【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11月27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】	４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞
ただし、愛称として「わたしへの贈りもの」という名称を用いる場合があります。
（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。
収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。
※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当たりに換算した基準価額で表示することがあります。）

＜基準価額の照会方法等＞
基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2023年11月28日から2024年5月24日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

②当ファンドの信託金限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 主として次のマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内株式、国内債券、先進国株式（除く日本）、先進国債券（除く日本）に投資します。

マザーファンド	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国株式（除く日本）
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国債券（除く日本）

上記マザーファンドを総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。

2 各資産クラスのベンチマークを次に掲げる基本配分比率で合成したものを当ファンドのベンチマーク（合成ベンチマーク）として定め、これに連動した投資成果をめざして運用を行います。

資産クラス	ベンチマーク	基本配分比率
国内株式	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	20%
国内債券	NOMURA-BPI総合	52%
先進国株式（除く日本）	MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）	10%
先進国債券（除く日本）	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）	15%
短期金融資産	コール・ローン（オーバーナイト物）	3%

指数の著作権等

●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。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。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、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JPXは責任を負いません。

●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。

●MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、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。

●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。

3 時価変動等により各資産クラスへの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。

4 マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。

5 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

運用プロセス

ポートフォリオ構築	ベンチマークの基本配分比率に基づき、各マザーファンドへ資金を配分します。
リバランス	時価変動等により、各資産クラスへの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合はリバランスを行います。

■分配方針

年1回の決算時(毎年2月25日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

＜商品分類＞

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉となる資産）	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」および「その他資産」のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいう。

＜属性区分＞

・属性区分表

投資対象資産（実際の組入資産）	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
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（債券、株式）資産配分固定型）） 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	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （合成ベンチマーク）

（注1）「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

（注2）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式）資産配分固定型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（債券、株式）を実質的な投資対象とし、組入比率については、固定的とする旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
その他（合成ベンチマーク）	日経２２５またはＴＯＰＩＸにあてはまらない全てのものをいう。（対象インデックスは、合成ベンチマークとする。（注1））

（注1）対象インデックスについては、上記　1ファンドの性格　(1)ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞をご参照ください。

（注2）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

（注3）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

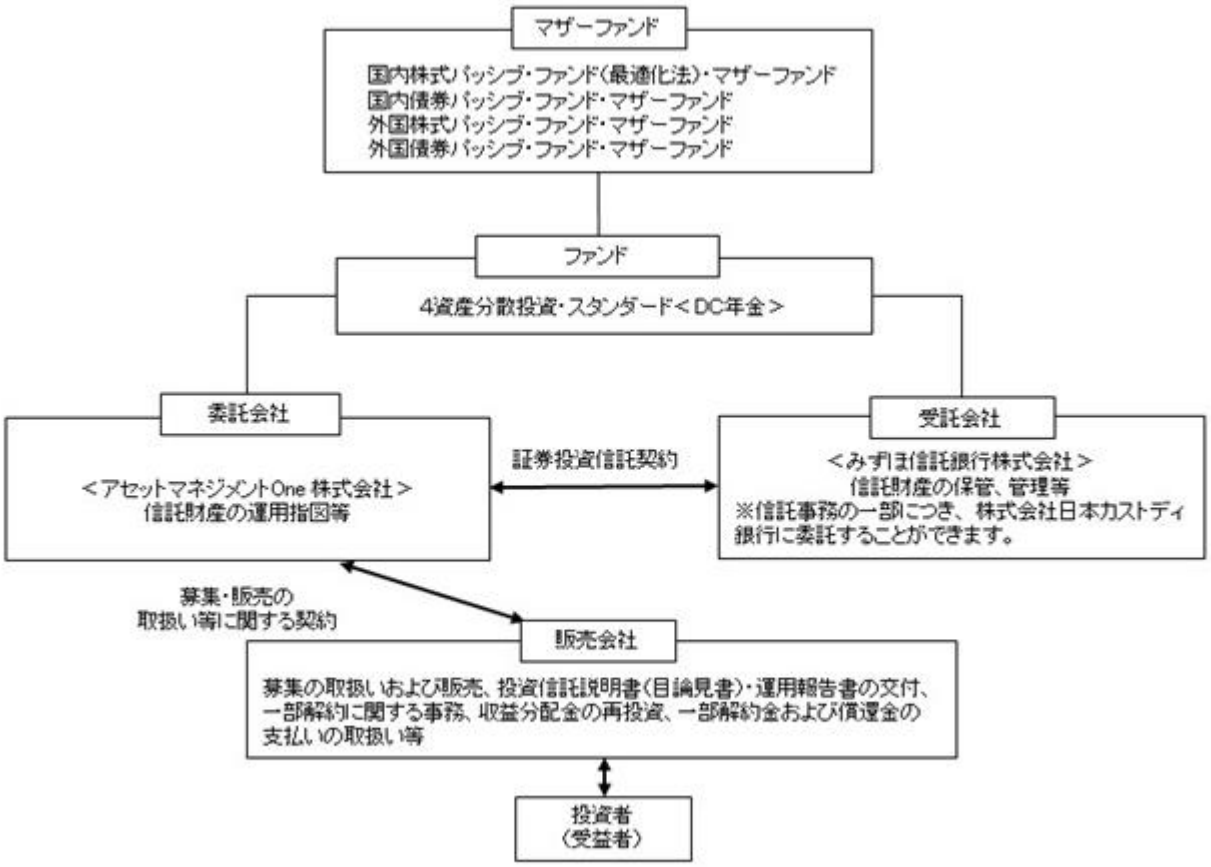
（注4）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、債券、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（２）【ファンドの沿革】

2018年2月28日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2019年5月25日　　信託報酬率（税抜）を「年率0.16%」から「年率0.14%」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

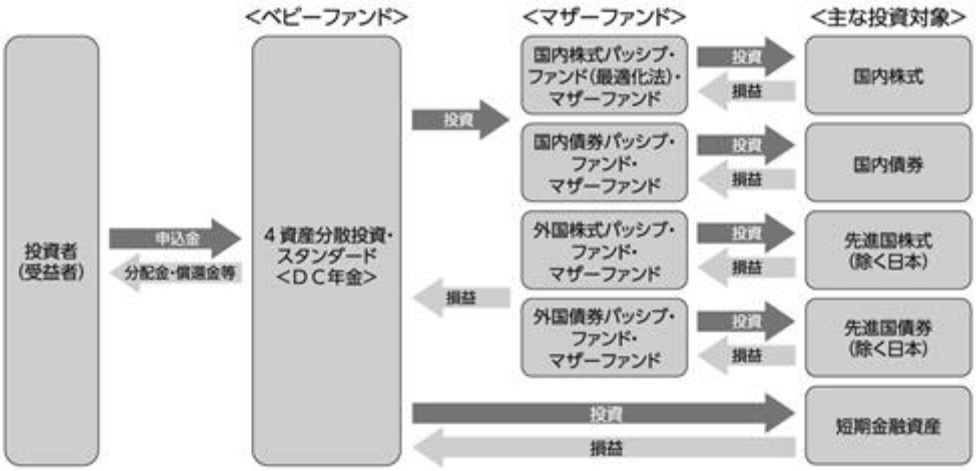
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。
当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。
当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

●ファミリーファンド方式とは●

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



○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8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8月31日現在）

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券および短期金融資産を主要投資対象とします。

＜投資態度＞

①この投資信託は、主として次のマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内株式、国内債券、先進国株式（除く日本）、先進国債券（除く日本）に投資します。

マザーファンド	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国株式（除く日本）
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国債券（除く日本）

上記マザーファンドを総称して「マザーファンド」ということがあります。

②各資産クラスのベンチマークを次に掲げる基本配分比率で合成したものを当ファンドのベンチマークとして定め、これに連動した投資成果をめざして運用を行います。

資産クラス	ベンチマーク	基本配分比率
国内株式	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	20%
国内債券	NOMURA-BPI総合	52%
先進国株式（除く日本）	MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）	10%
先進国債券（除く日本）	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）	15%
短期金融資産	コール・ローン（オーバーナイト物）	3%

③時価変動等により各資産クラスへの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。

④マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。
⑤実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
⑥ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

■対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項
ファンドは合成ベンチマークに連動させるため、時価変動等により各資産クラスへの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。
なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針（2)投資対象 （参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要をご参照ください。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）
この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
1.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）
イ.有価証券
ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)
ハ.金銭債権
ニ.約束手形
2.次に掲げる特定資産以外の資産
イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）
委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託である国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券を含む次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。
1．株券または新株引受権証書
2．国債証券
3．地方債証券
4．特別の法律により法人の発行する債券
5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10.コマーシャル・ペーパー
11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～11.の証券または証書の性質を有するもの
13.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14.投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。）
15.投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
16.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
17.オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
18.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
19.外国法人が発行する譲渡性預金証書
20.指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21.抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23.外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

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

4．手形割引市場において売買される手形

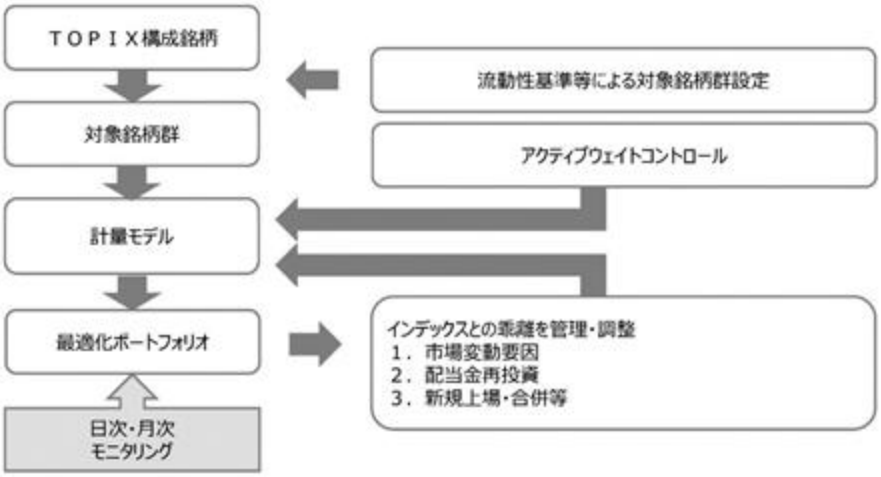
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

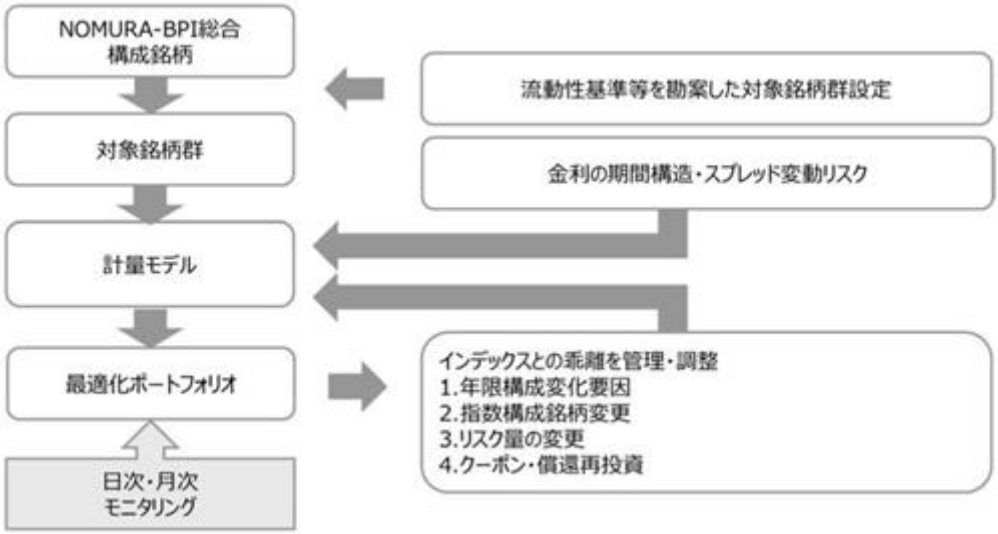
（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

投資態度	1.主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 ※①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。 ②ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。 ⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

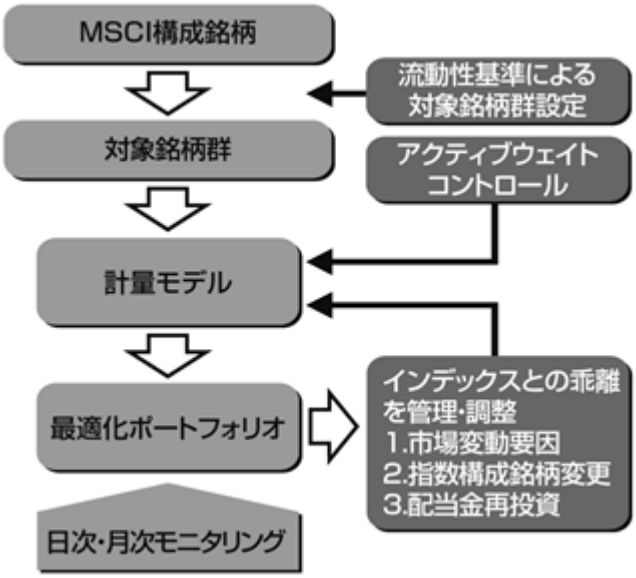
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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

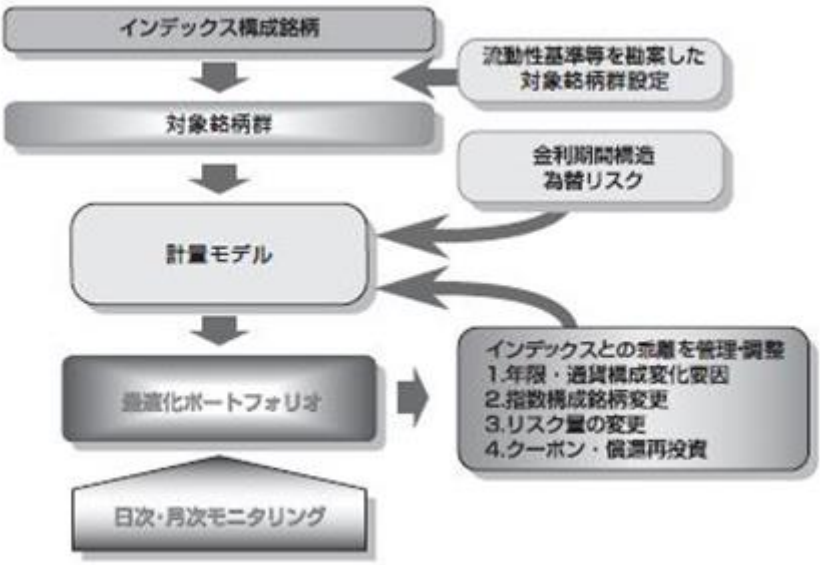
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

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

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

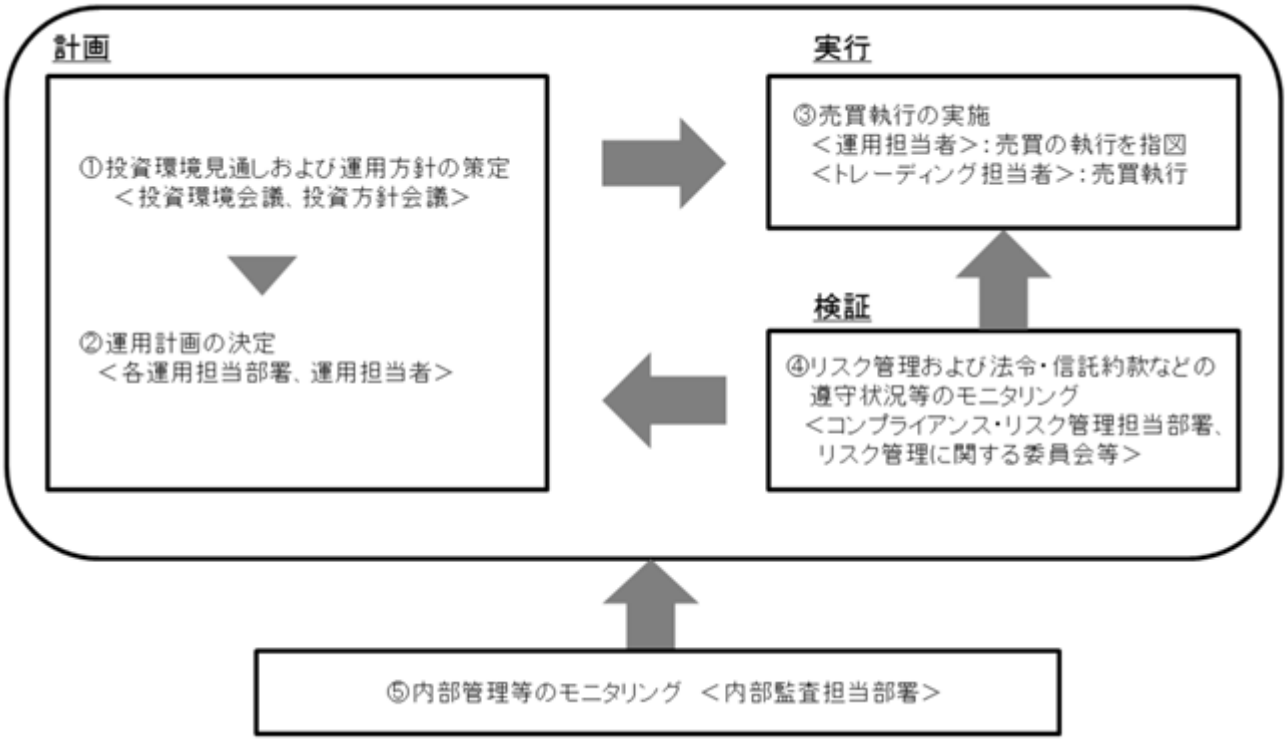
運用プロセス	**1.流動性基準等による対象銘柄群設定** **FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。** **2.最適化法によるポートフォリオの構築** **金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。** **3.インデックスとの乖離を管理** **日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。** **インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。** **・年限・通貨構成変化要因** **・指数構成銘柄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

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

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8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。
※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年2月25日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

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

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

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

②収益の分配方式

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

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

委託会社は受託会社から交付を受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（５）【投資制限】

①株式への実質投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

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

③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)

④デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

⑤一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)

⑥投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑦信用取引の指図範囲（約款第22条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

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

⑧先物取引等の運用指図（約款第23条）

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

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

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

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑧で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

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

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑧で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用

の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑧で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑨スワップ取引の運用指図（約款第24条）

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

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

3)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

⑩金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）

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

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

3)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同

じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

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

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

⑪デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条）

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

⑫有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

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

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

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

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

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

⑬公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

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

2)上記1)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。

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

⑭公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

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

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

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

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑮特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30条）

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

⑯外国為替予約取引の指図（約款第31条）

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

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

ち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

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

⑰資金の借入れ（約款第37条）

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

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

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑱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。

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

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも基準価額が下落する可能性があります。

○信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

○流動性リスク

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

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

○当ファンドは、各マザーファンドへの投資を通じて合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いますが、各マザーファンドがベンチマーク採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流出入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成ベンチマークが乖離する場合があります。

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

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

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

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

○当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、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、実質的に債券、株式などの値動きのある有価証券（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、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。**

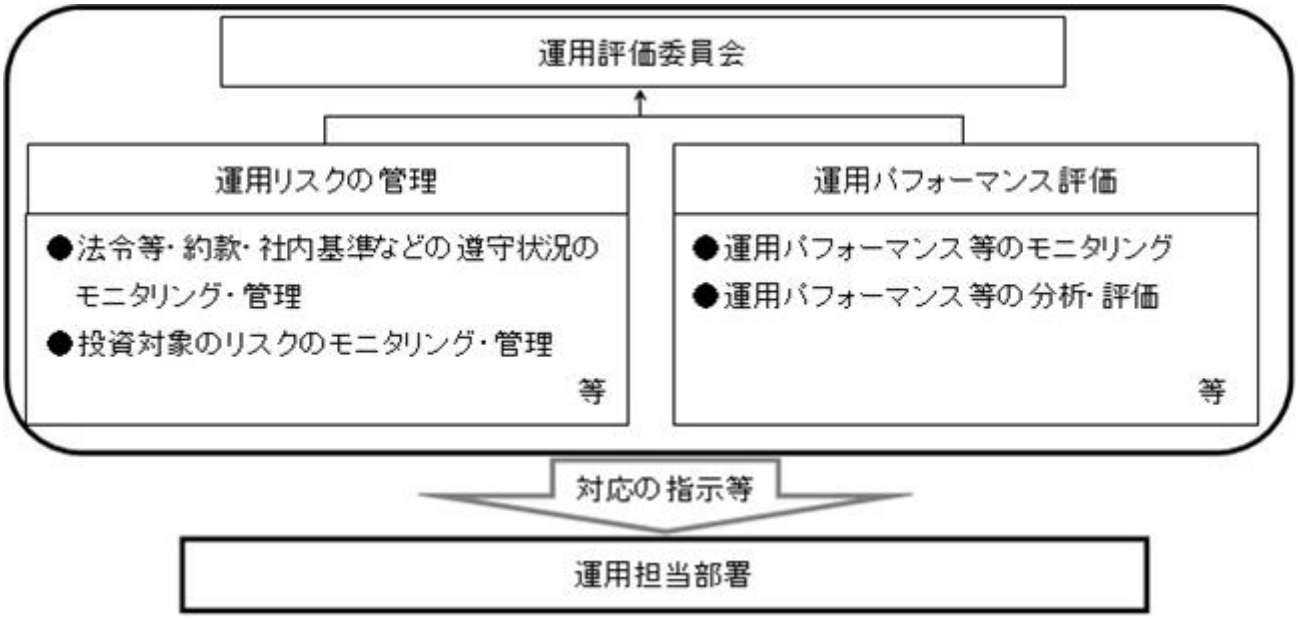
＜リスク管理体制＞

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。

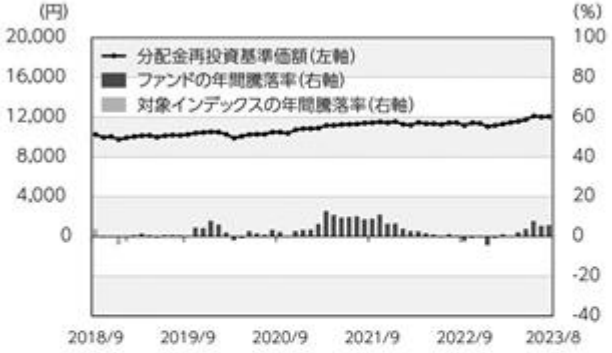


・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

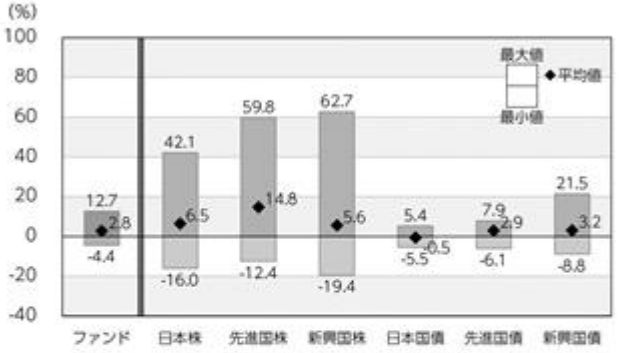
※リスク管理体制は2023年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年9月～2023年8月(2018年9月～2019年1月は対象インデックスのデータ)
代表的な資産クラス:2018年9月～2023年8月

＊ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
＊ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
＊ファンドの年間騰落率がない期間については、連動する投資成果を目指す対象インデックスの年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。
＊対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
＊ファンドの対象インデックスは当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチマークを基本配分比率で委託会社が合成したものです。対象インデックス(合成ベンチマーク)については、ファンドの特色をご参照ください。

＊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。
＊ファンドの年間騰落率がない期間については、ファンドの年間騰落率に代えて対象インデックスの年間騰落率を用いて算出・表示していますので、ファンドの実績ではありません。
＊対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
＊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0.154%（税抜0.14%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.06%	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0.06%	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0.02%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

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

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

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

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

※上記の「その他の費用」については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。
※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

②解約時および償還時

解約時および償還時の差益（譲渡益）※については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。
原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。
※解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。）を控除した利益。
買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

○法人の受益者に対する課税

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

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

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

※上記は、2023年8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
0.16%	0.15%	0.01%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2022年2月26日～2023年2月27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8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		9,556,986,061	97.02
	内　日本	9,556,986,061	97.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		293,831,434	2.98
純資産総額		9,850,817,495	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8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		436,095,303,110	97.45
	内　日本	436,095,303,110	97.45
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,410,340,250	2.55
純資産総額		447,505,643,360	100.00

その他資産の投資状況

2023年8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）		11,535,975,000	2.58
	内　日本	11,535,975,000	2.58

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		477,509,514,300	82.09
	内　日本	477,509,514,300	82.09
地方債証券		30,672,499,557	5.27
	内　日本	30,672,499,557	5.27
特殊債券		29,091,672,272	5.00
	内　日本	29,091,672,272	5.00
社債券		24,999,395,750	4.30
	内　日本	24,405,508,750	4.20
	内　フランス	593,887,000	0.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		19,385,774,465	3.33
純資産総額		581,658,856,344	100.00

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）

株式		1,099,770,181,743	95.14
	内　アメリカ	785,705,271,078	67.97
	内　イギリス	45,224,507,968	3.91
	内　カナダ	38,171,202,386	3.30
	内　フランス	36,679,564,390	3.17
	内　スイス	36,148,825,964	3.13
	内　ドイツ	27,300,928,299	2.36
	内　オーストラリア	21,748,426,559	1.88
	内　オランダ	21,241,008,115	1.84
	内　アイルランド	21,060,112,727	1.82
	内　デンマーク	10,635,822,057	0.92
	内　スウェーデン	9,315,731,228	0.81
	内　スペイン	8,250,380,880	0.71
	内　イタリア	6,151,209,749	0.53
	内　香港	5,769,347,427	0.50
	内　ジャージィー	3,802,962,169	0.33
	内　シンガポール	3,554,084,323	0.31
	内　フィンランド	3,540,097,044	0.31
	内　ベルギー	2,447,237,058	0.21
	内　ノルウェー	2,152,948,118	0.19
	内　イスラエル	2,094,110,603	0.18
	内　バミューダ	1,761,833,067	0.15
	内　オランダ領キュラソー	1,737,356,881	0.15
	内　ケイマン諸島	1,657,098,419	0.14
	内　ニュージーランド	811,003,433	0.07
	内　オーストリア	613,404,067	0.05
	内　ルクセンブルグ	593,267,616	0.05
	内　ポルトガル	587,851,604	0.05
	内　リベリア	460,465,236	0.04
	内　パナマ	344,335,351	0.03
	内　マン島	209,787,927	0.02
投資信託受益証券		1,791,716,990	0.16
	内　オーストラリア	1,342,378,842	0.12
	内　シンガポール	449,338,148	0.04
投資証券		20,972,521,663	1.81
	内　アメリカ	19,692,708,049	1.70
	内　イギリス	441,203,465	0.04
	内　フランス	419,247,964	0.04
	内　香港	257,529,155	0.02
	内　ベルギー	85,011,607	0.01
	内　カナダ	76,821,423	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		33,399,473,246	2.89
純資産総額		1,155,933,893,642	100.00

その他資産の投資状況

2023年8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）		33,892,455,803	2.93
	内　アメリカ	25,234,140,102	2.18
	内　ドイツ	5,387,779,627	0.47

	内　イギリス	1,433,399,294	0.12
	内　カナダ	1,131,928,560	0.10
	内　オーストラリア	705,208,220	0.06

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		242,721,198,587	98.86
	内　アメリカ	117,972,840,118	48.05
	内　フランス	20,315,287,987	8.27
	内　イタリア	18,616,485,688	7.58
	内　ドイツ	16,100,463,491	6.56
	内　中国	14,695,201,792	5.99
	内　イギリス	12,125,632,460	4.94
	内　スペイン	12,082,417,340	4.92
	内　カナダ	4,867,993,708	1.98
	内　ベルギー	4,468,472,520	1.82
	内　オランダ	3,625,348,572	1.48
	内　オーストラリア	3,568,359,754	1.45
	内　オーストリア	2,950,239,201	1.20
	内　メキシコ	2,429,628,356	0.99
	内　アイルランド	1,427,067,882	0.58
	内　フィンランド	1,272,322,887	0.52
	内　マレーシア	1,191,143,323	0.49
	内　ポーランド	1,186,629,146	0.48
	内　シンガポール	1,039,409,614	0.42
	内　デンマーク	767,343,344	0.31
	内　イスラエル	694,462,458	0.28
	内　ニュージーランド	504,177,710	0.21
	内　スウェーデン	458,083,751	0.19
	内　ノルウェー	362,187,485	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,787,176,732	1.14
純資産総額		245,508,375,319	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8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,099,233,044	1.2439 5,099,432,565	1.2415 5,089,197,824	－ －	51.66

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	497,019,935	3.4000 1,689,884,294	4.0253 2,000,654,344	－ －	20.31
3	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	663,133,438	2.0257 1,343,360,772	2.2157 1,469,304,758	－ －	14.92
4	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	134,921,999	6.1569 830,711,722	7.3956 997,829,135	－ －	10.13

（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8月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.02
合計	97.02

（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8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	7,222,400	1,896.32 13,695,991,310	2,515.00 18,164,336,000	－ －	4.06
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	930,400	12,038.97 11,201,060,660	12,145.00 11,299,708,000	－ －	2.53
3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,113,000	933.17 7,570,847,895	1,163.50 9,439,475,500	－ －	2.11
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	131,600	61,162.40 8,048,972,935	60,520.00 7,964,432,000	－ －	1.78
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	42,258,400	154.78 6,540,902,793	168.30 7,112,088,720	－ －	1.59
6	日立製作所 日本	株式 電気機器	646,000	7,057.14 4,558,915,453	9,694.00 6,262,324,000	－ －	1.40
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	920,700	5,622.33 5,176,482,141	6,681.00 6,151,196,700	－ －	1.37
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	848,500	4,625.78 3,924,975,200	7,196.00 6,105,806,000	－ －	1.36
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	278,400	15,624.81 4,349,947,981	21,575.00 6,006,480,000	－ －	1.34
10	三井物産 日本	株式 卸売業	987,600	3,933.85 3,885,074,565	5,432.00 5,364,643,200	－ －	1.20

11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,167,500	4,197.71 4,900,832,073	4,508.00 5,263,090,000	－ －	1.18
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,001,000	4,273.35 4,277,626,981	5,220.00 5,225,220,000	－ －	1.17
13	任天堂 日本	株式 その他製品	830,400	5,598.37 4,648,893,560	6,267.00 5,204,116,800	－ －	1.16
14	信越化学工業 日本	株式 化学	1,095,200	3,874.40 4,243,251,807	4,659.00 5,102,536,800	－ －	1.14
15	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,069,200	3,299.16 3,527,463,119	4,703.00 5,028,447,600	－ －	1.12
16	第一三共 日本	株式 医薬品	1,149,200	4,128.00 4,743,905,686	4,299.00 4,940,410,800	－ －	1.10
17	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	857,500	4,084.33 3,502,316,239	5,472.00 4,692,240,000	－ －	1.05
18	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,873,500	2,068.05 3,874,501,363	2,410.00 4,515,135,000	－ －	1.01
19	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	278,700	14,248.46 3,971,046,437	16,155.00 4,502,398,500	－ －	1.01
20	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,019,400	3,979.10 4,056,301,084	4,325.00 4,408,905,000	－ －	0.99
21	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	650,700	6,165.49 4,011,887,771	6,545.00 4,258,831,500	－ －	0.95
22	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,280,500	2,721.16 3,484,455,422	3,227.00 4,132,173,500	－ －	0.92
23	ダイキン工業 日本	株式 機械	158,600	23,012.64 3,649,805,550	25,225.00 4,000,685,000	－ －	0.89
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	715,600	4,347.10 3,110,786,535	5,249.00 3,756,184,400	－ －	0.84
25	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,120,300	1,529.44 3,242,873,300	1,670.00 3,540,901,000	－ －	0.79
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	398,900	7,722.21 3,080,390,194	8,185.00 3,264,996,500	－ －	0.73
27	ＳＭＣ 日本	株式 機械	43,100	68,001.90 2,930,882,070	70,600.00 3,042,860,000	－ －	0.68
28	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	479,600	5,948.12 2,852,721,959	5,981.00 2,868,487,600	－ －	0.64
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,246,200	1,915.41 2,386,990,648	2,214.50 2,759,709,900	－ －	0.62
30	デンソー 日本	株式 輸送用機器	271,300	7,379.40 2,002,032,144	9,959.00 2,701,876,700	－ －	0.60

（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8月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.45
合計	97.45

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年8月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	16.87
輸送用機器		8.14
情報・通信業		7.89
卸売業		6.66
銀行業		6.41
化学		5.82
機械		5.37
医薬品		5.00
サービス業		4.79
小売業		4.28
食料品		3.30
陸運業		2.90
精密機器		2.33
その他製品		2.22
保険業		2.20
建設業		2.05
不動産業		1.84
電気・ガス業		1.35
その他金融業		1.13
鉄鋼		0.96
証券、商品先物取引業		0.72
ゴム製品		0.67
ガラス・土石製品		0.67
海運業		0.65
非鉄金属		0.64
金属製品		0.50
空運業		0.48
石油・石炭製品		0.45
繊維製品		0.41
鉱業		0.35
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業		0.08
合計		97.45

