	
POOL CORP	5,406	351.220	1,898,695.320	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	28,920	137.420	3,974,186.400	
BUNGE LTD	21,715	89.590	1,945,446.850	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	58.160	841,982.320	
ELEVANCE HEALTH INC	32,178	459.350	14,780,964.300	
AMERISOURCEBERGEN CORP	21,286	169.500	3,607,977.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31,921	70.060	2,236,385.260	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	33,603	230.000	7,728,690.000	
CENTENE CORP	78,244	66.860	5,231,393.840	
SMITH (A.O.) CORP	19,467	69.220	1,347,505.740	
SNAP-ON INC	7,068	256.790	1,814,991.720	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	50,944	80.350	4,093,350.400	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	125.800	901,357.000	
EDISON INTERNATIONAL	52,609	74.190	3,903,061.710	
SOUTHERN CO	146,824	75.660	11,108,703.840	
TRUIST FINANCIAL CORP	182,655	27.900	5,096,074.500	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	29.240	576,028.000	
AT&T INC	962,665	17.040	16,403,811.600	
CHEVRON CORP	248,161	157.090	38,983,611.490	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	81.150	1,563,760.500	
STATE STREET CORP	50,667	68.500	3,470,689.500	
STARBUCKS CORP	154,460	106.970	16,522,586.200	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	96.480	2,212,961.760	
STRYKER CORP	45,731	285.600	13,060,773.600	
NETFLIX INC	59,920	335.420	20,098,366.400	
GEN DIGITAL INC	89,004	17.240	1,534,428.960	

KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,318	56.920	1,156,500.560	
SYNOPSYS INC	20,823	370.120	7,707,008.760	
SYSCO CORP	67,797	73.390	4,975,621.830	
INTUITIVE SURGICAL INC	47,389	302.590	14,339,437.510	
TELEFLEX INC	6,985	249.510	1,742,827.350	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	134,781	8.350	1,125,421.350	
TERADYNE INC	22,066	90.960	2,007,123.360	
TEXAS INSTRUMENTS INC	122,437	163.050	19,963,352.850	
TEXTRON INC	25,824	64.780	1,672,878.720	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	52,868	533.500	28,205,078.000	
GLOBE LIFE INC	12,153	107.790	1,309,971.870	
TORO CO	14,644	106.480	1,559,293.120	
DAVITA INC	6,813	99.270	676,326.510	
TRACTOR SUPPLY CO	15,260	243.870	3,721,456.200	
BIO-TECHNE CORP	20,652	81.200	1,676,942.400	
TRIMBLE INC	36,251	47.660	1,727,722.660	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,112	394.010	2,014,179.120	
TYSON FOODS INC	41,316	47.280	1,953,420.480	
UGI CORP	33,476	29.650	992,563.400	
MARATHON OIL CORP	84,059	22.670	1,905,617.530	
UNION PACIFIC CORP	82,657	199.060	16,453,702.420	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	197,362	96.300	19,005,960.600	
UNITEDHEALTH GROUP INC	126,297	490.070	61,894,370.790	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	141.530	1,145,826.880	
VF CORP	51,762	21.390	1,107,189.180	
PARAMOUNT GLOBAL	78,663	15.850	1,246,808.550	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	34,956	350.040	12,235,998.240	
VULCAN MATERIALS CO	18,430	196.090	3,613,938.700	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	98,551	31.590	3,113,226.090	
WALMART INC	201,882	152.550	30,797,099.100	
WASTE MANAGEMENT INC	55,635	170.550	9,488,549.250	
WATERS CORP	8,441	272.430	2,299,581.630	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	32.610	726,713.850	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	9,673	362.720	3,508,590.560	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,386	158.380	2,436,834.680	
VAIL RESORTS INC	5,235	240.060	1,256,714.100	
WESTERN DIGITAL CORP	40,723	32.880	1,338,972.240	
WABTEC CORP	24,118	97.750	2,357,534.500	
WHIRLPOOL CORP	6,832	133.520	912,208.640	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	98.560	2,191,481.600	

WYNN RESORTS LTD	15,379	111.500	1,714,758.500	
NASDAQ INC	47,600	55.200	2,627,520.000	
CME GROUP INC	48,821	185.310	9,047,019.510	
WILLIAMS COS INC	166,525	29.160	4,855,869.000	
LKQ CORP	31,504	56.870	1,791,632.480	
ALLIANT ENERGY CORP	33,966	55.160	1,873,564.560	
WEC ENERGY GROUP INC	43,488	95.450	4,150,929.600	
CARMAX INC	22,414	73.410	1,645,411.740	
TJX COMPANIES INC	155,600	77.980	12,133,688.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	6,730	271.770	1,829,012.100	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	4.440	692,857.560	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	50.540	1,189,105.120	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,146	210.970	3,617,291.620	
CBRE GROUP INC	41,089	73.810	3,032,779.090	
LIBERTY GLOBAL PLC	35,049	17.640	618,264.360	
REGIONS FINANCIAL CORP	122,025	16.090	1,963,382.250	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	306.890	1,576,493.930	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,003	415.980	2,497,127.940	
WESTLAKE CORP	4,187	115.340	482,928.580	
T-MOBILE US INC	83,642	142.030	11,879,673.260	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	62.520	2,989,706.400	
MOSAIC CO/THE	48,502	36.900	1,789,723.800	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	301.180	1,467,047.780	
CELANESE CORP	13,613	102.930	1,401,186.090	
DEXCOM INC	52,999	122.570	6,496,087.430	
EXPEDIA GROUP INC	19,389	91.030	1,764,980.670	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	25,070	67.790	1,699,495.300	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,506	290.860	4,219,215.160	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	18.450	664,827.300	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	75,703	108.490	8,213,018.470	
LIVE NATION	25,515	78.560	2,004,458.400	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,784	2,054.840	7,775,514.560	
TRANSDIGM GROUP INC	7,059	810.140	5,718,778.260	
MASTERCARD INC	116,035	382.540	44,388,028.900	
OWENS CORNING	13,227	105.760	1,398,887.520	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	80.060	1,445,963.660	
AERCAP HOLDINGS NV	24,379	55.510	1,353,278.290	
FIRST SOLAR INC	13,287	180.740	2,401,492.380	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	15,300	154.850	2,369,205.000	
AECOM TECHNOLOGY CORP	17,000	80.020	1,360,340.000	

DELTA AIR LINES INC	21,592	33.800	729,809.600	
INSULET CORP	9,083	322.850	2,932,446.550	
DISCOVER FINANCIAL	35,918	95.350	3,424,781.300	
TE CONNECTIVITY LTD	43,069	120.590	5,193,690.710	
MASIMO CORP	7,328	174.550	1,279,102.400	
LULULEMON ATHLETICA INC	15,887	379.320	6,026,256.840	
VMWARE INC	29,109	123.090	3,583,026.810	
MERCADOLIBRE INC	6,180	1,288.920	7,965,525.600	
ULTA BEAUTY INC	6,797	504.510	3,429,154.470	
INVESCO LTD	57,267	15.930	912,263.310	
MSCI INC	10,921	476.070	5,199,160.470	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	209,639	95.100	19,936,668.900	
VISA INC	219,836	231.270	50,841,471.720	
KEURIG DR PEPPER INC	105,959	32.590	3,453,203.810	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,549	149.740	3,975,447.260	
MARATHON PETROLEUM CORP	63,984	111.720	7,148,292.480	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	65.320	1,057,008.240	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	279,350	16.790	4,690,286.500	
XYLEM INC	25,527	106.810	2,726,538.870	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	33,932	90.540	3,072,203.280	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,330	198.340	1,255,492.200	
SPLUNK INC	20,626	85.790	1,769,504.540	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	232.200	1,895,216.400	
HCA HEALTHCARE INC	28,857	278.540	8,037,828.780	
VERISK ANALYTICS INC	21,512	214.470	4,613,678.640	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,792	136.530	1,063,841.760	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,881	228.210	2,026,733.010	
NXP SEMICONDUCTOR NV	35,214	165.200	5,817,352.800	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,741	93.270	1,841,243.070	
TARGA RESOURCES CORP	26,950	70.800	1,908,060.000	
LEAR CORP	9,620	124.270	1,195,477.400	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,261	138.450	2,112,885.450	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	28,639	55.360	1,585,455.040	
DOLLAR GENERAL CORP	30,721	218.180	6,702,707.780	
FORTINET INC	90,828	67.010	6,086,384.280	
HORIZON PHARMA PLC	28,293	110.400	3,123,547.200	
TESLA INC	362,277	168.540	61,058,165.580	
GENERAC HOLDINGS INC	9,111	112.840	1,028,085.240	
ENPHASE ENERGY INC	18,723	161.420	3,022,266.660	
GENERAL MOTORS CO	193,897	33.080	6,414,112.760	

ALLY FINANCIAL INC	39,230	25.310	992,911.300	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	10,655	190.350	2,028,179.250	
APTIV PLC	37,576	94.910	3,566,338.160	
PHILLIPS 66	64,680	94.230	6,094,796.400	
META PLATFORMS INC	303,449	233.080	70,727,892.920	
IQVIA HOLDINGS INC	25,473	188.080	4,790,961.840	
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,180	130.490	2,763,778.200	
SERVICENOW INC	27,592	454.140	12,530,630.880	
PALO ALTO NETWORKS INC	41,229	199.400	8,221,062.600	
WORKDAY INC	26,011	179.400	4,666,373.400	
ABBVIE INC	238,853	146.420	34,972,856.260	
ZOETIS INC	63,475	185.140	11,751,761.500	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	16.660	903,155.260	
CDW CORP	18,651	168.660	3,145,677.660	
HOWMET AEROSPACE INC	47,590	44.260	2,106,333.400	
TWILIO INC	25,710	48.920	1,257,733.200	
SNAP INC	152,250	8.700	1,324,575.000	
TRADE DESK INC A	61,854	64.970	4,018,654.380	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	28,191	70.840	1,997,050.440	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	28.240	249,782.800	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	28.150	559,368.650	
OKTA INC	21,831	78.250	1,708,275.750	
BLACK KNIGHT INC	21,663	54.720	1,185,399.360	
BAKER HUGHES CO	137,839	27.890	3,844,329.710	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	18,557	111.620	2,071,332.340	
BROADCOM INC	56,286	626.270	35,250,233.220	
ARES MANAGEMENT CORP	19,534	81.620	1,594,365.080	
MONGODB INC	9,021	262.020	2,363,682.420	
BURLINGTON STORES INC	8,453	172.230	1,455,860.190	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	61,321	9.000	551,889.000	
VEEVA SYSTEMS INC	18,727	178.870	3,349,698.490	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,938	40.330	1,005,749.540	
EVERGY INC	33,192	63.120	2,095,079.040	
ALLEGION PLC	13,423	108.310	1,453,845.130	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	58.520	1,071,735.280	
STERIS PLC	14,147	189.390	2,679,300.330	
DOCUSIGN INC	26,362	50.010	1,318,363.620	
WIX.COM LTD	8,997	77.510	697,357.470	
DROPBOX INC	45,227	21.760	984,139.520	
KKR & CO INC	74,006	49.180	3,639,615.080	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	41.990	212,049.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,770	64.430	1,789,221.100	
MODERNA INC	44,693	130.830	5,847,185.190	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	35,250	142.410	5,019,952.500	

ARAMARK	31,133	36.650	1,141,024.450	
CIGNA GROUP	41,150	263.450	10,840,967.500	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	45.830	1,501,849.100	
DOW INC	96,707	53.450	5,168,989.150	
OVINTIV INC	31,603	34.210	1,081,138.630	
AMCOR PLC	188,789	10.390	1,961,517.710	
PINTEREST INC	79,624	21.530	1,714,304.720	
FOX CORP-A	36,501	31.190	1,138,466.190	
FOX CORP-B	28,295	28.640	810,368.800	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	8.060	343,243.160	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	28,442	133.800	3,805,539.600	
CHEWY INC	9,648	34.000	328,032.000	
AVANTOR INC	97,157	20.580	1,999,491.060	
DYNATRACE INC	32,648	46.260	1,510,296.480	
CLOUDFLARE INC	35,474	49.210	1,745,675.540	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	72.340	998,292.000	
CARRIER GLOBAL CORP	113,892	43.080	4,906,467.360	
OTIS WORLDWIDE CORP	56,437	85.450	4,822,541.650	
UBER TECHNOLOGIES INC	204,870	38.790	7,946,907.300	
CORTEVA INC	97,725	57.570	5,626,028.250	
MATCH GROUP INC	35,259	32.360	1,140,981.240	
FERGUSON PLC	27,517	144.890	3,986,938.130	
BILL HOLDINGS INC	11,988	99.150	1,188,610.200	
BLACKSTONE INC	95,741	82.580	7,906,291.780	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,322	168.520	896,863.440	
CARLYLE GROUP INC	24,530	26.000	637,780.000	
DATADOG INC	35,218	86.000	3,028,748.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	57.270	1,471,209.030	
INGERSOLL RAND INC	50,384	58.410	2,942,929.440	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	50,030	75.900	3,797,277.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	7,334	273.180	2,003,502.120	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	14.110	541,005.620	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	28.740	886,312.860	
AON PLC	27,982	333.760	9,339,272.320	
WARNER BROS DISCOVERY INC	320,115	13.040	4,174,299.600	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,386.190	1,255,888.140	
BENTLEY SYSTEMS INC	28,502	45.890	1,307,956.780	
COINBASE GLOBAL INC	17,399	62.640	1,089,873.360	
AIRBNB INC	51,788	113.190	5,861,883.720	
CONSTELLATION ENERGY CORP	44,942	79.455	3,570,866.610	
ROYALTY PHARMA PLC	48,700	33.860	1,648,982.000	
ROBLOX CORP	51,683	38.870	2,008,918.210	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	41,904	21.100	884,174.400	
VIATRIS INC	150,826	9.590	1,446,421.340	

CAESARS ENTERTAINMENT INC	26,734	44.660	1,193,940.440	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	77.700	1,231,234.200	
HF SINCLAIR CORP	20,299	40.500	822,109.500	
SNOWFLAKE INC	30,955	172.040	5,325,498.200	
DOORDASH INC	33,971	68.760	2,335,845.960	
ARISTA NETWORKS INC	33,511	141.240	4,733,093.640	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	55,400	63.640	3,525,656.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	234,244	9.940	2,328,385.360	
FNF GROUP	31,004	34.150	1,058,786.600	
JACOBS SOLUTIONS INC	16,615	114.630	1,904,577.450	
MARVELL TECHNOLOGY INC	117,157	40.430	4,736,657.510	
APA CORP	40,946	32.800	1,343,028.800	
LINDE PLC	66,552	368.900	24,551,032.800	
LUCID GROUP INC	44,910	7.160	321,555.600	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	54.480	652,724.880	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	169.830	631,937.430	
TOAST INC	32,620	21.120	688,934.400	
GRAB HOLDINGS LTD	168,328	3.190	536,966.320	
CATALENT INC	20,564	33.590	690,744.760	
SYNCHRONY FINANCIAL	65,868	27.120	1,786,340.160	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	63,378	25.400	1,609,801.200	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	137.370	719,406.690	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22,760	145.670	3,315,449.200	
HUBSPOT INC	5,895	459.710	2,709,990.450	
QORVO INC	14,144	92.590	1,309,592.960	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	77.500	1,188,462.500	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	7,789	294.890	2,296,898.210	
GODADDY INC	19,713	69.830	1,376,558.790	
ETSY INC	18,558	94.840	1,760,040.720	
TRANSUNION	25,708	65.990	1,696,470.920	
ALCOA CORP	23,941	36.140	865,227.740	
BLOCK INC	74,347	57.530	4,277,182.910	
DUPONT DE NEMOURS INC	68,003	64.140	4,361,712.420	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	26,221	65.990	1,730,323.790	
WESTROCK CO	34,286	27.890	956,236.540	
KRAFT HEINZ CO	101,276	40.680	4,119,907.680	
NOVOCURE LTD	12,317	71.490	880,542.330	
FORTIVE CORP	42,608	64.550	2,750,346.400	
WASTE CONNECTIONS INC	35,315	144.870	5,116,084.050	
ALPHABET INC-CL A	803,970	111.750	89,843,647.500	

	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	173,258	14.090	2,441,205.220	
	PAYPAL HOLDINGS INC	145,052	63.380	9,193,395.760	
	SEA LTD ADR	50,316	85.540	4,304,030.640	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,768	22.820	1,295,445.760	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	47.340	1,059,185.160	
	ALPHABET INC-CL C	742,419	112.280	83,358,805.320	
	ZSCALER INC	12,304	116.790	1,436,984.160	
	ATLASSIAN CORP PLC	19,972	137.420	2,744,552.240	
	ROKU INC	15,660	55.930	875,863.800	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,968	339.940	5,088,221.920	
	VISTRA CORP	49,633	25.220	1,251,744.260	
アメリカ・ドル　小計		45,712,229		4,824,103,239.540 (647,298,172,679)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	14.395	661,637.380	
	ASHTEAD GROUP	58,565	46.670	2,733,228.550	
	SEVERN TRENT PLC	31,034	29.470	914,571.980	
	BARCLAYS PLC	2,207,571	1.532	3,381,998.770	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	5.000	620,980.000	
	BT GROUP PLC	904,198	1.546	1,397,890.100	
	BUNZL PLC	46,691	31.720	1,481,038.520	
	AVIVA PLC	353,288	4.129	1,458,726.150	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	67.820	1,395,260.860	
	DIAGEO PLC	306,300	35.840	10,977,792.000	
	SCHRODERS PLC	110,366	4.667	515,078.120	
	DCC PLC	16,599	47.750	792,602.250	
	NATIONAL GRID PLC	497,162	11.555	5,744,706.910	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.532	570,692.540	
	BAE SYSTEMS PLC	425,672	9.938	4,230,328.330	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	289,114	27.540	7,962,199.560	
	HALMA PLC	51,066	23.850	1,217,924.100	
	NEXT PLC	16,093	68.080	1,095,611.440	
	IMPERIAL BRANDS PLC	125,526	18.950	2,378,717.700	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	19.540	390,331.040	
	ANGLO AMERICAN PLC	176,521	24.440	4,314,173.240	
	COMPASS GROUP PLC	240,717	20.910	5,033,392.470	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,680,375	6.011	16,111,734.120	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.261	1,936,318.130	
	UNILEVER PLC	341,116	42.925	14,642,404.300	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.865	984,032.180	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	19.175	812,080.420	
	PEARSON PLC	84,159	7.972	670,915.540	
	PERSIMMON PLC	56,474	13.390	756,186.860	

PRUDENTIAL PLC	379,082	11.780	4,465,585.960	
RIO TINTO PLC	153,140	49.845	7,633,263.300	
VODAFONE GROUP PLC	3,693,933	0.927	3,424,275.890	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	97,637	64.040	6,252,673.480	
RELX PLC	259,441	24.630	6,390,031.830	
RENTOKIL INITIAL PLC	317,679	6.364	2,021,709.150	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	1.563	1,753,567.210	
NATWEST GROUP PLC	684,417	2.606	1,783,590.700	
ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	11.205	755,754.840	
SSE PLC	145,097	18.765	2,722,745.200	
BP PLC	2,434,799	4.871	11,859,905.920	
SAGE GROUP PLC(THE)	128,893	8.078	1,041,197.650	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.535	854,776.820	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	111.800	1,201,961.800	
STANDARD CHARTERED PLC	316,670	6.138	1,943,720.460	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,257,724	0.461	4,267,810.760	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.255	715,178.060	
TESCO PLC	1,032,016	2.779	2,867,972.460	
3I GROUP PLC	125,530	17.460	2,191,753.800	
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	12.570	1,582,940.100	
GSK PLC	553,801	14.364	7,954,797.560	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	51,576	84.580	4,362,298.080	
WPP PLC	142,785	8.886	1,268,787.510	
ASTRAZENECA PLC	208,861	118.200	24,687,370.200	
WHITBREAD PLC	25,470	32.420	825,737.400	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	41.520	967,789.680	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	25.060	1,308,858.740	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	53.180	1,156,771.360	
SAINSBURY (J) PLC	283,091	2.852	807,375.530	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	21.750	463,818.750	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	44.350	731,287.150	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	18.595	343,170.720	
ABRDN PLC	285,831	2.053	586,811.040	
EXPERIAN PLC	121,741	27.280	3,321,094.480	
MONDI PLC	58,887	12.855	756,992.380	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.832	289,329.740	
OCADO GROUP PLC	69,766	4.550	317,435.300	
INFORMA PLC	186,195	6.984	1,300,385.880	
GLENCORE PLC	1,408,346	4.451	6,268,548.040	
ENTAIN PLC	74,451	14.800	1,101,874.800	
COCA-COLA HBC AG	31,035	25.230	783,013.050	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,717	5.728	496,714.970	
M&G PLC	270,401	1.996	539,720.390	