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8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	１４５回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	7,250,000,000	100.29 7,271,305,000	100.17 7,262,615,000	0.1 2025/9/20	1.25
2	１４６回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	7,000,000,000	100.26 7,018,227,000	100.16 7,011,200,000	0.1 2025/12/20	1.21
3	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,540,000,000	100.97 6,603,582,400	100.78 6,591,600,600	0.4 2025/9/20	1.13
4	３６６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,280,000,000	97.91 6,149,130,000	97.26 6,107,990,800	0.2 2032/3/20	1.05
5	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,060,000,000	99.65 6,039,349,000	99.61 6,036,729,600	0.1 2028/3/20	1.04
6	１５４回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,800,000,000	100.01 5,801,088,000	99.83 5,790,604,000	0.1 2027/9/20	1.00
7	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,690,000,000	100.15 5,699,054,000	100.04 5,692,788,100	0.1 2026/12/20	0.98
8	３６３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,770,000,000	97.40 5,620,264,000	97.14 5,605,093,400	0.1 2031/6/20	0.96
9	３６９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,620,000,000	100.42 5,643,998,000	99.20 5,575,377,200	0.5 2032/12/20	0.96
10	３６７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,700,000,000	98.18 5,596,279,000	97.02 5,530,197,000	0.2 2032/6/20	0.95
11	３６５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,630,000,000	97.01 5,461,703,000	96.65 5,441,789,100	0.1 2031/12/20	0.94
12	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,390,000,000	100.02 5,391,612,000	99.90 5,384,879,500	0.1 2027/6/20	0.93
13	３６４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,550,000,000	97.34 5,402,654,000	96.90 5,378,116,500	0.1 2031/9/20	0.92
14	３６１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,500,000,000	97.84 5,381,218,000	97.66 5,371,465,000	0.1 2030/12/20	0.92
15	３５５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,430,000,000	98.94 5,372,893,000	98.91 5,371,138,800	0.1 2029/6/20	0.92
16	３６８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,450,000,000	98.59 5,373,656,000	96.77 5,274,128,500	0.2 2032/9/20	0.91

17	３６２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,410,000,000	97.58 5,279,351,000	97.40 5,269,826,900	0.1 2031/3/20	0.91
18	３７０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,300,000,000	100.28 5,315,317,000	98.96 5,244,986,000	0.5 2033/3/20	0.90
19	１４８回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,210,000,000	99.96 5,208,049,000	99.84 5,201,976,600	0.005 2026/6/20	0.89
20	３５３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,190,000,000	99.59 5,168,819,000	99.21 5,149,258,500	0.1 2028/12/20	0.89
21	３５２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,150,000,000	99.49 5,123,738,000	99.35 5,116,525,000	0.1 2028/9/20	0.88
22	３４９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,050,000,000	99.80 5,040,305,000	99.74 5,037,021,500	0.1 2027/12/20	0.87
23	３５１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,990,000,000	99.52 4,966,321,000	99.47 4,963,902,300	0.1 2028/6/20	0.85
24	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,840,000,000	100.07 4,843,484,000	99.98 4,839,128,800	0.1 2027/3/20	0.83
25	３５６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,800,000,000	99.02 4,753,218,000	98.75 4,740,096,000	0.1 2029/9/20	0.81
26	１５０回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,670,000,000	99.86 4,663,575,000	99.73 4,657,671,200	0.005 2026/12/20	0.80
27	３５８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,650,000,000	98.92 4,600,214,000	98.39 4,575,553,500	0.1 2030/3/20	0.79
28	３５７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,620,000,000	98.59 4,555,278,000	98.58 4,554,396,000	0.1 2029/12/20	0.78
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	100.18 4,538,154,000	0.1 2025/6/20	0.78
30	３６０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,600,000,000	98.49 4,530,955,000	97.94 4,505,332,000	0.1 2030/9/20	0.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年8月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	82.09
地方債証券	5.27
特殊債券	5.00
社債券	4.30
合計	96.67

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8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	2,258,513	22,802.71 51,500,227,840	27,434.42 61,961,016,802	－ －	5.36
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,009,604	40,351.51 40,739,052,626	48,069.09 48,530,753,617	－ －	4.20
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小売り	1,318,242	14,822.65 19,539,846,234	19,747.23 26,031,633,242	－ －	2.25
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	352,726	35,895.13 12,661,147,943	72,023.96 25,404,726,136	－ －	2.20
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	853,094	14,213.51 12,125,462,704	19,865.65 16,947,271,939	－ －	1.47
6	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	407,428	30,662.38 12,492,715,369	37,558.77 15,302,498,617	－ －	1.32
7	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	764,161	14,139.22 10,804,646,704	20,019.16 15,297,865,909	－ －	1.32
8	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	316,258	27,424.78 8,673,307,485	43,143.61 13,644,514,973	－ －	1.18
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	185,026	45,657.92 8,447,903,370	52,786.97 9,766,962,281	－ －	0.84

10	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	133,443	71,978.32 9,605,003,880	71,861.68 9,589,438,964	－ －	0.83
11	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	580,120	16,934.97 9,824,319,862	16,210.65 9,404,125,758	－ －	0.81
12	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	115,443	51,522.33 5,947,892,652	80,116.13 9,248,847,319	－ －	0.80
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	418,322	20,824.98 8,711,548,911	21,660.99 9,061,269,495	－ －	0.78
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	231,986	33,525.81 7,777,518,731	35,998.82 8,351,223,648	－ －	0.72
15	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	343,715	23,691.82 8,143,234,579	23,937.32 8,227,618,006	－ －	0.71
16	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	59,585	90,548.99 5,395,361,669	130,451.33 7,772,942,855	－ －	0.67
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	336,826	20,578.07 6,931,229,741	22,520.64 7,585,539,783	－ －	0.66
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	121,576	54,110.62 6,578,553,237	60,513.64 7,357,006,539	－ －	0.64
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	144,828	46,142.58 6,682,738,081	48,338.10 7,000,711,215	－ －	0.61
20	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	392,550	18,478.02 7,253,548,191	17,700.15 6,948,195,295	－ －	0.60
21	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	237,058	21,661.92 5,135,133,351	27,627.59 6,549,343,600	－ －	0.57
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	257,286	25,055.29 6,446,377,498	23,418.31 6,025,204,850	－ －	0.52
23	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	362,793	15,911.01 5,772,404,265	16,112.70 5,845,575,496	－ －	0.51
24	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	57,643	99,336.69 5,726,064,852	97,614.28 5,626,780,403	－ －	0.49
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	252,153	22,337.14 5,632,379,212	21,684.38 5,467,782,478	－ －	0.47

26	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	65,606	55,850.17 3,664,106,866	79,731.63 5,230,873,448	－ －	0.45
27	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	197,057	25,857.10 5,095,324,146	26,473.89 5,216,866,524	－ －	0.45
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	586,869	8,760.68 5,141,375,883	8,840.71 5,188,340,984	－ －	0.45
29	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・アパレル・贅沢品	39,471	130,298.95 5,143,030,009	128,511.35 5,072,471,890	－ －	0.44
30	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	63,372	73,673.49 4,668,836,765	79,278.41 5,024,031,525	－ －	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8月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.14
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.81
合計	97.11

（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8月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	7.89
半導体・半導体製造装置		6.05
コンピュータ・周辺機器		5.57
医薬品		5.15
銀行		5.11
石油・ガス・消耗燃料		4.69
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.09
金融サービス		3.05
資本市場		2.97
保険		2.95
大規模小売り		2.65
ヘルスケア機器・用品		2.24
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.03
ホテル・レストラン・レジャー		2.02
自動車		1.98
バイオテクノロジー		1.89
化学		1.89
機械		1.84
飲料		1.69
生活必需品流通・小売り		1.66
航空宇宙・防衛		1.64

専門小売り	1.64
電力	1.62
食品	1.52
金属・鉱業	1.45
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.31
繊維・アパレル・贅沢品	1.28
情報技術サービス	1.27
家庭用品	1.08
娯楽	1.07
陸上運輸	1.03
専門サービス	1.00
各種電気通信サービス	0.90
コングロマリット	0.86
電気設備	0.85
メディア	0.73
総合公益事業	0.73
通信機器	0.69
パーソナルケア用品	0.62
建設関連製品	0.61
タバコ	0.57
航空貨物・物流サービス	0.54
商業サービス・用品	0.52
電子装置・機器・部品	0.49
商社・流通業	0.42
不動産管理・開発	0.34
消費者金融	0.34
エネルギー設備・サービス	0.29
建設・土木	0.29
建設資材	0.29
家庭用耐久財	0.28
無線通信サービス	0.22
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	0.13
ガス	0.11
運送インフラ	0.10
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	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.02
合計	95.14

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8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	1,315,800,000	94.46 1,242,930,996	95.48 1,256,434,801	1.5 2024/11/30	0.51
2	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,485,392,000	81.40 1,209,114,936	80.66 1,198,119,503	1.25 2031/8/15	0.49
3	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,416,678,000	81.49 1,154,498,344	81.14 1,149,584,383	1.125 2031/2/15	0.47
4	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,111,120,000	103.19 1,146,624,779	99.81 1,109,080,048	4.125 2032/11/15	0.45
5	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,385,976,000	80.44 1,114,901,316	79.93 1,107,833,355	0.875 2030/11/15	0.45
6	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,343,578,000	82.03 1,102,236,174	80.94 1,087,563,400	1.375 2031/11/15	0.44
7	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,176,910,000	92.10 1,083,941,058	90.75 1,068,091,793	2.875 2032/5/15	0.44
8	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,248,548,000	84.61 1,056,450,113	83.64 1,044,293,348	1.625 2031/5/15	0.43
9	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,146,208,000	91.93 1,053,776,060	89.63 1,027,423,241	2.75 2032/8/15	0.42
10	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	1,078,956,000	95.25 1,027,738,087	94.56 1,020,329,911	3.125 2028/11/15	0.42
11	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,210,536,000	85.39 1,033,764,022	83.93 1,016,093,655	1.875 2032/2/15	0.41
12	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,067,260,000	97.61 1,041,783,480	95.09 1,014,897,556	3.5 2033/2/15	0.41
13	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証券	991,598,850	99.64 988,087,488	100.20 993,599,400	2.26 2025/2/24	0.40
14	US T N/B 4.5 07/15/26 アメリカ	国債証券	964,920,000	99.68 961,888,358	99.75 962,583,076	4.5 2026/7/15	0.39
15	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,204,688,000	79.49 957,615,010	78.65 947,585,928	0.625 2030/8/15	0.39
16	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	1,027,786,000	91.47 940,201,033	91.58 941,307,447	1.5 2026/8/15	0.38
17	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証券	877,200,000	98.93 867,898,756	97.77 857,702,861	3.75 2026/4/15	0.35
18	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	821,324,300	101.65 834,943,199	102.27 840,047,290	3.03 2026/3/11	0.34
19	US T N/B 3.875 01/15/26 アメリカ	国債証券	847,960,000	98.44 834,791,181	98.05 831,497,653	3.875 2026/1/15	0.34
20	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証券	890,358,000	92.44 823,099,374	92.89 827,128,671	1.625 2026/2/15	0.34
21	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	881,586,000	94.17 830,261,903	93.64 825,557,072	2.875 2028/8/15	0.34
22	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証券	934,218,000	86.43 807,494,041	86.93 812,149,280	1.125 2028/2/29	0.33

23	US T N/B 2.625 05/31/27 アメリカ	国債証券	864,042,000	93.87 811,079,564	93.76 810,174,380	2.625 2027/5/31	0.33
24	US T N/B 4.25 12/31/24 アメリカ	国債証券	804,100,000	99.03 796,364,558	98.73 793,954,516	4.25 2024/12/31	0.32
25	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証券	877,200,000	90.27 791,917,376	90.37 792,769,500	0.75 2026/4/30	0.32
26	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証券	791,275,850	100.15 792,538,563	100.13 792,362,825	2.3 2026/5/15	0.32
27	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証券	875,923,200	90.34 791,357,650	90.36 791,513,984	1.5 2031/5/25	0.32
28	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	839,188,000	90.39 758,616,896	90.63 760,579,679	1.5 2027/1/31	0.31
29	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	836,264,000	90.88 759,999,682	90.69 758,484,914	0.75 2026/3/31	0.31
30	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証券	833,340,000	89.75 747,925,574	90.19 751,601,062	0.375 2026/1/31	0.31

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年8月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.86
合計	98.86

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

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8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　０５０９月	買建	495	11,309,133,350	11,535,975,000	2.58

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8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 Sep23	買建	763	25,156,144,230	25,234,140,102	2.18
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep23	買建	779	5,432,232,729	5,387,779,627	0.47
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep23	買建	103	1,437,045,773	1,433,399,294	0.12
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep23	買建	43	1,128,805,200	1,131,928,560	0.10
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep23	買建	41	701,466,780	705,208,220	0.06

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2023年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末（2019年2月25日）	196	196	1.0087	1.0087
第2計算期間末（2020年2月25日）	499	499	1.0477	1.0477
第3計算期間末（2021年2月25日）	1,485	1,485	1.1019	1.1019
第4計算期間末（2022年2月25日）	5,509	5,509	1.1163	1.1163
第5計算期間末（2023年2月27日）	8,328	8,328	1.1296	1.1296
2022年8月末日	7,555	－	1.1439	－

9月末日	7,500	－	1.1179	－
10月末日	7,735	－	1.1436	－
11月末日	7,925	－	1.1387	－
12月末日	7,779	－	1.1051	－
2023年1月末日	8,171	－	1.1193	－
2月末日	8,359	－	1.1337	－
3月末日	8,618	－	1.1475	－
4月末日	8,853	－	1.1595	－
5月末日	9,115	－	1.1771	－
6月末日	9,531	－	1.2125	－
7月末日	9,568	－	1.2043	－
8月末日	9,850	－	1.2077	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2023年2月28日～2023年8月27日	－

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	0.9
第2計算期間	3.9
第3計算期間	5.2
第4計算期間	1.3
第5計算期間	1.2
2023年2月28日～2023年8月27日	5.8

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

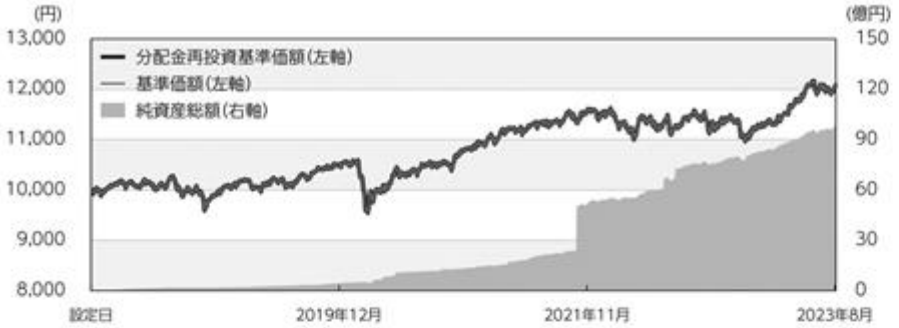
	設定口数	解約口数
第1計算期間	359,187,202	164,566,177
第2計算期間	459,829,471	178,063,350
第3計算期間	1,174,492,406	303,000,257
第4計算期間	4,094,018,074	506,064,493
第5計算期間	3,132,953,934	696,151,218
2023年2月28日～ 2023年8月27日	1,158,163,949	420,208,423

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

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2023年8月31日

基準価額・純資産の推移 《2018年2月28日～2023年8月31日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2018年2月28日)

分配の推移(税引前)

2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	51.66
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	20.31
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.92
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.13

■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	4.06
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.53
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.11
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.78
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.59

■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	145回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	1.25
2	146回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/12/20	1.21
3	340回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	1.13
4	366回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.2	2032/3/20	1.05
5	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.04

○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。
○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
○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8月31日

■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	5.36
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.20
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.25
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.20
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	1.47

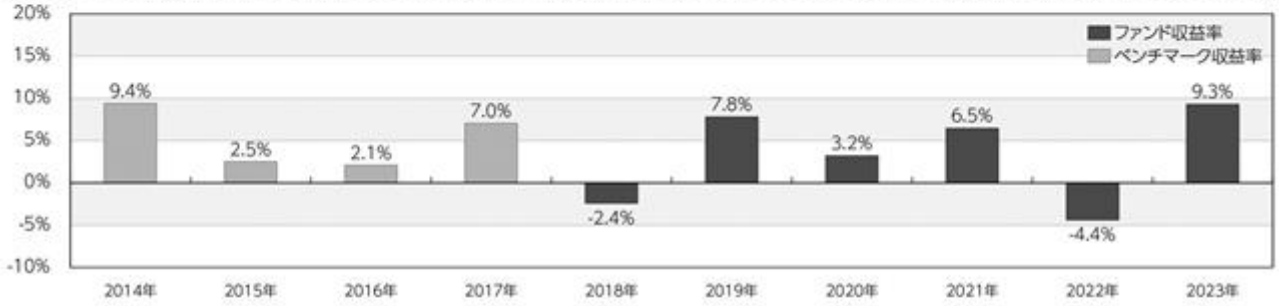
■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	0.51
2	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.49
3	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.47
4	US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	アメリカ	4.125	2032/11/15	0.45
5	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.45

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。
※2018年は設定日から年末までの収益率、および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。
※2017年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは、合成ベンチマークであり、当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチマークを基本配分比率で委託会社が合成したものです。合成ベンチマークについては、ファンドの特色をご参照ください。

○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。
○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

・お申込手数料
ありません。

・お申込単位
1円以上1円単位とします。
※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。
※当初元本は1口当たり1円です。

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

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

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

・委託会社への照会

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

・解約単位

1口単位とします。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://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、2018年2月28日から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年2月26日から翌年2月25日までとします。

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

（５）【その他】

イ.償還規定

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

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

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

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

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

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

g.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の

変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

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

ロ.信託約款の変更等

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

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

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

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

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

ニ.公告

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

（URL　https://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2月25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　https://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2022年2月26日から2023年2月27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】

【４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2022年2月25日現在	第5期 2023年2月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	185,046,892	268,207,962
親投資信託受益証券	5,343,949,613	8,078,488,743
流動資産合計	5,528,996,505	8,346,696,705
資産合計	5,528,996,505	8,346,696,705
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,349,554	12,153,411
未払受託者報酬	518,084	880,730
未払委託者報酬	3,108,784	5,284,550
その他未払費用	92,137	156,679
流動負債合計	19,068,559	18,475,370
負債合計	19,068,559	18,475,370
純資産の部		
元本等		
元本	4,935,832,876	7,372,635,592
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	574,095,070	955,585,743
（分配準備積立金）	105,620,994	177,642,647
元本等合計	5,509,927,946	8,328,221,335
純資産合計	5,509,927,946	8,328,221,335
負債純資産合計	5,528,996,505	8,346,696,705

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自　2021年2月26日 至　2022年2月25日	第5期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日
営業収益		
受取利息	376	1,774
有価証券売買等損益	△37,910,858	76,525,130
営業収益合計	△37,910,482	76,526,904
営業費用		
支払利息	23,335	87,726
受託者報酬	723,995	1,585,929
委託者報酬	4,344,453	9,515,908
その他費用	128,707	282,128
営業費用合計	5,220,490	11,471,691
営業利益又は営業損失（△）	△43,130,972	65,055,213
経常利益又は経常損失（△）	△43,130,972	65,055,213
当期純利益又は当期純損失（△）	△43,130,972	65,055,213
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（△）	10,233,229	7,413,762
期首剰余金又は期首欠損金（△）	137,329,351	574,095,070
剰余金増加額又は欠損金減少額	549,155,677	407,582,203
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	549,155,677	407,582,203
剰余金減少額又は欠損金増加額	59,025,757	83,732,981
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	59,025,757	83,732,981
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	574,095,070	955,585,743

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第5期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27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。
２．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2023年2月27日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第4期 2022年2月25日現在	第5期 2023年2月27日現在
１．　期首元本額	1,347,879,295円	4,935,832,876円
期中追加設定元本額	4,094,018,074円	3,132,953,934円
期中一部解約元本額	506,064,493円	696,151,218円
２．　受益権の総数	4,935,832,876口	7,372,635,592口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第4期 自　2021年2月26日 至　2022年2月25日	第5期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（29,915,185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（468,474,076円）及び分配準備積立金（75,705,809円）より分配対象収益は574,095,070円（1万口当たり1,163.11円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（83,162,068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（777,943,096円）及び分配準備積立金（94,480,579円）より分配対象収益は955,585,743円（1万口当たり1,296.12円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第4期 自　2021年2月26日 至　2022年2月25日	第5期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 2022年2月25日現在	第5期 2023年2月27日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期 2022年2月25日現在	第5期 2023年2月27日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	△44,854,561	65,167,141
合計	△44,854,561	65,167,141

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期 2022年2月25日現在	第5期 2023年2月27日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1163円 (11,163円)	1.1296円 (11,296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2月27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	494,603,718	1,677,794,732	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,469,765,237	4,307,366,565	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	139,305,552	858,637,630	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	610,839,468	1,234,689,816	
親投資信託受益証券　合計		4,714,513,975	8,078,488,743	
合計			8,078,488,743	

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

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

（参考）
当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・

ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年2月27日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,466,055,556
株式	390,898,786,050
派生商品評価勘定	96,150,220
未収入金	156,549,606
未収配当金	742,736,382
差入委託証拠金	155,520,000
流動資産合計	395,515,797,814
資産合計	395,515,797,814
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,659,140
前受金	80,190,000
未払解約金	440,339,000
流動負債合計	523,188,140
負債合計	523,188,140
純資産の部	
元本等	
元本	116,441,395,034
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	278,551,214,640
元本等合計	394,992,609,674
純資産合計	394,992,609,674
負債純資産合計	395,515,797,814

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2月26日 至　2023年2月27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2月27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	122,380,637,954円
同期中追加設定元本額	110,482,771,093円
同期中一部解約元本額	116,422,014,013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	2,637,145,530円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,048,839,745円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	25,050,819,507円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	4,940,713,146円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,060,345円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	14,114,902円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	36,812,387円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,981,436円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	24,853,218円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	29,803,929円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,689,874,643円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,491,149,688円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	51,762,845円
たわらノーロード　バランス（標準型）	347,914,526円
たわらノーロード　バランス（積極型）	553,873,164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）	2,943,781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）	173,543,623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）	436,614,794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）	334,963,435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）	448,869,501円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	400,014円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,769,403円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	33,090,409円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,283,694円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,815,951円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,490,852,375円
Ｏｎｅグローバルバランス	11,689,222円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,050,195,798円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,599,108,369円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,970,762,190円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	336,701,182円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,066,436,883円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,123,667,446円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	31,667,873円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,158,418,676円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	15,484,653円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	303,973,289円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	356,000,978円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	576,024,312円
投資のソムリエ	6,962,375,127円
クルーズコントロール	371,076,985円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	512,324,687円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	369,360,628円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	898,886,587円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	690,449,672円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,925,993,896円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	57,858,403円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	29,095,833円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,863,218円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	100,473,455円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	494,603,718円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	627,304,316円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	272,151,457円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	42,963,704円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	31,180,825円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	19,176,919円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	379,405,031円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,139,504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）	51,522,010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）	52,747,897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）	33,604,488円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	32,227,059円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	50,905,203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）	128,294,014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）	194,219,300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）	45,940,817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）	198,034,533円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	500,445,383円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	188,318,998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）	29,898,154円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,231,613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）	230,704,117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）	87,755,319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）	3,665,294円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	7,940,239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）	45,069,688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）	88,905,582円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,048,821円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,840,103円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,069,394円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	90,458円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,854,508円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,240,499円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	412,453,136円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	513,417,538円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,518,624,717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）	15,606,945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）	21,087,425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）	219,638,725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）	47,243,729円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	65,070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）	272,376,924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）	15,957,049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）	53,535,610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）	121,514,211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）	168,811,648円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,828,783円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,085,918円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	536,320,372円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,220,307,862円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	48,743,066円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	25,881,642円
コア資産形成ファンド	17,452,381円
ＭＨＡＭトピックスファンド	772,040,627円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	45,947,996円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	3,300,674,671円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,478,589,039円

計	116,441,395,034円
２．　受益権の総数	116,441,395,034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2月26日 至　2023年2月27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2月27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2月27日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,842,239,270
合計	1,842,239,270

（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2月27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2月27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	4,364,035,000	－	4,457,600,000	93,565,000
合計	4,364,035,000	－	4,457,600,000	93,565,000

（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2月27日現在
1口当たり純資産額	3.3922円
（1万口当たり純資産額）	(33,922円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年2月27日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,300	3,685.00	26,900,500	
ニッスイ	191,500	550.00	105,325,000	
マルハニチロ	28,400	2,447.00	69,494,800	
雪国まいたけ	16,300	1,030.00	16,789,000	
カネコ種苗	5,900	1,684.00	9,935,600	
サカタのタネ	21,800	4,070.00	88,726,000	
ホクト	17,000	1,890.00	32,130,000	
ホクリヨウ	2,500	839.00	2,097,500	
ショーボンドホールディングス	26,100	5,420.00	141,462,000	
ミライト・ワン	66,500	1,533.00	101,944,500	

タマホーム	12,100	3,355.00	40,595,500	
サンヨーホームズ	2,200	764.00	1,680,800	
日本アクア	7,100	919.00	6,524,900	
ファーストコーポレーション	4,300	789.00	3,392,700	
ベステラ	3,700	915.00	3,385,500	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	32,700	189.00	6,180,300	
キャンディル	2,700	504.00	1,360,800	
住石ホールディングス	26,400	365.00	9,636,000	
日鉄鉱業	7,600	3,655.00	27,778,000	
三井松島ホールディングス	8,700	3,935.00	34,234,500	
ＩＮＰＥＸ	707,900	1,445.00	1,022,915,500	
石油資源開発	22,200	5,020.00	111,444,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8,700	2,197.00	19,113,900	
ダイセキ環境ソリューション	3,400	900.00	3,060,000	
第一カッター興業	5,100	1,082.00	5,518,200	
明豊ファシリティワークス	6,300	803.00	5,058,900	
安藤・間	110,900	881.00	97,702,900	
東急建設	54,600	692.00	37,783,200	
コムシスホールディングス	64,800	2,507.00	162,453,600	
ビーアールホールディングス	30,500	350.00	10,675,000	
高松コンストラクショングループ	12,500	2,032.00	25,400,000	
東建コーポレーション	5,500	7,790.00	42,845,000	
ソネック	2,000	979.00	1,958,000	
ヤマウラ	9,800	1,096.00	10,740,800	
オリエンタル白石	68,700	325.00	22,327,500	
大成建設	133,200	4,450.00	592,740,000	
大林組	478,700	1,018.00	487,316,600	
清水建設	402,500	748.00	301,070,000	
飛島建設	14,900	1,107.00	16,494,300	
長谷工コーポレーション	138,200	1,582.00	218,632,400	
松井建設	12,600	678.00	8,542,800	
錢高組	1,500	2,969.00	4,453,500	
鹿島建設	296,900	1,649.00	489,588,100	
不動テトラ	9,300	1,660.00	15,438,000	
大末建設	4,300	1,211.00	5,207,300	
鉄建建設	9,600	1,837.00	17,635,200	
西松建設	22,700	3,680.00	83,536,000	
三井住友建設	107,500	430.00	46,225,000	
大豊建設	5,600	3,880.00	21,728,000	
佐田建設	7,700	507.00	3,903,900	
ナカノフドー建設	8,500	356.00	3,026,000	
奥村組	21,700	3,295.00	71,501,500	
東鉄工業	18,500	2,771.00	51,263,500	
イチケン	2,700	1,831.00	4,943,700	
富士ピー・エス	6,100	454.00	2,769,400	
淺沼組	10,700	3,370.00	36,059,000	
戸田建設	164,600	718.00	118,182,800	
熊谷組	23,200	2,818.00	65,377,600	
北野建設	2,300	2,958.00	6,803,400	
植木組	3,400	1,426.00	4,848,400	

矢作建設工業	18,400	831.00	15,290,400	
ピーエス三菱	17,200	660.00	11,352,000	
日本ハウスホールディングス	26,600	404.00	10,746,400	
大東建託	49,200	12,860.00	632,712,000	
新日本建設	18,800	935.00	17,578,000	
東亜道路工業	2,300	6,630.00	15,249,000	
日本道路	2,700	7,020.00	18,954,000	
東亜建設工業	11,500	2,710.00	31,165,000	
日本国土開発	40,200	567.00	22,793,400	
若築建設	6,000	3,140.00	18,840,000	
東洋建設	43,400	902.00	39,146,800	
五洋建設	189,900	659.00	125,144,100	
世紀東急工業	17,700	840.00	14,868,000	
福田組	5,100	4,415.00	22,516,500	
日本ドライケミカル	3,000	1,704.00	5,112,000	
住友林業	102,700	2,617.00	268,765,900	
日本基礎技術	7,200	544.00	3,916,800	
巴コーポレーション	13,500	433.00	5,845,500	
大和ハウス工業	374,100	3,147.00	1,177,292,700	
ライト工業	25,500	1,990.00	50,745,000	
積水ハウス	419,400	2,579.50	1,081,842,300	
日特建設	12,900	961.00	12,396,900	
北陸電気工事	9,300	779.00	7,244,700	
ユアテック	29,900	760.00	22,724,000	
日本リーテック	8,900	892.00	7,938,800	
四電工	5,700	1,900.00	10,830,000	
中電工	20,800	2,168.00	45,094,400	
関電工	73,600	907.00	66,755,200	
きんでん	94,500	1,547.00	146,191,500	
東京エネシス	13,300	913.00	12,142,900	
トーエネック	4,400	3,465.00	15,246,000	
住友電設	12,800	2,466.00	31,564,800	
日本電設工業	22,000	1,526.00	33,572,000	
エクシオグループ	61,500	2,411.00	148,276,500	
新日本空調	7,400	1,974.00	14,607,600	
日本工営	8,500	3,285.00	27,922,500	
九電工	32,600	3,445.00	112,307,000	
三機工業	29,700	1,534.00	45,559,800	
日揮ホールディングス	132,400	1,768.00	234,083,200	
中外炉工業	4,400	1,868.00	8,219,200	
ヤマト	10,100	835.00	8,433,500	
太平電業	8,400	3,910.00	32,844,000	
高砂熱学工業	32,300	2,135.00	68,960,500	
三晃金属工業	1,400	3,950.00	5,530,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	45,700	1,645.00	75,176,500	
朝日工業社	5,600	2,164.00	12,118,400	
明星工業	23,000	800.00	18,400,000	
大氣社	16,100	3,580.00	57,638,000	
ダイダン	8,900	2,387.00	21,244,300	
日比谷総合設備	11,500	2,058.00	23,667,000	

ニップン	36,300	1,636.00	59,386,800	
日清製粉グループ本社	124,300	1,606.00	199,625,800	
日東富士製粉	2,200	4,450.00	9,790,000	
昭和産業	11,800	2,582.00	30,467,600	
鳥越製粉	9,800	606.00	5,938,800	
中部飼料	18,700	1,054.00	19,709,800	
フィード・ワン	19,700	690.00	13,593,000	
東洋精糖	2,400	920.00	2,208,000	
日本甜菜製糖	8,000	1,715.00	13,720,000	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	13,300	2,085.00	27,730,500	
塩水港精糖	14,900	202.00	3,009,800	
ウェルネオシュガー	7,000	1,678.00	11,746,000	
ＬＩＦＵＬＬ	48,000	195.00	9,360,000	
ＭＩＸＩ	31,900	2,640.00	84,216,000	
ジェイエイシーリクルートメント	12,700	2,389.00	30,340,300	
日本M&Aセンターホールディングス	240,800	1,114.00	268,251,200	
メンバーズ	4,100	1,351.00	5,539,100	
中広	1,000	404.00	404,000	
ＵＴグループ	20,600	2,339.00	48,183,400	
アイティメディア	5,400	1,417.00	7,651,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	8,200	1,382.00	11,332,400	
オープンアップグループ	42,000	1,892.00	79,464,000	
コシダカホールディングス	42,000	910.00	38,220,000	
アルトナー	3,100	1,110.00	3,441,000	
パソナグループ	17,000	1,893.00	32,181,000	
ＣＤＳ	3,200	1,825.00	5,840,000	
リンクアンドモチベーション	40,300	582.00	23,454,600	
エス・エム・エス	53,400	3,250.00	173,550,000	
サニーサイドアップグループ	3,800	605.00	2,299,000	
パーソルホールディングス	157,100	2,704.00	424,798,400	
リニカル	7,100	708.00	5,026,800	
クックパッド	38,400	220.00	8,448,000	
エスクリ	5,200	362.00	1,882,400	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,200	639.00	3,961,800	
森永製菓	24,900	3,950.00	98,355,000	
中村屋	2,800	3,055.00	8,554,000	
江崎グリコ	38,500	3,450.00	132,825,000	
名糖産業	5,500	1,698.00	9,339,000	
井村屋グループ	7,200	2,230.00	16,056,000	
不二家	9,300	2,426.00	22,561,800	
山崎製パン	90,000	1,616.00	145,440,000	
第一屋製パン	2,200	409.00	899,800	
モロゾフ	4,300	3,415.00	14,684,500	
亀田製菓	8,600	4,255.00	36,593,000	
寿スピリッツ	14,300	8,680.00	124,124,000	
カルビー	61,500	2,722.00	167,403,000	
森永乳業	24,500	4,715.00	115,517,500	
六甲バター	9,900	1,347.00	13,335,300	
ヤクルト本社	96,100	9,360.00	899,496,000	
明治ホールディングス	83,400	6,350.00	529,590,000	