	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.644	628,124.720	
	HALEON PLC	703,324	3.398	2,389,894.950	
	SHELL PLC	951,603	23.985	22,824,197.950	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	6.278	695,809.570	
イギリス・ポンド　小計		37,614,981		248,090,978.890 (42,063,825,471)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	32.330	6,058,771.320	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	228,914	28.800	6,592,723.200	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	5.076	1,460,735.740	
	FIRST INTERNATIONAL BANK OF ISRAEL LTD/THE	7,896	136.500	1,077,804.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	712.700	2,373,291.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	151.700	1,907,475.800	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.690	3,045,423.360	
	ICL GROUP LTD	103,067	22.560	2,325,191.520	
	NICE LTD	9,053	693.000	6,273,729.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	122.800	2,141,632.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	213.500	997,472.000	
イスラエル・シュケル　小計		1,025,067		34,254,248.940 (1,260,618,019)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	61.020	1,727,232.120	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	478,692	21.700	10,387,616.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	234,609	20.630	4,839,983.670	
	TELSTRA GROUP LTD	482,855	4.310	2,081,105.050	
	ASX LTD	23,664	69.860	1,653,167.040	
	BHP GROUP LTD	680,355	44.450	30,241,779.750	
	AMPOL LTD	31,828	29.840	949,747.520	
	COMPUTERSHARE LT	72,081	22.050	1,589,386.050	
	CSL LIMITED	65,382	303.200	19,823,822.400	
	REA GROUP LTD	6,134	137.650	844,345.100	
	TRANSURBAN GROUP	405,358	14.780	5,991,191.240	
	COCHLEAR LTD	8,356	244.930	2,046,635.080	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	8.410	1,793,255.890	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	227,639	97.850	22,274,476.150	
	RIO TINTO LIMITED	49,873	110.920	5,531,913.160	
	APA GROUP	164,300	10.440	1,715,292.000	
	ARISTOCRAT LEISU	76,675	37.990	2,912,883.250	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	4.890	1,760,800.980	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	34.280	2,083,092.760	
	IGO LTD	91,947	14.480	1,331,392.560	
	ORICA LTD	63,862	16.470	1,051,807.140	

	LEND LEASE CORP LTD	107,181	7.940	851,017.140	
	BLUESCOPE STEEL LTD	75,503	19.550	1,476,083.650	
	MACQUARIE GROUP LTD	50,698	177.480	8,997,881.040	
	SUNCORP GROUP LTD	161,737	12.330	1,994,217.210	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	430,429	26.260	11,303,065.540	
	NEWCREST MINING LTD	126,686	29.090	3,685,295.740	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.320	712,004.880	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	215,572	15.210	3,278,850.120	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	14.030	2,281,684.870	
	REECE LTD	31,558	18.220	574,986.760	
	SANTOS LTD	417,358	7.200	3,004,977.600	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	35.640	2,312,929.080	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	32.060	833,079.100	
	WESFARMERS LTD	158,315	51.350	8,129,475.250	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	264,886	33.740	8,937,253.640	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	169,400	38.580	6,535,452.000	
	SEEK LTD	39,064	23.480	917,222.720	
	MINERAL RESOURCES LTD	21,179	72.530	1,536,112.870	
	BRAMBLES LTD	177,669	14.130	2,510,462.970	
	PILBARA MINERALS LTD	327,947	4.550	1,492,158.850	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.520	784,428.480	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	87,104	13.180	1,148,030.720	
	XERO LTD	18,860	92.240	1,739,646.400	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	27.150	645,654.150	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	4.920	1,433,048.400	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	6.360	1,020,589.200	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	410,226	24.110	9,890,548.860	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.570	1,473,521.070	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	4.150	2,476,280.100	
	COLES GROUP LTD	171,684	18.130	3,112,630.920	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	68.200	1,453,342.000	
オーストラリア・ドル　小計		9,384,345		219,172,856.640 (19,964,455,511)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	67,555	79.270	5,355,084.850	
	BARRICK GOLD CORP	239,565	26.450	6,336,494.250	
	BANK OF MONTREAL	90,726	117.780	10,685,708.280	
	BANK OF NOVA SCOTIA	160,517	66.090	10,608,568.530	
	NATIONAL BANK OF CANADA	46,066	100.480	4,628,711.680	
	BCE INC	7,697	64.140	493,685.580	
	BROOKFIELD CORP	194,244	41.640	8,088,320.160	
	SAPUTO INC	34,582	35.500	1,227,661.000	

ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	11.930	1,101,270.230	
DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	104.750	1,205,463.000	
CGI INC	27,918	137.470	3,837,887.460	
CCL INDUSTRIES INC	21,058	64.980	1,368,348.840	
CAE INC	40,808	29.390	1,199,347.120	
CAMECO CORP	54,264	38.280	2,077,225.920	
ROGERS COMM-CL B	46,626	66.180	3,085,708.680	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	123,724	55.640	6,884,003.360	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	151,940	75.680	11,498,819.200	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,465	175.390	1,133,896.350	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	39.300	641,769.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	77,911	162.450	12,656,641.950	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	40.440	878,073.720	
OPEN TEXT CORP	33,217	55.460	1,842,214.820	
EMPIRE CO LTD	20,608	35.130	723,959.040	
KINROSS GOLD CORP	132,063	7.420	979,907.460	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	26,641	77.560	2,066,275.960	
FORTIS INC	62,031	61.360	3,806,222.160	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	33.450	2,857,332.450	
TELUS CORP	31,890	27.570	879,207.300	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	38.060	1,301,956.480	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	62.140	1,693,066.440	
ENBRIDGE INC	278,758	53.140	14,813,200.120	
IGM FINANCIAL INC	12,478	38.890	485,269.420	
MANULIFE FINANCIAL CORP	249,587	26.240	6,549,162.880	
LOBLAW CO LTD	21,600	123.590	2,669,544.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	112,792	66.970	7,553,680.240	
MAGNA INTERNATIONAL INC	35,844	70.440	2,524,851.360	
SUN LIFE FINANCIAL INC	81,434	64.710	5,269,594.140	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,229	925.800	2,989,408.200	
METRO INC	30,428	77.160	2,347,824.480	
EMERA INC	36,998	58.750	2,173,632.500	
ONEX CORP	10,157	60.320	612,670.240	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	23.480	1,300,158.040	
POWER CORP OF CANADA	76,591	35.880	2,748,085.080	
QUEBECOR INC-B	17,195	33.820	581,534.900	
ROYAL BANK OF CANADA	184,606	128.960	23,806,789.760	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	126,848	109.210	13,853,070.080	
SUNCOR ENERGY INC	185,738	39.180	7,277,214.840	
LUNDIN MINING CORP	77,139	10.670	823,073.130	

	TECK RESOURCES LTD-CL B	58,904	59.890	3,527,760.560	
	THOMSON REUTERS CORP	22,378	167.940	3,758,161.320	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,698	105.010	1,438,426.980	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	242,158	82.150	19,893,279.700	
	TC ENERGY CORP	139,293	55.740	7,764,191.820	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	100.920	817,653.840	
	WESTON (GEORGE) LTD	9,839	170.250	1,675,089.750	
	INTACT FINANCIAL CORP	24,452	202.710	4,956,664.920	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	58,539	69.290	4,056,167.310	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,805	2,635.160	7,391,623.800	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	26,282	213.020	5,598,591.640	
	TOURMALINE OIL CORP	46,466	55.900	2,597,449.400	
	KEYERA CORP	39,467	32.250	1,272,810.750	
	PARKLAND CORP	15,665	33.820	529,790.300	
	ALTAGAS LTD	33,833	23.570	797,443.810	
	PEMBINA PIPELINE CORP	69,235	43.380	3,003,414.300	
	DOLLARAMA INC	36,204	83.850	3,035,705.400	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	202,950	21.720	4,408,074.000	
	ARC RESOURCES LTD	78,639	17.030	1,339,222.170	
	NORTHLAND POWER INC	34,152	28.630	977,771.760	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	20.350	1,042,795.050	
	TMX GROUP LTD	7,040	144.000	1,013,760.000	
	BRP INC	4,307	98.880	425,876.160	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	11.530	1,139,394.600	
	NUTRIEN LTD	71,801	84.670	6,079,390.670	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	143.160	1,659,367.560	
	WSP GLOBAL INC	17,782	179.470	3,191,335.540	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,516	82.750	1,035,699.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	27,577	50.350	1,388,501.950	
	NUVEI CORP	7,929	48.550	384,952.950	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	47.090	758,290.270	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	43.220	2,258,201.780	
	AIR CANADA	41,444	20.990	869,909.560	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	41,208	97.660	4,024,373.280	
	SHOPIFY INC	158,231	84.580	13,383,177.980	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	193.980	1,015,873.260	
	HYDRO ONE LTD	46,225	39.260	1,814,793.500	
カナダ・ドル　小計		5,418,012		329,846,581.320 (33,113,298,299)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	169,000	3.630	613,470.000	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	244,510	31.620	7,731,406.200	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	6.970	274,618.000	
	SEATRIUM LTD	7,235,222	0.130	940,578.860	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	34.300	531,650.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.490	947,102.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	1.100	837,312.300	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.420	1,187,058.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	459,198	12.320	5,657,319.360	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,092,930	2.570	2,808,830.100	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.880	956,676.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	153,766	28.120	4,323,899.920	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.960	303,456.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	15.510	679,338.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.940	1,018,490.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	431,290	3.780	1,630,276.200	
シンガポール・ドル　小計		11,395,309		30,441,480.940 (3,085,548,508)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	56.940	1,351,413.960	
	NESTLE SA-REGISTERED	371,943	114.580	42,617,228.940	
	CIE FINANC RICHEMONT	70,991	146.700	10,414,379.700	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	94,934	280.200	26,600,506.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	196.950	1,046,001.450	
	SIKA INHABER	20,139	248.000	4,994,472.000	
	SGS SA-REG	23,250	80.860	1,879,995.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	291,679	91.940	26,816,967.260	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,149	139.700	1,138,415.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,941.000	892,860.000	
	CLARIANT AG-REG	44,162	13.960	616,501.520	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	594.000	2,038,014.000	
	ABB LTD	212,002	32.600	6,911,265.200	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	29.030	576,013.260	
	GEBERIT AG	4,577	501.200	2,293,992.400	
	LONZA GROUP AG-REG	10,240	565.800	5,793,792.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	11,100.000	1,520,700.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	110,400.000	1,766,400.000	
	GIVAUDAN-REG	1,279	3,111.000	3,978,969.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	20,856	426.600	8,897,169.600	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,612	307.800	1,111,773.600	
	HOLCIM LTD	75,608	57.660	4,359,557.280	
	TEMENOS GROUP	7,082	72.880	516,136.160	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	92.950	434,355.350	
	SONOVA HOLDING AG	6,984	282.900	1,975,773.600	

	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,887	273.500	1,883,594.500	
	STRAUMANN HOLDING AG	14,531	140.100	2,035,793.100	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,215	294.300	946,174.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	53.900	499,060.100	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	188.200	511,904.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,978	555.400	2,209,381.200	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	84.800	415,774.400	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	713.000	577,530.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,636	79.400	1,082,698.400	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,956	847.200	2,504,323.200	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,865	61.360	1,648,436.400	
	SWISS RE LTD	41,653	89.040	3,708,783.120	
	BKW AG	3,194	160.100	511,359.400	
	SIG GROUP AG	38,322	25.820	989,474.040	
	ALCON INC	68,865	70.580	4,860,491.700	
	UBS GROUP AG	447,218	17.270	7,723,454.860	
	VAT GROUP AG	3,325	321.200	1,067,990.000	
スイス・フラン　小計		2,017,428		193,718,876.300 (29,228,304,056)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	361,234	147.200	53,173,644.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	194,204	129.600	25,168,838.400	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	54.320	22,705,760.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	243.700	6,276,493.500	
	INVESTOR AB-A SHS	62,097	220.500	13,692,388.500	
	LUNDBERGS B	7,859	480.400	3,775,463.600	
	SKF AB-B SHS	46,594	179.100	8,344,985.400	
	SANDVIK AB	150,884	203.200	30,659,628.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	110.350	24,536,101.800	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	148.400	6,520,250.800	
	SWEDBANK AB	130,971	164.100	21,492,341.100	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,465	142.500	13,176,262.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	184,499	85.960	15,859,534.040	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	210.000	5,081,580.000	
	VOLVO AB-B SHS	209,640	204.400	42,850,416.000	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	407.200	4,129,822.400	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	105.100	7,110,435.400	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	286.400	4,379,628.800	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	285.800	6,094,685.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	165.900	4,463,871.300	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	85.040	6,470,268.400	
	INVESTOR AB-B SHS	254,673	215.250	54,818,363.250	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	110,008	141.080	15,519,928.640	
	ASSA ABLOY AB-B	140,043	242.000	33,890,406.000	
	TELIA CO AB	344,810	26.960	9,296,077.600	

	BOLIDEN AB	36,260	354.600	12,857,796.000	
	ALFA LAVAL AB	35,313	379.100	13,387,158.300	
	KINNEVIK AB-B	36,278	164.950	5,984,056.100	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	39.900	2,910,385.800	
	INDUTRADE AB	39,178	252.000	9,872,856.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	90.180	4,307,808.420	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	114.300	24,326,697.600	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	222.800	4,095,064.000	
	HEXAGON AB-B SHS	275,826	114.750	31,651,033.500	
	SAGAX AB	28,022	219.300	6,145,224.600	
	EPIROC AB-A	84,563	202.200	17,098,638.600	
	EPIROC AB-B	61,487	173.600	10,674,143.200	
	ESSITY AB-B	86,900	299.000	25,983,100.000	
	EQT AB	55,194	207.200	11,436,196.800	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	52.450	4,185,037.950	
	VOLVO CAR AB	63,710	39.100	2,491,061.000	
	LIFCO AB	26,835	235.500	6,319,642.500	
	EVOLUTION AB	25,280	1,299.200	32,843,776.000	
	NORDEA BANK ABP	457,613	105.580	48,314,780.540	
	INVESTMENT AB LATOUR	13,616	218.600	2,976,457.600	
スウェーデン・クローナ　小計		4,999,413		717,348,090.540 (9,425,953,910)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	12,549	1,103.500	13,847,821.500	
	A P MOLLER A/S	663	11,800.000	7,823,400.000	
	AP MOLLER MAERSK A	520	11,620.000	6,042,400.000	
	DANSKE BANK A/S	88,591	137.100	12,145,826.100	
	GENMAB A/S	8,614	2,733.000	23,542,062.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	349.400	10,410,373.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,725.000	1,505,925.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	223,550	1,141.600	255,204,680.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	140,190	201.650	28,269,313.500	
	COLOPLAST-B	15,343	974.200	14,947,150.600	
	DSV A/S	24,578	1,311.000	32,221,758.000	
	DEMANT A/S	11,367	284.200	3,230,501.400	
	TRYG A/S	44,887	156.800	7,038,281.600	
	PANDORA A/S	12,473	603.000	7,521,219.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	522.000	6,544,836.000	
	ORSTED A/S	26,911	623.400	16,776,317.400	
デンマーク・クローネ　小計		653,442		447,071,865.100 (8,852,022,929)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.840	1,452,774.440	
	EBOS GROUP LTD	25,631	45.290	1,160,827.990	
	FISHER & PAYKEL	78,460	26.690	2,094,097.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.210	1,141,187.980	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.595	414,390.230	

	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.515	1,319,783.620	
ニュージーランド・ドル　小計		789,612		7,583,061.660 (648,958,417)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	191.050	10,770,443.750	
	NORSK HYDRO ASA	210,898	75.100	15,838,439.800	
	TELENOR ASA	85,954	129.950	11,169,722.300	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	478.400	5,350,904.000	
	ORKLA ASA	116,068	81.400	9,447,935.200	
	EQUINOR ASA	132,805	308.500	40,970,342.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	418.800	8,306,479.200	
	AKER BP ASA	38,723	242.100	9,374,838.300	
	SALMAR ASA	7,248	440.800	3,194,918.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	180.200	4,634,924.200	
	ADEVINTA ASA	24,382	80.000	1,950,560.000	
	DNB BANK ASA	139,232	184.150	25,639,572.800	
ノルウェー・クローネ　小計		868,425		146,649,080.450 (1,875,641,739)	
ユーロ	CRH PLC	102,020	44.910	4,581,718.200	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	23,185	182.800	4,238,218.000	
	KERRY GROUP PLC-A	20,761	94.480	1,961,499.280	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	61.420	1,342,641.200	
	UMICORE	24,290	29.060	705,867.400	
	AIR LIQUIDE	70,234	162.000	11,377,908.000	
	AIRBUS SE	80,311	121.700	9,773,848.700	
	AXA SA	250,734	27.160	6,809,935.440	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	85,994	27.870	2,396,652.780	
	ADIDAS AG	22,590	163.720	3,698,434.800	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	18.860	2,727,401.180	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	169.000	527,280.000	
	DANONE	88,043	58.210	5,124,983.030	
	SAFRAN SA	46,683	138.980	6,488,003.340	
	INTESA SANPAOLO	2,233,744	2.415	5,394,491.760	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	45,234	108.720	4,917,840.480	
	ACCOR SA	20,392	32.150	655,602.800	
	BOUYGUES	29,123	31.980	931,353.540	
	BNP PARIBAS	147,219	57.920	8,526,924.480	
	THALES SA	15,023	137.650	2,067,915.950	
	CAPGEMINI SA	22,531	163.450	3,682,691.950	
	UNICREDIT SPA	266,042	18.802	5,002,121.680	
	D'IETEREN TRDG	2,736	167.400	458,006.400	
	COMMERZBANK AG	141,036	9.874	1,392,589.460	
	EIFFAGE	11,784	105.250	1,240,266.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	28.220	1,659,731.080	
	UNITED INTERNET	10,010	14.360	143,743.600	
	PUBLICIS GROUPE	29,383	69.540	2,043,293.820	

IBERDROLA SA	828,982	11.775	9,761,263.050	
ENI SPA	340,270	13.432	4,570,506.640	
JERONIMO MARTINS	34,644	22.740	787,804.560	
KESKO OYJ-B	35,252	18.890	665,910.280	
KBC GROUPE	35,962	60.820	2,187,208.840	
HANNOVER RUECK SE	8,405	189.450	1,592,327.250	
WARTSILA OYJ	50,956	10.835	552,108.260	
L'OREAL	32,571	417.200	13,588,621.200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	37,297	872.300	32,534,173.100	
GEA GROUP AG	24,987	39.940	997,980.780	
BOLLORE	114,808	5.990	687,699.920	
MEDIOBANCA SPA	86,792	9.962	864,621.900	
MICHELIN(CGDE)-B	88,698	29.170	2,587,320.660	
CONTINENTAL AG	13,417	65.920	884,448.640	
DEUTSCHE POST AG-REG	136,158	41.625	5,667,576.750	
OMV AG	17,258	41.960	724,145.680	
VERBUND AG	10,663	77.800	829,581.400	
PERNOD-RICARD	28,172	213.100	6,003,453.200	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	23,311	51.320	1,196,320.520	
RENAULT SA	27,902	33.025	921,463.550	
REPSOL SA	179,874	13.105	2,357,248.770	
REMY COINTREAU	2,866	155.000	444,230.000	
MERCK KGAA	18,389	161.250	2,965,226.250	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	62,911	52.840	3,324,217.240	
RWE AG	85,480	41.810	3,573,918.800	
SEB SA	2,596	103.100	267,647.600	
SOCIETE GENERALE-A	115,239	21.905	2,524,310.290	
VINCI S.A.	72,410	109.380	7,920,205.800	
SODEXO	12,910	97.540	1,259,241.400	
SOFINA	2,281	200.600	457,568.600	
SOLVAY SA	9,070	107.600	975,932.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	73,488	155.560	11,431,793.280	
VIVENDI SE	98,944	9.728	962,527.230	
SAP SE	139,754	122.680	17,145,020.720	
TELEFONICA S.A	750,387	4.030	3,024,059.610	
TOTALENERGIES SE	335,862	55.590	18,670,568.580	
VALEO	26,570	17.410	462,583.700	
E.ON SE	308,720	12.095	3,733,968.400	
VOEST-ALPINE AG	18,032	30.480	549,615.360	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	67.060	896,994.560	
SIEMENS AG-REG	102,581	149.160	15,300,981.960	
UPM-KYMMENE OYJ	77,752	30.300	2,355,885.600	
ING GROEP NV-CVA	514,463	11.062	5,690,989.700	
PUMA AG	12,194	50.660	617,748.040	
BAYER AG	133,908	58.290	7,805,497.320	
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	11.780	883,028.800	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	74.280	1,796,907.480	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	109,427	67.660	7,403,830.820	
BASF SE	126,695	47.125	5,970,501.870	
BEIERSDORF AG	12,940	124.450	1,610,383.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	17,008	69.520	1,182,396.160	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	25,398	44.540	1,131,226.920	
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	343.050	2,281,625.550	
ORANGE	280,606	11.630	3,263,447.780	
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	46.150	2,957,292.000	
RANDSTAD NV	15,584	47.660	742,733.440	
ALLIANZ SE	53,972	212.350	11,460,954.200	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	377,252	4.827	1,820,995.400	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	143,719	31.080	4,466,786.520	
HERMES INTL	4,325	1,959.800	8,476,135.000	
ENDESA S.A.	37,701	19.765	745,160.260	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	9.204	665,835.760	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	32.190	1,470,632.340	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	19,069	327.300	6,241,283.700	
ARCELOR MITTAL (NL)	64,774	24.705	1,600,241.670	
DASSAULT SYSTEMES SA	92,308	36.205	3,342,011.140	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	25,380	32.040	813,175.200	
RHEINMETALL STAMM	5,596	263.400	1,473,986.400	
HEINEKEN NV	34,576	102.550	3,545,768.800	
AKZO NOBEL	23,353	74.240	1,733,726.720	
ASML HOLDING NV	54,297	599.600	32,556,481.200	
AEGON NV	232,433	4.009	931,823.890	
VOLKSWAGEN AG	3,315	154.200	511,173.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	25,053	126.680	3,173,714.040	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	835,535	6.302	5,265,541.570	
KERING	10,209	541.500	5,528,173.500	
ACCIONA S.A.	2,642	170.800	451,253.600	
FORTUM OYJ	54,194	13.755	745,438.470	
AGEAS	24,086	40.200	968,257.200	
UCB SA	16,732	84.340	1,411,176.880	
NEMETSCHEK SE	9,878	67.460	666,369.880	
CARREFOUR SA	76,528	18.070	1,382,860.960	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	28.300	500,259.100	
NOKIA OYJ	745,504	3.756	2,800,113.020	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	115,512	19.252	2,223,837.020	
WOLTERS KLUWER-CVA	35,602	111.300	3,962,502.600	
SANOFI	153,586	98.810	15,175,832.660	
STMICROELECTRONICS NV	93,810	39.140	3,671,723.400	
ELISA OYJ	20,242	55.900	1,131,527.800	

BANCO SANTANDER SA	2,306,214	3.143	7,248,430.600	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	16.400	803,780.400	
QIAGEN N.V.	34,306	41.320	1,417,523.920	
DEUTSCHE BANK AG-REG	276,499	9.716	2,686,464.280	
BMW VORZUG	7,821	104.500	817,294.500	
ENEL SPA	1,105,481	6.093	6,735,695.730	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	436,835	21.250	9,282,743.750	
SARTORIUS AG	3,651	349.800	1,277,119.800	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	178,950	33.400	5,976,930.000	
RATIONAL AG	516	658.000	339,528.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	112.100	545,478.600	
BECHTLE AG	14,521	42.550	617,868.550	
KONINKLIJKE KPN NV	504,342	3.329	1,678,954.510	
EUROFINS SCIENTIFIC	17,824	61.380	1,094,037.120	
TELEPERFORMANCE	7,845	154.950	1,215,582.750	
DEUTSCHE BOERSE AG	25,951	172.850	4,485,630.350	
EURAZEO	5,673	63.850	362,221.050	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	79.000	1,020,522.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	85.500	1,512,495.000	
INDITEX	150,465	31.230	4,699,021.950	
ESSILORLUXOTTICA	39,632	184.180	7,299,421.760	
SNAM SPA	256,415	5.084	1,303,613.860	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	11.706	1,953,977.220	
ENAGAS	38,270	18.230	697,662.100	
WENDEL	5,449	98.700	537,816.300	
TENARIS SA	55,855	12.250	684,223.750	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.277	251,595.220	
TERNA SPA	207,655	7.928	1,646,288.840	
BIOMERIEUX	4,870	95.600	465,572.000	
GRIFOLS SA	31,982	10.680	341,567.760	
FERROVIAL SA	63,513	28.810	1,829,809.530	
NESTE OYJ	56,226	40.040	2,251,289.040	
RECORDATI SPA	17,680	42.260	747,156.800	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	58,797	12.100	711,443.700	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	228.000	1,663,032.000	
KONE OYJ	49,300	51.800	2,553,740.000	
ELIA GROUP	4,078	124.300	506,895.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	247.100	952,570.500	
ENGIE	241,494	14.688	3,547,063.870	
ALSTOM	47,494	23.080	1,096,161.520	
IPSEN SA	3,873	111.700	432,614.100	
ARKEMA SA	10,961	87.900	963,471.900	
LEGRAND SA	34,352	85.080	2,922,668.160	
AMPLIFON SPA	20,249	35.320	715,194.680	
ADP	3,975	140.300	557,692.500	
ORION OYJ	13,559	42.430	575,308.370	

METSO CORPORATION	79,058	10.670	843,548.860	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.585	628,812.510	
SYMRISE AG	17,265	108.250	1,868,936.250	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	33.440	1,084,191.680	
PRYSMIAN SPA	31,596	36.530	1,154,201.880	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	105.550	256,380.950	
CAIXABANK	565,553	3.342	1,890,078.120	
BUREAU VERITAS SA	39,729	25.680	1,020,240.720	
GETLINK	63,509	16.500	1,047,898.500	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	19.985	793,164.680	
AMADEUS IT GROUP SA	62,816	64.640	4,060,426.240	
BRENNTAG SE	21,559	76.160	1,641,933.440	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	19.395	478,804.360	
EDENRED	31,091	58.460	1,817,579.860	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	137,436	2.981	409,696.710	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	53.160	436,390.440	
VONOVIA SE	92,440	18.650	1,724,006.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	134,537	9.520	1,280,792.240	
KNORR-BREMSE AG	10,342	64.240	664,370.080	
OCI NV	12,329	22.490	277,279.210	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	39,737	53.320	2,118,776.840	
FERRARI NV	16,685	268.000	4,471,580.000	
CNH INDUSTRIAL NV	143,842	12.945	1,862,034.690	
AROUNDTOWN SA	113,225	1.027	116,282.070	
AIB GROUP PLC	147,578	3.852	568,470.450	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	37.480	648,141.640	
MONCLER SPA	29,763	65.600	1,952,452.800	
NEXI SPA	83,576	7.518	628,324.360	
PROSUS NV	109,400	64.580	7,065,052.000	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	114.250	1,733,629.500	
JDE PEET'S BV	14,385	27.460	395,012.100	
EXOR NV	14,142	75.500	1,067,721.000	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	22.210	1,663,351.320	
EURONEXT NV	14,089	69.600	980,594.400	
IMCD NV	8,848	137.800	1,219,254.400	
WORLDLINE SA	29,916	39.430	1,179,587.880	
NN GROUP NV	36,289	33.090	1,200,803.010	
FINECOBANK SPA	75,180	12.480	938,246.400	
ARGENX SE	7,482	363.400	2,718,958.800	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	92,502	18.705	1,730,249.910	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	64,874	28.820	1,869,668.680	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	33.600	330,019.200	
DSM-FIRMENICH AG	22,201	116.660	2,589,968.660	
ZALANDO SE	31,321	31.360	982,226.560	

	STELLANTIS NV	309,373	14.970	4,631,313.810	
	AENA SME SA	9,989	149.550	1,493,854.950	
	CELLNEX TELECOM SAU	76,430	37.090	2,834,788.700	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	15.870	359,772.900	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	13.790	728,594.650	
	SCOUT24 SE	10,048	57.960	582,382.080	
	COVESTRO AG	27,558	39.580	1,090,745.640	
	HELLOFRESH SE	17,856	23.760	424,258.560	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	117,633	56.450	6,640,382.850	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.622	566,629.950	
	AMUNDI SA	12,553	59.700	749,414.100	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	12.125	507,782.870	
	ADYEN NV	2,995	1,406.800	4,213,366.000	
	DELIVERY HERO SE	22,564	38.685	872,888.340	
ユーロ　小計		24,423,502		642,462,096.600 (94,737,460,765)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	13.440	3,454,080.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	60.350	14,592,388.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	46.550	4,343,766.700	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	166,391	312.800	52,047,104.800	
	MTR CORP	192,441	39.600	7,620,663.600	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	114.300	10,869,472.800	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	27.950	4,778,667.400	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	46.150	9,821,643.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	7.550	11,599,865.300	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	322,904	51.950	16,774,862.800	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	498,995	24.850	12,400,025.750	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	20.750	3,591,119.500	
	SINO LAND CO	411,200	10.320	4,243,584.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	105.800	21,642,977.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	60.000	3,181,200.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	180,156	82.250	14,817,831.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	13.720	2,442,160.000	
	AIA GROUP LTD	1,576,516	81.000	127,697,796.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	10.220	4,733,249.920	
	SANDS CHINA LTD	335,800	25.750	8,646,850.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	12.920	1,808,800.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	21.150	4,263,840.000	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	42.500	10,885,737.500	
	ESR GROUP LTD	216,400	12.020	2,601,128.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	21.250	5,631,250.000	
	WH GROUP LTD	931,500	4.320	4,024,080.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	52.950	19,562,112.750	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	46.000	12,244,970.000	
香港・ドル　小計		10,009,869		400,321,226.420 (6,865,509,033)	
合計		154,311,634		898,419,769,336 (898,419,769,336)	

（２）株式以外の有価証券

2023年5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,315,191.780	
		GOODMAN GROUP	221,417.000	4,381,842.430	
		GPT GROUP	219,223.000	964,581.200	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	1,111,221.540	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,838,039.480	
		STOCKLAND	369,843.000	1,656,896.640	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,124,028.700	
	オーストラリア・ドル　小計		2,642,195.000	12,391,801.770 (1,128,769,223)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCOTT TRUST	24,589.000	26,064.340	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,613,823.550	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,264,745.860	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	820,193.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	689,350.000	
	シンガポール・ドル　小計		2,132,098.000	4,414,176.750 (447,420,955)	
投資信託受益証券　合計			4,774,293	1,576,190,178 (1,576,190,178)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,814.000	2,545,135.920	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,493,065.800	
		AMERICAN TOWER CORP	62,580.000	12,288,208.800	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58,993.000	1,110,838.190	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,496.000	3,512,204.400	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,257.000	1,227,646.770	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,271.000	1,467,639.890	

	CROWN CASTLE INC	58,995.000	7,017,455.250	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	39,801.000	3,935,124.870	
	EQUINIX INC	12,548.000	9,414,638.920	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22,301.000	1,548,358.430	
	EQUITY RESIDENTIAL	46,059.000	2,885,596.350	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,270.000	1,792,687.900	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	18,024.000	2,826,163.200	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,767,339.630	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	64,831.000	1,277,170.700	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68,971.000	1,453,908.680	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,589,577.640	
	INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,983,588.880	
	IRON MOUNTAIN INC	39,185.000	2,187,698.550	
	KIMCO REALTY	79,991.000	1,450,236.830	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	609,716.610	
	MID AMERICA	14,440.000	2,193,147.200	
	PROLOGIS INC	124,897.000	15,996,807.760	
	PUBLIC STORAGE	21,100.000	6,330,211.000	
	REALTY INCOME CORP	86,588.000	5,400,493.560	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,139,155.890	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	14,868.000	3,524,459.400	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	44,425.000	4,732,595.250	
	SUN COMMUNITIES INC	15,529.000	2,114,273.350	
	UDR INC	41,516.000	1,708,798.560	
	VENTAS INC	53,843.000	2,532,774.720	
	VICI PROPERTIES INC	129,458.000	4,213,857.900	
	WELLTOWER INC	64,928.000	5,153,984.640	
	WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,079,681.500	
	WP CAREY INC	27,925.000	2,027,355.000	
アメリカ・ドル　小計		1,747,139.000	126,531,597.940 (16,978,009,811)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	459,411.120	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,945.000	814,497.870	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,331,543.340	
イギリス・ポンド　小計		412,137.000	2,605,452.330 (441,754,443)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	429,122.400	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	292,951.440	
カナダ・ドル　小計		23,146.000	722,073.840 (72,488,993)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	246,714.200	

		GECINA SA	9,166.000	893,226.700	
		KLEPIERRE	25,279.000	552,598.940	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,535.000	619,903.000	
		WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	526,213.520	
	ユーロ　小計		73,192.000	2,838,656.360 (418,588,267)	
	香港・ドル	LINK REIT	349,516.000	17,563,179.000	
	香港・ドル　小計		349,516.000	17,563,179.000 (301,208,520)	
投資証券　合計			2,605,130	18,212,050,034 (18,212,050,034)	
合計				19,788,240,212 (19,788,240,212)	

（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	600銘柄	69.31	－	－	72.34
	投資証券	36銘柄	－	－	1.82	
イギリス・ポンド	株式	76銘柄	4.50	－	－	4.63
	投資証券	3銘柄	－	－	0.05	
イスラエル・シュケル	株式	11銘柄	0.13	－	－	0.14
オーストラリア・ドル	株式	52銘柄	2.14	－	－	2.30
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.12	－	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.55	－	－	3.61
	投資証券	2銘柄	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.33	－	－	0.38
	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.05	－	
スイス・フラン	株式	42銘柄	3.13	－	－	3.18
スウェーデン・クローナ	株式	45銘柄	1.01	－	－	1.03
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.95	－	－	0.96
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.07	－	－	0.07
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.20	－	－	0.20
ユーロ	株式	221銘柄	10.14	－	－	10.36
	投資証券	5銘柄	－	－	0.04	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.74	－	－	0.78
	投資証券	1銘柄	－	－	0.03	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年5月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,181,577,263
国債証券	505,010,306,950
地方債証券	32,818,844,886
特殊債券	30,404,946,713
社債券	25,705,731,100
未収利息	625,012,658
前払費用	341,087,686
流動資産合計	597,087,507,256
資産合計	597,087,507,256
負債の部	
流動負債	
未払金	917,130,000
未払解約金	125,276,000
流動負債合計	1,042,406,000
負債合計	1,042,406,000
純資産の部	
元本等	
元本	469,534,984,076
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	126,510,117,180
元本等合計	596,045,101,256
純資産合計	596,045,101,256
負債純資産合計	597,087,507,256

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11月12日 至　2023年5月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年5月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	613,180,832,594円
同期中追加設定元本額	623,984,033,286円
同期中一部解約元本額	767,629,881,804円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	25,432,106,416円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	56,639,596円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	97,635,700円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	54,027,230円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	755,367,664円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	202,481,087円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	45,417,547円
たわらノーロード　国内債券	17,989,186,779円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	4,127,135,480円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,323,022,406円
たわらノーロード　バランス（標準型）	2,366,872,408円
たわらノーロード　バランス（積極型）	307,076,615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）	138,277,557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）	1,776,846,708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）	1,888,965,761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）	531,013,958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）	243,747円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	27,284,416円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	18,504,239円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	164,086,895円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,087,262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＞	13,867,307,641円
Ｏｎｅグローバルバランス	45,502,583円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	9,876,194,900円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	14,097,590,565円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	6,047,385,035円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,411,861,990円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,483,260,391円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	436,048,600円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	76,877,550円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,843,395,929円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	13,036,864円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	4,858,815,993円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	2,017,867,730円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	393,122,638円
投資のソムリエ	112,501,888,928円
クルーズコントロール	1,232,324,772円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	8,794,521,896円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	5,739,966,860円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,440,681,220円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	9,236,046,178円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	36,836,257,803円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	384,083,292円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	189,976,679円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	66,138,413円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,573,874,339円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,649,713,537円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	13,919,729,467円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,625,564,143円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	502,644,601円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	209,630,171円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	125,960,307円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,391,118,768円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	27,538,437円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	133,538,355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）	1,909,029,792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）	1,954,033,546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）	1,518,119,197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）	1,194,334,138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）	1,886,328,528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）	4,880,494,938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）	1,872,849,045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）	1,696,213,839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）	1,920,767,549円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	9,419,436,914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）	2,995,010,295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）	567,293,469円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	262,347,735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）	3,175,355,513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）	46,298,861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）	103,765,896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）	142,702,237円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	98,027,504円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,426,638円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	63,136,155円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,822,251円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	332,511円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,613,464円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	108,567,161円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,862,824,051円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,062,674,949円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,078,727,935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）	54,974,945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）	137,630,900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）	1,695,711,268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）	110,962,615円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	530,977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）	1,920,394,010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）	43,241,940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）	285,653,743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）	430,297,673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）	754,882,927円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	195,609,909円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	94,547,964円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	881,640,818円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	332,891,205円
コア資産形成ファンド	222,867,031円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	23,210,423,737円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	41,399,605,431円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	11,220,722,617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］	1,425,008,051円
計	469,534,984,076円
２．　受益権の総数	469,534,984,076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11月12日 至　2023年5月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年5月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	7,261,441,250
地方債証券	408,741,722
特殊債券	508,806,040
社債券	302,818,820
合計	8,481,807,832

（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（2023年2月15日から2023年5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.2694円

（1万口当たり純資産額）	(12,694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5月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４３８回　利付国庫債券（２年）	1,800,000,000	1,802,448,000	
	４３９回　利付国庫債券（２年）	1,300,000,000	1,301,820,000	
	４４０回　利付国庫債券（２年）	1,700,000,000	1,702,431,000	
	４４１回　利付国庫債券（２年）	1,100,000,000	1,101,606,000	
	４４２回　利付国庫債券（２年）	1,500,000,000	1,502,205,000	
	４４３回　利付国庫債券（２年）	2,500,000,000	2,503,875,000	
	４４４回　利付国庫債券（２年）	1,400,000,000	1,402,058,000	
	４４５回　利付国庫債券（２年）	3,100,000,000	3,104,278,000	
	４４６回　利付国庫債券（２年）	3,600,000,000	3,604,536,000	
	４４７回　利付国庫債券（２年）	1,100,000,000	1,101,342,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	2,190,000,000	2,195,212,200	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	3,710,000,000	3,720,313,800	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	2,930,000,000	2,938,702,100	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	3,700,000,000	3,711,322,000	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	4,530,000,000	4,545,266,100	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	4,250,000,000	4,266,022,500	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	5,500,000,000	5,522,220,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	3,250,000,000	3,255,102,500	
	１４８回　利付国庫債券（５年）	3,510,000,000	3,514,878,900	
	１４９回　利付国庫債券（５年）	5,010,000,000	5,015,861,700	