雪印メグミルク	32,600	1,820.00	59,332,000	
プリマハム	18,200	2,167.00	39,439,400	
日本ハム	52,600	3,835.00	201,721,000	
林兼産業	3,700	473.00	1,750,100	
丸大食品	13,500	1,500.00	20,250,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	14,900	2,801.00	41,734,900	
柿安本店	5,300	2,069.00	10,965,700	
伊藤ハム米久ホールディングス	104,700	724.00	75,802,800	
学情	6,400	1,440.00	9,216,000	
スタジオアリス	7,000	2,060.00	14,420,000	
クロスキャット	7,800	1,247.00	9,726,600	
シミックホールディングス	7,700	1,794.00	13,813,800	
エプコ	2,700	710.00	1,917,000	
システナ	230,200	323.00	74,354,600	
ＮＪＳ	2,600	2,240.00	5,824,000	
デジタルアーツ	8,700	5,190.00	45,153,000	
日鉄ソリューションズ	23,400	3,465.00	81,081,000	
綜合警備保障	52,100	3,575.00	186,257,500	
キューブシステム	8,300	1,141.00	9,470,300	
いちご	154,800	286.00	44,272,800	
日本駐車場開発	160,100	252.00	40,345,200	
コア	5,900	1,532.00	9,038,800	
カカクコム	103,000	1,963.00	202,189,000	
アイロムグループ	5,100	1,953.00	9,960,300	
セントケア・ホールディング	9,100	796.00	7,243,600	
サイネックス	2,200	563.00	1,238,600	
ルネサンス	9,800	915.00	8,967,000	
ディップ	24,600	3,490.00	85,854,000	
ＳＢＳホールディングス	12,200	3,255.00	39,711,000	
デジタルホールディングス	10,900	1,171.00	12,763,900	
新日本科学	14,900	2,843.00	42,360,700	
キャリアデザインセンター	2,600	2,049.00	5,327,400	
ベネフィット・ワン	65,000	2,046.00	132,990,000	
エムスリー	277,300	3,182.00	882,368,600	
ツカダ・グローバルホールディング	7,800	413.00	3,221,400	
ブラス	1,700	1,192.00	2,026,400	
アウトソーシング	83,600	1,298.00	108,512,800	
ウェルネット	9,500	656.00	6,232,000	
ワールドホールディングス	6,300	2,728.00	17,186,400	
ディー・エヌ・エー	59,900	1,749.00	104,765,100	
博報堂ＤＹホールディングス	178,900	1,489.00	266,382,100	
ぐるなび	25,800	368.00	9,494,400	
タカミヤ	19,200	438.00	8,409,600	
ジャパンベストレスキューシステム	8,700	783.00	6,812,100	
ファンコミュニケーションズ	27,800	416.00	11,564,800	
ライク	5,300	1,912.00	10,133,600	
ビジネス・ブレークスルー	4,600	377.00	1,734,200	
エスプール	40,300	640.00	25,792,000	
ＷＤＢホールディングス	7,100	2,051.00	14,562,100	
手間いらず	2,300	4,930.00	11,339,000	

ティア	7,400	430.00	3,182,000	
ＣＤＧ	1,400	1,196.00	1,674,400	
アドウェイズ	19,300	650.00	12,545,000	
バリューコマース	10,500	1,675.00	17,587,500	
インフォマート	145,600	304.00	44,262,400	
サッポロホールディングス	44,300	3,190.00	141,317,000	
アサヒグループホールディングス	310,600	4,812.00	1,494,607,200	
キリンホールディングス	606,700	2,030.00	1,231,601,000	
宝ホールディングス	91,800	1,088.00	99,878,400	
オエノンホールディングス	40,100	268.00	10,746,800	
養命酒製造	4,400	1,881.00	8,276,400	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	105,300	1,443.00	151,947,900	
サントリー食品インターナショナル	94,700	4,820.00	456,454,000	
ダイドーグループホールディングス	7,600	4,820.00	36,632,000	
伊藤園	45,500	4,540.00	206,570,000	
キーコーヒー	15,100	2,064.00	31,166,400	
ユニカフェ	4,100	890.00	3,649,000	
ジャパンフーズ	1,500	1,102.00	1,653,000	
日清オイリオグループ	19,000	3,320.00	63,080,000	
不二製油グループ本社	31,300	1,982.00	62,036,600	
かどや製油	1,200	3,625.00	4,350,000	
Ｊ－オイルミルズ	13,700	1,584.00	21,700,800	
ローソン	35,800	5,310.00	190,098,000	
サンエー	11,000	4,145.00	45,595,000	
カワチ薬品	11,400	2,327.00	26,527,800	
エービーシー・マート	21,100	6,700.00	141,370,000	
ハードオフコーポレーション	5,200	1,307.00	6,796,400	
高千穂交易	4,500	2,475.00	11,137,500	
アスクル	29,800	1,726.00	51,434,800	
ゲオホールディングス	15,200	1,644.00	24,988,800	
アダストリア	17,400	2,232.00	38,836,800	
ジーフット	6,800	287.00	1,951,600	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,700	410.00	697,000	
オルバヘルスケアホールディングス	2,000	1,684.00	3,368,000	
伊藤忠食品	2,700	5,000.00	13,500,000	
くら寿司	16,900	3,155.00	53,319,500	
キャンドゥ	5,200	2,343.00	12,183,600	
エレマテック	13,000	1,847.00	24,011,000	
ＩＫホールディングス	4,000	374.00	1,496,000	
パルグループホールディングス	14,100	2,744.00	38,690,400	
エディオン	57,200	1,315.00	75,218,000	
あらた	11,000	4,105.00	45,155,000	
サーラコーポレーション	30,300	738.00	22,361,400	
ワッツ	6,300	690.00	4,347,000	
トーメンデバイス	2,100	6,800.00	14,280,000	
ハローズ	6,600	3,225.00	21,285,000	
ＪＰホールディングス	40,300	353.00	14,225,900	
フジオフードグループ本社	12,100	1,341.00	16,226,100	
あみやき亭	3,500	2,990.00	10,465,000	

東京エレクトロン　デバイス	5,400	8,170.00	44,118,000	
ひらまつ	27,200	189.00	5,140,800	
円谷フィールズホールディングス	12,400	4,080.00	50,592,000	
双日	153,300	2,656.00	407,164,800	
アルフレッサ　ホールディングス	144,900	1,667.00	241,548,300	
大黒天物産	4,400	5,190.00	22,836,000	
ハニーズホールディングス	11,400	1,491.00	16,997,400	
ファーマライズホールディングス	2,900	620.00	1,798,000	
キッコーマン	89,100	6,340.00	564,894,000	
味の素	329,000	4,020.00	1,322,580,000	
ブルドックソース	5,400	1,949.00	10,524,600	
キユーピー	72,200	2,217.00	160,067,400	
ハウス食品グループ本社	41,300	2,711.00	111,964,300	
カゴメ	62,700	3,020.00	189,354,000	
焼津水産化学工業	5,600	911.00	5,101,600	
アリアケジャパン	11,800	4,825.00	56,935,000	
ピエトロ	1,700	1,831.00	3,112,700	
エバラ食品工業	3,300	3,110.00	10,263,000	
やまみ	1,200	1,304.00	1,564,800	
ニチレイ	61,600	2,716.00	167,305,600	
横浜冷凍	39,400	1,009.00	39,754,600	
東洋水産	67,900	5,500.00	373,450,000	
イートアンドホールディングス	5,800	2,258.00	13,096,400	
大冷	1,700	1,913.00	3,252,100	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,600	1,054.00	9,064,400	
日清食品ホールディングス	47,300	11,350.00	536,855,000	
永谷園ホールディングス	6,700	2,128.00	14,257,600	
一正蒲鉾	5,200	723.00	3,759,600	
フジッコ	13,900	1,865.00	25,923,500	
ロック・フィールド	15,100	1,575.00	23,782,500	
日本たばこ産業	884,900	2,797.50	2,475,507,750	
ケンコーマヨネーズ	9,300	1,325.00	12,322,500	
わらべや日洋ホールディングス	9,900	1,853.00	18,344,700	
なとり	8,600	2,037.00	17,518,200	
イフジ産業	2,200	922.00	2,028,400	
ファーマフーズ	20,700	1,557.00	32,229,900	
北の達人コーポレーション	57,600	319.00	18,374,400	
ユーグレナ	86,600	946.00	81,923,600	
紀文食品	10,500	967.00	10,153,500	
ピックルスホールディングス	7,900	1,154.00	9,116,600	
スター・マイカ・ホールディングス	12,200	665.00	8,113,000	
ＳＲＥホールディングス	6,600	3,330.00	21,978,000	
ＡＤワークスグループ	30,000	171.00	5,130,000	
片倉工業	12,600	1,791.00	22,566,600	
グンゼ	10,200	4,515.00	46,053,000	
ヒューリック	313,400	1,079.00	338,158,600	
神栄	1,800	919.00	1,654,200	
ラサ商事	5,800	1,601.00	9,285,800	
アルペン	11,900	1,966.00	23,395,400	
ハブ	4,100	742.00	3,042,200	

ラクーンホールディングス	11,400	1,122.00	12,790,800	
クオールホールディングス	19,900	1,201.00	23,899,900	
アルコニックス	19,000	1,367.00	25,973,000	
神戸物産	111,800	3,655.00	408,629,000	
ソリトンシステムズ	7,000	993.00	6,951,000	
ジンズホールディングス	8,600	3,545.00	30,487,000	
ビックカメラ	96,000	1,162.00	111,552,000	
ＤＣＭホールディングス	88,100	1,155.00	101,755,500	
ペッパーフードサービス	30,200	168.00	5,073,600	
ハイパー	2,500	444.00	1,110,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	204,700	1,842.00	377,057,400	
東京一番フーズ	3,100	498.00	1,543,800	
ＤＤホールディングス	8,300	702.00	5,826,600	
あい　ホールディングス	23,100	2,267.00	52,367,700	
ディーブイエックス	3,500	1,048.00	3,668,000	
きちりホールディングス	3,100	582.00	1,804,200	
アークランドサービスホールディングス	11,800	2,201.00	25,971,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	179,500	1,251.00	224,554,500	
ドトール・日レスホールディングス	25,600	1,826.00	46,745,600	
マツキヨココカラ＆カンパニー	87,600	6,370.00	558,012,000	
ブロンコビリー	7,600	2,417.00	18,369,200	
ＺＯＺＯ	95,500	2,969.00	283,539,500	
トレジャー・ファクトリー	7,800	1,114.00	8,689,200	
物語コーポレーション	24,000	2,407.00	57,768,000	
三越伊勢丹ホールディングス	243,100	1,379.00	335,234,900	
東洋紡	59,000	1,095.00	64,605,000	
ユニチカ	41,400	233.00	9,646,200	
富士紡ホールディングス	5,400	3,165.00	17,091,000	
日清紡ホールディングス	112,100	1,019.00	114,229,900	
倉敷紡績	10,200	2,596.00	26,479,200	
ダイワボウホールディングス	59,000	2,108.00	124,372,000	
シキボウ	6,800	1,060.00	7,208,000	
日東紡績	15,400	2,085.00	32,109,000	
トヨタ紡織	57,500	2,113.00	121,497,500	
マクニカホールディングス	35,400	3,785.00	133,989,000	
Ｈａｍｅｅ	5,000	848.00	4,240,000	
マーケットエンタープライズ	1,300	1,100.00	1,430,000	
ラクト・ジャパン	5,700	1,986.00	11,320,200	
ウエルシアホールディングス	74,900	2,959.00	221,629,100	
クリエイトＳＤホールディングス	23,800	3,335.00	79,373,000	
グリムス	6,000	2,371.00	14,226,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,100	905.00	19,095,500	
八洲電機	11,800	1,110.00	13,098,000	
メディアスホールディングス	9,200	775.00	7,130,000	
レスターホールディングス	13,800	2,343.00	32,333,400	
ジューテックホールディングス	2,700	1,259.00	3,399,300	
丸善ＣＨＩホールディングス	15,400	347.00	5,343,800	
大光	5,200	669.00	3,478,800	

ＯＣＨＩホールディングス	2,900	1,346.00	3,903,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	71,300	876.00	62,458,800	
黒谷	3,700	598.00	2,212,600	
ミサワ	2,400	611.00	1,466,400	
ティーライフ	1,700	1,283.00	2,181,100	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,400	772.00	1,852,800	
エー・ピーホールディングス	1,900	780.00	1,482,000	
三洋貿易	14,900	1,163.00	17,328,700	
チムニー	4,000	1,161.00	4,644,000	
シュッピン	10,700	902.00	9,651,400	
ビューティガレージ	2,300	3,525.00	8,107,500	
オイシックス・ラ・大地	19,400	2,362.00	45,822,800	
ウイン・パートナーズ	10,500	1,068.00	11,214,000	
ネクステージ	32,900	3,045.00	100,180,500	
ジョイフル本田	42,800	1,751.00	74,942,800	
鳥貴族ホールディングス	5,400	2,013.00	10,870,200	
ホットランド	11,000	1,406.00	15,466,000	
すかいらーくホールディングス	197,400	1,587.00	313,273,800	
ＳＦＰホールディングス	7,900	1,707.00	13,485,300	
綿半ホールディングス	11,400	1,420.00	16,188,000	
日本毛織	36,000	987.00	35,532,000	
ダイトウボウ	21,500	83.00	1,784,500	
トーア紡コーポレーション	4,200	358.00	1,503,600	
ダイドーリミテッド	18,600	275.00	5,115,000	
ヨシックスホールディングス	2,600	2,115.00	5,499,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	47,200	1,115.00	52,628,000	
三栄建築設計	6,500	1,490.00	9,685,000	
野村不動産ホールディングス	84,000	2,981.00	250,404,000	
三重交通グループホールディングス	28,800	511.00	14,716,800	
サムティ	21,400	2,080.00	44,512,000	
ディア・ライフ	20,700	635.00	13,144,500	
コーセーアールイー	3,700	761.00	2,815,700	
地主	10,200	1,894.00	19,318,800	
プレサンスコーポレーション	17,600	1,740.00	30,624,000	
フィル・カンパニー	2,400	1,132.00	2,716,800	
ＴＨＥグローバル社	7,000	206.00	1,442,000	
ハウスコム	2,000	1,116.00	2,232,000	
ＪＰＭＣ	6,800	1,008.00	6,854,400	
サンセイランディック	3,700	823.00	3,045,100	
エストラスト	1,500	590.00	885,000	
フージャースホールディングス	20,600	846.00	17,427,600	
オープンハウスグループ	49,200	4,940.00	243,048,000	
東急不動産ホールディングス	404,100	649.00	262,260,900	
飯田グループホールディングス	117,800	2,262.00	266,463,600	
イーグランド	1,900	1,542.00	2,929,800	
ムゲンエステート	7,900	545.00	4,305,500	
帝国繊維	15,400	1,626.00	25,040,400	
日本コークス工業	123,500	87.00	10,744,500	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,500	908.00	5,902,000	

ミタチ産業	3,300	1,369.00	4,517,700	
ＢＥＥＮＯＳ	8,200	2,360.00	19,352,000	
あさひ	12,100	1,373.00	16,613,300	
日本調剤	9,900	1,182.00	11,701,800	
コスモス薬品	14,200	12,380.00	175,796,000	
シップヘルスケアホールディングス	51,900	2,471.00	128,244,900	
トーエル	5,800	798.00	4,628,400	
ソフトクリエイトホールディングス	5,700	3,390.00	19,323,000	
セブン&アイ・ホールディングス	497,800	6,047.00	3,010,196,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	108,700	937.00	101,851,900	
明治電機工業	5,500	1,215.00	6,682,500	
ツルハホールディングス	30,300	9,480.00	287,244,000	
デリカフーズホールディングス	5,200	541.00	2,813,200	
スターティアホールディングス	2,500	1,265.00	3,162,500	
サンマルクホールディングス	11,700	1,780.00	20,826,000	
フェリシモ	2,900	999.00	2,897,100	
トリドールホールディングス	35,900	2,706.00	97,145,400	
帝人	131,600	1,455.00	191,478,000	
東レ	916,300	789.60	723,510,480	
クラレ	217,300	1,234.00	268,148,200	
旭化成	853,900	956.00	816,328,400	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	14,800	463.00	6,852,400	
稲葉製作所	8,300	1,449.00	12,026,700	
宮地エンジニアリンググループ	3,900	3,710.00	14,469,000	
トーカロ	38,700	1,268.00	49,071,600	
アルファ	4,500	1,009.00	4,540,500	
ＳＵＭＣＯ	268,100	1,875.00	502,687,500	
川田テクノロジーズ	3,300	3,680.00	12,144,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	9,400	3,465.00	32,571,000	
ジェイテックコーポレーション	1,700	2,688.00	4,569,600	
信和	6,800	745.00	5,066,000	
ビーロット	8,300	593.00	4,921,900	
ファーストブラザーズ	2,300	882.00	2,028,600	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	8,000	888.00	7,104,000	
シーアールイー	6,100	1,105.00	6,740,500	
プロパティエージェント	1,500	1,216.00	1,824,000	
ケイアイスター不動産	6,500	4,285.00	27,852,500	
アグレ都市デザイン	2,200	1,676.00	3,687,200	
グッドコムアセット	12,500	867.00	10,837,500	
ジェイ・エス・ビー	3,300	3,920.00	12,936,000	
ロードスターキャピタル	5,800	1,480.00	8,584,000	
テンポイノベーション	3,700	1,272.00	4,706,400	
グローバル・リンク・マネジメント	2,300	1,296.00	2,980,800	
フェイスネットワーク	1,700	1,745.00	2,966,500	
住江織物	2,500	2,004.00	5,010,000	
日本フエルト	6,700	412.00	2,760,400	
イチカワ	1,500	1,373.00	2,059,500	
エコナックホールディングス	22,000	91.00	2,002,000	
日東製網	1,300	1,575.00	2,047,500	

芦森工業	2,300	1,524.00	3,505,200	
アツギ	7,100	395.00	2,804,500	
ウイルプラスホールディングス	2,100	1,173.00	2,463,300	
ＪＭホールディングス	12,300	1,838.00	22,607,400	
コメダホールディングス	35,300	2,338.00	82,531,400	
サツドラホールディングス	5,800	844.00	4,895,200	
アレンザホールディングス	10,800	993.00	10,724,400	
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,542.00	5,859,600	
バロックジャパンリミテッド	9,400	814.00	7,651,600	
クスリのアオキホールディングス	12,900	6,990.00	90,171,000	
ダイニック	3,000	762.00	2,286,000	
共和レザー	7,100	519.00	3,684,900	
ピーバンドットコム	1,700	536.00	911,200	
力の源ホールディングス	7,400	1,409.00	10,426,600	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	83,000	3,435.00	285,105,000	
アセンテック	4,700	512.00	2,406,400	
セーレン	26,400	2,433.00	64,231,200	
ソトー	3,900	801.00	3,123,900	
東海染工	1,300	1,091.00	1,418,300	
小松マテーレ	19,900	720.00	14,328,000	
ワコールホールディングス	26,300	2,451.00	64,461,300	
ホギメディカル	18,400	3,230.00	59,432,000	
クラウディアホールディングス	2,700	355.00	958,500	
ＴＳＩホールディングス	46,000	607.00	27,922,000	
マツオカコーポレーション	3,300	1,423.00	4,695,900	
ワールド	17,500	1,371.00	23,992,500	
ＴＩＳ	153,900	3,325.00	511,717,500	
ＪＮＳホールディングス	5,600	337.00	1,887,200	
グリー	36,700	735.00	26,974,500	
GMOペパボ	2,000	1,837.00	3,674,000	
コーエーテクモホールディングス	85,800	2,263.00	194,165,400	
三菱総合研究所	6,700	5,120.00	34,304,000	
ボルテージ	3,600	320.00	1,152,000	
電算	800	1,836.00	1,468,800	
ＡＧＳ	5,300	703.00	3,725,900	
ファインデックス	10,700	618.00	6,612,600	
ブレインパッド	10,200	678.00	6,915,600	
ＫＬａｂ	27,200	379.00	10,308,800	
ポールトゥウィンホールディングス	23,400	850.00	19,890,000	
ネクソン	354,000	2,941.00	1,041,114,000	
アイスタイル	39,800	426.00	16,954,800	
エムアップホールディングス	16,700	1,008.00	16,833,600	
エイチーム	9,900	761.00	7,533,900	
エニグモ	17,400	594.00	10,335,600	
テクノスジャパン	10,000	590.00	5,900,000	
ｅｎｉｓｈ	9,200	351.00	3,229,200	
コロプラ	53,200	588.00	31,281,600	
オルトプラス	9,200	231.00	2,125,200	
ブロードリーフ	79,900	427.00	34,117,300	

クロス・マーケティンググループ	7,300	616.00	4,496,800	
デジタルハーツホールディングス	8,600	1,517.00	13,046,200	
システム情報	12,100	773.00	9,353,300	
メディアドゥ	5,500	1,448.00	7,964,000	
じげん	39,900	409.00	16,319,100	
ブイキューブ	16,400	594.00	9,741,600	
エンカレッジ・テクノロジ	2,900	509.00	1,476,100	
サイバーリンクス	3,900	838.00	3,268,200	
ディー・エル・イー	8,800	248.00	2,182,400	
フィックスターズ	15,500	1,306.00	20,243,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,400	1,496.00	9,574,400	
オプティム	11,200	945.00	10,584,000	
セレス	5,500	1,146.00	6,303,000	
ＳＨＩＦＴ	10,000	21,900.00	219,000,000	
特種東海製紙	6,100	3,080.00	18,788,000	
ティーガイア	14,300	1,658.00	23,709,400	
セック	1,700	3,375.00	5,737,500	
テクマトリックス	25,000	1,427.00	35,675,000	
プロシップ	6,000	1,393.00	8,358,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,900	2,449.00	102,613,100	
GMOペイメントゲートウェイ	31,300	11,020.00	344,926,000	
ザッパラス	3,400	357.00	1,213,800	
システムリサーチ	4,200	2,257.00	9,479,400	
インターネットイニシアティブ	76,400	2,667.00	203,758,800	
さくらインターネット	15,300	588.00	8,996,400	
ヴィンクス	3,600	1,370.00	4,932,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,200	3,850.00	16,170,000	
ＳＲＡホールディングス	7,000	3,020.00	21,140,000	
システムインテグレータ	3,700	419.00	1,550,300	
朝日ネット	14,800	588.00	8,702,400	
ｅＢＡＳＥ	19,300	641.00	12,371,300	
アバントグループ	17,300	1,381.00	23,891,300	
アドソル日進	5,800	1,469.00	8,520,200	
ＯＤＫソリューションズ	2,700	603.00	1,628,100	
フリービット	7,100	1,142.00	8,108,200	
コムチュア	18,100	2,199.00	39,801,900	
サイバーコム	2,000	1,435.00	2,870,000	
アステリア	10,700	713.00	7,629,100	
アイル	7,600	2,240.00	17,024,000	
王子ホールディングス	569,800	557.00	317,378,600	
日本製紙	71,100	1,052.00	74,797,200	
三菱製紙	15,100	342.00	5,164,200	
北越コーポレーション	86,400	824.00	71,193,600	
中越パルプ工業	4,700	1,010.00	4,747,000	
巴川製紙所	3,800	683.00	2,595,400	
大王製紙	60,300	1,060.00	63,918,000	
阿波製紙	2,900	714.00	2,070,600	
マークラインズ	7,400	2,575.00	19,055,000	

メディカル・データ・ビジョン	20,400	876.00	17,870,400	
ｇｕｍｉ	20,000	818.00	16,360,000	
ショーケース	3,000	311.00	933,000	
モバイルファクトリー	2,600	888.00	2,308,800	
テラスカイ	5,900	1,868.00	11,021,200	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,900	1,626.00	12,845,400	
ＰＣＩホールディングス	5,100	1,033.00	5,268,300	
アイビーシー	1,900	401.00	761,900	
ネオジャパン	4,500	954.00	4,293,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,400	1,811.00	6,157,400	
ラクス	64,700	1,665.00	107,725,500	
ランドコンピュータ	3,000	1,000.00	3,000,000	
ダブルスタンダード	5,600	2,011.00	11,261,600	
オープンドア	9,600	1,565.00	15,024,000	
マイネット	4,000	354.00	1,416,000	
アカツキ	6,500	2,146.00	13,949,000	
ベネフィットジャパン	800	1,196.00	956,800	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,200	1,932.00	8,114,400	
カナミックネットワーク	19,700	509.00	10,027,300	
ノムラシステムコーポレーション	11,700	112.00	1,310,400	
レンゴー	124,600	894.00	111,392,400	
トーモク	7,900	1,586.00	12,529,400	
ザ・パック	10,100	2,993.00	30,229,300	
チェンジ	33,500	2,470.00	82,745,000	
シンクロ・フード	7,600	470.00	3,572,000	
オークネット	6,700	1,776.00	11,899,200	
キャピタル・アセット・プランニング	2,400	602.00	1,444,800	
セグエグループ	3,300	760.00	2,508,000	
エイトレッド	1,900	1,506.00	2,861,400	
マクロミル	26,800	985.00	26,398,000	
ビーグリー	2,100	1,265.00	2,656,500	
オロ	4,100	1,960.00	8,036,000	
ユーザーローカル	5,000	1,684.00	8,420,000	
テモナ	2,300	292.00	671,600	
ニーズウェル	3,700	837.00	3,096,900	
マネーフォワード	32,900	4,455.00	146,569,500	
サインポスト	4,700	561.00	2,636,700	
レゾナック・ホールディングス	132,100	2,281.00	301,320,100	
住友化学	1,014,500	486.00	493,047,000	
住友精化	5,800	4,375.00	25,375,000	
日産化学	64,900	5,910.00	383,559,000	
ラサ工業	5,300	2,205.00	11,686,500	
クレハ	11,700	8,460.00	98,982,000	
多木化学	5,400	4,495.00	24,273,000	
テイカ	9,200	1,186.00	10,911,200	
石原産業	24,700	1,084.00	26,774,800	
片倉コープアグリ	2,500	2,029.00	5,072,500	
日本曹達	14,700	4,715.00	69,310,500	
東ソー	182,600	1,877.00	342,740,200	

トクヤマ	44,100	2,195.00	96,799,500	
セントラル硝子	21,900	3,055.00	66,904,500	
東亞合成	68,500	1,268.00	86,858,000	
大阪ソーダ	8,200	4,415.00	36,203,000	
関東電化工業	26,400	1,025.00	27,060,000	
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	7,200	1,222.00	8,798,400	
デンカ	49,700	2,907.00	144,477,900	
イビデン	79,000	4,595.00	363,005,000	
信越化学工業	227,300	19,200.00	4,364,160,000	
日本カーバイド工業	4,600	1,339.00	6,159,400	
電算システムホールディングス	6,600	2,518.00	16,618,800	
堺化学工業	10,400	1,841.00	19,146,400	
第一稀元素化学工業	12,500	1,021.00	12,762,500	
エア・ウォーター	129,000	1,639.00	211,431,000	
日本酸素ホールディングス	132,600	2,401.00	318,372,600	
日本化学工業	4,500	2,026.00	9,117,000	
東邦アセチレン	2,600	1,308.00	3,400,800	
日本パーカライジング	67,800	990.00	67,122,000	
高圧ガス工業	20,100	698.00	14,029,800	
チタン工業	1,400	1,487.00	2,081,800	
四国化成ホールディングス	16,200	1,303.00	21,108,600	
戸田工業	3,100	2,567.00	7,957,700	
ステラ　ケミファ	8,000	2,560.00	20,480,000	
保土谷化学工業	3,900	3,200.00	12,480,000	
日本触媒	20,800	5,740.00	119,392,000	
大日精化工業	9,600	1,830.00	17,568,000	
カネカ	31,300	3,475.00	108,767,500	
協和キリン	165,400	2,903.00	480,156,200	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	38,900	1,625.00	63,212,500	
三菱瓦斯化学	102,100	1,972.00	201,341,200	
三井化学	112,700	3,315.00	373,600,500	
ＪＳＲ	127,700	3,100.00	395,870,000	
東京応化工業	23,900	7,210.00	172,319,000	
大阪有機化学工業	10,300	2,001.00	20,610,300	
三菱ケミカルグループ	922,800	813.60	750,790,080	
ＫＨネオケム	22,700	2,562.00	58,157,400	
ダイセル	201,000	953.00	191,553,000	
住友ベークライト	20,200	4,725.00	95,445,000	
積水化学工業	279,700	1,828.00	511,291,600	
日本ゼオン	82,000	1,299.00	106,518,000	
アイカ工業	34,500	3,065.00	105,742,500	
ＵＢＥ	70,400	2,071.00	145,798,400	
積水樹脂	19,900	1,990.00	39,601,000	
タキロンシーアイ	30,200	509.00	15,371,800	
旭有機材	9,100	2,823.00	25,689,300	
ニチバン	8,500	1,808.00	15,368,000	
リケンテクノス	29,500	581.00	17,139,500	
大倉工業	6,400	1,979.00	12,665,600	
積水化成品工業	18,700	406.00	7,592,200	
群栄化学工業	2,700	2,550.00	6,885,000	

タイガースポリマー	5,800	442.00	2,563,600	
ミライアル	3,700	1,573.00	5,820,100	
ダイキアクシス	4,400	687.00	3,022,800	
ダイキョーニシカワ	30,100	654.00	19,685,400	
竹本容器	4,100	846.00	3,468,600	
森六ホールディングス	6,900	1,898.00	13,096,200	
恵和	8,900	1,643.00	14,622,700	
日本化薬	104,300	1,211.00	126,307,300	
カーリットホールディングス	12,300	719.00	8,843,700	
ソルクシーズ	10,200	361.00	3,682,200	
ＣＬホールディングス	3,900	801.00	3,123,900	
プレステージ・インターナショナル	59,000	638.00	37,642,000	
フェイス	3,400	509.00	1,730,600	
プロトコーポレーション	17,100	1,231.00	21,050,100	
ハイマックス	4,300	1,460.00	6,278,000	
アミューズ	7,600	1,826.00	13,877,600	
野村総合研究所	280,900	2,948.00	828,093,200	
ドリームインキュベータ	4,300	2,964.00	12,745,200	
サイバネットシステム	11,500	955.00	10,982,500	
クイック	10,700	1,807.00	19,334,900	
ＴＡＣ	6,800	202.00	1,373,600	
ＣＥホールディングス	6,200	539.00	3,341,800	
日本システム技術	5,100	1,692.00	8,629,200	
電通グループ	137,900	4,340.00	598,486,000	
インテージホールディングス	15,500	1,468.00	22,754,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	1,456.00	6,115,200	
東邦システムサイエンス	3,500	1,088.00	3,808,000	
ぴあ	4,700	3,110.00	14,617,000	
イオンファンタジー	6,100	2,712.00	16,543,200	
ソースネクスト	69,600	224.00	15,590,400	
シーティーエス	15,600	780.00	12,168,000	
ネクシィーズグループ	3,800	667.00	2,534,600	
インフォコム	17,600	2,367.00	41,659,200	
メディカルシステムネットワーク	12,600	409.00	5,153,400	
日本精化	7,800	2,544.00	19,843,200	
扶桑化学工業	12,700	3,715.00	47,180,500	
トリケミカル研究所	18,300	2,277.00	41,669,100	
シンプレクス・ホールディングス	23,000	2,239.00	51,497,000	
ＨＥＲＯＺ	4,500	1,123.00	5,053,500	
ラクスル	38,700	1,359.00	52,593,300	
メルカリ	61,800	2,339.00	144,550,200	
ＩＰＳ	4,400	2,466.00	10,850,400	
ＦＩＧ	14,100	302.00	4,258,200	
システムサポート	5,300	1,731.00	9,174,300	
ＡＤＥＫＡ	47,700	2,230.00	106,371,000	
日油	42,300	5,920.00	250,416,000	
ミヨシ油脂	4,200	977.00	4,103,400	
新日本理化	16,800	215.00	3,612,000	
ハリマ化成グループ	8,700	911.00	7,925,700	
イーソル	8,800	747.00	6,573,600	

アルテリア・ネットワークス	12,700	1,293.00	16,421,100	
東海ソフト	1,900	919.00	1,746,100	
ウイングアーク１ｓｔ	14,100	1,746.00	24,618,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,700	1,563.00	5,783,100	
サーバーワークス	2,800	2,564.00	7,179,200	
東名	900	2,287.00	2,058,300	
ヴィッツ	1,200	956.00	1,147,200	
トビラシステムズ	3,100	858.00	2,659,800	
Ｓａｎｓａｎ	44,700	1,462.00	65,351,400	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,300	942.00	2,166,600	
ギフティ	14,900	2,249.00	33,510,100	
花王	333,000	5,054.00	1,682,982,000	
第一工業製薬	5,000	1,948.00	9,740,000	
石原ケミカル	6,300	1,319.00	8,309,700	
日華化学	5,000	864.00	4,320,000	
ニイタカ	2,200	2,110.00	4,642,000	
三洋化成工業	8,500	4,320.00	36,720,000	
メドレー	13,700	3,950.00	54,115,000	
ベース	4,600	4,550.00	20,930,000	
ＪＭＤＣ	22,500	4,160.00	93,600,000	
武田薬品工業	1,211,600	4,199.00	5,087,508,400	
アステラス製薬	1,312,100	1,923.00	2,523,168,300	
住友ファーマ	101,500	858.00	87,087,000	
塩野義製薬	175,000	6,105.00	1,068,375,000	
わかもと製薬	11,500	231.00	2,656,500	
日本新薬	32,300	6,080.00	196,384,000	
中外製薬	428,600	3,425.00	1,467,955,000	
科研製薬	23,400	3,665.00	85,761,000	
エーザイ	166,600	7,437.00	1,239,004,200	
理研ビタミン	11,600	2,089.00	24,232,400	
ロート製薬	132,600	2,494.00	330,704,400	
小野薬品工業	264,200	2,812.50	743,062,500	
久光製薬	30,400	3,895.00	118,408,000	
有機合成薬品工業	9,200	294.00	2,704,800	
持田製薬	16,400	3,420.00	56,088,000	
参天製薬	257,600	1,054.00	271,510,400	
扶桑薬品工業	4,300	1,996.00	8,582,800	
日本ケミファ	1,200	1,761.00	2,113,200	
ツムラ	43,100	2,607.00	112,361,700	
テルモ	419,800	3,682.00	1,545,703,600	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	41,100	2,694.00	110,723,400	
キッセイ薬品工業	21,200	2,505.00	53,106,000	
生化学工業	26,200	826.00	21,641,200	
栄研化学	22,200	1,562.00	34,676,400	
鳥居薬品	7,300	3,125.00	22,812,500	
ＪＣＲファーマ	46,300	1,449.00	67,088,700	
東和薬品	21,100	1,930.00	40,723,000	
富士製薬工業	8,900	1,062.00	9,451,800	
ゼリア新薬工業	19,000	2,178.00	41,382,000	