１５０回　利付国庫債券（５年）	5,720,000,000	5,724,118,400	
１５１回　利付国庫債券（５年）	4,500,000,000	4,500,855,000	
１５２回　利付国庫債券（５年）	1,030,000,000	1,033,965,500	
１５３回　利付国庫債券（５年）	6,510,000,000	6,505,963,800	
１５４回　利付国庫債券（５年）	5,500,000,000	5,513,145,000	
１５５回　利付国庫債券（５年）	1,800,000,000	1,819,008,000	
１５６回　利付国庫債券（５年）	3,400,000,000	3,419,516,000	
１５７回　利付国庫債券（５年）	1,900,000,000	1,908,702,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	140,098,200	
２回　利付国庫債券（４０年）	330,000,000	404,698,800	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	662,450,400	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	883,216,800	
５回　利付国庫債券（４０年）	710,000,000	841,662,400	
６回　利付国庫債券（４０年）	1,240,000,000	1,446,683,200	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,210,000,000	1,352,320,200	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,290,000,000	1,340,181,000	
９回　利付国庫債券（４０年）	2,150,000,000	1,654,984,000	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,970,000,000	1,774,319,900	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,580,000,000	1,370,776,400	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,440,000,000	1,118,592,000	
１３回　利付国庫債券（４０年）	2,190,000,000	1,686,212,400	
１４回　利付国庫債券（４０年）	1,920,000,000	1,577,702,400	
１５回　利付国庫債券（４０年）	2,440,000,000	2,197,146,800	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	7,320,000,000	7,377,974,400	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	9,410,000,000	9,487,444,300	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,009,420,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	2,300,000,000	2,314,260,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	6,230,000,000	6,283,764,900	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	6,480,000,000	6,542,856,000	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	3,340,000,000	3,376,272,400	

３４１回　利付国庫債券（１０年）	6,620,000,000	6,681,367,400	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	3,520,000,000	3,535,065,600	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,090,000,000	4,107,791,500	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	5,770,000,000	5,795,214,900	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	5,140,000,000	5,161,331,000	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	4,390,000,000	4,406,901,500	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	5,930,000,000	5,949,450,400	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	4,070,000,000	4,079,727,300	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	4,950,000,000	4,956,781,500	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	5,560,000,000	5,560,000,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	4,680,000,000	4,677,613,200	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	4,860,000,000	4,854,799,800	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	4,910,000,000	4,901,751,200	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	5,200,000,000	5,189,392,000	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	4,030,000,000	4,018,998,100	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	4,300,000,000	4,285,079,000	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	4,320,000,000	4,301,640,000	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	5,350,000,000	5,322,768,500	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	4,370,000,000	4,340,895,800	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	5,600,000,000	5,551,336,000	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	5,920,000,000	5,858,017,600	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	4,210,000,000	4,158,132,800	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	5,570,000,000	5,492,688,400	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	5,250,000,000	5,168,572,500	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	5,630,000,000	5,535,472,300	

３６６回　利付国庫債券（１０年）	4,980,000,000	4,932,739,800	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	2,500,000,000	2,472,350,000	
３６８回　利付国庫債券（１０年）	2,650,000,000	2,616,345,000	
３６９回　利付国庫債券（１０年）	2,420,000,000	2,453,734,800	
３７０回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,516,365,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	128,400,800	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	115,020,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	239,770,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	235,502,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	281,842,500	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	268,757,300	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	174,069,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	409,672,800	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	316,716,400	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	292,850,400	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	326,999,700	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	480,844,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	337,148,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	405,873,600	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	374,402,500	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	358,106,500	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	432,908,000	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	400,831,200	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	762,748,800	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	772,662,600	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	962,315,200	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,064,224,200	

３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,077,850,400	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	871,480,800	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,189,627,400	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,392,636,000	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,454,508,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	1,251,595,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,619,435,900	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,584,209,600	
３８回　利付国庫債券（３０年）	850,000,000	973,122,500	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,500,000,000	1,744,980,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,330,000,000	1,522,850,000	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,543,085,800	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,374,476,400	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,350,000,000	1,521,315,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,490,000,000	1,679,468,400	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,414,231,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	1,925,264,400	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,615,665,200	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,480,000,000	1,578,079,600	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,490,000,000	1,588,176,100	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,760,000,000	1,660,524,800	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,590,000,000	1,334,741,400	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,530,000,000	1,343,171,700	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,610,000,000	1,442,898,100	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,350,000,000	1,263,910,500	

５５回　利付国庫債券（３０年）	1,620,000,000	1,512,966,600	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,360,165,200	
５７回　利付国庫債券（３０年）	1,530,000,000	1,421,829,000	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,440,000,000	1,334,836,800	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,320,000,000	1,191,498,000	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,320,900,000	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,340,000,000	1,200,519,400	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,020,000,000	864,603,000	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	903,507,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,330,000,000	1,088,591,700	
６５回　利付国庫債券（３０年）	1,550,000,000	1,266,691,000	
６６回　利付国庫債券（３０年）	990,000,000	805,424,400	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	1,515,580,200	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,470,000,000	1,254,733,200	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,430,000,000	1,251,864,900	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,610,000,000	1,406,689,200	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,222,046,000	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,390,000,000	1,212,163,400	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,790,000,000	1,559,519,600	
７４回　利付国庫債券（３０年）	1,620,000,000	1,527,627,600	
７５回　利付国庫債券（３０年）	1,720,000,000	1,745,800,000	
７６回　利付国庫債券（３０年）	1,620,000,000	1,684,848,600	
７７回　利付国庫債券（３０年）	1,500,000,000	1,634,640,000	
７８回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,041,670,000	
７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,393,500	

７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,026,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	473,800,000	
７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	392,756,600	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,407,200	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	187,236,000	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	72,554,300	
７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,533,600	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	260,335,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,172,500	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	94,100,400	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	419,464,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	147,142,800	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	73,939,600	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	179,123,900	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	626,261,400	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	128,061,600	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	127,718,400	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	632,946,100	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,696,800	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	505,235,900	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	118,617,400	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,248,566,000	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	398,523,300	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	724,236,500	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	601,452,500	

９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	130,242,000	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	721,875,000	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	174,304,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	820,117,500	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	914,427,600	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	255,617,400	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	558,285,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	177,838,400	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	121,146,300	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	707,660,800	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	555,520,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	665,994,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	758,206,500	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	385,994,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	490,362,400	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	517,532,200	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	828,067,400	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,538,756,600	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	410,000,000	462,160,200	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	408,153,600	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	603,102,900	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	531,640,500	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	625,657,050	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	523,241,600	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	718,380,800	

１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	635,675,400	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	399,087,500	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	690,396,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	578,972,400	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	608,871,600	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	418,174,000	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,023,386,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	33,580,500	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	710,488,800	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	225,974,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	145,761,200	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	400,539,600	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	6,680,000,000	7,502,308,000	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	4,420,000,000	4,885,823,800	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	3,500,000,000	3,899,875,000	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	2,850,000,000	3,203,001,000	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,193,019,400	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	487,955,400	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,230,000,000	1,373,184,300	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	830,182,500	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,750,000,000	3,100,267,500	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	2,740,000,000	3,091,213,200	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	2,490,000,000	2,786,957,400	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	2,360,000,000	2,619,151,600	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,840,000,000	3,152,087,600	

１５０回　利付国庫債券（２０年）	3,000,000,000	3,297,270,000	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	3,060,000,000	3,293,172,000	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	3,040,000,000	3,270,827,200	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	2,800,000,000	3,043,544,000	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	2,930,000,000	3,148,548,700	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,380,000,000	2,498,904,800	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	2,540,000,000	2,476,398,400	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	2,460,000,000	2,330,505,600	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,880,000,000	2,830,377,600	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	2,640,000,000	2,623,473,600	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	2,040,000,000	2,050,342,800	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	2,040,000,000	2,018,988,000	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	2,370,000,000	2,339,071,500	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,140,000,000	2,107,429,200	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,440,000,000	2,363,188,800	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	1,950,000,000	1,882,569,000	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	2,080,000,000	2,062,819,200	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	2,350,000,000	2,255,295,000	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	2,090,000,000	1,968,215,700	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	2,260,000,000	2,086,838,800	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	2,000,000,000	1,839,360,000	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	2,240,000,000	2,053,206,400	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,580,000,000	1,467,598,800	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,520,000,000	2,333,192,400	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	2,770,000,000	2,556,294,500	

	１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,630,000,000	2,460,733,200	
	１７６回　利付国庫債券（２０年）	2,600,000,000	2,425,072,000	
	１７７回　利付国庫債券（２０年）	2,650,000,000	2,421,066,500	
	１７８回　利付国庫債券（２０年）	2,500,000,000	2,320,500,000	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	2,450,000,000	2,268,479,500	
	１８０回　利付国庫債券（２０年）	2,140,000,000	2,086,992,200	
	１８１回　利付国庫債券（２０年）	2,300,000,000	2,279,553,000	
	１８２回　利付国庫債券（２０年）	2,080,000,000	2,129,275,200	
	１８３回　利付国庫債券（２０年）	2,200,000,000	2,365,594,000	
	１８４回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	815,272,000	
国債証券　合計		499,555,000,000	505,010,306,950	
地方債証券	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,769,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	109,772,300	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	196,390,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	393,856,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	294,354,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	229,036,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	116,305,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	103,788,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	104,909,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	214,460,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	322,224,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	111,042,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	111,883,000	
	３１回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	211,466,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,837,000	
	３０年度８回　北海道公募公債	400,000,000	399,452,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	397,664,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	97,560,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	244,752,500	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	301,782,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	100,868,000	
	２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	198,278,000	

２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	195,976,000	
２５８回　神奈川県公募公債　１０年	300,000,000	291,588,000	
３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	123,351,000	
１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	110,647,000	
１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	336,747,000	
１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	110,642,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,625,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	100,130,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	194,154,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	195,080,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	194,104,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	193,260,000	
４７４回　大阪府公募公債　１０年	300,000,000	290,049,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	219,092,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	105,021,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	96,753,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	298,494,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	352,429,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	109,120,086	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	393,836,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	196,214,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	201,382,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	196,280,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	97,627,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	120,928,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	209,870,000	

１回　兵庫県公募公債（１２年)	300,000,000	303,630,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	315,636,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	104,141,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	102,112,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	196,514,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	97,996,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	195,082,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	105,081,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	105,438,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	206,020,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	104,944,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	332,595,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	336,396,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	117,921,000	
２６年度４回　愛知県公募公債　２０年	200,000,000	217,900,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	161,107,500	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	100,981,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	197,922,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	235,794,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	99,915,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	196,204,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	89,800,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	91,397,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	402,884,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	197,144,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	188,266,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	241,539,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	112,185,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	108,619,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	326,931,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	104,853,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	100,377,000	

３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	198,996,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	196,514,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	97,905,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	105,046,000	
令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	159,838,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	109,678,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,407,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	326,805,000	
２７年度４回　千葉県公募公債	200,000,000	202,322,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	100,014,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	193,504,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	104,294,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	104,605,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	95,224,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	195,722,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	108,770,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,475,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,988,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	605,886,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,265,000	
１５０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,057,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,992,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,964,000	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,782,000	
１６０回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,125,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,830,000	
１６９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,015,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,596,000	

１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,805,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,023,000	
１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,115,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,554,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,535,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	491,950,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,269,000	
２２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	486,990,000	
２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	484,365,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	99,416,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	100,726,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	195,692,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	100,727,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	100,477,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	199,654,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	294,966,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	221,120,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	453,505,500	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	196,120,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	108,720,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	105,247,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	108,010,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	225,122,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	219,668,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	100,697,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	299,745,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	169,278,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	392,828,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	119,852,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	109,788,000	

	２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	108,774,000	
	２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	117,292,000	
	２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	100,582,000	
	２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	289,749,000	
	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	199,102,000	
	６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	222,514,000	
	５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	117,612,000	
	６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	109,507,000	
	１１回　北九州市公募公債　２０年	300,000,000	336,024,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	108,555,000	
	２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	119,901,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	194,338,000	
	２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	90,234,000	
	２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	100,661,000	
	２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	193,928,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	299,928,000	
	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	97,613,000	
	令和３年度３回　仙台市公募公債　５年	300,000,000	298,512,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	196,900,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	195,692,000	
	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	100,686,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	100,660,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	198,326,000	
地方債証券　合計		32,439,330,000	32,818,844,886	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	208,764,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	207,374,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	300,246,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	449,635,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,858,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	82,793,000	
	１５６回　日本政策投資銀行債券	400,000,000	389,976,000	
	３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,616,000	
	１回　高速道路機構債	300,000,000	393,726,000	

１９回　高速道路機構債	150,000,000	190,825,500	
２６回　高速道路機構債	200,000,000	245,840,000	
３６回　高速道路機構債	300,000,000	388,107,000	
５０回　高速道路機構債	300,000,000	277,437,000	
７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,441,000	
１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,469,000	
１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,619,000	
１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,877,000	
１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,588,000	
１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,851,000	
１６９回　高速道路機構債	100,000,000	97,354,000	
１７２回　高速道路機構債	200,000,000	186,870,000	
２１０回　高速道路機構債	100,000,000	96,344,000	
９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,739,000	
１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,810,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	552,145,000	
１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,298,000	
１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,363,000	
２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,698,000	
２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	201,448,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	316,809,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	503,770,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,825,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,885,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	209,322,000	
第２６２回　政保道路債	500,000,000	523,290,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,426,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,610,000	
２８６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	188,816,000	

３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,037,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	800,544,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	195,784,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	96,837,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	241,530,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	159,718,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	167,460,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	169,684,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	603,375,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	219,092,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	334,287,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	335,097,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	112,412,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,193,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	221,696,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	109,420,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	219,474,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,424,000	
Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	340,995,000	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	108,883,000	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,166,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	536,300,000	
４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	307,923,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,667,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	211,962,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,636,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	399,760,000	

９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,964,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	97,629,000	
９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	499,870,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,083,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,885,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,939,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	264,219,000	
１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	238,911,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,950,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	220,932,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,868,160	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	105,149,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	104,309,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	206,732,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	165,924,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	106,961,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	100,748,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	221,840,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,473,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	392,413,000	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,808,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,516,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,296,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	282,037,500	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,919,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,985,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,926,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,262,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,433,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,460,000	

３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,595,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,595,000	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,032,000	43,567,318	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,595,000	16,316,268	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,500,000	104,085,935	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,120,000	156,033,203	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,893,000	21,798,711	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,985,000	18,727,420	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,054,000	21,855,946	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,100,000	22,945,767	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,069,000	28,069,740	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,638,000	68,725,102	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,189,000	31,198,218	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,278,000	37,126,542	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,001,000	37,879,403	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,629,000	41,545,996	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,212,000	42,876,416	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,557,000	47,520,856	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,860,000	54,198,779	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,726,000	56,449,323	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	210,000,000	204,974,700	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,211,000	69,926,353	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,805,000	69,607,687	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,037,000	69,771,120	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	221,937,000	216,932,320	

	１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	222,240,000	217,112,923	
	１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,926,000	147,441,118	
	１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	226,719,000	221,014,749	
	１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	225,453,000	219,805,402	
	１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	391,010,000	382,536,812	
	１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,129,000	76,365,628	
	１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,485,000	77,806,459	
	１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	258,564,000	248,503,274	
	１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	345,236,000	332,786,789	
	１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	265,773,000	256,258,326	
	１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,487,000	262,911,806	
	１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	828,531,000	796,301,144	
	６回　沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	416,300,000	
	２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,109,000	
	い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,874,000	
	い第８５１号　利付商工債	300,000,000	298,896,000	
	い第８５４号　利付商工債	300,000,000	298,617,000	
	い第８５５号　利付商工債	200,000,000	199,022,000	
	３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	399,404,000	
	３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	299,157,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	109,708,000	
	７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,740,000	
	７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	297,003,000	
	８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	299,451,000	
	８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	398,580,000	
	７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	100,714,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,564,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	194,978,000	
特殊債券　合計		29,868,981,000	30,404,946,713	
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	294,066,000	

２回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,698,000	
６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,648,000	
１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	98,652,000	
２５回　首都高速道路社債	100,000,000	99,945,000	
２７回　首都高速道路社債	400,000,000	398,700,000	
１６回　成田国際空港社債	100,000,000	100,678,000	
３７回　成田国際空港社債	100,000,000	88,601,000	
５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	99,706,000	
６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	197,160,000	
７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	298,563,000	
８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	199,042,000	
９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	199,012,000	
９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	497,100,000	
２５回　西日本高速道路社債	200,000,000	201,334,000	
２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	100,939,000	
３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	300,480,000	
３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	200,708,000	
６１回　西日本高速道路債券	500,000,000	497,450,000	
６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	497,100,000	
２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	199,054,000	
１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	100,740,000	
３回　ダイドーグループＨＤ社債	300,000,000	295,338,000	
９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	97,032,000	
１２回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,146,000	
１４回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,648,000	
３０回　東レ社債	300,000,000	299,568,000	
４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	199,080,000	
２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	189,644,000	
４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,315,000	
１７回　ダイセル社債	300,000,000	294,264,000	
１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	478,735,000	
４回　住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,733,000	
４回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債	300,000,000	293,157,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	297,711,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	298,305,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	100,367,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	97,071,000	

２３回　パナソニック社債	200,000,000	192,506,000	
２９回　三菱重工業社債	100,000,000	100,650,000	
５８回　川崎重工業社債	300,000,000	290,604,000	
5回　三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	98,921,000	
２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	199,064,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	95,947,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	393,688,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	398,848,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	107,766,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	105,783,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	297,573,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	201,030,000	
１１回　セブン銀行社債	200,000,000	201,122,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,330,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	298,797,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	394,284,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,332,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,693,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,548,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	194,044,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	289,191,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	98,114,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	198,654,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,398,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	193,688,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	297,636,000	
3回　野村ホールディングス社債	300,000,000	296,208,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	102,891,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	100,344,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	200,148,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	103,770,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	92,112,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	311,565,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	208,796,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	110,235,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,135,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	221,474,000	

１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	98,983,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	91,792,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	94,245,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,815,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	78,374,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,038,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	177,760,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	161,818,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,942,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	195,402,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	82,147,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	78,566,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,539,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	177,210,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,241,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	127,780,800	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	77,072,000	
７回　ニッコンＨＤ社債	300,000,000	292,884,000	
６回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	195,042,000	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	391,068,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	186,172,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	93,840,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	194,808,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	101,494,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	300,837,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	392,524,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	178,446,000	
５４１回　関西電力社債	300,000,000	286,551,000	
３９６回　中国電力社債	200,000,000	193,960,000	
４２５回　中国電力社債	100,000,000	97,304,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	102,336,000	
３１１回　北陸電力社債	100,000,000	101,898,000	
４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,865,000	
５２１回　東北電力社債	400,000,000	391,444,000	
５２５回　東北電力社債	200,000,000	197,904,000	
５３６回　東北電力社債	300,000,000	284,997,000	
３２０回　四国電力社債	300,000,000	288,888,000	
４２８回　九州電力社債	100,000,000	100,863,000	
４６３回　九州電力社債	100,000,000	92,416,000	
４６６回　九州電力社債	100,000,000	91,218,000	
４９１回　九州電力社債	300,000,000	287,652,000	
４９２回　九州電力社債	100,000,000	86,421,000	
４９３回　九州電力社債	200,000,000	198,676,000	
５０７回　九州電力社債	200,000,000	193,302,000	
３２１回　北海道電力社債	261,000,000	263,688,300	
３４０回　北海道電力社債	300,000,000	301,011,000	
３５０回　北海道電力社債	200,000,000	184,280,000	
１３回　電源開発社債	200,000,000	207,556,000	
５４回　電源開発社債	100,000,000	99,739,000	

	７５回　電源開発社債	200,000,000	191,144,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	187,976,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	89,816,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	86,279,000	
	５７回　東京瓦斯社債	300,000,000	218,934,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,938,000	
	８回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	192,456,000	
社債券　合計		26,281,000,000	25,705,731,100	
合計			593,939,829,649	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年5月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	894,710,623
コール・ローン	592,541,829
国債証券	210,164,213,651
派生商品評価勘定	6,394,034
未収入金	1,019,369,599
未収利息	1,399,450,414
前払費用	284,317,963
流動資産合計	214,360,998,113
資産合計	214,360,998,113
負債の部	
流動負債	
未払金	564,997,191
未払解約金	1,261,461,000
流動負債合計	1,826,458,191
負債合計	1,826,458,191
純資産の部	
元本等	
元本	102,110,959,132
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	110,423,580,790
元本等合計	212,534,539,922
純資産合計	212,534,539,922
負債純資産合計	214,360,998,113

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11月12日 至　2023年5月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年5月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	87,311,980,753円
同期中追加設定元本額	34,284,739,833円
同期中一部解約元本額	19,485,761,454円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,398,198,917円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,409,545円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	17,301,994円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	42,669,677円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	32,114,554円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	35,795,142円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	35,627,253円
たわらノーロード　先進国債券	17,635,888,632円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	254,033,715円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,598,589,523円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	67,835,412円
たわらノーロード　バランス（標準型）	348,061,936円
たわらノーロード　バランス（積極型）	74,508,317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）	16,845,793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）	998,899,077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）	1,629,916,249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）	755,946,724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）	446,093,687円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	2,049,387円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	13,531,926円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	188,557,846円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	15,329,517円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	25,019,747円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,675,446,561円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	947,369,880円

Ｏｎｅグローバルバランス	29,243,038円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	746,657,608円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,391,956,199円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,676,407,163円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	423,631,209円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	854,188,656円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	757,380,400円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	24,213,150円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	895,628,565円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	35,241,998円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	159,329,380円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	154,850,470円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	239,288,486円
クルーズコントロール	1,126,729,587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＞	630,924,193円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	635,077,111円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	181,400,956円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	341,519,003円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	10,036,395円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	87,801,857円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,031,313,518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）	686,297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）	689,934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）	140,709,276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）	297,656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）	690,706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）	910,881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）	403,153,228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）	290,748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）	417,866,540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）	5,199,767,596円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	1,398,147,865円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,058,944,526円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,279,779,882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）	80,223,864円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,087,704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）	1,076,736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）	349,672,850円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	241,330,109円

ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,947,742円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,883,796円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,842,588円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,848円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,514,816円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	44,509,559円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,540,538,859円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,374,368,554円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,508,633,904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）	56,295,557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）	118,526,558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）	1,381,136,708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）	244,738,296円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	163,311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）	295,162,281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）	263,774,842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）	371,375,515円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,509,307円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	66,130,186円
コア資産形成ファンド	44,052,130円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	2,340,218,077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）	11,272,856,177円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	8,156,527,633円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,441,412,212円
計	102,110,959,132円
２．　受益権の総数	102,110,959,132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11月12日 至　2023年5月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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5月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	3,154,266,632
合計	3,154,266,632

（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（2023年2月22日から2023年5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年5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	1,028,100,000	－	1,021,705,966	6,394,034
アメリカ・ドル	538,553,000	－	534,726,690	3,826,310
イギリス・ポンド	63,844,000	－	63,432,078	411,922
オーストラリア・ドル	50,000,000	－	49,827,671	172,329
カナダ・ドル	50,000,000	－	49,701,376	298,624
ユーロ	325,703,000	－	324,018,151	1,684,849
合計	1,028,100,000	－	1,021,705,966	6,394,034

（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5月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0814円 (20,814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5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/15/24	7,500,000.000	7,175,744.850	
		US T N/B 0.25 05/31/25	1,690,000.000	1,569,488.480	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,606,577.710	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,247,958.980	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,514,925.780	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,311,845.110	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,429,956.250	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,674,765.640	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,388,101.540	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,389,150.000	
		US T N/B 0.375 07/15/24	4,000,000.000	3,812,500.000	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,327,064.440	
		US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,897,802.710	
		US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,897,304.680	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,337,917.180	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,773,380.840	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,676,953.120	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,742,162.260	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,682,423.040	

		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,111,383.010	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,759,608.980	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,465,566.790	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,702,183.210	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,217,583.180	
		US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,974,800.770	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,683,761.740	
		US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,555,093.750	
		US T N/B 0.625 08/15/30	6,840,000.000	5,638,725.000	
		US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,798,750.000	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,442,664.070	
		US T N/B 0.625 12/31/27	3,820,000.000	3,365,479.660	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,875,102.320	
		US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,282,956.230	
		US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,405,878.890	
		US T N/B 0.75 05/31/26	3,630,000.000	3,334,566.200	
		US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,521,999.040	
		US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,478,276.560	
		US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	3,050,048.620	
		US T N/B 0.875 09/30/26	6,110,000.000	5,597,571.450	
		US T N/B 0.875 11/15/30	8,280,000.000	6,939,351.570	
		US T N/B 1.0 07/31/28	4,770,000.000	4,223,313.250	
		US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,386,613.080	
		US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,644,196.880	
		US T N/B 1.125 02/15/31	8,890,000.000	7,574,210.550	
		US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,830,883.600	
		US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,009,314.440	
		US T N/B 1.125 02/29/28	6,390,000.000	5,748,503.920	
		US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,188,183.590	
		US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	2,077,514.850	
		US T N/B 1.125 08/31/28	5,230,000.000	4,651,839.810	
		US T N/B 1.125 10/31/26	3,390,000.000	3,126,348.030	
		US T N/B 1.25 03/31/28	5,010,000.000	4,525,634.740	
		US T N/B 1.25 04/30/28	5,100,000.000	4,598,964.830	
		US T N/B 1.25 05/15/50	4,880,000.000	2,765,968.760	
		US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,727,940.620	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,334,652.320	
		US T N/B 1.25 08/15/31	8,660,000.000	7,340,703.100	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,757,049.790	
		US T N/B 1.25 09/30/28	4,480,000.000	4,003,125.000	
		US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,422,716.780	
		US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,592,931.610	
		US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	716,484.370	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	2,848,569.550	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,026,072.260	
		US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,230,168.750	
		US T N/B 1.375 11/15/31	7,990,000.000	6,804,764.670	
		US T N/B 1.375 11/15/40	3,520,000.000	2,409,343.760	
		US T N/B 1.375 12/31/28	6,600,000.000	5,915,378.890	

		US T N/B 1.5 01/31/27	4,940,000.000	4,598,831.240	
		US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,351,915.020	
		US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,308,408.010	
		US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,495,126.560	
		US T N/B 1.5 09/30/24	4,310,000.000	4,148,795.910	
		US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,652,241.390	
		US T N/B 1.5 11/30/24	9,000,000.000	8,640,703.080	
		US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,612,109.360	
		US T N/B 1.625 02/15/26	3,890,000.000	3,685,167.180	
		US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,465,282.800	
		US T N/B 1.625 05/15/31	8,240,000.000	7,241,704.700	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,571,425.000	
		US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,456,485.350	
		US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,605,362.680	
		US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	2,989,180.440	
		US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,697,193.160	
		US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	4,109,326.150	
		US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,840,312.480	
		US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,298,700.780	
		US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,925,869.140	
		US T N/B 1.75 08/15/41	5,110,000.000	3,677,203.920	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,860,775.370	
		US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,914,986.320	
		US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,984,801.160	
		US T N/B 1.875 02/15/32	7,280,000.000	6,442,089.020	
		US T N/B 1.875 02/15/41	4,700,000.000	3,492,779.280	
		US T N/B 1.875 02/15/51	6,280,000.000	4,187,484.400	
		US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,404,399.230	
		US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,675,859.360	
		US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,786,550.770	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,898,320.320	
		US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	793,830.470	
		US T N/B 1.875 11/15/51	4,670,000.000	3,098,070.700	
		US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,969,157.810	
		US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,578,570.270	
		US T N/B 2.0 04/30/24	4,720,000.000	4,599,451.340	
		US T N/B 2.0 05/31/24	800,000.000	778,414.910	
		US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	281,809.760	
		US T N/B 2.0 08/15/25	4,050,000.000	3,892,746.110	
		US T N/B 2.0 08/15/51	6,110,000.000	4,190,600.790	
		US T N/B 2.0 11/15/26	3,830,000.000	3,639,098.430	
		US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,188,081.040	
		US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,812,830.080	
		US T N/B 2.125 05/31/26	1,550,000.000	1,485,184.550	
		US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	369,460.930	
		US T N/B 2.125 09/30/24	590,000.000	572,876.170	
		US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,725,313.660	
		US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,616,692.200	
		US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	3,128,921.870	

		US T N/B 2.25 03/31/26	1,300,000.000	1,252,417.960	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,223,066.010	
		US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,486,706.640	
		US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	4,042,409.370	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,570,000.000	1,912,541.780	
		US T N/B 2.25 08/15/49	3,040,000.000	2,239,981.240	
		US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,283,447.270	
		US T N/B 2.25 11/15/24	3,080,000.000	2,991,149.190	
		US T N/B 2.25 11/15/25	3,620,000.000	3,492,592.970	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,110,204.280	
		US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,910,820.320	
		US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,881,301.750	
		US T N/B 2.375 03/31/29	3,000,000.000	2,831,835.930	
		US T N/B 2.375 04/30/26	1,260,000.000	1,217,056.640	
		US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,251,761.680	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,470,000.000	3,272,440.430	
		US T N/B 2.375 05/15/51	5,560,000.000	4,171,520.310	
		US T N/B 2.375 08/15/24	4,610,000.000	4,495,200.200	
		US T N/B 2.375 11/15/49	3,290,000.000	2,490,375.760	
		US T N/B 2.5 01/31/25	500,000.000	486,953.120	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,827,155.830	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,388,896.870	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,211,778.100	
		US T N/B 2.5 03/31/27	1,500,000.000	1,447,382.820	
		US T N/B 2.5 04/30/24	4,010,000.000	3,925,912.300	
		US T N/B 2.5 05/15/24	5,100,000.000	4,991,870.050	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,230,000.000	1,748,328.710	
		US T N/B 2.5 05/31/24	4,180,000.000	4,088,935.180	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,394,560.150	
		US T N/B 2.625 02/15/29	4,330,000.000	4,148,342.970	
		US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,746,788.280	
		US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,926,054.680	
		US T N/B 2.625 05/31/27	3,410,000.000	3,302,638.250	
		US T N/B 2.625 07/31/29	2,570,000.000	2,454,851.940	
		US T N/B 2.625 12/31/25	1,000,000.000	973,671.880	
		US T N/B 2.75 02/15/28	6,340,000.000	6,156,734.370	
		US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,916,971.880	
		US T N/B 2.75 04/30/27	3,500,000.000	3,407,031.250	
		US T N/B 2.75 05/15/25	4,000,000.000	3,910,156.240	
		US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,177,925.760	
		US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,016,478.110	
		US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,715,770.680	
		US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	7,417,374.980	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,540,000.000	1,303,525.770	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,824,897.830	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,788,610.530	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,313,361.250	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,841,572.250	
		US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,959,375.000	

		US T N/B 2.875 04/30/29	3,000,000.000	2,909,648.420	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,860,000.000	4,740,208.570	
		US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,708,661.160	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,966,537.500	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,300,000.000	2,773,611.320	
		US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,771,311.330	
		US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,538,354.680	
		US T N/B 2.875 06/15/25	3,420,000.000	3,352,000.780	
		US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,156,343.740	
		US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,413,918.750	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,492,123.820	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	907,284.350	
		US T N/B 2.875 11/30/25	1,360,000.000	1,332,428.120	
		US T N/B 3.0 02/15/47	2,960,000.000	2,539,471.870	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,272,840.800	
		US T N/B 3.0 02/15/49	3,310,000.000	2,846,858.560	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	954,323.430	
		US T N/B 3.0 05/15/45	2,290,000.000	1,975,930.070	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,389,150.000	
		US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,143,750.010	
		US T N/B 3.0 07/31/24	3,820,000.000	3,752,926.180	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,810,000.000	3,269,456.250	
		US T N/B 3.0 08/15/52	3,740,000.000	3,210,556.240	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,719,306.620	
		US T N/B 3.0 10/31/25	1,270,000.000	1,247,775.000	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,350,375.000	
		US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	740,574.210	
		US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,228,595.310	
		US T N/B 3.125 02/15/43	1,740,000.000	1,557,503.890	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,484,209.370	
		US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,985,141.780	
		US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,851,527.730	
		US T N/B 3.125 08/31/27	3,940,000.000	3,891,134.770	
		US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	3,056,060.930	
		US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,312,845.690	
		US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	923,916.790	
		US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	3,448,771.850	
		US T N/B 3.25 06/30/27	3,500,000.000	3,472,177.730	
		US T N/B 3.25 06/30/29	3,000,000.000	2,968,828.140	
		US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,321,130.070	
		US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,723,356.250	
		US T N/B 3.375 11/15/48	3,200,000.000	2,943,000.000	
		US T N/B 3.5 01/31/28	2,380,000.000	2,390,458.980	
		US T N/B 3.5 01/31/30	2,500,000.000	2,512,207.020	
		US T N/B 3.5 02/15/33	4,000,000.000	4,020,312.480	
		US T N/B 3.5 02/15/39	500,000.000	493,271.470	
		US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,982,128.910	
		US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,566,646.470	
		US T N/B 3.625 02/15/53	3,200,000.000	3,103,249.980	

	US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,419,066.770	
	US T N/B 3.75 08/15/41	820,000.000	813,465.610	
	US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,434,278.890	
	US T N/B 3.875 01/15/26	5,800,000.000	5,829,113.270	
	US T N/B 3.875 02/15/43	1,800,000.000	1,800,843.750	
	US T N/B 3.875 03/31/25	1,050,000.000	1,047,969.730	
	US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,316,102.330	
	US T N/B 3.875 09/30/29	3,250,000.000	3,331,630.850	
	US T N/B 3.875 11/30/27	3,000,000.000	3,059,121.090	
	US T N/B 3.875 11/30/29	2,300,000.000	2,360,060.540	
	US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,691,281.250	
	US T N/B 3.875 12/31/29	2,000,000.000	2,053,671.880	
	US T N/B 4.0 02/15/26	2,500,000.000	2,523,193.350	
	US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	3,105,703.140	
	US T N/B 4.0 02/29/28	3,200,000.000	3,287,750.010	
	US T N/B 4.0 10/31/29	2,500,000.000	2,582,226.550	
	US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	3,183,375.000	
	US T N/B 4.0 11/15/52	4,860,000.000	5,046,806.240	
	US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,171,858.580	
	US T N/B 4.125 01/31/25	1,800,000.000	1,800,562.500	
	US T N/B 4.125 09/30/27	3,920,000.000	4,028,871.880	
	US T N/B 4.125 10/31/27	2,340,000.000	2,406,635.150	
	US T N/B 4.125 11/15/32	8,300,000.000	8,756,500.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	1,021,917.950	
	US T N/B 4.25 09/30/24	2,200,000.000	2,197,464.850	
	US T N/B 4.25 10/15/25	2,800,000.000	2,831,445.310	
	US T N/B 4.25 11/15/40	1,300,000.000	1,388,867.180	
	US T N/B 4.25 12/31/24	5,500,000.000	5,507,304.660	
	US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	989,340.620	
	US T N/B 4.375 05/15/41	930,000.000	1,006,379.880	
	US T N/B 4.375 10/31/24	2,070,000.000	2,072,870.510	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,088,281.250	
	US T N/B 4.5 02/15/36	400,000.000	445,085.930	
	US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	664,289.050	
	US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,084,737.500	
	US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,635,333.780	
	US T N/B 4.5 11/30/24	4,200,000.000	4,217,308.570	
	US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	997,669.120	
	US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,729,683.210	
	US T N/B 4.75 02/15/41	830,000.000	941,531.250	
	US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	646,824.310	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	926,732.420	
	US T N/B 5.375 02/15/31	860,000.000	977,242.170	
	US T N/B 6.0 02/15/26	400,000.000	424,687.490	
	US T N/B 6.125 11/15/27	200,000.000	222,601.560	
	US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	893,500.130	
アメリカ・ドル　小計		843,730,000.000 (113,211,691,400)	771,923,392.330 (103,576,680,782)	

	イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,150,000.000	1,043,878.000	
		UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,040,000.000	881,100.320	
		UK TREASURY 0.25 01/31/25	2,400,000.000	2,243,001.600	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,695,232.000	
		UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,330,000.000	2,071,754.450	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	960,530.400	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,780,000.000	1,483,808.000	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	612,959.890	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	993,273.000	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,850,000.000	1,261,330.000	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	890,000.000	380,574.130	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,670,000.000	861,887.000	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,300,000.000	978,315.000	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,260,000.000	1,062,810.000	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,970,000.000	2,368,575.000	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,360,000.000	894,947.450	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	298,146.880	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	996,875.000	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,730,000.000	902,008.160	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,600,000.000	1,009,280.190	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,100,000.000	1,026,030.720	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	592,390.000	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,110,000.000	606,837.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	929,042.950	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	870,000.000	488,468.280	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	423,756.500	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	390,644.100	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	649,535.300	

	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	1,046,720.600	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,310,000.000	1,254,849.000	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	870,375.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	810,000.000	794,748.980	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,040,000.000	1,773,767.760	
	UK TREASURY 3.25 01/31/33	700,000.000	669,004.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,450,000.000	1,304,710.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	930,000.000	833,689.200	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	400,000.000	385,856.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	901,944.800	
	UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,400,000.000	1,296,157.800	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	888,498.000	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	1,890,000.000	1,899,072.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,500,000.000	1,548,600.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,420,000.000	1,479,799.040	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,078,497.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	910,000.000	930,532.330	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,086,124.900	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,080,000.000	1,086,318.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	1,025,308.890	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,236,421.800	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,269,625.320	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,565,000.000	1,638,914.950	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,395,000.000	1,494,927.750	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,080,000.000	1,166,508.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,785,000.000	1,813,337.210	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	758,608.000	
イギリス・ポンド　小計		71,684,000.000 (12,154,022,200)	59,639,907.650 (10,111,946,342)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	320,000.000	302,763.200	

		ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	830,000.000	757,640.600	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,764,231.840	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,410,433.740	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,720,000.000	1,283,259.320	
		ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,902,104.000	
		ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	560,000.000	431,304.160	
		ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,560,000.000	1,463,762.040	
		ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,360,000.000	2,199,335.920	
		ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,910,000.000	1,810,765.950	
		ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,010,000.000	1,212,627.210	
		ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,317,187.640	
イスラエル・シュケル　小計			18,240,000.000 (671,264,832)	16,855,415.620 (620,309,635)	
オーストラリア・ドル		AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,990,000.000	1,897,980.700	
		AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,358,725.660	
		AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,815,000.000	1,664,147.970	
		AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,470,000.000	2,031,886.720	
		AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,407,128.470	
		AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,771,276.210	
		AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,710,000.000	1,482,901.850	
		AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,460,000.000	914,982.000	
		AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,596,443.920	
		AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	830,000.000	796,385.000	
		AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,718,273.540	
		AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,020,000.000	868,847.780	
		AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	597,241.700	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,430,000.000	1,407,906.500	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	950,000.000	928,601.260	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,361,150.000	
		AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	940,000.000	799,155.540	
		AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	2,270,000.000	2,175,168.560	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,700,000.000	1,699,619.020	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,500,000.000	1,501,317.900	
		AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	764,020.940	
		AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	800,000.000	797,270.200	
		AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	833,710.260	
		AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,400,000.000	1,432,322.780	
		AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,200,000.000	1,237,786.550	