第一三共	1,192,700	4,324.00	5,157,234,800	
キョーリン製薬ホールディングス	29,700	1,693.00	50,282,100	
大幸薬品	24,800	417.00	10,341,600	
ダイト	9,600	2,458.00	23,596,800	
大塚ホールディングス	313,300	4,146.00	1,298,941,800	
大正製薬ホールディングス	30,400	5,410.00	164,464,000	
ペプチドリーム	66,400	1,788.00	118,723,200	
大日本塗料	16,900	859.00	14,517,100	
日本ペイントホールディングス	605,100	1,187.00	718,253,700	
関西ペイント	125,300	1,810.00	226,793,000	
神東塗料	10,400	127.00	1,320,800	
中国塗料	22,400	1,113.00	24,931,200	
日本特殊塗料	7,700	942.00	7,253,400	
藤倉化成	18,600	448.00	8,332,800	
太陽ホールディングス	20,700	2,358.00	48,810,600	
ＤＩＣ	53,500	2,454.00	131,289,000	
サカタインクス	30,300	1,046.00	31,693,800	
東洋インキＳＣホールディングス	26,700	1,935.00	51,664,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	12,200	1,186.00	14,469,200	
アルプス技研	12,200	2,482.00	30,280,400	
サニックス	22,700	268.00	6,083,600	
日本空調サービス	15,400	725.00	11,165,000	
オリエンタルランド	148,500	21,025.00	3,122,212,500	
フォーカスシステムズ	10,000	1,004.00	10,040,000	
ダスキン	31,300	3,105.00	97,186,500	
パーク２４	104,700	1,958.00	205,002,600	
明光ネットワークジャパン	18,400	614.00	11,297,600	
ファルコホールディングス	6,100	1,960.00	11,956,000	
クレスコ	10,500	1,715.00	18,007,500	
フジ・メディア・ホールディングス	131,400	1,197.00	157,285,800	
秀英予備校	3,100	421.00	1,305,100	
田谷	1,700	526.00	894,200	
ラウンドワン	117,300	512.00	60,057,600	
リゾートトラスト	55,400	2,113.00	117,060,200	
オービック	45,700	19,780.00	903,946,000	
ジャストシステム	19,700	3,195.00	62,941,500	
ＴＤＣソフト	11,600	1,487.00	17,249,200	
Ｚホールディングス	1,948,400	371.10	723,051,240	
ビー・エム・エル	17,400	3,195.00	55,593,000	
トレンドマイクロ	79,000	6,250.00	493,750,000	
りらいあコミュニケーションズ	23,200	1,457.00	33,802,400	
ＩＤホールディングス	9,300	1,008.00	9,374,400	
リソー教育	63,800	329.00	20,990,200	
日本オラクル	26,200	9,190.00	240,778,000	
早稲田アカデミー	7,800	1,233.00	9,617,400	
アルファシステムズ	4,300	4,235.00	18,210,500	
フューチャー	34,100	1,746.00	59,538,600	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,600	1,640.00	14,104,000	
ＳＢテクノロジー	5,800	1,999.00	11,594,200	
トーセ	3,200	736.00	2,355,200	

ユー・エス・エス	144,300	2,219.00	320,201,700	
オービックビジネスコンサルタント	26,900	4,585.00	123,336,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	73,500	3,025.00	222,337,500	
アイティフォー	18,200	866.00	15,761,200	
東京個別指導学院	16,700	518.00	8,650,600	
東計電算	2,000	6,110.00	12,220,000	
サイバーエージェント	335,700	1,157.00	388,404,900	
楽天グループ	649,500	667.00	433,216,500	
エックスネット	1,800	1,030.00	1,854,000	
クリーク・アンド・リバー社	8,300	2,183.00	18,118,900	
モーニングスター	23,000	499.00	11,477,000	
テー・オー・ダブリュー	27,200	307.00	8,350,400	
大塚商会	77,600	4,595.00	356,572,000	
サイボウズ	18,900	2,515.00	47,533,500	
山田コンサルティンググループ	7,100	1,532.00	10,877,200	
セントラルスポーツ	5,300	2,482.00	13,154,600	
パラカ	4,700	2,050.00	9,635,000	
電通国際情報サービス	16,600	4,530.00	75,198,000	
ＡＣＣＥＳＳ	16,200	964.00	15,616,800	
デジタルガレージ	24,300	4,365.00	106,069,500	
イーエムシステムズ	22,800	863.00	19,676,400	
ウェザーニューズ	4,200	6,730.00	28,266,000	
ＣＩＪ	11,400	1,077.00	12,277,800	
ビジネスエンジニアリング	2,600	2,894.00	7,524,400	
日本エンタープライズ	12,400	135.00	1,674,000	
WOWOW	7,600	1,296.00	9,849,600	
スカラ	12,700	724.00	9,194,800	
インテリジェント　ウェイブ	6,500	704.00	4,576,000	
フルキャストホールディングス	13,400	2,498.00	33,473,200	
エン・ジャパン	25,400	2,356.00	59,842,400	
あすか製薬ホールディングス	14,000	1,144.00	16,016,000	
サワイグループホールディングス	31,300	3,775.00	118,157,500	
富士フイルムホールディングス	262,700	6,388.00	1,678,127,600	
コニカミノルタ	307,800	601.00	184,987,800	
資生堂	285,800	6,146.00	1,756,526,800	
ライオン	164,300	1,460.00	239,878,000	
高砂香料工業	9,300	2,595.00	24,133,500	
マンダム	29,500	1,418.00	41,831,000	
ミルボン	20,300	5,690.00	115,507,000	
ファンケル	59,900	2,496.00	149,510,400	
コーセー	27,900	14,770.00	412,083,000	
コタ	11,600	1,680.00	19,488,000	
シーボン	1,500	1,597.00	2,395,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	70,200	1,725.00	121,095,000	
ノエビアホールディングス	12,200	5,410.00	66,002,000	
アジュバンホールディングス	3,000	1,025.00	3,075,000	
新日本製薬	7,800	1,409.00	10,990,200	
エステー	10,600	1,554.00	16,472,400	
アグロ　カネショウ	5,500	1,525.00	8,387,500	
コニシ	22,900	1,851.00	42,387,900	

長谷川香料	28,400	2,990.00	84,916,000	
星光ＰＭＣ	6,400	551.00	3,526,400	
小林製薬	39,800	8,150.00	324,370,000	
荒川化学工業	11,700	997.00	11,664,900	
メック	11,200	2,216.00	24,819,200	
日本高純度化学	3,400	2,482.00	8,438,800	
タカラバイオ	36,900	1,730.00	63,837,000	
ＪＣＵ	15,500	3,135.00	48,592,500	
新田ゼラチン	7,500	843.00	6,322,500	
ＯＡＴアグリオ	5,000	1,464.00	7,320,000	
デクセリアルズ	39,500	2,669.00	105,425,500	
アース製薬	12,400	4,830.00	59,892,000	
北興化学工業	13,800	842.00	11,619,600	
大成ラミック	4,300	2,885.00	12,405,500	
クミアイ化学工業	54,500	875.00	47,687,500	
日本農薬	25,100	710.00	17,821,000	
富士興産	2,900	1,230.00	3,567,000	
ニチレキ	16,300	1,483.00	24,172,900	
ユシロ化学工業	7,100	863.00	6,127,300	
ビーピー・カストロール	4,600	898.00	4,130,800	
富士石油	27,900	268.00	7,477,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,000	1,157.00	4,628,000	
出光興産	152,100	3,035.00	461,623,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,473,400	468.80	1,159,529,920	
コスモエネルギーホールディングス	54,100	4,070.00	220,187,000	
テスホールディングス	14,400	1,060.00	15,264,000	
インフロニア・ホールディングス	140,200	1,046.00	146,649,200	
横浜ゴム	77,900	2,585.00	201,371,500	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	78,600	1,605.00	126,153,000	
ブリヂストン	437,200	5,209.00	2,277,374,800	
住友ゴム工業	134,200	1,227.00	164,663,400	
藤倉コンポジット	8,700	1,056.00	9,187,200	
オカモト	7,600	3,930.00	29,868,000	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ　ＧＲＯＵＰ	2,200	1,498.00	3,295,600	
アキレス	8,900	1,328.00	11,819,200	
フコク	7,200	1,098.00	7,905,600	
ニッタ	13,900	3,015.00	41,908,500	
クリエートメディック	4,200	893.00	3,750,600	
住友理工	26,700	710.00	18,957,000	
三ツ星ベルト	20,000	3,925.00	78,500,000	
バンドー化学	21,800	1,047.00	22,824,600	
ＡＧＣ	139,300	5,100.00	710,430,000	
日本板硝子	69,800	700.00	48,860,000	
石塚硝子	1,900	1,484.00	2,819,600	
有沢製作所	22,400	1,421.00	31,830,400	
日本山村硝子	4,400	700.00	3,080,000	
日本電気硝子	55,800	2,560.00	142,848,000	
オハラ	6,500	1,206.00	7,839,000	
住友大阪セメント	19,300	3,730.00	71,989,000	
太平洋セメント	87,200	2,449.00	213,552,800	

リソルホールディングス	1,100	4,970.00	5,467,000	
日本ヒューム	12,500	691.00	8,637,500	
日本コンクリート工業	27,300	245.00	6,688,500	
三谷セキサン	5,800	4,385.00	25,433,000	
アジアパイルホールディングス	21,800	743.00	16,197,400	
東海カーボン	114,900	1,341.00	154,080,900	
日本カーボン	7,800	4,135.00	32,253,000	
東洋炭素	8,600	4,370.00	37,582,000	
ノリタケカンパニーリミテド	6,800	4,550.00	30,940,000	
ＴＯＴＯ	90,400	4,510.00	407,704,000	
日本碍子	162,000	1,820.00	294,840,000	
日本特殊陶業	104,200	2,782.00	289,884,400	
ダントーホールディングス	8,700	438.00	3,810,600	
ＭＡＲＵＷＡ	5,100	17,310.00	88,281,000	
品川リフラクトリーズ	3,800	4,455.00	16,929,000	
黒崎播磨	2,800	6,350.00	17,780,000	
ヨータイ	9,200	1,494.00	13,744,800	
東京窯業	11,600	324.00	3,758,400	
ニッカトー	5,600	583.00	3,264,800	
フジミインコーポレーテッド	10,900	6,540.00	71,286,000	
クニミネ工業	3,600	910.00	3,276,000	
エーアンドエーマテリアル	2,400	953.00	2,287,200	
ニチアス	34,600	2,660.00	92,036,000	
日本製鉄	630,700	3,132.00	1,975,352,400	
神戸製鋼所	283,200	929.00	263,092,800	
中山製鋼所	29,000	1,175.00	34,075,000	
合同製鐵	7,000	3,665.00	25,655,000	
ＪＦＥホールディングス	376,400	1,722.00	648,160,800	
東京製鐵	39,600	1,534.00	60,746,400	
共英製鋼	16,100	1,650.00	26,565,000	
大和工業	23,200	5,530.00	128,296,000	
東京鐵鋼	6,700	1,899.00	12,723,300	
大阪製鐵	6,600	1,372.00	9,055,200	
淀川製鋼所	16,100	2,759.00	44,419,900	
中部鋼鈑	11,700	2,171.00	25,400,700	
丸一鋼管	42,900	2,978.00	127,756,200	
モリ工業	2,900	3,145.00	9,120,500	
大同特殊鋼	17,700	5,370.00	95,049,000	
日本高周波鋼業	4,200	348.00	1,461,600	
日本冶金工業	10,300	4,465.00	45,989,500	
山陽特殊製鋼	13,900	2,672.00	37,140,800	
愛知製鋼	8,200	2,427.00	19,901,400	
日本金属	2,800	942.00	2,637,600	
大平洋金属	10,000	1,988.00	19,880,000	
新日本電工	90,000	373.00	33,570,000	
栗本鐵工所	6,700	2,130.00	14,271,000	
虹　技	1,700	1,011.00	1,718,700	
日本鋳鉄管	1,400	1,010.00	1,414,000	
日本製鋼所	38,000	2,605.00	98,990,000	
三菱製鋼	8,800	1,259.00	11,079,200	

日亜鋼業	13,300	279.00	3,710,700	
日本精線	2,000	4,690.00	9,380,000	
エンビプロ・ホールディングス	8,700	722.00	6,281,400	
大紀アルミニウム工業所	20,000	1,453.00	29,060,000	
日本軽金属ホールディングス	38,100	1,523.00	58,026,300	
三井金属鉱業	41,000	3,400.00	139,400,000	
東邦亜鉛	8,400	2,174.00	18,261,600	
三菱マテリアル	94,000	2,143.00	201,442,000	
住友金属鉱山	163,400	5,127.00	837,751,800	
ＤＯＷＡホールディングス	31,700	4,515.00	143,125,500	
古河機械金属	20,600	1,429.00	29,437,400	
エス・サイエンス	76,500	28.00	2,142,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,600	2,760.00	56,856,000	
東邦チタニウム	25,500	1,970.00	50,235,000	
ＵＡＣＪ	19,700	2,652.00	52,244,400	
ＣＫサンエツ	2,600	4,190.00	10,894,000	
古河電気工業	46,900	2,382.00	111,715,800	
住友電気工業	486,400	1,688.00	821,043,200	
フジクラ	151,100	952.00	143,847,200	
昭和電線ホールディングス	15,800	1,892.00	29,893,600	
タツタ電線	28,800	712.00	20,505,600	
カナレ電気	2,000	1,308.00	2,616,000	
平河ヒューテック	8,200	1,439.00	11,799,800	
いよぎんホールディングス	160,100	818.00	130,961,800	
しずおかフィナンシャルグループ	303,900	1,096.00	333,074,400	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	113,200	969.00	109,690,800	
リョービ	15,000	1,523.00	22,845,000	
アーレスティ	13,800	596.00	8,224,800	
アサヒホールディングス	57,100	1,996.00	113,971,600	
東洋製罐グループホールディングス	93,200	1,779.00	165,802,800	
ホッカンホールディングス	7,500	1,358.00	10,185,000	
コロナ	7,800	911.00	7,105,800	
横河ブリッジホールディングス	18,600	2,063.00	38,371,800	
駒井ハルテック	2,100	1,780.00	3,738,000	
高田機工	600	2,793.00	1,675,800	
三和ホールディングス	129,600	1,451.00	188,049,600	
文化シヤッター	40,600	1,136.00	46,121,600	
三協立山	16,100	727.00	11,704,700	
アルインコ	10,800	1,069.00	11,545,200	
東洋シヤッター	2,200	537.00	1,181,400	
ＬＩＸＩＬ	205,200	2,171.00	445,489,200	
日本フイルコン	8,200	461.00	3,780,200	
ノーリツ	20,700	1,675.00	34,672,500	
長府製作所	14,100	2,174.00	30,653,400	
リンナイ	25,500	9,500.00	242,250,000	
ユニプレス	24,500	792.00	19,404,000	
ダイニチ工業	6,500	677.00	4,400,500	
日東精工	20,600	534.00	11,000,400	
三洋工業	1,400	1,950.00	2,730,000	
岡部	22,600	759.00	17,153,400	

ジーテクト	15,700	1,454.00	22,827,800	
東プレ	24,900	1,233.00	30,701,700	
高周波熱錬	22,800	687.00	15,663,600	
東京製綱	8,400	1,282.00	10,768,800	
サンコール	11,100	643.00	7,137,300	
モリテックスチール	9,400	317.00	2,979,800	
パイオラックス	19,400	2,007.00	38,935,800	
エイチワン	14,700	650.00	9,555,000	
日本発条	124,700	928.00	115,721,600	
中央発條	7,800	754.00	5,881,200	
アドバネクス	1,500	1,157.00	1,735,500	
三浦工業	57,600	3,245.00	186,912,000	
タクマ	42,400	1,376.00	58,342,400	
テクノプロ・ホールディングス	83,100	3,395.00	282,124,500	
アトラグループ	3,000	182.00	546,000	
インターワークス	3,200	373.00	1,193,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,300	1,963.00	14,329,900	
ＫｅｅＰｅｒ技研	8,700	3,870.00	33,669,000	
ファーストロジック	2,000	882.00	1,764,000	
三機サービス	2,000	948.00	1,896,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	11,100	594.00	6,593,400	
デザインワン・ジャパン	3,700	191.00	706,700	
イー・ガーディアン	5,300	2,306.00	12,221,800	
リブセンス	5,800	257.00	1,490,600	
ジャパンマテリアル	42,900	2,359.00	101,201,100	
ベクトル	22,000	1,355.00	29,810,000	
ウチヤマホールディングス	5,600	274.00	1,534,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,700	1,108.00	12,963,600	
キャリアリンク	5,200	2,378.00	12,365,600	
ＩＢＪ	8,600	824.00	7,086,400	
アサンテ	7,000	1,682.00	11,774,000	
バリューＨＲ	12,300	1,589.00	19,544,700	
M&Aキャピタルパートナーズ	13,000	3,935.00	51,155,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,100	1,110.00	5,661,000	
ＥＲＩホールディングス	3,200	1,497.00	4,790,400	
アビスト	2,000	2,990.00	5,980,000	
シグマクシス・ホールディングス	21,300	1,084.00	23,089,200	
ウィルグループ	11,700	1,140.00	13,338,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,500	151.00	2,038,500	
メドピア	11,000	1,235.00	13,585,000	
レアジョブ	2,400	1,117.00	2,680,800	
リクルートホールディングス	1,039,000	3,675.00	3,818,325,000	
エラン	18,600	1,060.00	19,716,000	
ツガミ	30,600	1,470.00	44,982,000	
オークマ	13,800	5,460.00	75,348,000	
芝浦機械	13,700	3,095.00	42,401,500	
アマダ	220,000	1,245.00	273,900,000	
アイダエンジニアリング	28,400	794.00	22,549,600	

ＴＡＫＩＳＡＷＡ	3,300	1,164.00	3,841,200	
ＦＵＪＩ	60,000	2,058.00	123,480,000	
牧野フライス製作所	15,300	5,010.00	76,653,000	
オーエスジー	65,800	1,942.00	127,783,600	
ダイジェット工業	1,300	841.00	1,093,300	
旭ダイヤモンド工業	38,500	850.00	32,725,000	
ＤＭＧ森精機	83,600	2,164.00	180,910,400	
ソディック	37,900	775.00	29,372,500	
ディスコ	22,100	42,200.00	932,620,000	
日東工器	6,800	1,779.00	12,097,200	
日進工具	11,600	1,085.00	12,586,000	
パンチ工業	10,700	455.00	4,868,500	
冨士ダイス	5,900	599.00	3,534,100	
土木管理総合試験所	5,300	310.00	1,643,000	
日本郵政	1,839,200	1,229.50	2,261,296,400	
ベルシステム２４ホールディングス	18,800	1,450.00	27,260,000	
鎌倉新書	15,900	1,033.00	16,424,700	
ＳＭＮ	3,200	456.00	1,459,200	
一蔵	1,500	505.00	757,500	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,900	816.00	1,550,400	
エアトリ	9,100	2,444.00	22,240,400	
アトラエ	11,000	942.00	10,362,000	
ストライク	6,900	3,745.00	25,840,500	
ソラスト	38,700	674.00	26,083,800	
セラク	5,000	1,438.00	7,190,000	
インソース	34,800	1,200.00	41,760,000	
豊田自動織機	99,800	7,890.00	787,422,000	
豊和工業	6,600	1,003.00	6,619,800	
ニデックオーケーケー	5,000	885.00	4,425,000	
石川製作所	3,100	1,443.00	4,473,300	
東洋機械金属	8,500	580.00	4,930,000	
津田駒工業	2,300	501.00	1,152,300	
エンシュウ	2,600	700.00	1,820,000	
島精機製作所	21,900	1,863.00	40,799,700	
オプトラン	20,400	2,213.00	45,145,200	
ＮＣホールディングス	2,500	1,871.00	4,677,500	
イワキ	9,300	1,332.00	12,387,600	
フリュー	14,400	1,190.00	17,136,000	
ヤマシンフィルタ	32,800	397.00	13,021,600	
日阪製作所	13,300	975.00	12,967,500	
やまびこ	22,500	1,281.00	28,822,500	
野村マイクロ・サイエンス	4,600	4,450.00	20,470,000	
平田機工	6,600	6,580.00	43,428,000	
ペガサスミシン製造	15,300	677.00	10,358,100	
マルマエ	6,700	1,878.00	12,582,600	
タツモ	7,500	1,773.00	13,297,500	
ナブテスコ	86,500	3,460.00	299,290,000	
三井海洋開発	17,300	1,506.00	26,053,800	
レオン自動機	14,600	1,260.00	18,396,000	
ＳＭＣ	44,700	68,800.00	3,075,360,000	

ホソカワミクロン	10,600	2,788.00	29,552,800	
ユニオンツール	6,100	3,230.00	19,703,000	
オイレス工業	19,300	1,660.00	32,038,000	
日精エー・エス・ビー機械	6,300	4,375.00	27,562,500	
サトーホールディングス	19,600	2,274.00	44,570,400	
技研製作所	14,300	2,807.00	40,140,100	
日本エアーテック	7,000	1,115.00	7,805,000	
カワタ	3,600	881.00	3,171,600	
日精樹脂工業	10,300	999.00	10,289,700	
オカダアイヨン	3,800	1,637.00	6,220,600	
ワイエイシイホールディングス	5,200	2,145.00	11,154,000	
小松製作所	646,000	3,315.00	2,141,490,000	
住友重機械工業	81,500	3,190.00	259,985,000	
日立建機	54,900	3,075.00	168,817,500	
日工	20,600	633.00	13,039,800	
巴工業	6,000	2,449.00	14,694,000	
井関農機	12,900	1,197.00	15,441,300	
ＴＯＷＡ	14,000	1,893.00	26,502,000	
丸山製作所	2,200	1,788.00	3,933,600	
北川鉄工所	5,400	1,122.00	6,058,800	
シンニッタン	13,700	262.00	3,589,400	
ローツェ	7,200	10,430.00	75,096,000	
タカキタ	3,600	441.00	1,587,600	
クボタ	729,600	2,053.00	1,497,868,800	
荏原実業	6,600	2,793.00	18,433,800	
東洋エンジニアリング	17,700	592.00	10,478,400	
三菱化工機	4,400	2,284.00	10,049,600	
月島機械	18,700	1,109.00	20,738,300	
帝国電機製作所	10,000	2,689.00	26,890,000	
東京機械製作所	2,900	541.00	1,568,900	
新東工業	28,200	770.00	21,714,000	
澁谷工業	12,900	2,459.00	31,721,100	
アイチコーポレーション	19,600	803.00	15,738,800	
小森コーポレーション	31,900	981.00	31,293,900	
鶴見製作所	10,500	2,061.00	21,640,500	
日本ギア工業	4,000	510.00	2,040,000	
酒井重工業	2,000	3,900.00	7,800,000	
荏原製作所	56,400	5,810.00	327,684,000	
石井鐵工所	1,000	2,332.00	2,332,000	
酉島製作所	12,000	1,531.00	18,372,000	
北越工業	13,800	1,413.00	19,499,400	
ダイキン工業	164,600	23,425.00	3,855,755,000	
オルガノ	19,000	3,415.00	64,885,000	
トーヨーカネツ	5,300	2,753.00	14,590,900	
栗田工業	77,100	6,080.00	468,768,000	
椿本チエイン	19,500	3,230.00	62,985,000	
大同工業	5,000	783.00	3,915,000	
日機装	31,800	956.00	30,400,800	
木村化工機	10,500	706.00	7,413,000	
レイズネクスト	19,400	1,413.00	27,412,200	

アネスト岩田	23,400	920.00	21,528,000	
ダイフク	71,100	7,370.00	524,007,000	
サムコ	4,500	3,390.00	15,255,000	
加藤製作所	5,800	997.00	5,782,600	
油研工業	1,700	2,100.00	3,570,000	
タダノ	72,600	1,020.00	74,052,000	
フジテック	50,500	3,130.00	158,065,000	
ＣＫＤ	38,100	2,072.00	78,943,200	
平和	45,800	2,527.00	115,736,600	
理想科学工業	12,300	2,452.00	30,159,600	
ＳＡＮＫＹＯ	27,100	5,510.00	149,321,000	
日本金銭機械	15,200	1,290.00	19,608,000	
マースグループホールディングス	8,200	2,397.00	19,655,400	
フクシマガリレイ	10,100	4,450.00	44,945,000	
オーイズミ	4,600	537.00	2,470,200	
ダイコク電機	7,500	2,645.00	19,837,500	
竹内製作所	25,000	2,903.00	72,575,000	
アマノ	39,100	2,510.00	98,141,000	
ＪＵＫＩ	21,400	643.00	13,760,200	
サンデン	18,300	224.00	4,099,200	
ジャノメ	14,100	628.00	8,854,800	
ブラザー工業	184,200	2,035.00	374,847,000	
マックス	17,000	2,155.00	36,635,000	
モリタホールディングス	24,000	1,227.00	29,448,000	
グローリー	35,700	2,775.00	99,067,500	
新晃工業	13,800	1,577.00	21,762,600	
大和冷機工業	21,200	1,325.00	28,090,000	
セガサミーホールディングス	110,800	2,331.00	258,274,800	
日本ピストンリング	4,200	1,380.00	5,796,000	
リケン	5,500	2,664.00	14,652,000	
ＴＰＲ	15,800	1,415.00	22,357,000	
ツバキ・ナカシマ	34,000	1,039.00	35,326,000	
ホシザキ	88,700	4,805.00	426,203,500	
大豊工業	12,100	650.00	7,865,000	
日本精工	253,000	758.00	191,774,000	
ＮＴＮ	271,800	340.00	92,412,000	
ジェイテクト	122,700	1,020.00	125,154,000	
不二越	10,200	3,940.00	40,188,000	
ミネベアミツミ	239,800	2,362.00	566,407,600	
日本トムソン	33,700	598.00	20,152,600	
ＴＨＫ	79,600	3,050.00	242,780,000	
ユーシン精機	10,800	732.00	7,905,600	
前澤給装工業	9,800	1,000.00	9,800,000	
イーグル工業	15,300	1,215.00	18,589,500	
前澤工業	7,100	637.00	4,522,700	
日本ピラー工業	12,800	3,470.00	44,416,000	
キッツ	50,700	879.00	44,565,300	
日立製作所	670,500	6,884.00	4,615,722,000	
東芝	265,300	4,180.00	1,108,954,000	
三菱電機	1,425,000	1,550.00	2,208,750,000	

富士電機	83,800	5,230.00	438,274,000	
東洋電機製造	3,900	904.00	3,525,600	
安川電機	163,400	5,140.00	839,876,000	
シンフォニア　テクノロジー	15,200	1,680.00	25,536,000	
明電舎	20,900	1,951.00	40,775,900	
オリジン	2,800	1,317.00	3,687,600	
山洋電気	6,000	5,700.00	34,200,000	
デンヨー	10,500	1,580.00	16,590,000	
ＰＨＣホールディングス	19,200	1,420.00	27,264,000	
ソシオネクスト	14,100	8,870.00	125,067,000	
ベイカレント・コンサルティング	111,000	5,370.00	596,070,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,000	1,794.00	5,382,000	
アイモバイル	7,300	1,244.00	9,081,200	
キャリアインデックス	4,200	335.00	1,407,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,100	1,061.00	4,350,100	
船場	1,500	752.00	1,128,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	50,000	1,951.00	97,550,000	
フルテック	1,700	1,090.00	1,853,000	
グリーンズ	4,200	1,284.00	5,392,800	
ツナググループ・ホールディングス	3,500	559.00	1,956,500	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	3,700	324.00	1,198,800	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,400	576.00	806,400	
ウェルビー	10,300	706.00	7,271,800	
エル・ティー・エス	1,900	2,568.00	4,879,200	
ミダックホールディングス	8,600	2,704.00	23,254,400	
日総工産	10,500	679.00	7,129,500	
キュービーネットホールディングス	6,600	1,451.00	9,576,600	
ＲＰＡホールディングス	19,000	324.00	6,156,000	
三櫻工業	20,900	710.00	14,839,000	
マキタ	171,500	3,355.00	575,382,500	
東芝テック	20,600	3,825.00	78,795,000	
芝浦メカトロニクス	2,700	14,000.00	37,800,000	
マブチモーター	34,300	3,780.00	129,654,000	
日本電産	334,900	6,839.00	2,290,381,100	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,900	489.00	4,841,100	
トレックス・セミコンダクター	6,500	2,465.00	16,022,500	
東光高岳	8,400	2,110.00	17,724,000	
ダブル・スコープ	45,100	1,248.00	56,284,800	
宮越ホールディングス	6,200	817.00	5,065,400	
ダイヘン	12,500	4,350.00	54,375,000	
ヤーマン	23,800	1,517.00	36,104,600	
ＪＶＣケンウッド	125,500	399.00	50,074,500	
ミマキエンジニアリング	13,100	596.00	7,807,600	
Ｉ－ＰＥＸ	7,600	1,286.00	9,773,600	
日新電機	33,000	1,696.00	55,968,000	
大崎電気工業	32,500	542.00	17,615,000	
オムロン	126,300	7,213.00	911,001,900	
日東工業	18,600	2,655.00	49,383,000	

ＩＤＥＣ	20,300	3,310.00	67,193,000	
正興電機製作所	4,600	1,004.00	4,618,400	
不二電機工業	2,500	1,112.00	2,780,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	45,300	2,473.00	112,026,900	
サクサホールディングス	2,600	1,539.00	4,001,400	
メルコホールディングス	3,700	3,415.00	12,635,500	
テクノメディカ	3,300	1,712.00	5,649,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,500	937.00	4,216,500	
日本電気	195,000	4,790.00	934,050,000	
富士通	137,400	17,430.00	2,394,882,000	
沖電気工業	62,300	720.00	44,856,000	
岩崎通信機	5,400	791.00	4,271,400	
電気興業	5,500	2,260.00	12,430,000	
サンケン電気	12,800	8,990.00	115,072,000	
ナカヨ	2,100	1,167.00	2,450,700	
アイホン	8,400	1,992.00	16,732,800	
ルネサスエレクトロニクス	899,700	1,720.50	1,547,933,850	
セイコーエプソン	183,600	1,899.00	348,656,400	
ワコム	109,200	652.00	71,198,400	
アルバック	32,700	5,240.00	171,348,000	
アクセル	4,500	1,718.00	7,731,000	
ＥＩＺＯ	10,100	3,785.00	38,228,500	
ジャパンディスプレイ	528,800	40.00	21,152,000	
日本信号	31,400	1,057.00	33,189,800	
京三製作所	29,000	417.00	12,093,000	
能美防災	18,700	1,667.00	31,172,900	
ホーチキ	10,300	1,486.00	15,305,800	
星和電機	5,200	469.00	2,438,800	
エレコム	32,900	1,322.00	43,493,800	
パナソニック　ホールディングス	1,628,600	1,189.00	1,936,405,400	
シャープ	166,000	933.00	154,878,000	
アンリツ	97,100	1,260.00	122,346,000	
富士通ゼネラル	39,100	3,800.00	148,580,000	
ソニーグループ	965,700	11,400.00	11,008,980,000	
ＴＤＫ	218,400	4,535.00	990,444,000	
帝国通信工業	6,200	1,501.00	9,306,200	
タムラ製作所	59,100	752.00	44,443,200	
アルプスアルパイン	123,100	1,368.00	168,400,800	
池上通信機	4,000	627.00	2,508,000	
日本電波工業	16,500	1,399.00	23,083,500	
鈴木	7,400	1,060.00	7,844,000	
メイコー	15,100	2,784.00	42,038,400	
日本トリム	3,100	3,005.00	9,315,500	
ローランド　ディー．ジー．	7,700	3,150.00	24,255,000	
フォスター電機	12,800	1,007.00	12,889,600	
ＳＭＫ	3,300	2,586.00	8,533,800	
ヨコオ	10,900	2,004.00	21,843,600	
ティアック	18,800	117.00	2,199,600	
ホシデン	32,200	1,688.00	54,353,600	

ヒロセ電機	22,800	16,690.00	380,532,000	
日本航空電子工業	28,300	2,239.00	63,363,700	
ＴＯＡ	15,700	805.00	12,638,500	
マクセル	29,900	1,464.00	43,773,600	
古野電気	18,000	945.00	17,010,000	
スミダコーポレーション	12,600	1,626.00	20,487,600	
アイコム	5,400	2,591.00	13,991,400	
リオン	5,700	1,850.00	10,545,000	
横河電機	150,900	2,059.00	310,703,100	
新電元工業	5,300	3,585.00	19,000,500	
アズビル	95,400	3,545.00	338,193,000	
東亜ディーケーケー	5,900	802.00	4,731,800	
日本光電工業	63,100	3,400.00	214,540,000	
チノー	5,700	1,945.00	11,086,500	
共和電業	11,600	345.00	4,002,000	
日本電子材料	9,000	1,522.00	13,698,000	
堀場製作所	30,300	7,360.00	223,008,000	
アドバンテスト	107,500	10,760.00	1,156,700,000	
小野測器	4,500	443.00	1,993,500	
エスペック	10,900	2,029.00	22,116,100	
キーエンス	136,500	58,400.00	7,971,600,000	
日置電機	7,100	7,770.00	55,167,000	
シスメックス	117,700	8,051.00	947,602,700	
日本マイクロニクス	22,500	1,334.00	30,015,000	
メガチップス	11,200	2,859.00	32,020,800	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,400	3,875.00	24,800,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	11,200	642.00	7,190,400	
澤藤電機	1,400	1,174.00	1,643,600	
デンソー	281,600	7,245.00	2,040,192,000	
原田工業	5,500	878.00	4,829,000	
コーセル	16,400	1,140.00	18,696,000	
イリソ電子工業	12,600	4,665.00	58,779,000	
オプテックスグループ	25,100	1,988.00	49,898,800	
千代田インテグレ	4,700	2,231.00	10,485,700	
レーザーテック	62,500	22,205.00	1,387,812,500	
スタンレー電気	97,100	2,839.00	275,666,900	
岩崎電気	4,400	4,445.00	19,558,000	
ウシオ電機	71,300	1,561.00	111,299,300	
岡谷電機産業	9,800	300.00	2,940,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	11,100	398.00	4,417,800	
エノモト	3,100	1,895.00	5,874,500	
日本セラミック	13,900	2,665.00	37,043,500	
遠藤照明	5,400	859.00	4,638,600	
古河電池	10,100	1,143.00	11,544,300	
双信電機	5,000	379.00	1,895,000	
山一電機	11,900	1,834.00	21,824,600	
図研	11,900	3,440.00	40,936,000	
日本電子	34,200	4,280.00	146,376,000	
カシオ計算機	101,600	1,339.00	136,042,400	
ファナック	133,900	23,140.00	3,098,446,000	

日本シイエムケイ	29,000	502.00	14,558,000	
エンプラス	4,000	4,025.00	16,100,000	
大真空	16,600	731.00	12,134,600	
ローム	63,100	10,520.00	663,812,000	
浜松ホトニクス	109,500	6,620.00	724,890,000	
三井ハイテック	14,100	7,050.00	99,405,000	
新光電気工業	48,300	3,760.00	181,608,000	
京セラ	212,100	6,711.00	1,423,403,100	
協栄産業	1,100	1,999.00	2,198,900	
太陽誘電	66,500	4,115.00	273,647,500	
村田製作所	414,000	7,350.00	3,042,900,000	
双葉電子工業	25,800	561.00	14,473,800	
日東電工	99,400	8,200.00	815,080,000	
北陸電気工業	4,500	1,437.00	6,466,500	
東海理化電機製作所	38,600	1,576.00	60,833,600	
ニチコン	27,900	1,343.00	37,469,700	
日本ケミコン	13,500	2,164.00	29,214,000	
ＫＯＡ	20,600	1,886.00	38,851,600	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	63,200	430.00	27,176,000	
日立造船	113,000	907.00	102,491,000	
三菱重工業	241,100	5,062.00	1,220,448,200	
川崎重工業	102,900	3,040.00	312,816,000	
ＩＨＩ	86,900	3,580.00	311,102,000	
名村造船所	31,200	393.00	12,261,600	
サノヤスホールディングス	16,800	135.00	2,268,000	
スプリックス	4,300	860.00	3,698,000	
マネジメントソリューションズ	7,700	3,225.00	24,832,500	
プロレド・パートナーズ	3,300	515.00	1,699,500	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	3,600	365.00	1,314,000	
テノ．ホールディングス	1,500	895.00	1,342,500	
フロンティア・マネジメント	4,700	1,160.00	5,452,000	
ピアラ	2,000	541.00	1,082,000	
コプロ・ホールディングス	2,100	1,191.00	2,501,100	
ギークス	1,800	1,153.00	2,075,400	
カーブスホールディングス	43,100	762.00	32,842,200	
フォーラムエンジニアリング	8,300	916.00	7,602,800	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	4,700	1,450.00	6,815,000	
日本車輌製造	5,300	1,967.00	10,425,100	
三菱ロジスネクスト	21,800	818.00	17,832,400	
近畿車輌	1,500	1,260.00	1,890,000	
一家ホールディングス	2,800	602.00	1,685,600	
フルサト・マルカホールディングス	14,300	2,953.00	42,227,900	
ヤマエグループホールディングス	8,200	1,718.00	14,087,600	
ジャパンクラフトホールディングス	4,000	579.00	2,316,000	
ＦＰＧ	54,500	1,178.00	64,201,000	
島根銀行	4,200	540.00	2,268,000	
じもとホールディングス	7,900	441.00	3,483,900	
全国保証	35,200	5,260.00	185,152,000	
めぶきフィナンシャルグループ	666,700	364.00	242,678,800	

ジャパンインベストメントアドバイザー	10,900	1,045.00	11,390,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,200	2,962.00	50,946,400	
九州フィナンシャルグループ	236,800	519.00	122,899,200	
かんぽ生命保険	163,300	2,368.00	386,694,400	
ゆうちょ銀行	382,900	1,156.00	442,632,400	
あんしん保証	6,000	264.00	1,584,000	
富山第一銀行	33,400	660.00	22,044,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	740,900	590.00	437,131,000	
ジェイリース	4,000	2,278.00	9,112,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	85,000	1,180.00	100,300,000	
イントラスト	4,500	859.00	3,865,500	
日本モーゲージサービス	6,700	889.00	5,956,300	
ＣＡＳＡ	4,500	829.00	3,730,500	
アルヒ	16,500	1,111.00	18,331,500	
プレミアグループ	22,600	1,557.00	35,188,200	
日産自動車	1,939,100	528.60	1,025,008,260	
いすゞ自動車	396,900	1,638.00	650,122,200	
トヨタ自動車	7,495,900	1,857.00	13,919,886,300	
日野自動車	175,800	557.00	97,920,600	
三菱自動車工業	532,600	546.00	290,799,600	
エフテック	8,300	680.00	5,644,000	
レシップホールディングス	4,700	469.00	2,204,300	
ＧＭＢ	2,400	839.00	2,013,600	
ファルテック	2,100	595.00	1,249,500	
武蔵精密工業	33,300	1,800.00	59,940,000	
日産車体	24,100	849.00	20,460,900	
新明和工業	42,900	1,123.00	48,176,700	
極東開発工業	24,000	1,472.00	35,328,000	
トピー工業	11,100	1,941.00	21,545,100	
ティラド	3,400	2,322.00	7,894,800	
曙ブレーキ工業	83,300	145.00	12,078,500	
タチエス	21,600	1,259.00	27,194,400	
ＮＯＫ	53,000	1,338.00	70,914,000	
フタバ産業	36,500	423.00	15,439,500	
ＫＹＢ	13,100	3,805.00	49,845,500	
市光工業	19,700	450.00	8,865,000	
大同メタル工業	26,600	527.00	14,018,200	
プレス工業	60,800	477.00	29,001,600	
ミクニ	14,000	356.00	4,984,000	
太平洋工業	31,300	1,184.00	37,059,200	
河西工業	16,100	216.00	3,477,600	
アイシン	105,400	3,765.00	396,831,000	
マツダ	451,500	1,222.00	551,733,000	
今仙電機製作所	7,700	803.00	6,183,100	
本田技研工業	1,109,700	3,539.00	3,927,228,300	
スズキ	250,800	4,753.00	1,192,052,400	
ＳＵＢＡＲＵ	432,000	2,212.00	955,584,000	

安永	5,400	693.00	3,742,200	
ヤマハ発動機	214,500	3,450.00	740,025,000	
小糸製作所	164,200	2,288.00	375,689,600	
ＴＢＫ	11,700	266.00	3,112,200	
エクセディ	22,200	1,832.00	40,670,400	
ミツバ	25,600	518.00	13,260,800	
豊田合成	39,800	2,204.00	87,719,200	
愛三工業	22,600	945.00	21,357,000	
盟和産業	1,500	970.00	1,455,000	
日本プラスト	9,500	413.00	3,923,500	
ヨロズ	12,600	784.00	9,878,400	
エフ・シー・シー	24,300	1,518.00	36,887,400	
新家工業	2,700	2,464.00	6,652,800	
シマノ	55,800	21,135.00	1,179,333,000	
テイ・エス　テック	62,500	1,740.00	108,750,000	
三十三フィナンシャルグループ	12,100	1,776.00	21,489,600	
第四北越フィナンシャルグループ	21,200	3,320.00	70,384,000	
ひろぎんホールディングス	175,500	697.00	122,323,500	
マーキュリアホールディングス	7,100	795.00	5,644,500	
おきなわフィナンシャルグループ	12,800	2,427.00	31,065,600	
ダイレクトマーケティングミックス	16,800	1,420.00	23,856,000	
ポピンズ	2,100	1,802.00	3,784,200	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	10,900	2,479.00	27,021,100	
十六フィナンシャルグループ	17,400	3,275.00	56,985,000	
北國フィナンシャルホールディングス	11,400	4,195.00	47,823,000	
ネットプロテクションズホールディングス	44,400	563.00	24,997,200	
プロクレアホールディングス	16,600	2,331.00	38,694,600	
あいちフィナンシャルグループ	18,800	2,513.00	47,244,400	
ジャムコ	6,600	1,724.00	11,378,400	
小野建	13,400	1,560.00	20,904,000	
はるやまホールディングス	5,300	457.00	2,422,100	
南陽	2,500	2,106.00	5,265,000	
ノジマ	47,200	1,369.00	64,616,800	
佐鳥電機	8,000	1,689.00	13,512,000	
カッパ・クリエイト	22,800	1,435.00	32,718,000	
エコートレーディング	2,500	781.00	1,952,500	
伯東	8,300	5,050.00	41,915,000	
コンドーテック	11,100	1,077.00	11,954,700	
中山福	6,600	347.00	2,290,200	
ライトオン	9,700	557.00	5,402,900	
ナガイレーベン	18,200	1,937.00	35,253,400	
三菱食品	13,400	3,300.00	44,220,000	
良品計画	186,300	1,381.00	257,280,300	
パリミキホールディングス	16,500	285.00	4,702,500	
松田産業	10,900	2,302.00	25,091,800	
第一興商	27,900	4,280.00	119,412,000	
メディパルホールディングス	149,700	1,795.00	268,711,500	
アドヴァングループ	13,800	931.00	12,847,800	
ＳＰＫ	6,400	1,565.00	10,016,000	

萩原電気ホールディングス	5,500	2,854.00	15,697,000	
アルビス	4,700	2,426.00	11,402,200	
アズワン	20,600	5,440.00	112,064,000	
スズデン	5,100	2,712.00	13,831,200	
尾家産業	3,100	1,019.00	3,158,900	
シモジマ	9,900	1,045.00	10,345,500	
ドウシシャ	15,300	1,873.00	28,656,900	
小津産業	2,900	1,754.00	5,086,600	
コナカ	14,000	355.00	4,970,000	
高速	7,500	1,906.00	14,295,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,700	1,650.00	2,805,000	
Ｇ－７ホールディングス	18,000	1,407.00	25,326,000	
たけびし	5,600	1,644.00	9,206,400	
イオン北海道	21,400	867.00	18,553,800	
コジマ	28,000	554.00	15,512,000	
ヒマラヤ	4,100	923.00	3,784,300	
コーナン商事	19,500	3,230.00	62,985,000	
ネットワンシステムズ	51,000	3,090.00	157,590,000	
エコス	5,400	1,837.00	9,919,800	
ワタミ	17,400	889.00	15,468,600	
マルシェ	4,000	389.00	1,556,000	
リックス	2,700	2,509.00	6,774,300	
システムソフト	46,400	87.00	4,036,800	
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	291,500	2,504.00	729,916,000	
丸文	12,900	1,456.00	18,782,400	
西松屋チェーン	32,000	1,568.00	50,176,000	
ゼンショーホールディングス	79,000	3,815.00	301,385,000	
ハピネット	12,300	1,851.00	22,767,300	
幸楽苑ホールディングス	9,500	1,051.00	9,984,500	
ハークスレイ	4,500	715.00	3,217,500	
橋本総業ホールディングス	5,800	1,143.00	6,629,400	
日本ライフライン	42,300	935.00	39,550,500	
サイゼリヤ	24,000	3,005.00	72,120,000	
タカショー	12,500	687.00	8,587,500	
ＶＴホールディングス	54,800	512.00	28,057,600	
アルゴグラフィックス	12,600	3,755.00	47,313,000	
魚力	4,500	2,130.00	9,585,000	
ＩＤＯＭ	43,700	841.00	36,751,700	
日本エム・ディ・エム	8,000	1,021.00	8,168,000	
ポプラ	3,200	139.00	444,800	
フジ・コーポレーション	8,200	1,242.00	10,184,400	
ユナイテッドアローズ	15,400	1,756.00	27,042,400	
進和	9,600	2,092.00	20,083,200	
エスケイジャパン	3,200	561.00	1,795,200	
ダイトロン	5,700	2,601.00	14,825,700	
ハイデイ日高	21,400	1,967.00	42,093,800	
シークス	20,500	1,507.00	30,893,500	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,100	201.00	1,427,100	

コロワイド	66,600	1,880.00	125,208,000	
ピーシーデポコーポレーション	15,700	297.00	4,662,900	
田中商事	3,900	606.00	2,363,400	
オーハシテクニカ	7,200	1,558.00	11,217,600	
壱番屋	11,500	4,580.00	52,670,000	
白銅	5,300	2,626.00	13,917,800	
トップカルチャー	4,200	198.00	831,600	
ＰＬＡＮＴ	3,200	668.00	2,137,600	
スギホールディングス	29,100	5,630.00	163,833,000	
ダイコー通産	1,400	1,140.00	1,596,000	
薬王堂ホールディングス	8,000	2,394.00	19,152,000	
島津製作所	166,200	3,930.00	653,166,000	
ＪＭＳ	12,800	535.00	6,848,000	
クボテック	3,200	225.00	720,000	
長野計器	9,900	1,228.00	12,157,200	
ブイ・テクノロジー	6,600	2,491.00	16,440,600	
スター精密	26,000	1,714.00	44,564,000	
東京計器	10,400	1,296.00	13,478,400	
愛知時計電機	5,400	1,518.00	8,197,200	
インターアクション	6,400	1,494.00	9,561,600	
オーバル	10,700	478.00	5,114,600	
東京精密	29,900	5,050.00	150,995,000	
マニー	60,100	1,848.00	111,064,800	
ニコン	212,300	1,344.00	285,331,200	
トプコン	71,800	1,770.00	127,086,000	
オリンパス	853,300	2,298.00	1,960,883,400	
理研計器	8,500	5,100.00	43,350,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	23,300	10,780.00	251,174,000	
キヤノン電子	15,100	1,770.00	26,727,000	
タムロン	10,200	3,290.00	33,558,000	
ＨＯＹＡ	291,500	13,240.00	3,859,460,000	
シード	6,200	580.00	3,596,000	
ノーリツ鋼機	12,900	2,220.00	28,638,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	19,900	1,414.00	28,138,600	
朝日インテック	152,500	2,283.00	348,157,500	
キヤノン	749,000	2,973.50	2,227,151,500	
リコー	342,200	1,074.00	367,522,800	
シチズン時計	149,900	821.00	123,067,900	
リズム	3,800	1,552.00	5,897,600	
大研医器	9,300	480.00	4,464,000	
メニコン	46,900	2,869.00	134,556,100	
シンシア	1,200	497.00	596,400	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	17,600	129.00	2,270,400	
中本パックス	3,800	1,584.00	6,019,200	
スノーピーク	23,300	2,136.00	49,768,800	
パラマウントベッドホールディングス	31,600	2,355.00	74,418,000	
トランザクション	10,500	1,490.00	15,645,000	
粧美堂	3,500	377.00	1,319,500	
ニホンフラッシュ	12,900	954.00	12,306,600	
前田工繊	11,600	3,280.00	38,048,000	

永大産業	13,000	225.00	2,925,000	
アートネイチャー	14,100	750.00	10,575,000	
バンダイナムコホールディングス	124,700	8,408.00	1,048,477,600	
アイフィスジャパン	3,500	602.00	2,107,000	
ＳＨＯＥＩ	14,400	5,260.00	75,744,000	
フランスベッドホールディングス	16,800	1,003.00	16,850,400	
マーベラス	22,300	727.00	16,212,100	
パイロットコーポレーション	21,400	4,370.00	93,518,000	
萩原工業	9,100	1,221.00	11,111,100	
エイベックス	23,200	1,601.00	37,143,200	
フジシールインターナショナル	27,700	1,613.00	44,680,100	
タカラトミー	62,900	1,336.00	84,034,400	
広済堂ホールディングス	8,200	2,392.00	19,614,400	
エステールホールディングス	2,900	633.00	1,835,700	
レック	19,500	955.00	18,622,500	
タカノ	4,600	686.00	3,155,600	
三光合成	17,100	573.00	9,798,300	
プロネクサス	11,400	989.00	11,274,600	
ホクシン	9,400	152.00	1,428,800	
ウッドワン	4,000	1,113.00	4,452,000	
大建工業	8,300	2,272.00	18,857,600	
きもと	18,100	202.00	3,656,200	
凸版印刷	178,500	2,498.00	445,893,000	
大日本印刷	162,000	3,655.00	592,110,000	
共同印刷	3,800	3,000.00	11,400,000	
ＮＩＳＳＨＡ	26,000	1,848.00	48,048,000	
光村印刷	600	1,240.00	744,000	
藤森工業	10,800	3,235.00	34,938,000	
ヴィア・ホールディングス	17,900	97.00	1,736,300	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,800	2,233.00	19,650,400	
前澤化成工業	8,800	1,400.00	12,320,000	
未来工業	5,000	1,507.00	7,535,000	
アシックス	126,000	3,360.00	423,360,000	
ツツミ	2,400	1,958.00	4,699,200	
ウェーブロックホールディングス	3,700	624.00	2,308,800	
ＪＳＰ	9,600	1,597.00	15,331,200	
ニチハ	17,100	2,656.00	45,417,600	
ローランド	10,000	3,885.00	38,850,000	
エフピコ	25,900	3,435.00	88,966,500	
小松ウオール工業	5,100	1,997.00	10,184,700	
ヤマハ	86,100	5,110.00	439,971,000	
河合楽器製作所	3,700	2,701.00	9,993,700	
クリナップ	15,400	684.00	10,533,600	
ピジョン	86,900	2,073.00	180,143,700	
天馬	11,700	2,410.00	28,197,000	
兼松サステック	600	2,246.00	1,347,600	
キングジム	12,200	888.00	10,833,600	
象印マホービン	40,800	1,642.00	66,993,600	
リンテック	27,400	2,238.00	61,321,200	
信越ポリマー	25,400	1,373.00	34,874,200	

東リ	27,600	275.00	7,590,000	
イトーキ	27,900	765.00	21,343,500	
任天堂	861,900	5,198.00	4,480,156,200	
三菱鉛筆	19,400	1,498.00	29,061,200	
松風	6,200	2,110.00	13,082,000	
タカラスタンダード	26,400	1,459.00	38,517,600	
コクヨ	65,700	1,862.00	122,333,400	
ナカバヤシ	15,000	482.00	7,230,000	
ニフコ	49,400	3,550.00	175,370,000	
立川ブラインド工業	6,400	1,324.00	8,473,600	
グローブライド	11,000	2,560.00	28,160,000	
オカムラ	41,100	1,357.00	55,772,700	
バルカー	11,500	3,320.00	38,180,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,700	1,750.00	2,975,000	
伊藤忠商事	890,100	4,132.00	3,677,893,200	
丸紅	1,140,300	1,753.50	1,999,516,050	
スクロール	21,500	802.00	17,243,000	
高島	2,100	3,080.00	6,468,000	
ヨンドシーホールディングス	12,400	1,750.00	21,700,000	
三陽商会	4,600	1,400.00	6,440,000	
長瀬産業	67,900	2,044.00	138,787,600	
ナイガイ	4,100	259.00	1,061,900	
蝶理	7,800	2,599.00	20,272,200	
豊田通商	126,500	5,610.00	709,665,000	
オンワードホールディングス	88,500	341.00	30,178,500	
三共生興	20,700	566.00	11,716,200	
兼松	56,000	1,644.00	92,064,000	
美津濃	13,500	3,160.00	42,660,000	
ツカモトコーポレーション	1,900	1,410.00	2,679,000	
ルックホールディングス	3,500	2,170.00	7,595,000	
三井物産	1,056,800	3,847.00	4,065,509,600	
日本紙パルプ商事	7,600	5,410.00	41,116,000	
東京エレクトロン	96,300	46,870.00	4,513,581,000	
カメイ	15,400	1,491.00	22,961,400	
東都水産	600	5,840.00	3,504,000	
ＯＵＧホールディングス	2,000	2,480.00	4,960,000	
スターゼン	11,000	2,209.00	24,299,000	
セイコーグループ	21,200	2,920.00	61,904,000	
山善	38,900	1,069.00	41,584,100	
椿本興業	2,100	4,120.00	8,652,000	
住友商事	894,600	2,357.00	2,108,572,200	
ＢＩＰＲＯＧＹ	50,400	2,952.00	148,780,800	
内田洋行	6,400	4,900.00	31,360,000	
三菱商事	903,100	4,689.00	4,234,635,900	
第一実業	5,100	5,290.00	26,979,000	
キヤノンマーケティングジャパン	33,400	3,070.00	102,538,000	
西華産業	5,700	1,721.00	9,809,700	
佐藤商事	10,100	1,431.00	14,453,100	
菱洋エレクトロ	12,300	2,535.00	31,180,500	
東京産業	13,300	789.00	10,493,700	

ユアサ商事	13,000	3,700.00	48,100,000	
神鋼商事	3,600	6,070.00	21,852,000	
トルク	6,600	215.00	1,419,000	
阪和興業	25,900	4,030.00	104,377,000	
正栄食品工業	9,600	4,250.00	40,800,000	
カナデン	11,700	1,140.00	13,338,000	
菱電商事	11,600	1,921.00	22,283,600	
ニプロ	113,800	1,035.00	117,783,000	
岩谷産業	32,900	5,620.00	184,898,000	
ナイス	3,500	1,366.00	4,781,000	
ニチモウ	1,400	3,315.00	4,641,000	
極東貿易	8,700	1,557.00	13,545,900	
アステナホールディングス	25,000	430.00	10,750,000	
兼松エレクトロニクス	8,500	6,180.00	52,530,000	
三愛オブリ	39,800	1,433.00	57,033,400	
稲畑産業	29,200	2,678.00	78,197,600	
ＧＳＩクレオス	8,500	1,688.00	14,348,000	
明和産業	19,200	712.00	13,670,400	
クワザワホールディングス	4,400	473.00	2,081,200	
キムラタン	72,800	21.00	1,528,800	
ゴールドウイン	24,300	11,640.00	282,852,000	
ユニ・チャーム	285,200	4,994.00	1,424,288,800	
デサント	23,500	3,970.00	93,295,000	
キング	5,400	512.00	2,764,800	
ワキタ	26,500	1,152.00	30,528,000	
ヤマトインターナショナル	9,800	257.00	2,518,600	
東邦ホールディングス	35,900	2,216.00	79,554,400	
サンゲツ	36,300	2,435.00	88,390,500	
ミツウロコグループホールディングス	18,600	1,363.00	25,351,800	
シナネンホールディングス	4,600	3,455.00	15,893,000	
伊藤忠エネクス	35,800	1,119.00	40,060,200	
サンリオ	41,000	4,090.00	167,690,000	
サンワ　テクノス	7,400	2,045.00	15,133,000	
リョーサン	15,400	3,120.00	48,048,000	
新光商事	19,400	1,335.00	25,899,000	
トーホー	6,200	1,835.00	11,377,000	
三信電気	5,800	2,636.00	15,288,800	
東陽テクニカ	15,900	1,317.00	20,940,300	
モスフードサービス	21,300	3,065.00	65,284,500	
加賀電子	11,800	4,875.00	57,525,000	
三益半導体工業	10,800	2,608.00	28,166,400	
都築電気	7,200	1,461.00	10,519,200	
ソーダニッカ	9,400	881.00	8,281,400	
立花エレテック	10,500	1,980.00	20,790,000	
木曽路	21,900	2,199.00	48,158,100	
ＳＲＳホールディングス	23,800	914.00	21,753,200	
千趣会	27,100	396.00	10,731,600	
タカキュー	9,200	78.00	717,600	
リテールパートナーズ	21,500	1,290.00	27,735,000	
ケーヨー	23,400	861.00	20,147,400	

上新電機	12,900	2,042.00	26,341,800	
日本瓦斯	77,400	1,875.00	145,125,000	
ロイヤルホールディングス	28,000	2,567.00	71,876,000	
東天紅	600	742.00	445,200	
いなげや	14,100	1,362.00	19,204,200	
チヨダ	13,800	771.00	10,639,800	
ライフコーポレーション	12,600	2,743.00	34,561,800	
リンガーハット	18,600	2,197.00	40,864,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	20,400	653.00	13,321,200	
テンアライド	13,700	279.00	3,822,300	
ＡＯＫＩホールディングス	26,800	816.00	21,868,800	
オークワ	23,000	889.00	20,447,000	
コメリ	22,300	2,668.00	59,496,400	
青山商事	30,900	950.00	29,355,000	
しまむら	16,900	12,900.00	218,010,000	
はせがわ	6,200	348.00	2,157,600	
高島屋	108,900	1,891.00	205,929,900	
松屋	24,500	1,102.00	26,999,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	70,300	1,349.00	94,834,700	
近鉄百貨店	4,600	2,362.00	10,865,200	
丸井グループ	106,500	2,060.00	219,390,000	
クレディセゾン	85,100	1,864.00	158,626,400	
アクシアル　リテイリング	9,900	3,560.00	35,244,000	
井筒屋	6,100	345.00	2,104,500	
イオン	489,700	2,552.00	1,249,714,400	
イズミ	22,000	3,010.00	66,220,000	
フォーバル	5,500	1,046.00	5,753,000	
平和堂	24,000	2,163.00	51,912,000	
フジ	22,200	1,766.00	39,205,200	
ヤオコー	16,300	6,850.00	111,655,000	
ゼビオホールディングス	19,700	1,024.00	20,172,800	
ケーズホールディングス	114,900	1,182.00	135,811,800	
ＰＡＬＴＡＣ	22,700	4,905.00	111,343,500	
三谷産業	25,300	321.00	8,121,300	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,200	517.00	2,688,400	
日産東京販売ホールディングス	16,400	350.00	5,740,000	
ＳＢＩ新生銀行	39,700	2,473.00	98,178,100	
あおぞら銀行	84,400	2,651.00	223,744,400	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,536,500	965.80	8,244,551,700	
りそなホールディングス	1,699,300	747.90	1,270,906,470	
三井住友トラスト・ホールディングス	244,400	4,949.00	1,209,535,600	
三井住友フィナンシャルグループ	982,500	5,918.00	5,814,435,000	
千葉銀行	374,700	1,006.00	376,948,200	
群馬銀行	260,600	514.00	133,948,400	
武蔵野銀行	17,100	2,572.00	43,981,200	
千葉興業銀行	28,000	562.00	15,736,000	
筑波銀行	59,100	244.00	14,420,400	
七十七銀行	43,000	2,423.00	104,189,000	
秋田銀行	9,000	2,012.00	18,108,000	
山形銀行	15,000	1,284.00	19,260,000	

岩手銀行	9,200	2,507.00	23,064,400	
東邦銀行	107,200	245.00	26,264,000	
東北銀行	6,000	1,063.00	6,378,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	107,300	3,105.00	333,166,500	
スルガ銀行	118,500	434.00	51,429,000	
八十二銀行	275,500	623.00	171,636,500	
山梨中央銀行	13,700	1,372.00	18,796,400	
大垣共立銀行	25,700	2,021.00	51,939,700	
福井銀行	12,000	1,737.00	20,844,000	
清水銀行	5,400	1,593.00	8,602,200	
富山銀行	1,900	1,822.00	3,461,800	
滋賀銀行	22,400	2,969.00	66,505,600	
南都銀行	20,200	2,716.00	54,863,200	
百五銀行	126,600	425.00	53,805,000	
京都銀行	42,600	6,550.00	279,030,000	
紀陽銀行	48,100	1,644.00	79,076,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	85,400	1,074.00	91,719,600	
山陰合同銀行	84,000	859.00	72,156,000	
鳥取銀行	3,900	1,284.00	5,007,600	
百十四銀行	12,200	2,014.00	24,570,800	
四国銀行	21,200	971.00	20,585,200	
阿波銀行	19,900	2,254.00	44,854,600	
大分銀行	8,000	2,325.00	18,600,000	
宮崎銀行	8,800	2,776.00	24,428,800	
佐賀銀行	7,800	1,873.00	14,609,400	
琉球銀行	30,500	1,144.00	34,892,000	
セブン銀行	481,400	276.00	132,866,400	
みずほフィナンシャルグループ	1,944,500	2,105.00	4,093,172,500	
高知銀行	4,100	779.00	3,193,900	
山口フィナンシャルグループ	148,500	930.00	138,105,000	
芙蓉総合リース	12,400	9,350.00	115,940,000	
みずほリース	20,000	3,670.00	73,400,000	
東京センチュリー	25,100	4,605.00	115,585,500	
ＳＢＩホールディングス	194,600	2,952.00	574,459,200	
日本証券金融	54,000	1,048.00	56,592,000	
アイフル	222,600	374.00	83,252,400	
日本アジア投資	9,600	262.00	2,515,200	
長野銀行	3,700	1,558.00	5,764,600	
名古屋銀行	8,900	3,625.00	32,262,500	
北洋銀行	204,100	320.00	65,312,000	
大光銀行	3,500	1,287.00	4,504,500	
愛媛銀行	18,100	989.00	17,900,900	
トマト銀行	4,000	1,128.00	4,512,000	
京葉銀行	62,500	661.00	41,312,500	
栃木銀行	61,600	340.00	20,944,000	
北日本銀行	4,700	2,182.00	10,255,400	
東和銀行	24,900	625.00	15,562,500	
福島銀行	12,800	251.00	3,212,800	
大東銀行	4,600	738.00	3,394,800	
リコーリース	12,700	4,060.00	51,562,000	

イオンフィナンシャルサービス	77,100	1,303.00	100,461,300	
アコム	240,200	340.00	81,668,000	
ジャックス	14,300	4,410.00	63,063,000	
オリエントコーポレーション	35,100	1,173.00	41,172,300	
オリックス	882,500	2,428.00	2,142,710,000	
三菱ＨＣキャピタル	523,800	714.00	373,993,200	
ジャフコ　グループ	44,900	2,166.00	97,253,400	
九州リースサービス	5,600	948.00	5,308,800	
トモニホールディングス	109,000	404.00	44,036,000	
大和証券グループ本社	961,300	652.00	626,767,600	
野村ホールディングス	2,476,600	571.00	1,414,138,600	
岡三証券グループ	118,400	438.00	51,859,200	
丸三証券	44,700	439.00	19,623,300	
東洋証券	44,600	345.00	15,387,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	146,200	382.00	55,848,400	
光世証券	2,700	383.00	1,034,100	
水戸証券	36,200	305.00	11,041,000	
いちよし証券	24,600	646.00	15,891,600	
松井証券	79,500	816.00	64,872,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	230,700	5,905.00	1,362,283,500	
日本取引所グループ	377,700	2,036.50	769,186,050	
マネックスグループ	150,100	503.00	75,500,300	
極東証券	16,800	656.00	11,020,800	
岩井コスモホールディングス	15,300	1,383.00	21,159,900	
アイザワ証券グループ	19,400	699.00	13,560,600	
フィデアホールディングス	13,800	1,529.00	21,100,200	
池田泉州ホールディングス	170,800	266.00	45,432,800	
アニコム　ホールディングス	45,700	557.00	25,454,900	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	273,600	4,503.00	1,232,020,800	
マネーパートナーズグループ	12,500	254.00	3,175,000	
スパークス・グループ	15,000	1,601.00	24,015,000	
小林洋行	2,800	240.00	672,000	
第一生命ホールディングス	684,500	2,883.00	1,973,413,500	
東京海上ホールディングス	1,353,800	2,903.50	3,930,758,300	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,700	468.00	2,667,600	
イー・ギャランティ	21,700	2,266.00	49,172,200	
アサックス	5,500	659.00	3,624,500	
ＮＥＣキャピタルソリューション	6,700	2,691.00	18,029,700	
Ｔ＆Ｄホールディングス	360,900	2,048.00	739,123,200	
アドバンスクリエイト	7,800	1,205.00	9,399,000	
三井不動産	584,300	2,554.00	1,492,302,200	
三菱地所	811,200	1,666.00	1,351,459,200	
平和不動産	21,800	3,625.00	79,025,000	
東京建物	128,100	1,631.00	208,931,100	
京阪神ビルディング	16,900	1,193.00	20,161,700	
住友不動産	243,000	3,176.00	771,768,000	
太平洋興発	4,400	1,050.00	4,620,000	
テーオーシー	24,500	645.00	15,802,500	