	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,460,000.000	1,588,016.880	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,590,000.000	1,684,336.130	
オーストラリア・ドル　小計		39,155,000.000 (3,566,628,950)	36,316,604.040 (3,308,079,462)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	10,000,000.000	9,964,678.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	4,200,000.000	4,199,370.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	19,906,000.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,470,859.710	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	49,500,000.000	49,457,925.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,727,010.090	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	26,000,000.000	25,868,700.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,343,767.180	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,051,055.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,364,077.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	7,300,000.000	7,189,770.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	17,500,000.000	17,404,625.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,572,610.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,781,866.860	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	13,000,000.000	12,900,550.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,000,000.000	19,958,000.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	20,000,000.000	20,066,000.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	3,000,000.000	2,995,350.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	26,000,000.000	26,106,600.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,076,450.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	33,300,000.000	33,363,270.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	18,500,000.000	18,725,700.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,135,692.550	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	22,100,000.000	22,396,140.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	9,000,000.000	9,187,650.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	35,000,000.000	35,630,000.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	7,500,000.000	7,532,079.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,231,200.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	450,000.000	461,677.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,620,750.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	20,320,000.000	21,065,097.820	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	5,100,000.000	5,329,261.830	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	16,450,000.000	17,677,109.130	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,246,346.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,327,056.620	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	3,000,000.000	3,369,030.300	
オフショア・人民元　小計			555,220,000.000 (10,741,397,164)	559,703,325.490 (10,828,132,476)	
カナダ・ドル		CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,293,015.120	
		CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,151,072.000	
		CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,513,515.600	
		CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	775,350.630	
		CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	508,765.400	
		CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,183,069.770	
		CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	670,272.400	
		CANADA 1.25 03/01/27	1,210,000.000	1,129,291.790	
		CANADA 1.25 06/01/30	1,850,000.000	1,661,777.300	
		CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,055,799.800	
		CANADA 1.5 05/01/24	940,000.000	914,854.060	
		CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	665,121.800	
		CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,229,068.790	
		CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	426,148.800	
		CANADA 1.5 12/01/31	2,620,000.000	2,350,658.760	
		CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,623,592.060	
		CANADA 2.0 06/01/28	1,430,000.000	1,372,270.900	
		CANADA 2.0 06/01/32	1,940,000.000	1,805,350.420	
		CANADA 2.0 12/01/51	3,260,000.000	2,605,170.320	
		CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,285,326.240	
		CANADA 2.25 06/01/29	230,000.000	222,875.980	

	CANADA 2.5 06/01/24	970,000.000	953,466.350	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,471,101.600	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,280,000.000	1,264,087.040	
	CANADA 2.75 08/01/24	590,000.000	580,651.450	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,250,000.000	1,234,667.500	
	CANADA 2.75 12/01/48	860,000.000	811,943.200	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	362,182.080	
	CANADA 3.0 04/01/26	200,000.000	197,971.000	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,760,000.000	1,738,466.400	
	CANADA 3.0 11/01/24	860,000.000	848,636.820	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,130,000.000	1,155,641.960	
	CANADA 3.5 12/01/45	900,000.000	958,873.500	
	CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,159,033.720	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	640,620.720	
	CANADA 5.0 06/01/37	380,000.000	464,325.420	
	CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	858,951.300	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	760,527.260	
カナダ・ドル　小計		45,710,000.000 (4,588,826,900)	42,903,515.260 (4,307,083,897)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	380,000.000	357,310.060	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	482,154.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	540,000.000	495,450.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	448,840.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	471,558.750	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	940,000.000	916,876.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	564,925.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	768,155.700	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	184,944.100	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	340,000.000	338,349.300	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	460,000.000	486,450.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	688,264.500	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	590,000.000	595,015.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	200,800.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	624,774.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	153,062.500	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	370,000.000	368,011.480	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	330,000.000	347,985.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	818,800.000	
シンガポール・ドル　小計		9,425,000.000 (955,318,000)	9,311,725.390 (943,836,486)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	5,420,000.000	4,568,149.440	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,132,025.970	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,010,000.000	2,728,930.410	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,910,000.000	7,500,680.900	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	2,000,000.000	1,893,200.000	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,050,000.000	4,032,704.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,875,615.260	

	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,370,000.000	3,831,555.200	
スウェーデン・クローナ　小計		35,070,000.000 (460,819,800)	33,562,861.180 (441,015,996)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,200,000.000	2,108,172.000	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,180,000.000	3,391,509.460	
	DENMARK 0.25 11/15/52	3,760,000.000	1,959,538.650	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,350,000.000	5,828,097.300	
	DENMARK 0.5 11/15/29	6,290,000.000	5,557,756.170	
	DENMARK 1.75 11/15/25	4,840,000.000	4,735,363.060	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,930,000.000	11,057,661.800	
デンマーク・クローネ　小計		36,550,000.000 (723,690,000)	34,638,098.440 (685,834,349)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	450,000.000	372,548.030	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/24	650,000.000	620,060.090	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	518,614.330	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	580,000.000	476,818.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	265,143.610	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	440,000.000	369,871.660	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	820,000.000	791,263.420	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	810,000.000	672,482.570	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	440,000.000	322,903.250	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	350,000.000	329,834.820	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	350,000.000	331,503.690	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	130,104.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	600,000.000	607,844.810	
ニュージーランド・ドル　小計		6,600,000.000 (564,828,000)	5,808,992.280 (497,133,559)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,273,302.500	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,803,812.050	
	NORWAY 1.5 02/19/26	6,710,000.000	6,389,597.500	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,275,884.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,130,000.000	1,094,953.720	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,620,000.000	2,408,455.960	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,956,253.500	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,630,000.000	2,407,502.000	
	NORWAY 3.0 08/15/33	2,900,000.000	2,835,040.000	
ノルウェー・クローネ　小計		27,420,000.000 (350,701,800)	25,444,801.230 (325,439,008)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,564,818.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	4,470,000.000	4,069,935.000	
	POLAND 07/25/24	1,710,000.000	1,601,893.130	

	POLAND 1.25 10/25/30	4,370,000.000	3,221,607.700	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,920,000.000	2,853,564.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,150,000.000	2,050,820.500	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,529,274.500	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,080,340.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,026,524.280	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,509,546.000	
	POLAND 3.75 05/25/27	3,650,000.000	3,394,135.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,444,896.000	
	POLAND 7.5 07/25/28	1,500,000.000	1,612,389.150	
ポーランド・ズロチ　小計		35,290,000.000 (1,152,024,405)	30,959,743.260 (1,010,665,339)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,100,000.000	1,013,295.670	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	648,308.830	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,383,964.000	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,018,166.400	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,456,131.870	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,814,240.450	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,658,619.430	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	1,350,000.000	1,366,759.980	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	707,431.760	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,012,829.100	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,756,103.100	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,683,780.820	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	920,000.000	934,436.270	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,750,000.000	2,790,409.320	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	909,993.330	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,900,000.000	1,874,087.040	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,030,000.000	1,041,301.050	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	691,148.000	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	600,000.000	614,342.460	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,079,056.960	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,261,770.000	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,079,253.070	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	950,000.000	1,019,757.360	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,600,000.000	1,763,112.000	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	327,281.370	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,100,000.000	1,188,174.460	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,280,912.920	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,781,215.520	
マレーシア・リンギット　小計		38,080,000.000 (1,148,009,184)	39,155,882.540 (1,180,444,138)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	15,580,000.000	13,821,641.200	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	11,680,000.000	10,673,768.000	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	6,790,000.000	6,227,142.950	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	9,290,000.000	8,313,760.350	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	6,030,702.650	

	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	21,702,000.000	21,495,404.960	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	32,282,000.000	29,350,015.740	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	28,146,000.000	26,747,706.720	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	31,148,000.000	29,396,547.960	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	21,007,000.000	18,535,841.550	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	6,835,000.000	6,341,581.350	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,070,000.000	21,307,347.960	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	21,661,000.000	19,544,936.910	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	19,941,484.390	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	15,023,046.060	
メキシコ・ペソ　小計		269,477,000.000 (2,061,606,841)	252,750,928.750 (1,933,645,705)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	930,000.000	772,825.350	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	810,000.000	651,754.350	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	1,090,000.000	1,034,883.060	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	570,000.000	493,373.760	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	450,000.000	260,595.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	380,000.000	261,934.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,420,000.000	1,255,548.380	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,070,000.000	986,545.350	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	410,000.000	180,547.600	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	765,297.540	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	333,124.030	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,190,000.000	1,119,462.750	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	128,326.360	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	900,000.000	762,195.600	
	AUSTRIA 07/15/24	520,000.000	503,165.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	940,000.000	909,031.700	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	740,000.000	537,986.660	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	110,447.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	930,000.000	915,526.410	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	290,000.000	222,889.940	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	260,000.000	255,547.500	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	279,918.990	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	770,000.000	727,459.810	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	500,000.000	497,050.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	540,000.000	537,955.560	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	310,000.000	354,112.520	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,510,000.000	1,676,100.000	

		AUSTRIA 4.85 03/15/26	710,000.000	754,515.000	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	415,000.000	472,876.100	
		BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	517,714.380	
		BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	740,619.420	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	666,240.000	
		BELGIUM 0.35 06/22/32	1,200,000.000	956,160.000	
		BELGIUM 0.4 06/22/40	450,000.000	279,260.550	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	750,000.000	726,288.750	
		BELGIUM 0.65 06/22/71	670,000.000	269,771.130	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	1,980,000.000	1,906,403.400	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,260,000.000	1,173,300.660	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	1,440,000.000	1,310,544.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	1,500,000.000	1,356,351.000	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,810,000.000	1,725,436.800	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,270,000.000	1,105,802.970	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	696,185.280	
		BELGIUM 1.4 06/22/53	1,490,000.000	924,713.370	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	380,000.000	304,498.560	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	648,061.800	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	980,000.000	684,618.200	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	511,550.270	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	321,750.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	299,680.290	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	840,000.000	836,607.240	
		BELGIUM 2.75 04/22/39	220,000.000	204,847.500	
		BELGIUM 3.0 06/22/33	500,000.000	500,306.600	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	680,000.000	676,255.920	
		BELGIUM 3.3 06/22/54	270,000.000	258,790.950	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	740,000.000	780,163.500	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	630,000.000	684,095.580	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,280,000.000	1,432,793.600	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,125,854.000	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,220,000.000	1,444,223.800	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,570,000.000	1,779,419.160	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	2,110,000.000	1,970,107.000	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,514,610.150	
		BUNDESOBL 0.0 04/16/27	2,160,000.000	1,978,434.720	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,860,000.000	1,720,090.800	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,850,000.000	2,686,210.500	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,272,847.500	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,880,000.000	1,806,473.200	
		BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,529,723.740	
		BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,800,000.000	1,797,696.000	
		BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	1,250,000.000	1,214,712.500	
		BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	900,000.000	872,028.000	
		BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	1,350,000.000	1,339,443.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,120,000.000	1,830,853.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,840,000.000	1,554,211.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,900,000.000	2,392,607.300	

		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,660,000.000	1,249,183.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,780,000.000	1,301,180.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,430,000.000	2,076,483.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	590,000.000	504,880.700	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,190,000.000	1,828,912.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	669,176.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,650,977.460	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	710,000.000	373,992.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,540,000.000	768,383.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,467,298.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,060,000.000	1,827,079.920	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,968,229.200	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,080,000.000	1,863,222.400	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,770,000.000	1,599,301.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,832,170.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,660,000.000	2,527,000.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,240,000.000	2,068,684.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,310,000.000	2,149,928.550	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	2,590,000.000	2,403,924.040	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	1,990,000.000	1,737,733.670	
		DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,460,000.000	1,190,133.600	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,820,000.000	1,780,806.300	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,340,890.200	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,670,000.000	2,091,798.150	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,520,000.000	1,499,823.520	
		DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,430,000.000	1,364,720.500	
		DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	850,000.000	728,586.000	
		DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,400,000.000	1,389,346.000	
		DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	950,000.000	950,541.500	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,070,000.000	2,078,031.600	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,170,000.000	2,195,115.580	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,479,598.400	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,130,000.000	2,511,847.230	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,700,000.000	2,093,482.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,325,022.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,820,000.000	2,246,589.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	1,849,948.200	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,820,000.000	3,461,014.200	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,505,399.600	

		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	973,011.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	991,040.500	
		FINLAND 0.0 09/15/24	410,000.000	395,388.830	
		FINLAND 0.0 09/15/26	430,000.000	394,761.500	
		FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	171,736.530	
		FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	192,397.800	
		FINLAND 0.125 04/15/52	660,000.000	300,606.680	
		FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	240,511.200	
		FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	179,254.510	
		FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	434,242.300	
		FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	232,666.400	
		FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	366,340.000	
		FINLAND 0.5 09/15/28	550,000.000	492,429.850	
		FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	262,020.900	
		FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	170,956.440	
		FINLAND 0.875 09/15/25	910,000.000	875,466.410	
		FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	397,509.120	
		FINLAND 1.375 04/15/27	110,000.000	105,171.440	
		FINLAND 1.375 04/15/47	480,000.000	347,259.610	
		FINLAND 1.5 09/15/32	50,000.000	44,412.350	
		FINLAND 2.625 07/04/42	430,000.000	400,452.550	
		FINLAND 2.75 04/15/38	170,000.000	161,608.540	
		FINLAND 2.75 07/04/28	490,000.000	493,699.500	
		FINLAND 4.0 07/04/25	510,000.000	524,893.530	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/25	2,190,000.000	2,086,270.650	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	4,030,000.000	3,750,446.960	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	3,650,000.000	3,316,536.000	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	5,390,000.000	4,205,278.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,890,000.000	2,439,824.700	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,780,000.000	3,914,757.860	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,594,872.530	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,920,000.000	2,692,368.480	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,730,000.000	3,569,280.810	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,460,000.000	3,250,614.640	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,390,000.000	2,995,729.440	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,150,000.000	1,388,295.410	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	300,491.510	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,590,000.000	932,989.740	
		FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,280,000.000	3,010,384.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,110,000.000	4,672,246.740	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,770,000.000	2,000,015.160	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,350,000.000	1,213,670.420	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,500,000.000	4,077,657.000	
		FRANCE OAT 03/25/25	3,970,000.000	3,775,485.880	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,560,000.000	3,347,343.400	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,631,944.670	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,860,000.000	2,405,403.000	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	4,180,000.000	3,363,646.000	

		FRANCE OAT 1.25 05/25/38	500,000.000	385,450.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,480,000.000	4,104,244.480	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,470,000.000	1,681,667.390	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	658,343.070	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,370,000.000	1,953,278.160	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,380,000.000	2,342,640.900	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,250,000.000	1,755,537.750	
		FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,600,000.000	1,492,915.200	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,480,127.900	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,550,000.000	4,511,907.400	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/43	250,000.000	220,941.250	
		FRANCE OAT 2.5 09/24/26	520,000.000	517,706.280	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,890,000.000	3,918,871.580	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,040,000.000	2,025,638.400	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,000,000.000	3,075,450.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,711,917.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,170,000.000	1,326,228.220	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,130,442.040	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,088,892.400	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,530,000.000	2,968,190.940	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,500,000.000	4,046,472.500	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,118,112.760	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,340,080.260	
		IRISH 0.0 10/18/31	870,000.000	694,109.490	
		IRISH 0.2 05/15/27	520,000.000	474,112.600	
		IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	461,310.300	
		IRISH 0.35 10/18/32	400,000.000	321,319.200	
		IRISH 0.4 05/15/35	370,000.000	276,644.560	
		IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	160,695.750	
		IRISH 0.9 05/15/28	610,000.000	563,910.270	
		IRISH 1.0 05/15/26	900,000.000	860,314.570	
		IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	672,535.130	
		IRISH 1.3 05/15/33	90,000.000	78,321.420	
		IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	327,682.440	
		IRISH 1.5 05/15/50	570,000.000	391,165.920	
		IRISH 1.7 05/15/37	490,000.000	414,716.530	
		IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	676,362.120	
		IRISH 2.4 05/15/30	860,000.000	852,003.720	
		IRISH 3.0 10/18/43	410,000.000	396,970.200	
		IRISH 5.4 03/13/25	920,000.000	964,727.070	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,520,000.000	1,381,376.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,050,000.000	1,843,565.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,460,000.000	1,401,322.600	
		ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,292,013.600	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,248,884.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,800,000.000	1,713,610.800	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,500,000.000	1,248,975.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,491,803.460	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	941,600.000	

		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,520,000.000	1,164,671.120	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,310,000.000	1,195,440.500	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,610,000.000	1,280,516.720	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,980,000.000	1,292,742.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	2,380,000.000	1,828,554.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,103,760.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,511,664.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,326,705.500	
		ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,007,105.000	
		ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,298,664.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,830,000.000	1,701,085.650	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,574,110.740	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	803,936.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,880,000.000	1,815,583.680	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	680,000.000	662,048.680	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	475,146.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,760,000.000	1,698,903.360	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,550,000.000	1,471,725.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,790,000.000	1,478,994.660	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,483,148.160	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,320,000.000	745,316.880	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,178,529.600	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	773,605.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	975,466.800	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,205,528.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	3,040,000.000	2,840,080.480	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,607,567.490	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.000	1,417,800.000	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,290,000.000	1,241,115.450	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	200,088.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	315,384.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,515,588.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,071,952.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,830,000.000	1,563,735.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	778,205.000	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,521,588.290	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,618,336.390	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	2,040,000.000	1,785,408.000	
		ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,220,000.000	1,177,056.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,590,000.000	1,174,692.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	472,710.000	
		ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,137,480.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,740,000.000	1,667,817.660	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,520,000.000	1,253,696.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,545,559.750	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,160,000.000	968,016.520	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	520,320.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	965,365.080	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,020,000.000	926,459.880	

		ITALY BTPS 3.4 04/01/28	550,000.000	545,600.000	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	997,433.010	
		ITALY BTPS 3.5 01/15/26	2,010,000.000	2,017,437.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,870,000.000	1,837,970.640	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,629,151.860	
		ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,000,000.000	1,010,870.000	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	650,000.000	577,479.500	
		ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,800,000.000	1,802,700.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,170,000.000	2,080,813.000	
		ITALY BTPS 4.0 04/30/35	660,000.000	637,824.000	
		ITALY BTPS 4.4 05/01/33	750,000.000	764,250.000	
		ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,200,000.000	1,175,880.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,510,000.000	2,589,065.000	
		ITALY BTPS 4.5 10/01/53	370,000.000	358,826.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,771,588.560	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,132,455.300	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	560,000.000	576,751.280	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,759,600.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,090,000.000	2,205,577.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,250,000.000	1,320,625.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,140,000.000	2,328,962.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,460,000.000	1,645,420.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,832,904.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,510,000.000	1,700,562.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	394,205.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/26	1,260,000.000	1,177,669.080	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,080,000.000	986,844.600	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,110,000.000	965,574.570	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	366,779.600	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,000,000.000	474,175.280	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	585,495.400	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,400,000.000	1,139,045.600	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,490,000.000	1,418,106.870	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,060,000.000	926,052.460	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,110,000.000	774,173.940	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,420,000.000	1,334,090.000	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/32	700,000.000	581,239.400	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,082,309.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,358,249.280	
		NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	559,647.000	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,140,000.000	1,130,141.280	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,099,663.680	
		NETHERLANDS 2.5 07/15/33	450,000.000	445,749.300	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,510,000.000	1,515,408.820	