東京楽天地	2,400	4,400.00	10,560,000	
レオパレス２１	151,400	320.00	48,448,000	
スターツコーポレーション	19,300	2,585.00	49,890,500	
フジ住宅	18,800	689.00	12,953,200	
空港施設	16,200	543.00	8,796,600	
明和地所	6,100	945.00	5,764,500	
ゴールドクレスト	12,800	1,702.00	21,785,600	
リログループ	78,100	2,140.00	167,134,000	
エスリード	6,400	2,132.00	13,644,800	
日神グループホールディングス	21,700	476.00	10,329,200	
日本エスコン	30,300	853.00	25,845,900	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	67,700	382.00	25,861,400	
ＡＶＡＮＴＩＡ	5,900	790.00	4,661,000	
イオンモール	69,700	1,774.00	123,647,800	
毎日コムネット	4,500	735.00	3,307,500	
ファースト住建	5,000	1,113.00	5,565,000	
ランド	810,900	10.00	8,109,000	
カチタス	36,100	2,644.00	95,448,400	
東祥	9,800	1,143.00	11,201,400	
トーセイ	22,300	1,480.00	33,004,000	
穴吹興産	2,400	2,240.00	5,376,000	
サンフロンティア不動産	22,400	1,255.00	28,112,000	
ＦＪネクストホールディングス	14,100	1,015.00	14,311,500	
インテリックス	3,100	564.00	1,748,400	
ランドビジネス	4,400	229.00	1,007,600	
サンネクスタグループ	3,600	999.00	3,596,400	
グランディハウス	10,100	594.00	5,999,400	
東武鉄道	150,000	3,030.00	454,500,000	
相鉄ホールディングス	45,100	2,287.00	103,143,700	
東急	382,700	1,645.00	629,541,500	
京浜急行電鉄	154,800	1,262.00	195,357,600	
小田急電鉄	206,900	1,633.00	337,867,700	
京王電鉄	72,200	4,660.00	336,452,000	
京成電鉄	88,000	3,860.00	339,680,000	
富士急行	16,800	4,145.00	69,636,000	
東日本旅客鉄道	231,600	6,900.00	1,598,040,000	
西日本旅客鉄道	174,300	5,281.00	920,478,300	
東海旅客鉄道	105,200	15,270.00	1,606,404,000	
西武ホールディングス	165,100	1,365.00	225,361,500	
鴻池運輸	23,300	1,505.00	35,066,500	
西日本鉄道	36,400	2,367.00	86,158,800	
ハマキョウレックス	10,700	3,210.00	34,347,000	
サカイ引越センター	6,500	4,480.00	29,120,000	
近鉄グループホールディングス	136,300	4,130.00	562,919,000	
阪急阪神ホールディングス	181,700	3,855.00	700,453,500	
南海電気鉄道	65,100	2,745.00	178,699,500	
京阪ホールディングス	56,300	3,320.00	186,916,000	
神戸電鉄	3,700	3,170.00	11,729,000	
名古屋鉄道	150,600	2,062.00	310,537,200	
山陽電気鉄道	10,300	2,202.00	22,680,600	

アルプス物流	10,900	1,292.00	14,082,800	
トランコム	3,900	6,680.00	26,052,000	
ヤマトホールディングス	174,500	2,323.00	405,363,500	
山九	34,700	5,040.00	174,888,000	
日新	10,300	2,116.00	21,794,800	
丸運	6,500	226.00	1,469,000	
丸全昭和運輸	8,500	3,090.00	26,265,000	
センコーグループホールディングス	72,200	967.00	69,817,400	
トナミホールディングス	2,500	4,010.00	10,025,000	
ニッコンホールディングス	43,700	2,484.00	108,550,800	
日本石油輸送	800	2,388.00	1,910,400	
福山通運	10,400	3,415.00	35,516,000	
セイノーホールディングス	84,900	1,423.00	120,812,700	
エスライン	3,700	847.00	3,133,900	
神奈川中央交通	3,900	3,265.00	12,733,500	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	32,900	1,793.00	58,989,700	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	13,200	1,230.00	16,236,000	
日本郵船	364,600	3,642.00	1,327,873,200	
商船三井	240,200	3,635.00	873,127,000	
川崎汽船	116,100	3,405.00	395,320,500	
ＮＳユナイテッド海運	7,300	4,500.00	32,850,000	
明治海運	11,800	726.00	8,566,800	
飯野海運	50,000	1,068.00	53,400,000	
共栄タンカー	2,200	983.00	2,162,600	
九州旅客鉄道	96,300	2,965.00	285,529,500	
ＳＧホールディングス	261,600	2,003.00	523,984,800	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	50,900	7,660.00	389,894,000	
日本航空	334,800	2,566.00	859,096,800	
ＡＮＡホールディングス	370,800	2,781.00	1,031,194,800	
ビーウィズ	2,700	1,550.00	4,185,000	
パスコ	2,500	1,413.00	3,532,500	
ＴＲＥホールディングス	29,500	1,501.00	44,279,500	
人・夢・技術グループ	6,300	1,556.00	9,802,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,600	3,570.00	12,852,000	
シルバーライフ	3,300	1,908.00	6,296,400	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,815.00	1,815,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,300	3,930.00	24,759,000	
コーア商事ホールディングス	8,200	667.00	5,469,400	
ＫＰＰグループホールディングス	33,600	756.00	25,401,600	
ナルミヤ・インターナショナル	2,100	912.00	1,915,200	
ブックオフグループホールディングス	8,400	1,292.00	10,852,800	
ギフトホールディングス	3,100	4,155.00	12,880,500	
三菱倉庫	29,300	3,175.00	93,027,500	
三井倉庫ホールディングス	12,700	4,030.00	51,181,000	
住友倉庫	37,500	2,152.00	80,700,000	
澁澤倉庫	5,500	2,262.00	12,441,000	
ヤマタネ	6,400	1,707.00	10,924,800	
東陽倉庫	16,400	298.00	4,887,200	

乾汽船	17,300	2,147.00	37,143,100	
日本トランスシティ	27,600	589.00	16,256,400	
ケイヒン	2,200	1,618.00	3,559,600	
中央倉庫	6,700	1,017.00	6,813,900	
川西倉庫	2,100	1,024.00	2,150,400	
安田倉庫	9,500	1,029.00	9,775,500	
ファイズホールディングス	2,300	1,182.00	2,718,600	
大栄環境	26,700	1,832.00	48,914,400	
東洋埠頭	3,500	1,441.00	5,043,500	
上組	65,300	2,689.00	175,591,700	
サンリツ	2,800	751.00	2,102,800	
キムラユニティー	5,900	1,066.00	6,289,400	
キユーソー流通システム	7,300	967.00	7,059,100	
東海運	7,500	294.00	2,205,000	
エーアイテイー	8,600	1,512.00	13,003,200	
内外トランスライン	5,000	2,247.00	11,235,000	
ショーエイコーポレーション	3,800	571.00	2,169,800	
日本コンセプト	4,200	1,403.00	5,892,600	
ＴＢＳホールディングス	70,200	1,832.00	128,606,400	
日本テレビホールディングス	121,300	1,152.00	139,737,600	
朝日放送グループホールディングス	13,000	685.00	8,905,000	
テレビ朝日ホールディングス	33,300	1,502.00	50,016,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	121,300	530.00	64,289,000	
テレビ東京ホールディングス	9,800	2,320.00	22,736,000	
日本ＢＳ放送	4,400	915.00	4,026,000	
ビジョン	18,100	1,565.00	28,326,500	
スマートバリュー	3,000	461.00	1,383,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	12,300	2,468.00	30,356,400	
ワイヤレスゲート	5,500	268.00	1,474,000	
日本通信	126,200	222.00	28,016,400	
クロップス	2,100	1,162.00	2,440,200	
日本電信電話	1,754,400	3,966.00	6,957,950,400	
ＫＤＤＩ	1,058,000	4,011.00	4,243,638,000	
ソフトバンク	2,199,300	1,542.00	3,391,320,600	
光通信	16,100	19,790.00	318,619,000	
エムティーアイ	12,500	542.00	6,775,000	
GMOインターネットグループ	50,900	2,494.00	126,944,600	
ファイバーゲート	7,300	872.00	6,365,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,100	288.00	892,800	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	72,300	2,676.00	193,474,800	
学研ホールディングス	22,800	889.00	20,269,200	
ゼンリン	23,300	849.00	19,781,700	
昭文社ホールディングス	5,600	296.00	1,657,600	
インプレスホールディングス	10,800	201.00	2,170,800	
東京電力ホールディングス	1,230,600	456.00	561,153,600	
中部電力	503,100	1,429.00	718,929,900	
関西電力	527,100	1,293.00	681,540,300	
中国電力	217,400	683.00	148,484,200	

北陸電力	128,700	554.00	71,299,800	
東北電力	333,700	656.00	218,907,200	
四国電力	116,500	740.00	86,210,000	
九州電力	315,000	734.00	231,210,000	
北海道電力	131,700	479.00	63,084,300	
沖縄電力	31,900	1,052.00	33,558,800	
電源開発	102,800	2,223.00	228,524,400	
エフオン	8,900	611.00	5,437,900	
イーレックス	24,300	1,917.00	46,583,100	
レノバ	36,300	2,105.00	76,411,500	
東京瓦斯	288,600	2,600.00	750,360,000	
大阪瓦斯	276,600	2,210.00	611,286,000	
東邦瓦斯	53,800	2,614.00	140,633,200	
北海道瓦斯	8,200	1,837.00	15,063,400	
広島ガス	28,800	351.00	10,108,800	
西部ガスホールディングス	12,800	1,805.00	23,104,000	
静岡ガス	31,200	1,148.00	35,817,600	
メタウォーター	17,000	1,661.00	28,237,000	
アイネット	8,400	1,266.00	10,634,400	
松竹	7,800	10,640.00	82,992,000	
東宝	85,700	4,675.00	400,647,500	
エイチ・アイ・エス	36,700	2,013.00	73,877,100	
東映	3,800	16,800.00	63,840,000	
ラックランド	4,400	2,882.00	12,680,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	429,600	1,861.00	799,485,600	
共立メンテナンス	24,000	5,300.00	127,200,000	
イチネンホールディングス	15,000	1,296.00	19,440,000	
建設技術研究所	7,200	3,530.00	25,416,000	
スペース	10,000	897.00	8,970,000	
アインホールディングス	19,900	5,600.00	111,440,000	
燦ホールディングス	6,000	2,080.00	12,480,000	
ピー・シー・エー	7,800	1,265.00	9,867,000	
スバル興業	600	9,220.00	5,532,000	
東京テアトル	4,600	1,146.00	5,271,600	
タナベコンサルティンググループ	5,000	875.00	4,375,000	
ビジネスブレイン太田昭和	5,900	2,044.00	12,059,600	
ナガワ	3,700	7,610.00	28,157,000	
東京都競馬	11,800	3,765.00	44,427,000	
常磐興産	4,300	1,233.00	5,301,900	
カナモト	25,700	2,299.00	59,084,300	
ＤＴＳ	29,100	3,115.00	90,646,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	68,800	6,030.00	414,864,000	
シーイーシー	19,200	1,467.00	28,166,400	
カプコン	136,000	4,265.00	580,040,000	
西尾レントオール	13,000	3,170.00	41,210,000	
アイ・エス・ビー	7,000	1,286.00	9,002,000	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	70,200	26.00	1,825,200	
日本空港ビルデング	47,600	6,470.00	307,972,000	

トランス・コスモス	17,400	3,395.00	59,073,000	
乃村工藝社	61,200	877.00	53,672,400	
ジャステック	8,400	1,243.00	10,441,200	
ＳＣＳＫ	111,700	1,955.00	218,373,500	
藤田観光	6,200	3,270.00	20,274,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,400	1,679.00	14,103,600	
日本管財	14,800	2,582.00	38,213,600	
トーカイ	12,500	1,920.00	24,000,000	
白洋舎	1,100	1,609.00	1,769,900	
セコム	142,900	7,921.00	1,131,910,900	
ＮＳＷ	5,400	2,110.00	11,394,000	
セントラル警備保障	7,500	2,473.00	18,547,500	
アイネス	9,500	1,351.00	12,834,500	
丹青社	27,000	714.00	19,278,000	
メイテック	55,900	2,413.00	134,886,700	
ＴＫＣ	24,600	3,665.00	90,159,000	
富士ソフト	15,500	7,890.00	122,295,000	
応用地質	13,100	2,028.00	26,566,800	
船井総研ホールディングス	29,500	2,771.00	81,744,500	
ＮＳＤ	48,800	2,292.00	111,849,600	
進学会ホールディングス	4,200	304.00	1,276,800	
丸紅建材リース	800	2,017.00	1,613,600	
オオバ	7,900	726.00	5,735,400	
コナミグループ	58,600	6,000.00	351,600,000	
いであ	2,800	1,571.00	4,398,800	
学究社	5,600	2,037.00	11,407,200	
ベネッセホールディングス	52,300	2,009.00	105,070,700	
イオンディライト	15,500	2,975.00	46,112,500	
ナック	6,500	973.00	6,324,500	
福井コンピュータホールディングス	9,500	2,757.00	26,191,500	
ダイセキ	28,700	4,070.00	116,809,000	
ステップ	5,800	1,825.00	10,585,000	
日鉄物産	9,900	9,260.00	91,674,000	
泉州電業	7,200	3,590.00	25,848,000	
元気寿司	4,100	3,090.00	12,669,000	
トラスコ中山	30,300	2,230.00	67,569,000	
ヤマダホールディングス	592,400	485.00	287,314,000	
オートバックスセブン	50,200	1,449.00	72,739,800	
モリト	10,400	1,022.00	10,628,800	
アークランズ	21,200	1,445.00	30,634,000	
ニトリホールディングス	58,400	15,310.00	894,104,000	
グルメ杵屋	11,800	1,015.00	11,977,000	
愛眼	7,600	167.00	1,269,200	
ケーユーホールディングス	8,500	1,451.00	12,333,500	
吉野家ホールディングス	56,400	2,327.00	131,242,800	
加藤産業	17,500	3,615.00	63,262,500	
北恵	2,900	716.00	2,076,400	
イノテック	9,100	1,410.00	12,831,000	
イエローハット	25,500	1,783.00	45,466,500	
松屋フーズホールディングス	6,800	3,970.00	26,996,000	

ＪＢＣＣホールディングス	9,900	1,987.00	19,671,300	
ＪＫホールディングス	11,400	1,124.00	12,813,600	
サガミホールディングス	23,200	1,273.00	29,533,600	
日伝	8,600	1,945.00	16,727,000	
関西フードマーケット	13,000	1,385.00	18,005,000	
ミロク情報サービス	12,500	1,785.00	22,312,500	
北沢産業	7,100	271.00	1,924,100	
杉本商事	6,200	1,974.00	12,238,800	
因幡電機産業	37,400	2,826.00	105,692,400	
王将フードサービス	9,500	6,050.00	57,475,000	
ミニストップ	10,400	1,400.00	14,560,000	
アークス	26,500	2,191.00	58,061,500	
バローホールディングス	27,600	2,002.00	55,255,200	
東テク	4,900	4,490.00	22,001,000	
ミスミグループ本社	217,900	3,150.00	686,385,000	
アルテック	7,100	314.00	2,229,400	
ベルク	7,200	5,480.00	39,456,000	
大　庄	6,900	1,025.00	7,072,500	
タキヒヨー	3,100	999.00	3,096,900	
ファーストリテイリング	65,100	26,735.00	1,740,448,500	
ソフトバンクグループ	791,600	5,469.00	4,329,260,400	
蔵王産業	2,200	2,050.00	4,510,000	
スズケン	44,900	3,470.00	155,803,000	
サンドラッグ	54,800	3,680.00	201,664,000	
サックスバー　ホールディングス	13,700	763.00	10,453,100	
ジェコス	9,400	883.00	8,300,200	
ヤマザワ	2,300	1,291.00	2,969,300	
やまや	2,800	2,636.00	7,380,800	
グローセル	15,400	419.00	6,452,600	
ベルーナ	33,800	692.00	23,389,600	
合計	159,800,500		390,898,786,050	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年2月27日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,320,422,738
国債証券	436,498,245,300
地方債証券	32,363,403,848
特殊債券	30,191,787,558
社債券	25,447,634,830
未収入金	350,168,000
未収利息	757,654,073
前払費用	334,676,586
流動資産合計	527,263,992,933
資産合計	527,263,992,933
負債の部	
流動負債	
未払解約金	799,302,000
流動負債合計	799,302,000
負債合計	799,302,000
純資産の部	
元本等	
元本	424,094,237,578
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	102,370,453,355
元本等合計	526,464,690,933
純資産合計	526,464,690,933
負債純資産合計	527,263,992,933

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2月26日 至　2023年2月27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2月27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	481,096,291,502円
同期中追加設定元本額	1,142,273,586,255円
同期中一部解約元本額	1,199,275,640,179円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	25,732,787,968円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	57,586,017円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	103,700,225円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	62,885,905円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	754,422,213円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	180,875,125円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	51,325,733円
たわらノーロード　国内債券	17,632,508,826円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,888,112,862円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,256,521,902円
たわらノーロード　バランス（標準型）	2,241,650,466円
たわらノーロード　バランス（積極型）	291,857,561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）	132,329,722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）	1,738,190,419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）	1,833,446,174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）	508,599,896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）	26,635,918円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	18,875,773円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	155,520,321円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,930,043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＞	13,860,809,396円
Ｏｎｅグローバルバランス	30,192,066円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	9,805,521,036円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	13,822,092,050円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	5,870,626,977円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,359,050,134円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,431,084,042円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	412,257,005円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	97,387,528円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	3,564,928,239円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	13,441,521円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	4,637,037,970円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,970,911,409円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	377,779,353円
投資のソムリエ	80,243,319,715円
クルーズコントロール	973,146,033円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	5,911,038,890円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	5,610,654,070円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,339,897,741円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	6,499,330,383円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	27,485,903,692円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	470,764,235円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	236,380,237円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	45,753,552円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,970,386,655円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,469,765,237円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	11,811,390,919円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,499,704,588円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	663,974,989円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	253,415,299円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	155,546,201円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,277,065,219円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	33,649,224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）	1,914,336,025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）	1,960,133,241円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,522,865,115円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	1,197,551,351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）	1,891,634,761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）	4,894,240,933円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	1,872,779,890円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	1,707,158,852円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	1,920,698,394円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	9,122,704,518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）	2,161,052,848円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	572,870,714円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	262,362,220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）	3,260,977,468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）	41,605,092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）	74,795,895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）	146,999,752円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	96,492,643円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,332,957円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	72,848,637円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,734,823円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	327,700円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,873,600円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,055,264円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,005,729,282円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,096,139,778円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,132,430,121円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	64,082,448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）	143,932,786円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,802,860,977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）	128,439,182円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	532,578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）	1,985,448,216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）	43,566,296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）	293,969,678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）	444,193,606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）	770,619,222円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	249,593,873円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	95,752,506円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	905,339,373円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	366,377,124円
コア資産形成ファンド	245,142,281円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	21,934,729,621円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	47,766,276,797円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	11,308,736,688円
ＭＨＡＭ動的パッケージ４資産ファンド［適格機関投資家限定］	1,689,593,873円
計	424,094,237,578円
２．　受益権の総数	424,094,237,578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2月26日 至　2023年2月27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2月27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2月27日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	114,089,000
地方債証券	△46,699,316
特殊債券	△12,854,650
社債券	△56,147,450
合計	△1,612,416

（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2月27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2月27日現在
1口当たり純資産額	1.2414円

（1万口当たり純資産額）	(12,414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2月27日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４３５回　利付国庫債券（２年）	3,720,000,000	3,723,236,400	
	４３６回　利付国庫債券（２年）	6,100,000,000	6,105,307,000	
	４３７回　利付国庫債券（２年）	3,850,000,000	3,853,349,500	
	４３８回　利付国庫債券（２年）	3,800,000,000	3,803,534,000	
	４３９回　利付国庫債券（２年）	1,300,000,000	1,301,196,000	
	４４０回　利付国庫債券（２年）	1,700,000,000	1,701,530,000	
	４４１回　利付国庫債券（２年）	1,100,000,000	1,101,045,000	
	４４２回　利付国庫債券（２年）	1,500,000,000	1,501,380,000	
	４４３回　利付国庫債券（２年）	2,500,000,000	2,502,175,000	
	４４４回　利付国庫債券（２年）	3,100,000,000	3,102,542,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	6,990,000,000	7,005,028,500	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	2,810,000,000	2,816,772,100	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	2,930,000,000	2,937,412,900	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	3,100,000,000	3,108,277,000	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	3,230,000,000	3,238,914,800	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	2,650,000,000	2,657,446,500	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	2,900,000,000	2,907,714,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	4,250,000,000	4,248,045,000	
	１４８回　利付国庫債券（５年）	3,310,000,000	3,306,160,400	
	１４９回　利付国庫債券（５年）	5,010,000,000	4,998,426,900	

１５０回　利付国庫債券（５年）	4,720,000,000	4,702,960,800	
１５１回　利付国庫債券（５年）	700,000,000	696,465,000	
１５２回　利付国庫債券（５年）	1,030,000,000	1,028,743,400	
１５３回　利付国庫債券（５年）	5,310,000,000	5,274,794,700	
１５４回　利付国庫債券（５年）	4,300,000,000	4,282,499,000	
１５５回　利付国庫債券（５年）	1,300,000,000	1,305,564,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	133,245,200	
２回　利付国庫債券（４０年）	630,000,000	736,766,100	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	632,210,400	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	844,524,000	
５回　利付国庫債券（４０年）	710,000,000	804,628,800	
６回　利付国庫債券（４０年）	1,040,000,000	1,153,651,200	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,210,000,000	1,283,011,400	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,190,000,000	1,171,840,600	
９回　利付国庫債券（４０年）	1,950,000,000	1,409,050,500	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,470,000,000	1,250,058,600	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,380,000,000	1,130,785,800	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,440,000,000	1,053,720,000	
１３回　利付国庫債券（４０年）	1,590,000,000	1,160,191,200	
１４回　利付国庫債券（４０年）	1,620,000,000	1,264,669,200	
１５回　利付国庫債券（４０年）	1,540,000,000	1,310,031,800	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	4,420,000,000	4,458,409,800	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	4,610,000,000	4,649,876,500	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,029,310,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,900,000,000	1,911,685,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	5,430,000,000	5,478,001,200	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	5,980,000,000	6,037,946,200	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	3,040,000,000	3,071,889,600	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	4,420,000,000	4,456,597,600	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	4,520,000,000	4,531,028,800	

３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,690,000,000	4,699,286,200	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	5,570,000,000	5,575,904,200	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	3,440,000,000	3,440,000,000	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	4,690,000,000	4,684,278,200	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	5,130,000,000	5,116,815,900	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	4,970,000,000	4,949,772,100	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	4,250,000,000	4,227,730,000	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	5,860,000,000	5,818,980,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	2,580,000,000	2,557,038,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	4,260,000,000	4,213,395,600	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	4,510,000,000	4,452,136,700	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	4,200,000,000	4,136,496,000	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	3,630,000,000	3,566,293,500	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	4,500,000,000	4,412,295,000	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	3,720,000,000	3,639,982,800	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	3,750,000,000	3,662,737,500	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	5,070,000,000	4,940,968,500	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	5,200,000,000	5,048,472,000	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	4,620,000,000	4,471,005,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	3,210,000,000	3,098,580,900	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	5,070,000,000	4,880,990,400	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	3,650,000,000	3,508,562,500	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	4,330,000,000	4,159,311,400	
３６６回　利付国庫債券（１０年）	2,780,000,000	2,698,379,200	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	2,955,420,000	

３６８回　利付国庫債券（１０年）	3,750,000,000	3,732,487,500	
３６９回　利付国庫債券（１０年）	1,320,000,000	1,320,000,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	127,075,300	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	113,577,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	236,144,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	231,096,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	275,222,500	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	262,432,300	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	169,678,500	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	399,102,200	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	308,227,400	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	284,824,800	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	317,806,200	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	466,476,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	326,872,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	393,122,400	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	362,337,300	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	346,431,100	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	418,537,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	470,000,000	562,571,200	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	386,740,200	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	735,109,200	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	744,334,800	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	924,754,600	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,020,725,400	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,031,835,200	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	833,853,600	

３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,137,974,900	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,329,435,200	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,389,408,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,644,763,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,544,757,200	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,660,000,000	1,842,600,000	
３８回　利付国庫債券（３０年）	1,550,000,000	1,692,119,500	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,442,688,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,130,000,000	1,233,666,200	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,270,000,000	1,363,243,400	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,420,000,000	1,523,958,200	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,350,000,000	1,448,550,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	590,000,000	632,934,300	
４５回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	620,916,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,670,000,000	1,727,247,600	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,560,000,000	1,642,336,800	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,480,000,000	1,500,572,000	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,490,000,000	1,509,563,700	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,303,896,800	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,390,000,000	1,100,046,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,430,000,000	1,184,154,400	
５３回　利付国庫債券（３０年）	810,000,000	685,114,200	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,450,000,000	1,281,901,500	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	987,380,800	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,195,576,000	

５７回　利付国庫債券（３０年）	1,430,000,000	1,253,538,000	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,540,000,000	1,346,129,400	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,038,110,200	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,159,093,000	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,140,000,000	964,029,600	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	895,910,400	
６３回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	464,976,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,030,000,000	795,911,900	
６５回　利付国庫債券（３０年）	950,000,000	732,687,500	
６６回　利付国庫債券（３０年）	990,000,000	760,656,600	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,570,000,000	1,271,637,200	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,470,000,000	1,187,715,900	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,530,000,000	1,269,869,400	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,410,000,000	1,167,663,300	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,156,764,000	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,490,000,000	1,233,168,700	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,490,000,000	1,231,634,000	
７４回　利付国庫債券（３０年）	1,520,000,000	1,362,072,000	
７５回　利付国庫債券（３０年）	1,620,000,000	1,566,799,200	
７６回　利付国庫債券（３０年）	1,520,000,000	1,505,818,400	
７７回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	621,312,000	
６７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,042,000	
７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,612,000	
７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,184,800	
７２回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	475,465,200	

７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	394,025,800	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,548,800	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	187,882,200	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	72,777,600	
７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,669,200	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	261,077,500	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,330,500	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	94,402,800	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	420,576,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	147,560,000	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	74,117,400	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	179,521,700	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	627,465,000	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	128,352,000	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	127,986,000	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	634,031,700	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,713,300	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	505,536,700	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	118,707,600	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,248,241,200	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	397,986,800	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	723,378,900	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	600,468,000	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	129,985,200	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	720,119,400	

９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	173,851,200	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	817,860,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	911,696,900	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	254,936,600	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	556,010,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	177,084,800	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	120,594,100	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	703,564,800	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	552,395,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	661,272,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	752,589,900	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	382,389,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	485,940,400	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	512,035,200	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	819,150,400	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,520,782,200	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	410,000,000	456,194,700	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	402,944,400	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	595,046,900	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,193,980,900	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	616,505,100	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	515,430,200	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	725,013,700	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	706,547,200	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	625,107,600	

１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,176,682,500	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	667,884,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	678,450,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	568,568,400	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	597,839,400	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	410,167,200	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,003,793,700	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	910,186,300	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,138,160,300	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	996,597,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	142,771,200	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	392,263,200	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	1,880,000,000	2,067,736,800	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	1,020,000,000	1,103,344,200	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	981,927,000	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	1,450,000,000	1,597,073,500	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,167,462,800	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	1,530,000,000	1,699,279,200	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,730,000,000	1,887,776,000	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	1,450,000,000	1,568,537,500	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,850,000,000	3,137,536,500	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	2,340,000,000	2,575,123,200	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	2,890,000,000	3,149,753,200	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	2,060,000,000	2,222,245,600	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,640,000,000	2,844,890,400	

１５０回　利付国庫債券（２０年）	2,700,000,000	2,877,471,000	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	2,660,000,000	2,771,799,800	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	2,440,000,000	2,538,917,600	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	2,700,000,000	2,836,944,000	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	2,530,000,000	2,624,520,800	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,680,000,000	2,712,320,800	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	2,240,000,000	2,098,118,400	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	2,060,000,000	1,871,942,600	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,480,000,000	2,338,912,800	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	1,340,000,000	1,276,510,800	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	1,340,000,000	1,290,460,200	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	1,440,000,000	1,363,636,800	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	2,170,000,000	2,047,959,200	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,240,000,000	2,106,764,800	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,540,000,000	2,344,674,000	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	1,550,000,000	1,425,349,000	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	1,680,000,000	1,586,508,000	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	1,850,000,000	1,688,014,000	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	1,890,000,000	1,689,867,900	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	2,060,000,000	1,804,683,600	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	1,482,502,000	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,940,000,000	1,685,161,600	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,480,000,000	1,303,140,000	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,220,000,000	1,947,339,600	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	2,170,000,000	1,896,211,100	

	１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,330,000,000	2,064,915,900	
	１７６回　利付国庫債券（２０年）	2,100,000,000	1,854,321,000	
	１７７回　利付国庫債券（２０年）	2,050,000,000	1,771,917,500	
	１７８回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,229,774,000	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	2,150,000,000	1,882,927,000	
	１８０回　利付国庫債券（２０年）	1,740,000,000	1,608,351,600	
	１８１回　利付国庫債券（２０年）	2,000,000,000	1,879,420,000	
	１８２回　利付国庫債券（２０年）	1,980,000,000	1,924,243,200	
	１８３回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	817,752,000	
国債証券　合計		440,315,000,000	436,498,245,300	
地方債証券	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,487,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	108,935,200	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	193,230,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	386,996,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	288,093,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	226,000,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	111,422,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	104,145,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	105,244,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	215,000,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	322,677,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	110,077,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	110,559,000	
	３１回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	205,992,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,564,000	
	３０年度８回　北海道公募公債	400,000,000	395,692,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	393,524,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	95,437,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	239,802,500	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	301,986,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	100,912,000	
	２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	196,206,000	
	２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	191,706,000	

２５８回　神奈川県公募公債　１０年	300,000,000	286,368,000	
3回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	119,303,000	
１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	109,521,000	
１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	331,380,000	
１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	108,751,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,294,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,672,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	190,076,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	190,844,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	189,956,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	188,818,000	
４７４回　大阪府公募公債　１０年	300,000,000	283,509,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	217,720,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	101,813,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	92,935,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	297,336,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	352,569,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	108,408,348	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	386,788,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	192,026,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	201,472,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	193,186,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	95,584,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	116,063,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	210,086,000	
１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	304,176,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	314,082,000	

９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	102,961,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	101,729,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	193,356,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	96,042,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	190,810,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,787,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,851,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	202,952,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	105,282,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	330,726,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	331,116,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	112,517,000	
２６年度４回　愛知県公募公債　２０年	200,000,000	212,854,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	153,421,500	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	100,961,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	195,282,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	222,399,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	98,960,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	191,938,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	85,040,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	86,812,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	403,160,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	193,882,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	178,574,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	228,288,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	110,701,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	106,944,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	319,536,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	101,988,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	99,977,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	196,940,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	193,710,000	

令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	95,928,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,675,000	
令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	151,036,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	108,938,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	110,972,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	323,037,000	
２７年度４回　千葉県公募公債	200,000,000	202,408,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	99,831,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	189,140,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	102,387,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	101,542,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	91,600,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	191,424,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	106,285,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,545,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	403,148,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	606,126,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,435,000	
１５０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,081,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,953,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,716,800	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,370,000	
１６０回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,885,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,925,000	
１６９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,750,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,404,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,233,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,444,000	

１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	496,930,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,524,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	292,398,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	484,850,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,543,000	
２２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	477,050,000	
２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	474,770,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	98,388,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	100,784,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	191,618,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	100,775,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	100,489,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	198,514,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	289,707,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	219,750,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	453,811,500	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	192,672,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	106,183,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	102,210,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	108,176,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	221,602,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	217,050,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	100,772,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	296,886,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	160,150,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	386,544,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	116,789,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	109,051,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	106,300,000	
２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	111,959,000	

	２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	100,647,000	
	２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	278,094,000	
	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	197,174,000	
	６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	220,368,000	
	５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	112,148,000	
	６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	108,764,000	
	１１回　北九州市公募公債　２０年	300,000,000	330,189,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	106,019,000	
	２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	114,902,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	185,518,000	
	２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	85,597,000	
	２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	100,674,000	
	２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	186,134,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	298,011,000	
	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	93,126,000	
	令和３年度３回　仙台市公募公債　５年	300,000,000	297,267,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	193,644,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	191,618,000	
	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	100,739,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	100,695,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	195,692,000	
地方債証券　合計		32,439,330,000	32,363,403,848	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	206,736,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	204,410,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	298,587,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	426,410,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,732,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	78,306,000	
	１５６回　日本政策投資銀行債券	400,000,000	380,552,000	
	３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,226,000	
	１回　高速道路機構債	300,000,000	377,406,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	182,365,500	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	236,868,000	
	３６回　高速道路機構債	300,000,000	370,620,000	
	５０回　高速道路機構債	300,000,000	265,641,000	

７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,337,000	
１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,839,000	
１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,639,000	
１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,552,000	
１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,553,000	
１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,458,000	
１６９回　高速道路機構債	100,000,000	92,560,000	
１７２回　高速道路機構債	200,000,000	179,154,000	
２１０回　高速道路機構債	100,000,000	91,769,000	
９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,471,000	
１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,043,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	544,420,000	
１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,602,000	
１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,391,000	
２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,806,000	
２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	201,662,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	307,437,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	504,125,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,674,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,936,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	199,648,000	
第２６２回　政保道路債	500,000,000	507,230,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	97,572,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,166,000	
２８６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	181,840,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,686,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	797,168,000	

３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	188,008,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	92,821,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	228,732,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	152,310,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	159,200,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	161,428,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	590,150,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	217,304,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	330,609,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	331,062,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	110,458,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,731,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	217,060,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	107,987,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	217,420,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,806,000	
Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	326,823,000	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	106,162,000	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,373,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	522,040,000	
４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	298,836,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,724,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	205,292,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,855,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	398,740,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,641,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	93,457,000	

９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,060,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,609,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,360,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,002,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	250,416,000	
１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	224,712,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,095,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	217,232,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,735,290	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	105,380,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	102,963,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	203,170,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	156,934,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	107,202,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	100,820,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	219,158,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,654,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	385,080,500	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,719,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,695,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,778,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	269,495,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,588,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,926,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,640,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	297,147,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	297,222,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	90,989,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	495,680,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	495,680,000	

２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	29,481,000	29,543,794	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,416,000	45,054,702	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,028,000	10,049,760	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,395,000	48,500,500	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,716,000	28,767,975	
４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	9,766,000	9,785,434	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,224,000	16,937,693	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,085,000	106,181,705	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,752,000	160,403,311	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,513,000	22,336,517	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,489,000	19,239,653	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,674,000	22,447,545	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,728,000	23,527,343	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,955,000	28,861,301	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,544,000	70,206,877	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,310,000	32,152,239	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,252,000	37,864,795	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,866,000	38,497,226	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,647,000	42,272,954	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,218,000	43,574,548	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,571,000	48,110,546	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,967,000	54,829,582	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,873,000	57,070,918	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	213,474,000	206,196,671	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,432,000	70,324,228	

１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,120,000	70,139,584	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,281,000	70,224,605	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	225,873,000	218,326,583	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	226,248,000	218,544,255	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,450,000	148,099,198	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	230,445,000	221,911,621	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	229,833,000	221,329,179	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	397,340,000	383,822,492	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,465,000	76,677,367	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,727,000	77,970,827	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	262,260,000	248,556,915	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	350,088,000	333,010,707	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	269,238,000	256,293,036	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	276,114,000	262,912,989	
１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	838,701,000	795,382,093	
６回　沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	417,496,000	
２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,130,000	
い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,040,000	
い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,863,000	
い第８５１号　利付商工債	300,000,000	298,491,000	
い第８５４号　利付商工債	300,000,000	298,020,000	
い第８５５号　利付商工債	200,000,000	198,580,000	
３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	398,952,000	
３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	298,350,000	
１５回　国際協力機構債	100,000,000	108,926,000	
７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	197,336,000	
７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	294,846,000	
８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	298,815,000	
８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	397,216,000	
７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	100,733,000	
７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,790,000	

	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	190,496,000	
特殊債券　合計		30,178,559,000	30,191,787,558	
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	292,077,000	
	２回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,648,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,672,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	98,351,000	
	２５回　首都高速道路社債	100,000,000	99,836,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	397,932,000	
	１６回　成田国際空港社債	100,000,000	100,689,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	83,902,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	99,361,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	193,530,000	
	７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	297,492,000	
	８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,328,000	
	９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	198,210,000	
	９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	494,730,000	
	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	100,930,000	
	３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	298,932,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	199,564,000	
	６１回　西日本高速道路債券	500,000,000	495,660,000	
	６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	494,725,000	
	２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	198,452,000	
	１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	100,739,000	
	３回　ダイドーグループＨＤ社債	300,000,000	290,991,000	
	９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	93,266,000	
	１２回　セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,158,000	
	１４回　セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,274,000	
	３０回　東レ社債	300,000,000	298,389,000	
	４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	198,784,000	
	４９回　住友化学社債	100,000,000	100,828,000	
	２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	183,350,000	
	４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,130,000	
	１７回　ダイセル社債	300,000,000	290,307,000	
	１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	470,195,000	

４回　住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,657,000	
４回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債	300,000,000	294,384,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	294,183,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	297,675,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	100,019,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	96,660,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	191,214,000	
２９回　三菱重工業社債	100,000,000	100,673,000	
５８回　川崎重工業社債	300,000,000	284,973,000	
５回　三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	97,897,000	
２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	198,668,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	91,648,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	388,592,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	398,356,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	107,552,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	105,941,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	296,430,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	200,992,000	
１１回　セブン銀行社債	200,000,000	201,098,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	296,520,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	296,982,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	388,432,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	297,405,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,021,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,409,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	190,974,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	284,172,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	97,298,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	197,794,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,154,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	192,074,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	295,488,000	
３回　野村ホールディングス社債	300,000,000	295,122,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	103,246,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	100,097,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	199,022,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	102,507,000	

４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	87,514,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	312,399,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	209,298,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	108,760,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,322,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	217,566,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	94,191,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,933,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	89,947,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,033,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	74,663,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,168,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	168,388,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	153,258,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,868,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	191,736,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	77,867,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	74,817,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	94,343,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	167,872,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,938,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	127,963,200	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	73,426,000	
７回　ニッコンＨＤ社債	300,000,000	289,014,000	
６回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	191,800,000	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	388,712,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	180,778,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	89,741,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	190,370,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	101,389,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	297,444,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	384,176,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	169,654,000	
５４１回　関西電力社債	300,000,000	278,064,000	
３９６回　中国電力社債	200,000,000	188,004,000	
４２５回　中国電力社債	100,000,000	94,919,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	101,914,000	
３１１回　北陸電力社債	100,000,000	100,740,000	
４８８回　東北電力社債	100,000,000	98,944,000	
５２１回　東北電力社債	400,000,000	381,748,000	
５２５回　東北電力社債	200,000,000	195,140,000	
５３６回　東北電力社債	300,000,000	276,603,000	
３２０回　四国電力社債	300,000,000	281,925,000	
４２８回　九州電力社債	100,000,000	100,935,000	
４６３回　九州電力社債	100,000,000	88,104,000	
４６６回　九州電力社債	100,000,000	86,927,000	
４９１回　九州電力社債	300,000,000	278,766,000	

	４９２回　九州電力社債	100,000,000	81,937,000	
	４９３回　九州電力社債	200,000,000	197,010,000	
	５０７回　九州電力社債	200,000,000	188,914,000	
	３２１回　北海道電力社債	261,000,000	263,826,630	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	297,147,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	175,736,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	207,738,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	98,405,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	185,378,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	180,322,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	85,267,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	81,783,000	
	５７回　東京瓦斯社債	300,000,000	206,331,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	198,218,000	
	８回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	183,446,000	
社債券　合計		26,381,000,000	25,447,634,830	
合計			524,501,071,536	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年2月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	13,380,057,053
コール・ローン	709,367,732
株式	807,379,101,023
投資信託受益証券	1,513,817,898
投資証券	17,286,550,891
派生商品評価勘定	91,457,962
未収入金	4,096,509
未収配当金	1,111,738,769
差入委託証拠金	5,966,966,536
流動資産合計	847,443,154,373
資産合計	847,443,154,373
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	332,249,600
未払解約金	345,254,000
流動負債合計	677,503,600
負債合計	677,503,600
純資産の部	
元本等	
元本	137,380,038,509
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	709,385,612,264
元本等合計	846,765,650,773
純資産合計	846,765,650,773
負債純資産合計	847,443,154,373

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2月26日 至　2023年2月27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2月27日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	110,324,823,154円
同期中追加設定元本額	64,623,240,707円
同期中一部解約元本額	37,568,025,352円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,360,156,308円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,537,466円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,392,849円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	26,223,986円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	20,134,515円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	14,285,405円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	21,312,714円
たわらノーロード　先進国株式	43,681,423,968円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	368,925,334円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	3,153,123,152円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	812,932,249円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	86,757,879円
たわらノーロード　バランス（標準型）	734,337,287円
たわらノーロード　バランス（積極型）	932,352,496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）	71,149,266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）	286,211,979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）	254,011,980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）	425,072,055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）	661,118円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	20,032,953円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,506,908円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,798,568円
たわらノーロード　全世界株式	617,803,860円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	55,258,100,085円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	2,776,443,631円
Ｏｎｅグローバルバランス	6,366,096円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	151,769,336円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	793,914,587円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,038,885,567円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	92,579,178円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	252,772,413円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	245,063,456円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,255,462円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	629,832,963円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	123,209,099円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	166,588,954円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	195,669,781円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	316,948,534円
投資のソムリエ	5,236,697,696円
クルーズコントロール	101,484,005円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	385,311,092円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	202,630,849円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	236,204,754円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	318,178,464円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,347,351,737円
ワールドアセットバランス（基本コース）	144,201,865円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	187,755,370円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	21,116,295円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	10,603,461円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,240,319円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	42,119,092円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	139,305,552円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	290,143,180円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	148,095,074円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	22,279,679円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	11,365,527円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,977,782円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	103,225,568円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,508,385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）	25,941,171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）	26,556,014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）	16,226,015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）	25,627,384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）	65,035,704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）	23,128,713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）	380,917,073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）	40,467,208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）	1,108,413,253円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	201,329,974円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,060,718,321円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	140,711,864円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	1,328,457円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,031,509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）	44,178,916円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	2,713,784円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	3,660,019円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,112,379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）	49,174,934円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,693,020円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,795,903円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,140,011円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,395円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,237,756円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,742,485円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	151,469,493円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	248,727,482円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	838,473,435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）	43,796,613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）	35,704,735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）	241,963,681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）	8,534,431円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	164,151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）	101,758,748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）	8,811,852円

ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,828,913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）	44,862,538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）	93,220,044円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	9,895,958円
コア資産形成ファンド	6,569,591円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,490,800,431円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	139,711,193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）	6,727,945円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,261,770,351円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,389,989,697円
計	137,380,038,509円
２．　受益権の総数	137,380,038,509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2月26日 至　2023年2月27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2月27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2月27日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△27,298,781,196
投資信託受益証券	14,465,832
投資証券	△865,477,550
合計	△28,149,792,914

（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2月27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2月27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	95,109,724	－	95,110,756	△1,032
イギリス・ポンド	79,982,623	－	79,983,556	△933
オーストラリア・ドル	15,127,101	－	15,127,200	△99
買建	661,856,180	－	664,901,306	3,045,126
アメリカ・ドル	523,694,468	－	526,285,212	2,590,744
イギリス・ポンド	7,094,032	－	7,168,462	74,430
オーストラリア・ドル	1,188,486	－	1,191,970	3,484
カナダ・ドル	25,919,439	－	26,051,732	132,293
ユーロ	103,959,755	－	104,203,930	244,175
合計	756,965,904	－	760,012,062	3,044,094

（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2月27日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	21,060,625,994	－	20,816,790,262	△243,835,732
合計	21,060,625,994	－	20,816,790,262	△243,835,732

（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2月27日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	6.1637円 (61,637円)

附属明細表
第１　有価証券明細表
（１）株式

2023年2月27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	1,141,595	93.500	106,739,132.500	
	ABBOTT LABORATORIES	218,054	100.460	21,905,704.840	
	AES CORP	79,505	25.320	2,013,066.600	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	112,458	130.570	14,683,641.060	
	ADVANCED MICRO DEVICES	201,632	78.090	15,745,442.880	
	ADOBE INC	58,405	320.540	18,721,138.700	
	CHUBB LTD	52,117	210.910	10,991,996.470	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	27,773	280.980	7,803,657.540	

ALLSTATE CORP	32,939	131.590	4,334,443.010	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	83,770	192.040	16,087,190.800	
AMGEN INC	66,676	233.660	15,579,514.160	
HESS CORP	35,271	138.950	4,900,905.450	
AMERICAN EXPRESS CO	79,536	174.250	13,859,148.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	62,653	90.430	5,665,710.790	
AFLAC INC	72,673	68.570	4,983,187.610	
AMERICAN INTL GROUP	93,843	60.170	5,646,533.310	
ANALOG DEVICES	63,336	182.940	11,586,687.840	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	86,452	62.550	5,407,572.600	
VALERO ENERGY CORP	48,490	132.750	6,437,047.500	
ANSYS INC	10,831	291.340	3,155,503.540	
APPLE INC	2,000,134	146.710	293,439,659.140	
APPLIED MATERIALS INC	106,803	111.310	11,888,241.930	
ALBEMARLE CORP	13,961	249.520	3,483,548.720	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	69,412	81.440	5,652,913.280	
AMEREN CORP	31,621	84.370	2,667,863.770	
ARROW ELECTRONICS INC	9,936	117.340	1,165,890.240	
AUTODESK INC	26,907	192.530	5,180,404.710	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	51,847	221.580	11,488,258.260	
AUTOZONE INC	2,451	2,540.560	6,226,912.560	
AVERY DENNISON CORP	9,514	181.650	1,728,218.100	
BALL CORP	40,223	56.850	2,286,677.550	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	161,951	304.020	49,236,343.020	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	96,968	50.460	4,893,005.280	
BAXTER INTERNATIONAL INC	63,174	40.160	2,537,067.840	
BECTON DICKINSON & CO	35,061	237.920	8,341,713.120	
AMETEK INC	28,958	140.940	4,081,340.520	
VERIZON COMM INC	524,012	38.740	20,300,224.880	
WR BERKLEY CORP	29,191	66.350	1,936,822.850	
BEST BUY CO INC	25,405	83.820	2,129,447.100	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	480.000	1,450,080.000	
YUM! BRANDS INC	35,337	126.830	4,481,791.710	
FIRSTENERGY CORP	67,213	39.800	2,675,077.400	
BOEING CO	70,282	198.150	13,926,378.300	
ROBERT HALF INTL INC	14,456	78.570	1,135,807.920	
BORGWARNER INC	27,800	49.780	1,383,884.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	175,352	47.010	8,243,297.520	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	100.340	1,454,327.960	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	19,529	109.300	2,134,519.700	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,731	1,428.090	3,900,113.790	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	265,949	70.180	18,664,300.820	
ONEOK INC	56,980	67.560	3,849,568.800	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	132.950	1,290,811.550	
UNITED RENTALS INC	8,883	450.430	4,001,169.690	
SEMPRA ENERGY	38,567	155.280	5,988,683.760	
FEDEX CORP	30,991	203.280	6,299,850.480	
VERISIGN INC	11,850	198.380	2,350,803.000	
AMPHENOL CORP	74,344	76.520	5,688,802.880	
BROWN-FORMAN CORP	38,405	64.990	2,495,940.950	
QUANTA SERVICES INC	17,560	160.640	2,820,838.400	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.390	446,748.350	
CSX CORP	263,536	30.750	8,103,732.000	
COTERRA ENERGY INC	99,916	25.560	2,553,852.960	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	53.130	1,433,341.140	
CONSTELLATION BRANDS INC	19,343	224.090	4,334,572.870	
CARDINAL HEALTH INC	34,421	77.570	2,670,036.970	
CARLISLE COS INC	6,119	257.510	1,575,703.690	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	10.590	1,400,961.690	
CATERPILLAR INC	65,850	236.170	15,551,794.500	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	124.200	1,568,770.200	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	3.560	345,579.880	
JPMORGAN CHASE & CO	365,043	140.930	51,445,509.990	
CHURCH & DWIGHT CO INC	30,236	83.570	2,526,822.520	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19,878	121.450	2,414,183.100	
CINTAS CORP	11,173	435.030	4,860,590.190	
CISCO SYSTEMS INC	516,136	48.480	25,022,273.280	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	19.720	1,367,996.120	
CLOROX COMPANY	15,794	154.030	2,432,749.820	
COCA-COLA CO/THE	510,854	59.840	30,569,503.360	
COPART INC	54,011	69.230	3,739,181.530	
COGNEX CORP	20,432	47.040	961,121.280	
COLGATE-PALMOLIVE CO	98,865	73.130	7,229,997.450	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	34,546	170.330	5,884,220.180	
MOLINA HEALTHCARE INC	7,434	287.290	2,135,713.860	
NRG ENERGY, INC.	28,364	33.600	953,030.400	
COMCAST CORP-CL A	549,210	37.000	20,320,770.000	
CONAGRA BRANDS INC	61,981	36.530	2,264,165.930	
CONSOLIDATED EDISON INC	43,855	91.260	4,002,207.300	
CMS ENERGY CORP	36,603	60.420	2,211,553.260	
COOPER COS INC	6,342	330.510	2,096,094.420	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	53.780	1,359,612.180	
CORNING INC	95,758	34.310	3,285,456.980	

WOLFSPEED INC	15,684	71.640	1,123,601.760	
SEALED AIR CORP	17,610	49.060	863,946.600	
HEICO CORP-CL A	9,463	138.790	1,313,369.770	
CUMMINS INC	17,803	244.110	4,345,890.330	
DARLING INTERNATIONAL INC	20,032	66.970	1,341,543.040	
DR HORTON INC	40,602	91.160	3,701,278.320	
DANAHER CORP	86,123	249.120	21,454,961.760	
MOODY'S CORP	20,682	289.240	5,982,061.680	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	62,906	63.830	4,015,289.980	
TARGET CORP	57,714	166.960	9,635,929.440	
DEERE & CO	36,203	417.420	15,111,856.260	
MORGAN STANLEY	160,405	97.700	15,671,568.500	
REPUBLIC SERVICES INC	27,024	129.610	3,502,580.640	
COSTAR GROUP INC	50,052	70.730	3,540,177.960	
THE WALT DISNEY CO	227,404	100.300	22,808,621.200	
DOLLAR TREE INC	28,149	144.000	4,053,456.000	
DOVER CORP	17,842	148.400	2,647,752.800	
OMNICOM GROUP	26,570	91.600	2,433,812.000	
DTE ENERGY CO	23,792	113.000	2,688,496.000	
DUKE ENERGY CORP	96,473	96.920	9,350,163.160	
DARDEN RESTAURANTS INC	15,676	144.530	2,265,652.280	
EBAY INC	67,667	45.070	3,049,751.690	
BANK OF AMERICA CORP	900,868	34.210	30,818,694.280	
CITIGROUP INC	241,865	50.180	12,136,785.700	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	83.840	1,407,673.600	
EATON CORP PLC	49,676	173.250	8,606,367.000	
CADENCE DESIGN SYS INC	34,337	193.740	6,652,450.380	
DISH NETWORK CORP	24,416	13.270	324,000.320	
ECOLAB INC	32,550	158.580	5,161,779.000	
PERKINELMER INC	15,649	125.130	1,958,159.370	
ELECTRONIC ARTS INC	34,838	109.770	3,824,167.260	
SALESFORCE INC	124,876	162.200	20,254,887.200	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	235.650	794,611.800	
EMERSON ELECTRIC CO	73,889	82.180	6,072,198.020	
ATMOS ENERGY CORP	17,567	115.750	2,033,380.250	
ENTERGY CORP	26,097	107.310	2,800,469.070	
EOG RESOURCES INC	73,498	114.260	8,397,881.480	
EQUIFAX INC	15,156	200.140	3,033,321.840	
EQT CORP	40,996	34.730	1,423,791.080	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	28,995	242.720	7,037,666.400	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,974	107.190	2,141,013.060	
EXXON MOBIL CORP	519,382	110.750	57,521,556.500	
FMC CORP	15,534	128.870	2,001,866.580	
NEXTERA ENERGY INC	244,925	72.920	17,859,931.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,716	421.390	1,987,275.240	
FAIR ISAAC CORP	2,962	665.940	1,972,514.280	

ASSURANT INC	5,823	127.980	745,227.540	
FASTENAL CO	72,941	51.240	3,737,496.840	
FIFTH THIRD BANCORP	84,362	36.310	3,063,184.220	
M&T BANK CORP	20,766	156.130	3,242,195.580	
FIRST HORIZON CORP	69,634	24.850	1,730,404.900	
FISERV INC	76,076	114.450	8,706,898.200	
FORD MOTOR CO	494,379	11.880	5,873,222.520	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	29.290	1,110,559.640	
FREEPORT-MCMORAN INC	180,180	39.890	7,187,380.200	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	739.560	1,173,681.720	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	26,269	184.730	4,852,672.370	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	34.330	878,813.670	
GENERAL DYNAMICS CORP	28,725	231.950	6,662,763.750	
GENERAL MILLS INC	74,919	80.640	6,041,468.160	
GENUINE PARTS CO	17,374	178.820	3,106,818.680	
GILEAD SCIENCES INC	156,388	80.660	12,614,256.080	
GARTNER INC	9,564	332.350	3,178,595.400	
MCKESSON CORP	17,980	359.140	6,457,337.200	
NVIDIA CORP	310,242	232.860	72,242,952.120	
GENERAL ELECTRIC CO	136,910	83.550	11,438,830.500	
WW GRAINGER INC	5,466	664.100	3,629,970.600	
HALLIBURTON CO	111,570	36.990	4,126,974.300	
MONSTER BEVERAGE CORP	49,739	101.230	5,035,078.970	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	42,430	363.850	15,438,155.500	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24,320	210.150	5,110,848.000	
HASBRO INC	15,437	56.430	871,109.910	
HENRY SCHEIN INC	17,431	80.820	1,408,773.420	
HEICO CORP	5,185	174.870	906,700.950	
HERSHEY FOODS CORP	18,695	239.020	4,468,478.900	
HP INC	125,955	29.220	3,680,405.100	
F5 INC	6,924	140.650	973,860.600	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	85.580	1,311,256.760	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	30.770	1,345,110.550	
HOLOGIC INC	30,695	80.100	2,458,669.500	
HOME DEPOT INC	127,583	296.660	37,848,772.780	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	22,880	102.070	2,335,361.600	
HORMEL FOODS CORP	38,851	45.100	1,752,180.100	
CENTERPOINT ENERGY INC	78,791	28.570	2,251,058.870	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	251.120	904,534.240	
HUBBELL INC	6,903	253.460	1,749,634.380	
HUMANA INC	15,844	507.420	8,039,562.480	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,348	183.540	1,899,271.920	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	181,491	15.290	2,774,997.390	
BIOGEN INC	17,603	270.020	4,753,162.060	

IDEX CORP	9,065	224.840	2,038,174.600	
ILLINOIS TOOL WORKS	38,790	232.700	9,026,433.000	
INTUIT INC	33,501	419.810	14,064,054.810	
IDEXX LABORATORIES INC	10,162	468.170	4,757,543.540	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	29,293	181.700	5,322,538.100	
INTEL CORP	512,432	25.140	12,882,540.480	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	31,979	93.800	2,999,630.200	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	36.490	1,611,142.970	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	36.210	1,654,036.590	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9,506	165.260	1,570,961.560	
INCYTE CORP	24,449	77.020	1,883,061.980	
JOHNSON & JOHNSON	327,095	155.970	51,017,007.150	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,402	77.970	3,072,173.940	
KLA CORPORATION	17,734	379.850	6,736,259.900	
DEVON ENERGY CORP	78,384	55.000	4,311,120.000	
KELLOGG CO	32,941	67.680	2,229,446.880	
KEYCORP	118,955	18.320	2,179,255.600	
KIMBERLY-CLARK CORP	42,173	126.200	5,322,232.600	
BLACKROCK INC/NEW YORK	18,814	683.430	12,858,052.020	
KROGER CO	82,775	43.750	3,621,406.250	
LAM RESEARCH CORP	17,260	478.610	8,260,808.600	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,890	429.640	2,530,579.600	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	137.800	1,519,796.200	
AKAMAI TECHNOLOGIES	20,036	72.710	1,456,817.560	
PLUG POWER INC	56,149	14.180	796,192.820	
LENNAR CORP	32,361	95.840	3,101,478.240	
ELI LILLY & CO	100,641	321.640	32,370,171.240	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	42.420	1,194,377.520	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	31.860	571,472.820	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	91,189	180.150	16,427,698.350	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	37,189	141.200	5,251,086.800	
LOCKHEED MARTIN CORP	29,695	480.400	14,265,478.000	
LOEWS CORP	23,530	61.080	1,437,212.400	
LOWE'S COS INC	77,478	201.540	15,614,916.120	
DOMINION ENERGY INC	101,828	57.000	5,804,196.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	42.600	1,721,082.600	
MCCORMICK & CO INC	32,031	74.980	2,401,684.380	
MCDONALD'S CORPORATION	91,413	263.680	24,103,779.840	
S&P GLOBAL INC	42,505	343.380	14,595,366.900	
EVEREST RE GROUP LTD	5,353	386.170	2,067,168.010	
MARKEL CORPORATION	1,674	1,335.710	2,235,978.540	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	77,695	76.250	5,924,243.750	
MARSH & MCLENNAN COS	62,147	162.040	10,070,299.880	
MASCO CORP	28,937	52.480	1,518,613.760	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,736	362.080	2,801,050.880	
METLIFE INC	84,799	71.840	6,091,960.160	
MEDTRONIC PLC	166,079	83.490	13,865,935.710	
ACTIVISION BLIZZARD INC	97,496	76.820	7,489,642.720	
CVS HEALTH CORP	163,616	85.770	14,033,344.320	
MERCK & CO.INC.	315,672	109.890	34,689,196.080	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	54,362	76.280	4,146,733.360	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,455	242.300	2,775,546.500	
MICROSOFT CORP	881,904	249.220	219,788,114.880	
MICRON TECH INC	135,654	58.180	7,892,349.720	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	69,597	79.680	5,545,488.960	
3M CO	69,396	107.800	7,480,888.800	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	104.000	656,344.000	
ENTEGRIS INC	17,709	82.870	1,467,544.830	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	6,445	219.810	1,416,675.450	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,578	261.800	5,387,320.400	
ILLUMINA INC	19,833	196.590	3,898,969.470	
XCEL ENERGY INC	69,325	65.810	4,562,278.250	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,716	102.450	1,200,304.200	
NETAPP INC	28,265	65.380	1,847,965.700	
NEWELL BRANDS INC	41,984	14.550	610,867.200	
NEWMONT CORP	99,287	43.540	4,322,955.980	
NVR INC	405	5,132.470	2,078,650.350	
NIKE INC-CL B	157,485	118.040	18,589,529.400	
NORDSON CORP	6,447	220.320	1,420,403.040	
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,997	224.770	6,517,655.690	
EVERSOURCE ENERGY	43,042	77.380	3,330,589.960	
NISOURCE INC	53,270	27.820	1,481,971.400	
NORTHERN TRUST CORP	24,836	93.420	2,320,179.120	
NORTHROP GRUMMAN CORP	18,361	470.910	8,646,378.510	
WELLS FARGO & CO	472,491	46.620	22,027,530.420	
NUCOR CORP	31,660	162.530	5,145,699.800	
CHENIERE ENERGY INC	28,554	157.770	4,504,964.580	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,654	109.640	5,115,144.560	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	114,744	58.980	6,767,601.120	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,630	339.540	3,948,850.200	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,757	831.820	6,452,427.740	

ORACLE CORP	199,212	88.660	17,662,135.920	
PACCAR INC	64,801	72.300	4,685,112.300	
PTC INC	13,665	126.990	1,735,318.350	
EXELON CORP	121,664	41.320	5,027,156.480	
PARKER HANNIFIN CORP	16,101	348.030	5,603,631.030	
PAYCHEX INC	40,519	110.980	4,496,798.620	
ALIGN TECHNOLOGY INC	9,651	306.280	2,955,908.280	
PPL CORPORATION	88,737	27.690	2,457,127.530	
PEPSICO INC	171,495	175.960	30,176,260.200	
PENTAIR PLC	19,804	55.430	1,097,735.720	
PFIZER INC	698,945	41.750	29,180,953.750	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	44.400	1,456,142.400	
CONOCOPHILLIPS	159,169	105.250	16,752,537.250	
PG&E CORP	178,257	15.780	2,812,895.460	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	28,445	196.570	5,591,433.650	
ALTRIA GROUP INC	224,442	47.170	10,586,929.140	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51,010	158.490	8,084,574.900	
BROWN & BROWN INC	30,650	56.470	1,730,805.500	
GARMIN LTD	19,911	98.300	1,957,251.300	
PPG INDUSTRIES INC	28,341	129.710	3,676,111.110	
COSTCO WHOLESALE CORP	55,182	488.610	26,962,477.020	
T ROWE PRICE GROUP INC	27,707	110.160	3,052,203.120	
QUEST DIAGNOSTICS	14,536	139.990	2,034,894.640	
PROCTER & GAMBLE CO	296,779	139.260	41,329,443.540	
PROGRESSIVE CORP	73,178	141.810	10,377,372.180	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	60,100	61.150	3,675,115.000	
PULTE GROUP INC	29,050	53.580	1,556,499.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	33,653	112.210	3,776,203.130	
QUALCOMM INC	140,158	124.340	17,427,245.720	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	23,437	107.770	2,525,805.490	
EXACT SCIENCES CORP	23,386	60.050	1,404,329.300	
REGENERON PHARMACEUTICALS	13,397	756.990	10,141,395.030	
REPLIGEN CORP	6,730	173.440	1,167,251.200	
RESMED INC	18,628	211.530	3,940,380.840	
US BANCORP	176,600	47.640	8,413,224.000	
SEAGEN INC	16,860	161.370	2,720,698.200	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	45,851	69.170	3,171,513.670	
ROSS STORES INC	44,171	111.460	4,923,299.660	
ROLLINS INC	25,920	35.120	910,310.400	
ROPER TECHNOLOGIES INC	13,120	428.440	5,621,132.800	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14,633	290.390	4,249,276.870	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	70.170	1,928,061.090	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	87.310	1,437,733.770	

ACCENTURE PLC-CL A	78,843	266.530	21,014,024.790	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	168,645	65.550	11,054,679.750	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,232	234.700	3,105,550.400	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	29,595	185.330	5,484,841.350	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	75,043	64.900	4,870,290.700	
BOOKING HOLDINGS INC	4,956	2,452.480	12,154,490.880	
SCHLUMBERGER LTD	177,410	53.920	9,565,947.200	
SCHWAB (CHARLES) CORP	181,379	80.600	14,619,147.400	
POOL CORP	4,660	356.310	1,660,404.600	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	26,144	122.700	3,207,868.800	
BUNGE LTD	18,642	98.060	1,828,034.520	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	59.750	865,000.750	
ELEVANCE HEALTH INC	29,928	478.030	14,306,481.840	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,104	158.570	3,029,321.280	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31,921	88.890	2,837,457.690	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	30,476	221.080	6,737,634.080	
CENTENE CORP	70,080	70.280	4,925,222.400	
SVB FINANCIAL GROUP	7,330	282.920	2,073,803.600	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	64.900	964,154.400	
SNAP-ON INC	7,068	246.770	1,744,170.360	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	46,776	99.040	4,632,695.040	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	138.850	994,860.250	
EDISON INTERNATIONAL	48,533	68.630	3,330,819.790	
SOUTHERN CO	136,027	64.560	8,781,903.120	
TRUIST FINANCIAL CORP	165,326	47.080	7,783,548.080	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	33.570	661,329.000	
AT&T INC	888,201	19.240	17,088,987.240	
CHEVRON CORP	231,639	162.410	37,620,489.990	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	84.800	1,634,096.000	
STATE STREET CORP	46,198	87.170	4,027,079.660	
STARBUCKS CORP	142,819	101.600	14,510,410.400	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	118.500	2,718,034.500	
STRYKER CORP	42,635	262.310	11,183,586.850	
NETFLIX INC	55,471	317.150	17,592,627.650	
GEN DIGITAL INC	73,086	20.170	1,474,144.620	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,318	57.540	1,169,097.720	
SYNOPSYS INC	18,779	362.280	6,803,256.120	
SYSCO CORP	62,521	75.830	4,740,967.430	
INTUITIVE SURGICAL INC	44,632	231.050	10,312,223.600	
TELEFLEX INC	5,532	235.180	1,301,015.760	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	134,781	9.910	1,335,679.710	
TERADYNE INC	18,512	100.640	1,863,047.680	
TEXAS INSTRUMENTS INC	113,701	169.140	19,231,387.140	
TEXTRON INC	25,824	73.560	1,899,613.440	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	48,795	542.790	26,485,438.050	
GLOBE LIFE INC	12,153	122.030	1,483,030.590	
DAVITA INC	6,813	82.310	560,778.030	
TRACTOR SUPPLY CO	13,690	230.540	3,156,092.600	
BIO-TECHNE CORP	20,652	72.480	1,496,856.960	
TRIMBLE INC	28,676	51.780	1,484,843.280	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,300	327.050	1,733,365.000	
TYSON FOODS INC	35,684	61.230	2,184,931.320	
UGI CORP	24,160	37.710	911,073.600	
MARATHON OIL CORP	84,059	25.590	2,151,069.810	
UNION PACIFIC CORP	77,769	194.020	15,088,741.380	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	183,061	99.620	18,236,536.820	
UNITEDHEALTH GROUP INC	116,509	484.330	56,428,803.970	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	146.920	1,189,464.320	
VF CORP	37,887	24.180	916,107.660	
PARAMOUNT GLOBAL	78,663	22.300	1,754,184.900	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	32,140	287.370	9,236,071.800	
VULCAN MATERIALS CO	16,452	183.640	3,021,245.280	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	91,706	35.800	3,283,074.800	
WALMART INC	187,896	142.470	26,769,543.120	
WASTE MANAGEMENT INC	50,578	151.310	7,652,957.180	
WATERS CORP	7,511	314.050	2,358,829.550	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	53.330	1,188,459.050	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	9,641	310.250	2,991,120.250	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	148.600	1,884,099.400	
VAIL RESORTS INC	5,235	237.890	1,245,354.150	
WESTERN DIGITAL CORP	40,723	39.110	1,592,676.530	
WABTEC CORP	20,273	103.500	2,098,255.500	
WHIRLPOOL CORP	6,832	139.090	950,262.880	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	112.120	2,111,555.960	
WYNN RESORTS LTD	12,757	105.530	1,346,246.210	
NASDAQ INC	41,596	57.050	2,373,051.800	
CME GROUP INC	44,342	187.170	8,299,492.140	
WILLIAMS COS INC	151,890	31.180	4,735,930.200	
LKQ CORP	31,504	57.550	1,813,055.200	
ALLIANT ENERGY CORP	33,966	52.720	1,790,687.520	
WEC ENERGY GROUP INC	38,318	91.020	3,487,704.360	
CARMAX INC	18,673	67.860	1,267,149.780	