		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,420,000.000	1,610,396.440	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,720,000.000	1,952,028.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	840,000.000	950,040.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	2,050,000.000	1,951,108.000	
		SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,518,710.520	
		SPAIN 0.0 01/31/27	1,610,000.000	1,447,309.500	
		SPAIN 0.0 01/31/28	2,280,000.000	1,983,714.000	
		SPAIN 0.0 05/31/24	1,110,000.000	1,074,283.530	
		SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	820,363.710	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,380,000.000	1,085,370.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	1,080,000.000	1,043,834.040	
		SPAIN 0.5 04/30/30	3,000,000.000	2,523,738.000	
		SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,315,424.270	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,314,874.350	
		SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,487,955.000	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,750,000.000	1,597,575.000	
		SPAIN 0.8 07/30/29	1,100,000.000	955,240.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	900,000.000	619,740.170	
		SPAIN 1.0 07/30/42	840,000.000	518,868.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,590,000.000	824,205.120	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	843,280.200	
		SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,526,350.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,930,000.000	1,833,092.770	
		SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	2,018,349.550	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,670,000.000	1,539,573.000	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,900,000.000	1,742,495.700	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,747,408.620	
		SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	191,692.630	
		SPAIN 1.5 04/30/27	1,710,000.000	1,622,875.500	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,591,813.990	
		SPAIN 1.85 07/30/35	2,840,000.000	2,371,879.800	
		SPAIN 1.9 10/31/52	870,000.000	558,076.290	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,330,000.000	1,296,594.390	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,639,759.860	
		SPAIN 2.15 10/31/25	2,010,000.000	1,979,554.530	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,970,000.000	1,796,640.000	
		SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,614,183.880	
		SPAIN 2.7 10/31/48	1,210,000.000	975,976.610	
		SPAIN 2.75 10/31/24	2,190,000.000	2,183,147.490	
		SPAIN 2.8 05/31/26	800,000.000	797,080.000	
		SPAIN 2.9 10/31/46	1,730,000.000	1,476,108.660	
		SPAIN 3.15 04/30/33	670,000.000	657,404.000	
		SPAIN 3.45 07/30/43	250,000.000	233,864.460	
		SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	991,268.320	
		SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,479,075.780	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,600,000.000	1,697,448.000	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,967,453.430	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,630,000.000	1,815,226.680	

		SPAIN 4.9 07/30/40	1,510,000.000	1,719,135.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	1,560,000.000	1,719,900.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,431,128.710	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,815,000.000	2,174,705.770	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,778,564.720	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,460,000.000	1,689,177.950	
	ユーロ　小計		521,657,000.000 (76,923,541,220)	477,376,688.440 (70,393,966,477)	
国債証券　合計			229,274,370,695.800 (229,274,370,696)	210,164,213,651 (210,164,213,651)	
合計				210,164,213,651 (210,164,213,651)	

（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　261銘柄	48.73	49.28
イギリス・ポンド	国債証券　55銘柄	4.76	4.81
イスラエル・シュケル	国債証券　12銘柄	0.29	0.30
オーストラリア・ドル	国債証券　27銘柄	1.56	1.57
オフショア・人民元	国債証券　36銘柄	5.09	5.15
カナダ・ドル	国債証券　38銘柄	2.03	2.05
シンガポール・ドル	国債証券　19銘柄	0.44	0.45
スウェーデン・クローナ	国債証券　8銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券　7銘柄	0.32	0.33
ニュージーランド・ドル	国債証券　13銘柄	0.23	0.24
ノルウェー・クローネ	国債証券　9銘柄	0.15	0.15
ポーランド・ズロチ	国債証券　13銘柄	0.48	0.48
マレーシア・リンギット	国債証券　28銘柄	0.56	0.56
メキシコ・ペソ	国債証券　15銘柄	0.91	0.92
ユーロ	国債証券　359銘柄	33.12	33.49

（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5月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,056,435,115
投資証券	199,317,900,274
派生商品評価勘定	119,420,700
未収入金	1,579,847,116
未収配当金	2,116,650,068
差入委託証拠金	261,744,000
流動資産合計	207,451,997,273
資産合計	207,451,997,273
負債の部	
流動負債	
前受金	132,531,270
未払解約金	3,023,365,294
流動負債合計	3,155,896,564
負債合計	3,155,896,564
純資産の部	
元本等	
元本	87,246,759,652
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	117,049,341,057
元本等合計	204,296,100,709
純資産合計	204,296,100,709
負債純資産合計	207,451,997,273

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11月12日 至　2023年5月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年5月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	87,353,406,924円
同期中追加設定元本額	26,047,012,151円
同期中一部解約元本額	26,153,659,423円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	248,892円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	1,137,797円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	2,971,983円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	3,318,464円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	2,355,444円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	2,505,973円
たわらノーロード　国内リート	5,639,348,625円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	1,179,477,901円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,324,831,194円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	40,400,885円
たわらノーロード　バランス（標準型）	776,201,414円
たわらノーロード　バランス（積極型）	864,941,740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）	226,461,331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）	550,170,978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）	361,002,327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）	407,544,453円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,538,679円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	45,630,651円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,970,480円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,351,658円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,819,640円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	473,699,700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）	143,513,616円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	210,067,895円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	386,063,331円
投資のソムリエ	9,621,384,207円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	750,143,469円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	161,194,790円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	832,954,300円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,326,204,401円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	40,011,169円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	19,785,776円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,961,695円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	117,267,274円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	376,810,428円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	120,549,676円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	47,751,705円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	21,832,556円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	13,225,557円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	2,870,856円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	43,314,520円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	66,192,545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）	694,730,215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）	2,238,851円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	2,089,099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）	34,776,351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）	1,287,716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）	188,600,781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）	81,793,611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）	61,967,387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）	2,317,326円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	5,481,997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）	50,863,696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）	83,763,731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）	58,706,785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）	81,316,281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）	2,127,352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）	58,458,912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）	84,406,930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）	11,422,898円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,532,338,455円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	255,772,370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）	81,931,359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）	435,975,434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）	3,481,597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）	3,949,662円
日米資産配分戦略ファンド（ＴＩＰＳ活用型）（為替ヘッジ比率調整型）（適格機関投資家限定）	62,162,048円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	9,358,253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）	1,016,521,207円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,798,543,062円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	36,623,298,621円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,672,437,040円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ファンドラップ）	3,999,303,686円
計	87,246,759,652円
２．　受益権の総数	87,246,759,652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11月12日 至　2023年5月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月11日現在

１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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5月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△10,512,182,467
合計	△10,512,182,467

（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5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2023年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	4,213,120,230	－	4,332,798,000	119,677,770
合計	4,213,120,230	－	4,332,798,000	119,677,770

（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5月11日現在

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3416円 (23,416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5月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	8,165	1,521,139,500	
	ＧＬＰ投資法人	61,515	9,337,977,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	18,321	2,379,897,900	
	Ｏｎｅリート投資法人	3,324	792,774,000	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	9,480	1,285,488,000	
	いちごオフィスリート投資法人	15,617	1,366,487,500	
	いちごホテルリート投資法人	3,157	335,589,100	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	10,062	4,019,769,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	19,056	6,717,240,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	8,308	1,148,165,600	
	イオンリート投資法人	21,880	3,411,092,000	
	インヴィンシブル投資法人	83,886	4,815,056,400	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,874	440,861,200	
	オリックス不動産投資法人	37,975	6,657,017,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	14,025	1,455,795,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	11,090	3,338,090,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	13,977	2,944,953,900	
	ケネディクス商業リート投資法人	8,285	2,010,769,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	9,114	3,116,988,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,954	583,085,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	6,105	510,988,500	
	ザイマックス・リート投資法人	3,091	337,228,100	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	61,461	4,812,396,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	17,484	2,038,634,400	

	ジャパンリアルエステイト投資法人	19,543	10,338,247,000	
	スターアジア不動産投資法人	23,796	1,330,196,400	
	スターツプロシード投資法人	3,304	765,536,800	
	タカラレーベン不動産投資法人	8,984	822,934,400	
	トーセイ・リート投資法人	4,228	552,176,800	
	ヒューリックリート投資法人	17,832	2,753,260,800	
	フロンティア不動産投資法人	7,071	3,418,828,500	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	4,699	774,865,100	
	マリモ地方創生リート投資法人	2,911	373,772,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	42,633	6,348,053,700	
	ラサールロジポート投資法人	23,332	3,786,783,600	
	阪急阪神リート投資法人	8,609	1,255,192,200	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7,529	3,854,848,000	
	三菱地所物流リート投資法人	6,548	2,740,338,000	
	産業ファンド投資法人	29,080	4,446,332,000	
	森トラストリート投資法人	35,473	2,529,259,124	
	森ヒルズリート投資法人	22,412	3,379,729,600	
	星野リゾート・リート投資法人	3,333	2,409,759,000	
	積水ハウス・リート投資法人	57,270	4,495,695,000	
	大江戸温泉リート投資法人	3,076	210,090,800	
	大和ハウスリート投資法人	28,729	8,268,206,200	
	大和証券オフィス投資法人	3,948	2,301,684,000	
	大和証券リビング投資法人	26,410	3,016,022,000	
	投資法人みらい	23,155	1,061,656,750	
	東海道リート投資法人	3,170	374,377,000	
	東急リアル・エステート投資法人	12,778	2,320,484,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	6,581	4,303,974,000	
	日本ビルファンド投資法人	22,234	12,161,998,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	13,034	4,516,281,000	
	日本プロロジスリート投資法人	32,125	9,958,750,000	
	日本リート投資法人	6,191	2,002,788,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	12,851	4,080,192,500	
	日本都市ファンド投資法人	96,163	9,510,520,700	
	福岡リート投資法人	9,857	1,586,977,000	
	平和不動産リート投資法人	13,025	2,078,790,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	61,632	9,811,814,400	
投資証券　合計		1,157,752	199,317,900,274	
合計			199,317,900,274	

（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5月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	136,117,664
コール・ローン	184,729,123
投資信託受益証券	8,400,356,945
投資証券	69,684,749,213
派生商品評価勘定	5,422,121
未収入金	794,679,645
未収配当金	117,138,286
流動資産合計	79,323,192,997
資産合計	79,323,192,997
負債の部	
流動負債	
未払解約金	946,043,000
流動負債合計	946,043,000
負債合計	946,043,000
純資産の部	
元本等	
元本	47,920,374,095
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	30,456,775,902
元本等合計	78,377,149,997
純資産合計	78,377,149,997
負債純資産合計	79,323,192,997

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11月12日 至　2023年5月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年5月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,946,447,436円
同期中追加設定元本額	27,896,123,286円
同期中一部解約元本額	19,922,196,627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）	1,676,317,420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）	23,628,960円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,989,918円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	18,742,309円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	47,147,304円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	53,208,585円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	37,381,833円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	39,521,072円
たわらノーロード　先進国リート	15,202,105,342円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,802,915,884円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	345,674,332円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,359,269,067円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	29,614,284円

たわらノーロード　バランス（標準型）	555,092,711円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,144,783,732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）	47,414,920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）	484,143,168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）	485,319,689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）	846,789,931円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	620,383円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	33,342,097円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,560,944円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	24,708,635円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	1,687,380,260円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	18,689,774円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	690,947,972円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	57,534,103円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	214,120,117円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	312,458,906円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	562,208,318円
投資のソムリエ	9,315,485,484円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	725,520,314円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	240,510,446円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	805,262,137円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,219,247,674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）	925,313,968円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	50,771,870円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	25,103,440円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,763,722円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	113,574,374円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	172,467,838円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	53,836,161円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	27,706,334円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	16,817,881円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,640,014円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	86,634,576円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	284,697,856円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	320,908,316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）	4,070,778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）	3,950,091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）	2,326,971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）	4,138,523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）	8,968,317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）	3,808,861円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	247,446,743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）	1,243,561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）	3,875,267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）	3,820,821円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	9,043,042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）	58,339,655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）	189,065,790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）	828,030,081円
計	47,920,374,095円
２．　受益権の総数	47,920,374,095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11月12日 至　2023年5月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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5月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	89,264,705
投資証券	△1,765,184,848
合計	△1,675,920,143

（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5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年5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	825,443,780	－	820,021,659	5,422,121
アメリカ・ドル	628,308,000	－	623,844,000	4,464,000
イギリス・ポンド	40,950,960	－	40,686,744	264,216
オーストラリア・ドル	54,837,000	－	54,648,000	189,000
カナダ・ドル	15,147,000	－	15,056,535	90,465
シンガポール・ドル	27,500,580	－	27,363,906	136,674
ニュージーランド・ドル	5,137,500	－	5,134,050	3,450
ユーロ	41,499,640	－	41,284,964	214,676
香港・ドル	12,063,100	－	12,003,460	59,640
合計	825,443,780	－	820,021,659	5,422,121

（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5月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6356円 (16,356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5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	144,600.000	60,009.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	297,200.000	98,076.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	125,850.000	
		PRIME US REIT	317,600.000	74,636.000	
	アメリカ・ドル　小計		1,671,100.000	358,571.000 (48,113,057)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	195,539.000	529,910.690	
		ARENA REIT	165,205.000	602,998.250	
		BWP TRUST	225,291.000	867,370.350	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	302,227.000	539,475.190	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	253,201.000	817,839.230	
		CENTURIA OFFICE REIT	210,931.000	303,740.640	
		CHARTER HALL GROUP	217,650.000	2,359,326.000	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	301,809.000	1,321,923.420	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	230,204.000	877,077.240	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	160,446.000	478,129.080	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	632,521.000	366,862.180	
		DEXUS	487,453.000	3,909,373.060	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	91,184.000	269,904.640	
		GDI PROPERTY GROUP	222,442.000	160,158.240	
		GOODMAN GROUP	778,707.000	15,410,611.530	
		GPT GROUP	875,265.000	3,851,166.000	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	126,146.000	413,758.880	
		HEALTHCO REIT	182,619.000	245,622.550	
		HMC CAPITAL LTD	88,028.000	367,957.040	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	726,438.000	864,461.220	

		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	303,075.210	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	162,299.000	699,508.690	
		MIRVAC GROUP	1,803,793.000	4,220,875.620	
		NATIONAL STORAGE REIT	558,199.000	1,401,079.490	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	140,343.000	98,941.810	
		REGION RE LTD	515,147.000	1,303,321.910	
		RURAL FUNDS GROUP	173,970.000	340,111.350	
		SCENTRE GROUP	2,357,729.000	6,695,950.360	
		STOCKLAND	1,091,946.000	4,891,918.080	
		VICINITY CENTRES	1,752,825.000	3,610,819.500	
		WAYPOINT REIT LTD	300,308.000	789,810.040	
	オーストラリア・ドル　小計		15,415,722.000	58,913,077.490 (5,366,392,228)	
	シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	228,595.000	317,747.050	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	962,016.000	1,019,736.960	
		CAPITALAND CHINA TRUST	551,380.000	612,031.800	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,326,109.000	4,768,523.450	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	1,524,760.000	4,376,061.200	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	399,600.000	479,520.000	
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	183,300.000	103,564.500	
		EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	32,034.000	
		ESR LOGOS REIT	2,777,440.000	902,668.000	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	481,400.000	291,247.000	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100.000	139,906.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	497,900.000	1,090,401.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,304,864.000	1,722,420.480	
		KEPPEL DC REIT	594,400.000	1,283,904.000	
		KEPPEL REIT	890,700.000	774,909.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	882,500.000	595,687.500	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	903,920.000	2,106,133.600	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,459,420.000	2,524,796.600	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,038,800.000	1,765,960.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	1,176,955.000	388,395.150	
		PARAGON REIT	507,300.000	474,325.500	
		PARKWAY LIFE REIT	173,200.000	665,088.000	

		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	259,900.000	197,524.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	614,900.000	316,673.500	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,040,290.000	1,414,794.400	
	シンガポール・ドル　小計		21,430,149.000	28,364,052.690 (2,874,980,381)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	162,640.000	247,212.800	
	ユーロ　小計		162,640.000	247,212.800 (36,453,999)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	678,000.000	4,339,200.000	
	香港・ドル　小計		678,000.000	4,339,200.000 (74,417,280)	
投資信託受益証券　合計			39,357,611	8,400,356,945 (8,400,356,945)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	44,351.000	587,207.240	
		AGREE REALTY CORP	40,487.000	2,728,823.800	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	33,832.000	625,892.000	
		ALEXANDER'S INC.	1,021.000	175,234.230	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	71,656.000	8,762,095.680	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,698.000	73,382.760	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	23,022.000	436,036.680	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	139,455.000	4,936,707.000	
		AMERICOLD REALTY TRUST	123,293.000	3,807,287.840	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	67,944.000	2,439,189.600	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	71,020.000	606,510.800	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	97,974.000	1,543,090.500	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	29,672.000	341,821.440	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	50,072.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	63,668.000	11,469,790.200	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,188.000	20,801.880	
		BOSTON PROPERTIES INC	65,276.000	3,303,618.360	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	92,319.810	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	81,948.000	309,763.440	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	137,121.000	2,838,404.700	
		BROADSTONE NET LEASE INC	79,827.000	1,298,785.290	
		BRT APARTMENTS CORP	4,568.000	77,610.320	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	50,056.000	5,535,693.040	

CARETRUST REIT INC	46,148.000	928,959.240	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	11,835.000	269,246.250	
CENTERSPACE	6,622.000	402,551.380	
CHATHAM LODGING TRUST	22,868.000	228,908.680	
CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	80,985.700	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	27,413.540	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10,321.000	370,730.320	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	51,897.000	1,246,046.970	
COUSINS PROPERTIES INC	69,803.000	1,445,620.130	
CTO REALTY GROUTH INC	9,356.000	151,941.440	
CUBESMART	102,022.000	4,712,396.180	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	97,287.000	817,210.800	
DIGITAL REALTY TRUST INC	130,870.000	12,939,116.900	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	101,192.000	89,150.150	
DOUGLAS EMMETT INC	81,363.000	935,674.500	
EAST GROUP	19,936.000	3,426,001.600	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	42,482.000	596,022.460	
ELME COMMUNITIES	40,732.000	675,336.560	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	62,501.000	360,005.760	
EPR PROPERTIES	33,842.000	1,424,409.780	
EQUINIX INC	42,149.000	31,623,973.210	
EQUITY COMMONWEALTH	50,687.000	1,043,138.460	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	79,512.000	5,520,518.160	
EQUITY RESIDENTIAL	154,969.000	9,708,807.850	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	64,303.000	1,609,504.090	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	29,373.000	6,367,185.210	
EXTRA SPACE STORAGE INC	60,934.000	9,554,451.200	
FARMLAND PARTNERS INC	20,969.000	224,158.610	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	33,495.000	3,094,938.000	
FIRST INDUSTRIAL RT	60,438.000	3,283,596.540	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	38,805.000	1,008,153.900	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	53,550.000	75,505.500	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	117,063.000	5,945,629.770	
GETTY REALTY CORP	19,806.000	680,930.280	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16,720.000	188,100.000	

GLADSTONE LAND CORP	15,596.000	237,059.200	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,422.000	237,269.560	
GLOBAL NET LEASE INC	48,468.000	527,816.520	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	174,134.000	3,430,439.800	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	248,475.000	5,237,853.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,525.000	82,232.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	48,618.000	1,053,552.060	
HOST HOTELS & RESORTS INC	324,992.000	5,628,861.440	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,059.000	286,977.300	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	101,147.000	1,735,682.520	
INDUS REALTY TRUST INC	2,103.000	140,185.980	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	52,686.760	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	12,947.000	933,867.110	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	31,373.000	693,343.300	
INVITATION HOMES INC	264,257.000	9,111,581.360	
IRON MOUNTAIN INC	132,214.000	7,381,507.620	
JBG SMITH PROPERTIES	46,113.000	697,228.560	
KILROY REALTY CORP	48,516.000	1,382,706.000	
KIMCO REALTY	281,047.000	5,095,382.110	
KITE REALTY GROUP TRUST	99,730.000	2,055,435.300	
LIFE STORAGE INC	38,627.000	5,333,229.890	
LTC PROPERTIES INC	18,900.000	637,875.000	
LXP INDUSTRIAL TRUST	127,205.000	1,256,785.400	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	271,247.000	2,286,612.210	
MID AMERICA	52,527.000	7,977,800.760	
NATIONAL HEALTH INVS INC	20,079.000	1,070,210.700	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	38,889.000	1,489,837.590	
NETSTREIT CORP	24,197.000	438,933.580	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	14,638.000	143,306.020	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10,016.000	421,773.760	
NNN REIT INC	83,046.000	3,681,429.180	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	146,243.520	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	106,244.000	3,114,011.640	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,132.000	162,883.960	
ORION OFFICE REIT INC	28,112.000	170,077.600	

PARAMOUNT GROUP INC		78,702.000	354,946.020	
PARK HOTELS & RESORTS INC		101,322.000	1,351,635.480	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		59,690.000	869,683.300	
PHILLIPS EDISON & CO INC		53,873.000	1,603,799.210	
PHYSICIANS REALTY TRUST		105,110.000	1,516,737.300	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC		58,595.000	384,969.150	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		17,079.000	368,223.240	
POSTAL REALTY TRUST INC		7,309.000	110,658.260	
PROLOGIS INC		420,520.000	53,860,201.600	
PUBLIC STORAGE		71,983.000	21,595,619.830	
REALTY INCOME CORP		285,553.000	17,809,940.610	
REGENCY CENTERS CORP		69,936.000	4,125,524.640	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP		55,617.000	702,998.880	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC		85,918.000	4,911,072.880	
RLJ LODGING TRUST		75,291.000	821,424.810	
RPT REALTY		40,594.000	366,563.820	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		24,982.000	2,411,012.820	
SABRA HEALTH CARE REIT INC		106,654.000	1,225,454.460	
SAFEHOLD INC		17,782.000	494,161.780	
SAUL CENTERS INC		5,447.000	185,089.060	
SERVICE PROPERTIES TRUST		76,925.000	626,169.500	
SIMON PROPERTY GROUP INC		148,850.000	15,856,990.500	
SITE CENTERS CORP		84,851.000	998,696.270	
SL GREEN		29,972.000	643,199.120	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		63,792.000	2,466,198.720	
STAG INDUSTRIAL INC		81,926.000	2,906,734.480	
STAR HOLDINGS		5,322.000	88,930.620	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC		50,883.000	352,619.190	
SUN COMMUNITIES INC		56,348.000	7,671,780.200	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		97,453.000	1,022,281.970	
TANGER FACTORY OUTLET		48,332.000	927,491.080	
TERRENO REALTY CORP		33,508.000	2,097,935.880	
THE MACERICH COMPANY		99,539.000	966,523.690	
THE NECESSITY RETAIL REIT INC		63,796.000	324,083.680	
UDR INC		140,569.000	5,785,820.040	
UMH PROPERTIES INC		23,551.000	376,109.470	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME		6,151.000	277,041.040	

	URBAN EDGE PROPERTIES	52,509.000	754,029.240	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	14,046.000	238,079.700	
	VENTAS INC	181,965.000	8,559,633.600	
	VERIS RESIDENTIAL INC	35,212.000	578,885.280	
	VICI PROPERTIES INC	456,926.000	14,872,941.300	
	VORNADO REALTY TRUST	74,428.000	1,008,499.400	
	WELLTOWER INC	215,130.000	17,077,019.400	
	WHITESTONE REIT	19,598.000	167,954.860	
	WP CAREY INC	95,778.000	6,953,482.800	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	53,054.000	677,499.580	
アメリカ・ドル　小計		9,998,360.000	446,795,484.200 (59,951,018,072)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	184,841.000	96,487.000	
	AEW UK REIT PLC	61,013.000	60,402.870	
	ASSURA PLC	1,374,116.000	695,302.690	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,463.000	307,690.410	
	BIG YELLOW GROUP PLC	78,821.000	923,782.120	
	BRITISH LAND CO PLC	424,521.000	1,637,377.490	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	293,773.000	234,724.620	
	CLS HOLDINGS PLC	83,611.000	108,861.520	
	CUSTODIAN REIT PLC	190,248.000	179,213.610	
	DERWENT LONDON PLC	51,714.000	1,182,182.040	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	103,977.000	65,297.550	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	288,036.000	260,384.540	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	118,068.000	600,966.120	
	HAMMERSON PLC	1,871,151.000	475,272.350	
	HOME REIT PLC	286,621.000	108,915.980	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	185,316.000	180,868.410	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	343,472.000	2,186,542.750	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	441,765.000	828,751.140	
	LXI REIT PLC	793,782.000	813,626.550	
	NEWRIVER REIT PLC	148,157.000	123,118.460	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	248,473.000	184,366.960	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	621,156.000	652,213.800	
	PRS REIT PLC/THE	249,964.000	212,219.430	
	REGIONAL REIT LTD	180,491.000	97,826.120	

	SAFESTORE HOLDINGS LTD	98,983.000	934,399.520	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	256,281.000	115,326.450	
	SEGRO PLC	549,694.000	4,433,831.800	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	839,724.000	968,201.770	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	552,980.000	478,880.680	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	153,569.000	85,077.220	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	844,097.000	1,247,575.360	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	413,475.000	219,968.700	
	UNITE GROUP PLC	182,717.000	1,686,477.910	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	224,112.000	302,551.200	
	WAREHOUSE REIT PLC	184,359.000	190,258.480	
	WORKSPACE GROUP PLC	60,495.000	285,173.430	
イギリス・ポンド　小計		13,593,076.000	23,164,117.050 (3,927,476,046)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314,331.000	502,929.600	
	REIT 1 LTD	93,057.000	1,554,051.900	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	92,361.000	709,055.390	
イスラエル・シュケル　小計		499,749.000	2,766,036.890 (101,795,136)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	28,626.000	656,680.440	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,568.000	167,062.400	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,337.000	94,374.840	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,320.000	631,068.000	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,768.000	115,529.760	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	50,278.980	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	37,432.000	1,841,654.400	
	CHOICE PROPERTIES REIT	72,055.000	1,021,739.900	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	24,830.000	376,671.100	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25,268.000	390,390.600	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	58,733.000	822,262.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	11,617.000	169,375.860	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,876.000	57,918.240	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	46,831.000	703,869.930	

	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,520.000	1,169,295.600	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	58,204.000	664,689.680	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	16,157.640	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	32,999.000	446,806.460	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,983.000	443,448.250	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,341.000	139,928.180	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,705.000	147,723.850	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	137,322.500	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	56,019.000	441,989.910	
	PRIMARIS REIT	21,998.000	281,574.400	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,769.000	86,887.190	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	66,005.000	1,340,561.550	
	SLATE GROCERY REIT	12,066.000	157,823.280	
	SLATE OFFICE REIT	17,818.000	36,348.720	
	SMARTCENTRES REIT	33,054.000	848,826.720	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	21,434.000	55,728.400	
カナダ・ドル　小計		800,697.000	13,513,988.780 (1,356,669,334)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	376,442.000	419,732.830	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	476,422.000	1,029,071.520	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	741,522.000	674,785.020	
	PRECINCT PROPERTIES	610,508.000	757,029.920	
	STRIDE STAPLED GROUP	256,569.000	330,974.010	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	209,563.000	492,473.050	
ニュージーランド・ドル　小計		2,671,026.000	3,704,066.350 (316,993,998)	
ユーロ	AEDIFICA	18,077.000	1,313,294.050	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3,939.000	22,137.180	
	ALTAREA	2,245.000	264,461.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	16,012.000	216,802.480	
	CARMILA SA	26,256.000	387,013.440	
	COFINIMMO SA	13,780.000	1,163,032.000	
	COVIVIO	21,431.000	1,043,689.700	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	19,954.000	417,437.680	
	GECINA SA	24,656.000	2,402,727.200	

	HAMBORNER REIT AG	32,393.000	226,751.000	
	ICADE	14,462.000	580,215.440	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	53,545.770	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	136,792.000	763,299.360	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	12,613.000	203,826.080	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	198,163.000	200,144.630	
	KLEPIERRE	89,049.000	1,946,611.140	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	26,318.000	128,695.020	
	MERCIALYS	35,663.000	283,699.160	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	151,085.000	1,135,403.770	
	MONTEA SCA	6,234.000	483,135.000	
	NSI NV	7,741.000	157,916.400	
	RETAIL ESTATES	5,130.000	338,580.000	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	48,401.000	2,216,765.800	
	VASTNED RETAIL	7,975.000	162,291.250	
	WAREHOUSES DE PAUW	70,740.000	1,847,728.800	
	WERELDHAVE NV	19,295.000	259,324.800	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	11,051.000	316,058.600	
ユーロ　小計		1,040,010.000	18,534,586.750 (2,733,110,162)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	26,101.000	87,829,865.000	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	11,135.000	57,233,900.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	77,740.000	302,019,900.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	18,354.000	86,355,570.000	
	JR REIT XXVII	66,386.000	289,111,030.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,530.000	110,451,400.000	
	LOTTE REIT CO LTD	55,954.000	210,107,270.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	39,353.000	159,773,180.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	20,887.000	74,775,460.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	29,807.000	169,005,690.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9,851.000	34,527,755.000	
	SK REITS CO LTD	31,791.000	160,226,640.000	
韓国・ウォン　小計		407,889.000	1,741,417,660.000 (177,624,601)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	896,070.000	2,876,384.700	
	LINK REIT	1,150,220.000	57,798,555.000	
	PROSPERITY REIT	538,000.000	1,049,100.000	

		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	445,000.000	1,401,750.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,103,000.000	2,183,940.000	
	香港・ドル　小計		4,132,290.000	65,309,729.700 (1,120,061,864)	
投資証券　合計			33,143,097	69,684,749,213 (69,684,749,213)	
合計				78,085,106,158 (78,085,106,158)	

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

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券	5銘柄	0.06	－	76.84
	投資証券	140銘柄	－	76.49	
イギリス・ポンド	投資証券	37銘柄	－	5.01	5.03
イスラエル・シュケル	投資証券	3銘柄	－	0.13	0.13
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	31銘柄	6.85	－	6.87
カナダ・ドル	投資証券	30銘柄	－	1.73	1.74
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	25銘柄	3.67	－	3.68
ニュージーランド・ドル	投資証券	6銘柄	－	0.40	0.41
ユーロ	投資信託受益証券	1銘柄	0.05	－	3.55
	投資証券	27銘柄	－	3.49	
韓国・ウォン	投資証券	12銘柄	－	0.23	0.23
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.09	－	1.53
	投資証券	5銘柄	－	1.43	

（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5月31日現在

Ⅰ　資産総額	440,113,986円
Ⅱ　負債総額	247,333円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	439,866,653円
Ⅳ　発行済数量	326,693,668口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3464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5月31日現在

Ⅰ　資産総額	435,144,827,444円
Ⅱ　負債総額	546,209,184円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	434,598,618,260円
Ⅳ　発行済数量	118,370,573,385口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.6715円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	976,911,044,858円
Ⅱ　負債総額	98,469,022円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	976,812,575,836円
Ⅳ　発行済数量	147,178,005,581口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	6.6369円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	607,698,207,595円
Ⅱ　負債総額	12,240,570,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	595,457,637,595円
Ⅳ　発行済数量	470,050,368,996口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2668円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	218,957,683,946円
Ⅱ　負債総額	764,402,193円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	218,193,281,753円
Ⅳ　発行済数量	102,929,260,908口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1198円

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	207,363,978,659円
Ⅱ　負債総額	709,198,870円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	206,654,779,789円
Ⅳ　発行済数量	87,020,816,926口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3748円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	**77,908,429,860円**
Ⅱ　負債総額	**224,461,950円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**77,683,967,910円**
Ⅳ　発行済数量	**47,539,224,139口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.6341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5月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2023年5月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年5月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,451,770,775,342
追加型株式投資信託	793	14,811,823,510,932
単位型公社債投資信託	23	39,882,073,259
単位型株式投資信託	211	1,113,561,477,132
合計	1,053	17,417,037,836,665

３【委託会社等の経理状況】

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

2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第37期 （2022年3月31日現在）		第38期 （2023年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		31,421		33,770
金銭の信託		30,332		29,184
未収委託者報酬		17,567		16,279
未収運用受託報酬		4,348		3,307
未収投資助言報酬		309		283
未収収益		5		15
前払費用		1,167		1,129
その他		2,673		2,377
流動資産計		87,826		86,346
固定資産				
有形固定資産		1,268		1,127
建物	※1	1,109	※1	1,001
器具備品	※1	158	※1	118
リース資産		-	※1	7
無形固定資産		4,561		5,021
ソフトウエア		3,107		3,367
ソフトウエア仮勘定		1,449		1,651
電話加入権		3		2
投資その他の資産		10,153		9,768
投資有価証券		241		182
関係会社株式		5,349		5,810
長期差入保証金		1,102		775
繰延税金資産		3,092		2,895
その他		367		104
固定資産計		15,983		15,918
資産合計		103,810		102,265

（単位：百万円）

	第37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
（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	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
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	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第37期 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）		第38期 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	108,563		95,739	
運用受託報酬	16,716		16,150	
投資助言報酬	1,587		2,048	
その他営業収益	12		23	
営業収益計		126,879		113,962
営業費用				
支払手数料	45,172		41,073	
広告宣伝費	391		216	
公告費	0		0	
調査費	36,488		33,177	
調査費	10,963		12,294	
委託調査費	25,525		20,882	
委託計算費	557		548	
営業雑経費	842		733	
通信費	35		36	
印刷費	606		504	
協会費	66		69	
諸会費	26		29	
支払販売手数料	106		92	
営業費用計		83,453		75,749
一般管理費				
給料	10,377		10,484	
役員報酬	168		168	
給料・手当	8,995		9,199	
賞与	1,213		1,115	
交際費	6		17	
寄付金	15		11	
旅費交通費	40		128	
租税公課	367		330	
不動産賃借料	1,674		1,006	
退職給付費用	495		437	
固定資産減価償却費	1,389		1,388	
福利厚生費	42		47	
修繕費	0		1	
賞与引当金繰入額	1,933		1,730	
役員賞与引当金繰入額	69		48	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,901		4,074	
事務用消耗品費	45		37	
器具備品費	0		1	
諸経費	217		334	
一般管理費計		20,578		20,078
営業利益		22,848		18,135

（単位：百万円）

		第37期 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）			第38期 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	
営業外収益						
受取利息		13			10	
受取配当金	※1	559		※1	2,400	
時効成立分配金・償還金		0			0	
為替差益		7			―	
雑収入		19			10	
時効後支払損引当金戻入額		10			24	
営業外収益計			610			2,446
営業外費用						
為替差損		―			3	
金銭の信託運用損		743			1,003	
早期割増退職金		20			24	
雑損失		―			47	
営業外費用計			764			1,079
経常利益			22,694			19,502
特別利益						
固定資産売却益		0			―	
投資有価証券売却益		―			4	
特別利益計			0			4
特別損失						
固定資産除却損		5			12	
投資有価証券売却損		6			9	
ゴルフ会員権売却損		3			―	
オフィス再編費用	※2	509			―	
関係会社株式評価損		―			584	
特別損失計			525			606
税引前当期純利益			22,169			18,900
法人税、住民税及び事業税			6,085			4,881
法人税等調整額			584			197
法人税等合計			6,669			5,078
当期純利益			15,499			13,821

（３）【株主資本等変動計算書】

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

第38期（自　2022年4月1日　至　2023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	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	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	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			△12,360
当期純利益			13,821
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	1,461
当期末残高	△0	△0	79,034

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物　…　8～18年 器具備品　…　2～20年 (2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

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

（会計方針の変更）

「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。）を当事業年度の期首から適用し、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、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、（金融商品会計）注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27－３項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
建物	415	523
器具備品	966	934
リース資産	－	1

（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37期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
受取配当金	543	2,393

※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

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					

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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
2022年6月16日定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022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

2023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
2023年6月16日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19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	－

第38期（2023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	29,184	29,184	－
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	－
資産計	29,186	29,186	－

（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	－	－

第38期（2023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	33,770	－	－	－
（2）金銭の信託	29,184	－	－	－
（3）未収委託者報酬	16,279	－	－	－
（4）未収運用受託報酬	3,307	－	－	－
（5）投資有価証券				
その他有価証券(投資信託)	－	1	－	－
合計	82,540	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

第37期（2022年3月31日現在）

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。

第38期（2023年3月31日現在）

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	－	29,184	－	29,184
（2）投資有価証券	－	－	－	－
その他有価証券	－	1	－	1
資産計	－	29,186	－	29,186

（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。

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

（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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023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	239	180
関係会社株式		
非上場株式	5,349	5,810

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）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			
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			
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。

第38期（2023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			
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			
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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について584百万円（関係会社株式584百万円）減損処理を行っております。

（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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	△14	31
退職給付の支払額	△185	△191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

（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37期（2022年3月31日現在）	第38期（2023年3月31日現在）
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	△35	△44
未認識過去勤務費用	△33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	34	22
過去勤務費用の費用処理額	69	34
その他	△3	△4
確定給付制度に係る退職給付費用	398	334

（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20百万円、当事業年度において24百万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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023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%～3.56%

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97百万円、当事業年度103百万円であります。

（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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
繰延税金資産	（百万円）	（百万円）
未払事業税	156	121
未払事業所税	10	9
賞与引当金	592	529
未払法定福利費	92	94
運用受託報酬	845	390
資産除去債務	13	15
減価償却超過額（一括償却資産）	12	21
減価償却超過額	58	198
繰延資産償却超過額（税法上）	292	297
退職給付引当金	767	812
時効後支払損引当金	45	33
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	345
投資有価証券評価損	28	4
その他	2	13
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,092	2,895
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	－	－
繰延税金資産の純額	3,092	2,895

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

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
法定実効税率	－	30.62 %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	－	△3.69 %
その他	－	△0.06 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	－	26.87 %

（注）前事業年度は、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が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

	第37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	76,763百万円	68,921百万円
資産合計	76,763百万円	68,921百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	4,740百万円	3,643百万円
負債合計	4,740百万円	3,643百万円
純資産	72,022百万円	65,278百万円

（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	55,263百万円	51,451百万円
顧客関連資産	25,175百万円	20,947百万円

（2）損益計算書項目

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,429百万円	△8,039百万円
経常利益	△8,429百万円	△8,039百万円
税引前当期純利益	△8,429百万円	△8,039百万円
当期純利益	△7,015百万円	△6,744百万円
1株当たり当期純利益	△175,380円68銭	△168,617円97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	4,618百万円	4,228百万円

（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

収益の構成は次の通りです。

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬（注）	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023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。

（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。

（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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

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。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	7,474	未払手数料	1,579
	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	13,932	未払手数料	2,404

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37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19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37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
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	15,499百万円	13,821百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2022年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

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

（注）資本金の額は2022年3月末日現在

(3) 投資顧問会社

名称	イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社
資本金の額	9,557.5万円（2023年3月末日現在）
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(6)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

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

・目論見書の使用開始日

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

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

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

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

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

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

２０２３年5月２５日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　京　事　務　所

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

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２０２３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7月１４日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の２０２２年１１月１２日から２０２３年５月１１日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の２０２３年５月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。