TJX COMPANIES INC	145,228	77.190	11,210,149.320	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	6,730	291.920	1,964,621.600	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	4.540	708,462.460	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,328	49.600	859,468.800	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15,092	189.780	2,864,159.760	
SIGNATURE BANK	7,996	114.210	913,223.160	
CBRE GROUP INC	41,089	84.990	3,492,154.110	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	20.520	323,785.080	
REGIONS FINANCIAL CORP	117,222	23.170	2,716,033.740	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	297.470	1,224,089.050	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,387	483.060	2,602,244.220	
WESTLAKE CORP	4,187	121.370	508,176.190	
T-MOBILE US INC	78,434	144.410	11,326,653.940	
LAS VEGAS SANDS CORP	42,972	56.150	2,412,877.800	
MOSAIC CO/THE	42,561	51.510	2,192,317.110	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	346.620	1,688,386.020	
CELANESE CORP	13,841	117.720	1,629,362.520	
DEXCOM INC	48,710	110.090	5,362,483.900	
EXPEDIA GROUP INC	19,186	104.310	2,001,291.660	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	85.590	2,056,470.930	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,123	339.790	4,459,064.170	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	21.230	765,001.820	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	69,896	102.510	7,165,038.960	
LIVE NATION	20,444	68.780	1,406,138.320	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,474	1,476.730	5,130,160.020	
TRANSDIGM GROUP INC	6,148	741.850	4,560,893.800	
MASTERCARD INC	107,466	353.120	37,948,393.920	
WESTERN UNION CO	46,712	13.090	611,460.080	
OWENS CORNING	13,227	97.840	1,294,129.680	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	99.280	1,499,922.240	
AERCAP HOLDINGS NV	17,861	61.120	1,091,664.320	
FIRST SOLAR INC	11,903	162.160	1,930,190.480	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	15,300	141.100	2,158,830.000	
DELTA AIR LINES INC	21,592	37.360	806,677.120	
INSULET CORP	8,834	294.350	2,600,287.900	
DISCOVER FINANCIAL	33,236	112.220	3,729,743.920	
TE CONNECTIVITY LTD	38,762	125.470	4,863,468.140	
MASIMO CORP	5,688	166.090	944,719.920	
LULULEMON ATHLETICA INC	14,547	308.100	4,481,930.700	
VMWARE INC	26,690	112.690	3,007,696.100	

MERCADOLIBRE INC	5,715	1,156.880	6,611,569.200	
ULTA BEAUTY INC	6,073	519.990	3,157,899.270	
INVESCO LTD	38,530	17.530	675,430.900	
MSCI INC	9,807	518.160	5,081,595.120	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	193,016	98.580	19,027,517.280	
VISA INC	203,526	219.550	44,684,133.300	
KEURIG DR PEPPER INC	92,816	35.790	3,321,884.640	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	22,809	141.560	3,228,842.040	
MARATHON PETROLEUM CORP	63,137	124.920	7,887,074.040	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	61.460	994,545.720	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	257,877	17.440	4,497,374.880	
XYLEM INC	22,848	102.400	2,339,635.200	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	33,342	96.690	3,223,837.980	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	220.750	1,040,394.750	
SPLUNK INC	20,898	101.900	2,129,506.200	
EPAM SYSTEMS INC	7,090	306.030	2,169,752.700	
HCA HEALTHCARE INC	28,752	249.140	7,163,273.280	
VERISK ANALYTICS INC	18,974	171.680	3,257,456.320	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,792	143.850	1,120,879.200	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	206.770	1,828,673.880	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	22,434	120.440	2,701,950.960	
NXP SEMICONDUCTOR NV	32,109	176.860	5,678,797.740	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	16,343	95.700	1,564,025.100	
TARGA RESOURCES CORP	25,830	75.760	1,956,880.800	
LEAR CORP	6,911	140.100	968,231.100	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,709	129.690	1,648,230.210	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	31,059	59.940	1,861,676.460	
DOLLAR GENERAL CORP	27,899	214.250	5,977,360.750	
FORTINET INC	81,166	58.860	4,777,430.760	
HORIZON PHARMA PLC	27,613	110.500	3,051,236.500	
TESLA INC	331,953	196.880	65,354,906.640	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	118.210	817,303.940	
ENPHASE ENERGY INC	17,046	198.960	3,391,472.160	
GENERAL MOTORS CO	171,210	39.180	6,708,007.800	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	30.220	1,185,530.600	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9,661	247.300	2,389,165.300	
APTIV PLC	34,310	114.940	3,943,591.400	
PHILLIPS 66	59,404	102.000	6,059,208.000	

META PLATFORMS INC	284,533	170.390	48,481,577.870	
IQVIA HOLDINGS INC	22,514	209.540	4,717,583.560	
DIAMONDBACK ENERGY INC	20,087	142.380	2,859,987.060	
SERVICENOW INC	25,333	425.590	10,781,471.470	
PALO ALTO NETWORKS INC	36,942	186.630	6,894,485.460	
WORKDAY INC	25,547	183.130	4,678,422.110	
ABBVIE INC	220,198	152.710	33,626,436.580	
ZOETIS INC	58,756	166.330	9,772,885.480	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	17.440	945,439.840	
CDW CORP	16,465	202.530	3,334,656.450	
HOWMET AEROSPACE INC	47,590	41.960	1,996,876.400	
TWILIO INC	21,090	64.100	1,351,869.000	
SNAP INC	127,318	9.810	1,248,989.580	
TRADE DESK INC A	53,230	54.970	2,926,053.100	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,466	69.000	1,550,154.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	32.030	283,305.350	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	32.010	636,070.710	
OKTA INC	17,828	72.270	1,288,429.560	
BLACK KNIGHT INC	17,653	63.080	1,113,551.240	
BAKER HUGHES CO	126,292	30.380	3,836,750.960	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	18,167	99.980	1,816,336.660	
BROADCOM INC	50,259	577.750	29,037,137.250	
ARES MANAGEMENT CORP	19,534	80.170	1,566,040.780	
MONGODB INC	9,021	205.900	1,857,423.900	
BURLINGTON STORES INC	8,453	224.290	1,895,923.370	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	61,321	11.680	716,229.280	
VEEVA SYSTEMS INC	16,856	165.110	2,783,094.160	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,212	50.040	1,211,568.480	
EVERGY INC	28,226	60.630	1,711,342.380	
ALLEGION PLC	10,140	113.010	1,145,921.400	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	72.920	1,335,456.880	
STERIS PLC	12,524	186.130	2,331,092.120	
DOCUSIGN INC	26,362	59.140	1,559,048.680	
WIX.COM LTD	5,855	89.300	522,851.500	
DROPBOX INC	30,479	20.600	627,867.400	
KKR & CO INC	67,430	55.030	3,710,672.900	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	45.670	230,633.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,921	73.930	2,064,199.530	
MODERNA INC	41,626	139.260	5,796,836.760	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	34,409	144.790	4,982,079.110	
ARAMARK	31,133	37.500	1,167,487.500	
CIGNA GROUP	38,214	293.730	11,224,598.220	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	41.610	1,363,559.700	
DOW INC	87,667	57.790	5,066,275.930	
OVINTIV INC	31,603	45.560	1,439,832.680	

AMCOR PLC	188,789	11.280	2,129,539.920	
PINTEREST INC	69,746	25.030	1,745,742.380	
FOX CORP-A	36,501	35.890	1,310,020.890	
FOX CORP-B	15,511	33.060	512,793.660	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	10.060	428,415.160	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	25,723	117.280	3,016,793.440	
CHEWY INC	9,648	39.560	381,674.880	
AVANTOR INC	78,214	24.620	1,925,628.680	
DYNATRACE INC	25,429	42.940	1,091,921.260	
CLOUDFLARE INC	29,770	59.200	1,762,384.000	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	71.050	980,490.000	
CARRIER GLOBAL CORP	101,898	44.250	4,508,986.500	
OTIS WORLDWIDE CORP	52,855	83.630	4,420,263.650	
UBER TECHNOLOGIES INC	181,560	33.400	6,064,104.000	
CORTEVA INC	90,590	61.680	5,587,591.200	
MATCH GROUP INC	35,259	41.340	1,457,607.060	
FERGUSON PLC	25,702	142.270	3,656,623.540	
BILL.COM HOLDINGS INC	11,988	85.990	1,030,848.120	
BLACKSTONE INC	88,026	89.060	7,839,595.560	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,322	197.020	1,048,540.440	
CARLYLE GROUP INC	24,530	34.700	851,191.000	
DATADOG INC	29,179	76.670	2,237,153.930	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	66.090	1,697,786.010	
INGERSOLL RAND INC	51,479	57.680	2,969,308.720	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	44,135	75.010	3,310,566.350	
PAYCOM SOFTWARE INC	6,341	293.420	1,860,576.220	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	17.320	664,083.440	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	23.980	222,222.660	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	29.610	913,142.790	
AON PLC	26,341	302.970	7,980,532.770	
WARNER BROS DISCOVERY INC	291,778	15.550	4,537,147.900	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	736	1,766.690	1,300,283.840	
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	39.490	891,131.340	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	58.440	765,213.360	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	13.070	242,160.960	
AIRBNB INC	47,177	122.780	5,792,392.060	
CONSTELLATION ENERGY CORP	41,224	79.270	3,267,826.480	
ROYALTY PHARMA PLC	41,775	36.380	1,519,774.500	
ROBLOX CORP	45,019	36.960	1,663,902.240	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	25.190	747,034.640	
VIATRIS INC	150,826	11.510	1,736,007.260	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	26,444	50.030	1,322,993.320	

CHESAPEAKE ENERGY CORP	12,687	85.400	1,083,469.800	
HF SINCLAIR CORP	20,299	50.350	1,022,054.650	
SNOWFLAKE INC	28,582	148.440	4,242,712.080	
DOORDASH INC	29,575	55.090	1,629,286.750	
ARISTA NETWORKS INC	29,367	135.530	3,980,109.510	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	50,482	70.870	3,577,659.340	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	202,824	8.090	1,640,846.160	
FNF GROUP	31,004	39.490	1,224,347.960	
JACOBS SOLUTIONS INC	16,615	120.850	2,007,922.750	
MARVELL TECHNOLOGY INC	107,989	43.850	4,735,317.650	
APA CORP	40,946	39.220	1,605,902.120	
LUCID GROUP INC	44,910	8.510	382,184.100	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	56.710	679,442.510	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	214.640	798,675.440	
TOAST INC	32,620	19.460	634,785.200	
GRAB HOLDINGS LTD	168,328	3.100	521,816.800	
CATALENT INC	20,564	67.980	1,397,940.720	
SYNCHRONY FINANCIAL	61,118	35.800	2,188,024.400	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	63,378	41.890	2,654,904.420	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	143.750	752,818.750	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22,209	157.810	3,504,802.290	
HUBSPOT INC	5,802	386.130	2,240,326.260	
QORVO INC	14,144	100.670	1,423,876.480	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	88.460	1,356,534.100	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	6,728	296.180	1,992,699.040	
GODADDY INC	19,713	75.600	1,490,302.800	
ETSY INC	15,614	124.105	1,937,775.470	
TRANSUNION	25,708	65.230	1,676,932.840	
ALCOA CORP	23,941	46.450	1,112,059.450	
BLOCK INC	66,910	77.360	5,176,157.600	
DUPONT DE NEMOURS INC	60,266	72.920	4,394,596.720	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	26,221	55.970	1,467,589.370	
WESTROCK CO	34,286	31.650	1,085,151.900	
KRAFT HEINZ CO	92,106	39.610	3,648,318.660	
NOVOCURE LTD	12,317	76.980	948,162.660	
FORTIVE CORP	42,608	67.010	2,855,162.080	
WASTE CONNECTIONS INC	31,039	134.130	4,163,261.070	
ALPHABET INC-CL A	744,329	89.130	66,342,043.770	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	156,384	15.600	2,439,590.400	
PAYPAL HOLDINGS INC	137,530	73.550	10,115,331.500	
SEA LTD ADR	43,908	60.010	2,634,919.080	

	EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	31.350	1,408,367.400	
	ZILLOW GROUP INC-C	16,321	41.110	670,956.310	
	ALPHABET INC-CL C	691,660	89.350	61,799,821.000	
	ZSCALER INC	10,310	130.880	1,349,372.800	
	LINDE PLC	62,082	347.660	21,583,428.120	
	ROKU INC	15,660	62.650	981,099.000	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,085	374.810	5,279,198.850	
	VISTRA CORP	49,633	22.360	1,109,793.880	
アメリカ・ドル　小計		42,370,849		4,274,961,901.890 (582,549,058,375)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	15.400	707,830.200	
	ASHTEAD GROUP	54,304	54.840	2,978,031.360	
	SEVERN TRENT PLC	29,397	27.570	810,475.290	
	BARCLAYS PLC	2,022,417	1.705	3,448,220.980	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.527	562,235.290	
	BT GROUP PLC	904,198	1.373	1,241,463.850	
	BUNZL PLC	38,593	30.130	1,162,807.090	
	AVIVA PLC	348,683	4.400	1,534,205.200	
	CRODA INTERNATIONAL	16,782	68.640	1,151,916.480	
	DIAGEO PLC	282,974	36.055	10,202,627.570	
	SCHRODERS PLC	110,366	4.895	540,241.570	
	DCC PLC	11,135	46.070	512,989.450	
	NATIONAL GRID PLC	460,569	10.555	4,861,305.790	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.691	606,529.870	
	BAE SYSTEMS PLC	379,623	9.178	3,484,179.890	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	262,877	32.165	8,455,438.700	
	HALMA PLC	51,066	21.790	1,112,728.140	
	NEXT PLC	18,751	68.420	1,282,943.420	
	IMPERIAL BRANDS PLC	107,889	20.700	2,233,302.300	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	21.500	429,484.000	
	ANGLO AMERICAN PLC	157,426	28.460	4,480,343.960	
	COMPASS GROUP PLC	220,935	19.380	4,281,720.300	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,488,738	6.357	15,820,907.460	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	738,179	2.535	1,871,283.760	
	UNILEVER PLC	316,686	41.915	13,273,893.690	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.210	924,709.490	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	19.465	824,362.210	
	PEARSON PLC	84,159	9.180	772,579.620	
	PERSIMMON PLC	35,252	13.950	491,765.400	
	PRUDENTIAL PLC	333,971	12.165	4,062,757.210	
	RIO TINTO PLC	140,839	56.670	7,981,346.130	
	VODAFONE GROUP PLC	3,220,482	0.991	3,191,497.660	

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	88,653	58.140	5,154,285.420	
RELX PLC	240,403	25.270	6,074,983.810	
RENTOKIL INITIAL PLC	312,114	5.144	1,605,514.410	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	1.360	1,525,816.640	
NATWEST GROUP PLC	670,464	2.815	1,887,356.160	
ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	12.175	821,179.400	
SSE PLC	131,574	17.600	2,315,702.400	
BP PLC	2,347,086	5.502	12,913,667.170	
SAGE GROUP PLC(THE)	128,893	7.504	967,213.070	
SMITHS GROUP PLC	51,695	17.710	915,518.450	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	119.200	1,065,171.200	
STANDARD CHARTERED PLC	319,802	7.712	2,466,313.020	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,477,863	0.516	4,374,577.300	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.198	682,695.870	
TESCO PLC	934,247	2.469	2,306,655.840	
3I GROUP PLC	124,751	16.240	2,025,956.240	
SMITH & NEPHEW PLC	107,679	12.150	1,308,299.850	
GSK PLC	499,550	14.450	7,218,497.500	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	41,494	75.380	3,127,817.720	
WPP PLC	142,785	10.315	1,472,827.270	
ASTRAZENECA PLC	193,029	111.000	21,426,219.000	
WHITBREAD PLC	25,470	31.150	793,390.500	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	43.770	1,020,234.930	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	23.970	1,251,929.130	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	55.420	1,205,495.840	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.630	505,215.110	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	21.950	468,083.750	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	41.120	678,027.680	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	17.165	316,780.070	
ABRDN PLC	285,831	2.110	603,103.410	
EXPERIAN PLC	112,709	28.650	3,229,112.850	
MONDI PLC	58,887	14.075	828,834.520	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.424	311,199.400	
OCADO GROUP PLC	69,766	6.112	426,409.790	
INFORMA PLC	186,195	6.674	1,242,665.430	
GLENCORE PLC	1,225,776	4.883	5,985,464.200	
ENTAIN PLC	74,451	13.065	972,702.310	
COCA-COLA HBC AG	21,338	21.300	454,499.400	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	6.280	541,480.440	
M&G PLC	270,401	2.113	571,357.310	
JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.798	453,419.640	
HALEON PLC	622,766	3.267	2,034,576.520	
SHELL PLC	905,972	24.990	22,640,240.280	

	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.964	661,008.010	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.467	714,732.660	
イギリス・ポンド　小計		35,143,594		234,862,354.250 (38,268,472,001)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	29.910	4,387,886.730	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	28.280	5,100,100.040	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	5.016	1,443,469.360	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,662	615.700	2,254,693.400	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	148.500	1,867,239.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	17.180	2,799,377.920	
	ICL GROUP LTD	103,067	25.780	2,657,067.260	
	NICE LTD	7,640	741.000	5,661,240.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	108.500	1,892,240.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	199.000	929,728.000	
イスラエル・シュケル　小計		926,818		28,993,041.710 (1,078,387,488)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	67.900	1,477,096.600	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	437,712	22.670	9,922,931.040	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	210,104	22.440	4,714,733.760	
	TELSTRA GROUP LTD	482,855	4.180	2,018,333.900	
	ASX LTD	23,664	67.810	1,604,655.840	
	BHP GROUP LTD	631,300	45.940	29,001,922.000	
	AMPOL LTD	31,828	33.010	1,050,642.280	
	COMPUTERSHARE LT	72,081	24.380	1,757,334.780	
	CSL LIMITED	60,103	299.480	17,999,646.440	
	REA GROUP LTD	6,134	124.810	765,584.540	
	TRANSURBAN GROUP	379,633	14.120	5,360,417.960	
	COCHLEAR LTD	7,836	226.190	1,772,424.840	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	8.080	1,722,890.320	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	211,229	101.220	21,380,599.380	
	RIO TINTO LIMITED	45,936	118.920	5,462,709.120	
	APA GROUP	164,300	10.890	1,789,227.000	
	ARISTOCRAT LEISU	76,675	36.880	2,827,774.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.770	1,343,537.280	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	31.410	1,908,691.470	
	IGO LTD	91,947	13.450	1,236,687.150	
	ORICA LTD	63,862	15.900	1,015,405.800	
	LEND LEASE CORP LTD	107,181	7.710	826,365.510	
	BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	18.460	928,999.500	
	MACQUARIE GROUP LTD	46,642	188.910	8,811,140.220	

	SUNCORP GROUP LTD	154,162	12.950	1,996,397.900	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	392,866	29.850	11,727,050.100	
	NEWCREST MINING LTD	112,815	22.610	2,550,747.150	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.160	693,979.440	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	15.300	2,639,051.100	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	10.410	1,411,366.980	
	REECE LTD	31,558	16.410	517,866.780	
	SANTOS LTD	417,358	7.010	2,925,679.580	
	SONIC HEALTHCARE	52,774	33.100	1,746,819.400	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	29.020	754,084.700	
	WESFARMERS LTD	139,720	48.730	6,808,555.600	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	235,431	34.600	8,145,912.600	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	154,320	37.030	5,714,469.600	
	SEEK LTD	38,405	24.470	939,770.350	
	MINERAL RESOURCES LTD	21,179	84.910	1,798,308.890	
	BRAMBLES LTD	170,929	12.970	2,216,949.130	
	PILBARA MINERALS LTD	327,947	4.530	1,485,599.910	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.350	746,544.150	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	13.950	1,105,300.350	
	XERO LTD	18,860	77.630	1,464,101.800	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	29.110	692,264.910	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	5.200	1,514,604.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	6.860	1,100,824.200	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	374,353	24.790	9,280,210.870	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.350	1,000,229.600	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	4.410	2,631,420.540	
	COLES GROUP LTD	171,684	18.080	3,104,046.720	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	63.120	935,627.760	
オーストラリア・ドル　小計		8,727,527		204,347,534.840 (18,738,668,945)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	57,030	61.830	3,526,164.900	
	BARRICK GOLD CORP	214,835	21.770	4,676,957.950	
	BANK OF MONTREAL	82,585	130.880	10,808,724.800	
	BANK OF NOVA SCOTIA	149,435	71.340	10,660,692.900	
	NATIONAL BANK OF CANADA	40,967	99.080	4,059,010.360	
	BCE INC	7,697	60.460	465,360.620	
	BROOKFIELD CORP	177,131	45.950	8,139,169.450	
	SAPUTO INC	34,582	36.970	1,278,496.540	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	10.650	983,112.150	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	100.460	1,156,093.680	

CGI INC	27,918	123.280	3,441,731.040	
CCL INDUSTRIES INC	21,058	65.040	1,369,612.320	
CAE INC	40,808	30.550	1,246,684.400	
CAMECO CORP	54,264	37.130	2,014,822.320	
ROGERS COMM-CL B	45,607	65.340	2,979,961.380	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	114,514	62.890	7,201,785.460	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	140,703	76.990	10,832,723.970	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	169.490	1,037,956.760	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	36.310	592,942.300	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	73,233	156.760	11,480,005.080	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	42.600	924,973.800	
OPEN TEXT CORP	33,217	46.400	1,541,268.800	
EMPIRE CO LTD	29,433	36.970	1,088,138.010	
KINROSS GOLD CORP	219,914	4.920	1,081,976.880	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	82.350	1,094,102.100	
FORTIS INC	60,484	54.800	3,314,523.200	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	74,203	26.580	1,972,315.740	
TELUS CORP	31,890	27.170	866,451.300	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	36.790	1,258,512.320	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	67.910	1,850,275.860	
ENBRIDGE INC	251,728	51.460	12,953,922.880	
IGM FINANCIAL INC	12,478	41.690	520,207.820	
MANULIFE FINANCIAL CORP	233,861	26.740	6,253,443.140	
LOBLAW CO LTD	21,600	119.630	2,584,008.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	101,210	64.290	6,506,790.900	
MAGNA INTERNATIONAL INC	35,844	73.200	2,623,780.800	
SUN LIFE FINANCIAL INC	75,884	65.950	5,004,549.800	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,799	931.350	2,606,848.650	
METRO INC	28,629	71.420	2,044,683.180	
EMERA INC	36,998	54.640	2,021,570.720	
ONEX CORP	10,157	69.170	702,559.690	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	20.250	391,290.750	
POWER CORP OF CANADA	65,500	35.820	2,346,210.000	
QUEBECOR INC-B	17,195	32.170	553,163.150	
ROYAL BANK OF CANADA	171,947	137.220	23,594,567.340	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	116,363	103.600	12,055,206.800	
SHAW COMM INC-B	59,877	39.750	2,380,110.750	
SUNCOR ENERGY INC	171,898	46.220	7,945,125.560	
LUNDIN MINING CORP	68,762	8.140	559,722.680	
TECK RESOURCES LTD-CL B	57,326	52.810	3,027,386.060	
THOMSON REUTERS CORP	19,979	165.370	3,303,927.230	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	113.380	1,095,817.700	

	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	225,161	91.110	20,514,418.710	
	TC ENERGY CORP	123,753	56.220	6,957,393.660	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	102.900	833,695.800	
	WESTON (GEORGE) LTD	9,839	173.790	1,709,919.810	
	INTACT FINANCIAL CORP	21,566	198.060	4,271,361.960	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	58,539	55.080	3,224,328.120	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,530	2,405.910	6,086,952.300	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	23,163	170.600	3,951,607.800	
	TOURMALINE OIL CORP	39,298	60.080	2,361,023.840	
	KEYERA CORP	24,571	30.320	744,992.720	
	PARKLAND CORP	15,665	30.500	477,782.500	
	ALTAGAS LTD	33,833	23.760	803,872.080	
	PEMBINA PIPELINE CORP	68,179	45.070	3,072,827.530	
	DOLLARAMA INC	36,204	79.360	2,873,149.440	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	167,715	24.780	4,155,977.700	
	ARC RESOURCES LTD	74,961	15.370	1,152,150.570	
	NORTHLAND POWER INC	34,152	33.130	1,131,455.760	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	19.180	982,840.740	
	TMX GROUP LTD	7,040	136.130	958,355.200	
	BRP INC	4,307	117.940	507,967.580	
	IVANHOE MINES LTD	64,027	11.100	710,699.700	
	NUTRIEN LTD	66,177	104.620	6,923,437.740	
	TFI INTERNATIONAL INC	9,399	166.600	1,565,873.400	
	WSP GLOBAL INC	15,681	172.670	2,707,638.270	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,011	89.370	1,073,423.070	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	27,577	41.820	1,153,270.140	
	NUVEI CORP	7,929	40.830	323,741.070	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	38.320	617,066.960	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	42,501	46.190	1,963,121.190	
	AIR CANADA	18,814	19.820	372,893.480	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	35,384	88.630	3,136,083.920	
	SHOPIFY INC	146,823	55.430	8,138,398.890	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	185.490	971,411.130	
	HYDRO ONE LTD	46,225	35.760	1,653,006.000	
カナダ・ドル　小計		5,086,966		302,101,578.770 (30,276,620,224)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	3.560	513,352.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	224,810	34.400	7,733,464.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.830	308,502.000	
	SEMBCORP MARINE	3,531,590	0.128	452,043.520	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	29.460	456,630.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	8.870	885,226.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	1.020	776,416.860	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	5.530	1,022,497.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	398,198	12.670	5,045,168.660	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.410	2,273,425.300	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.770	938,779.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	139,966	29.850	4,177,985.100	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.790	296,044.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	18.170	795,846.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.930	1,015,905.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.880	1,189,569.200	
シンガポール・ドル　小計		7,298,077		27,880,853.640 (2,816,245,026)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	451,599	2.770	1,250,929.230	
	LOGITECH INTL-REG	23,734	51.400	1,219,927.600	
	NESTLE SA-REGISTERED	341,882	108.320	37,032,658.240	
	CIE FINANC RICHEMONT	64,458	140.750	9,072,463.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	87,221	275.750	24,051,190.750	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,236	211.800	1,108,984.800	
	SIKA INHABER	17,793	264.800	4,711,586.400	
	SGS SA-REG	748	2,168.000	1,621,664.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	269,394	80.690	21,737,401.860	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	152.500	865,437.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,927.000	886,420.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	15.640	329,566.080	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	581.400	1,994,783.400	
	ABB LTD	194,538	31.080	6,046,241.040	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	33.920	673,040.640	
	GEBERIT AG	4,377	511.800	2,240,148.600	
	LONZA GROUP AG-REG	9,027	567.000	5,118,309.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	10,380.000	1,422,060.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	104,100.000	1,353,300.000	
	GIVAUDAN-REG	1,173	2,854.000	3,347,742.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	18,771	444.200	8,338,078.200	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,612	293.000	1,058,316.000	
	HOLCIM LTD	66,607	56.700	3,776,616.900	
	TEMENOS GROUP	7,082	69.560	492,623.920	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	89.300	417,298.900	
	SONOVA HOLDING AG	6,984	237.500	1,658,700.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,887	241.100	1,660,455.700	
	STRAUMANN HOLDING AG	14,531	127.250	1,849,069.750	

	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	320.400	1,002,852.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	58.900	545,355.100	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	201.000	546,720.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,978	560.400	2,229,271.200	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	82.900	406,458.700	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	709.500	574,695.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	79.550	665,992.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,852	903.000	2,575,356.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	62.120	1,617,045.720	
	SWISS RE LTD	38,139	97.100	3,703,296.900	
	BKW AG	3,194	135.100	431,509.400	
	SIG GROUP AG	38,322	21.040	806,294.880	
	ALCON INC	61,285	66.380	4,068,098.300	
	UBS GROUP AG	418,921	20.070	8,407,744.470	
	VAT GROUP AG	3,325	277.200	921,690.000	
スイス・フラン　小計		2,276,198		173,837,394.280 (25,185,561,683)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	334,122	123.340	41,210,607.480	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	194,204	108.300	21,032,293.200	
	ERICSSON LM-B SHS	366,551	57.940	21,237,964.940	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	220.200	5,671,251.000	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	204.900	11,973,741.300	
	LUNDBERGS B	7,859	476.400	3,744,027.600	
	SKF AB-B SHS	46,594	197.250	9,190,666.500	
	SANDVIK AB	133,350	212.600	28,350,210.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	195,837	130.550	25,566,520.350	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	189.050	8,306,289.850	
	SWEDBANK AB	112,296	213.000	23,919,048.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,211	142.200	9,984,004.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	184,499	110.250	20,341,014.750	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	214.000	5,178,372.000	
	VOLVO AB-B SHS	191,625	205.200	39,321,450.000	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	410.100	4,159,234.200	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	94.360	6,078,293.760	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	284.100	4,344,457.200	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	283.500	6,045,637.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	129.800	3,492,528.600	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	88.340	6,721,348.900	
	INVESTOR AB-B SHS	226,392	200.300	45,346,317.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	125.480	10,325,372.760	
	ASSA ABLOY AB-B	124,612	253.900	31,638,986.800	
	TELIA CO AB	344,810	26.940	9,289,181.400	
	BOLIDEN AB	36,260	417.650	15,143,989.000	
	ALFA LAVAL AB	35,313	339.200	11,978,169.600	

	KINNEVIK AB-B	36,278	153.700	5,575,928.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	49.505	3,610,993.710	
	INDUTRADE AB	39,178	224.600	8,799,378.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	91.340	4,363,220.460	
	NIBE INDUSTRIER AB	185,845	114.850	21,344,298.250	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	239.100	4,394,658.000	
	HEXAGON AB-B SHS	248,163	115.400	28,638,010.200	
	SAGAX AB	28,022	250.300	7,013,906.600	
	EPIROC AB-A	84,563	195.150	16,502,469.450	
	EPIROC AB-B	41,205	166.800	6,872,994.000	
	ESSITY AB-B	75,180	284.200	21,366,156.000	
	EQT AB	40,716	231.200	9,413,539.200	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	48.980	3,908,163.180	
	VOLVO CAR AB	63,710	47.525	3,027,817.750	
	LIFCO AB	26,835	208.400	5,592,414.000	
	EVOLUTION AB	22,326	1,250.000	27,907,500.000	
	NORDEA BANK ABP	420,356	131.280	55,184,335.680	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	221.600	3,443,442.400	
スウェーデン・クローナ　小計		4,600,114		666,550,204.770 (8,658,487,160)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	12,549	985.600	12,368,294.400	
	A P MOLLER A/S	663	15,960.000	10,581,480.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	15,770.000	5,661,430.000	
	DANSKE BANK A/S	85,371	160.350	13,689,239.850	
	GENMAB A/S	7,926	2,661.000	21,091,086.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	340.000	8,112,060.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,723.500	1,504,615.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	206,349	997.100	205,750,587.900	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	125,436	198.420	24,889,011.120	
	COLOPLAST-B	15,343	805.800	12,363,389.400	
	DSV A/S	23,842	1,281.000	30,541,602.000	
	DEMANT A/S	11,367	209.100	2,376,839.700	
	TRYG A/S	44,887	156.700	7,033,792.900	
	PANDORA A/S	12,473	638.000	7,957,774.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	489.700	6,139,858.600	
	ORSTED A/S	23,240	621.400	14,441,336.000	
デンマーク・クローネ　小計		607,075		384,502,397.370 (7,424,741,293)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.760	1,439,627.160	
	FISHER & PAYKEL	78,460	26.300	2,063,498.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.040	1,103,951.520	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.350	398,995.900	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	5.370	709,683.090	
ニュージーランド・ドル　小計		656,830		5,715,755.670 (480,237,791)	

ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	172.100	9,702,137.500	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	74.180	12,089,188.780	
	TELENOR ASA	85,954	117.150	10,069,511.100	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	435.600	4,872,186.000	
	ORKLA ASA	116,068	69.480	8,064,404.640	
	EQUINOR ASA	115,617	322.350	37,269,139.950	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	481.500	9,550,071.000	
	AKER BP ASA	38,723	275.300	10,660,441.900	
	SALMAR ASA	7,248	409.400	2,967,331.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	182.400	4,691,510.400	
	ADEVINTA ASA	24,382	74.800	1,823,773.600	
	DNB BANK ASA	119,319	205.600	24,531,986.400	
ノルウェー・クローネ　小計		783,397		136,291,682.470 (1,789,509,791)	
ユーロ	CRH PLC	90,748	43.560	3,952,982.880	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19,953	147.400	2,941,072.200	
	KERRY GROUP PLC-A	20,761	89.920	1,866,829.120	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	63.680	1,111,279.680	
	UMICORE	24,290	31.220	758,333.800	
	AIR LIQUIDE	65,317	147.740	9,649,933.580	
	AIRBUS SE	73,377	121.940	8,947,591.380	
	AXA SA	228,092	28.410	6,480,093.720	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	83,720	28.340	2,372,624.800	
	ADIDAS AG	21,974	136.400	2,997,253.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	18.150	2,624,725.950	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	165.800	517,296.000	
	DANONE	79,150	53.770	4,255,895.500	
	SAFRAN SA	42,557	133.300	5,672,848.100	
	INTESA SANPAOLO	2,050,973	2.495	5,117,177.630	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	41,577	97.190	4,040,868.630	
	ACCOR SA	18,305	31.730	580,817.650	
	BOUYGUES	29,123	32.120	935,430.760	
	BNP PARIBAS	139,023	63.890	8,882,179.470	
	THALES SA	12,886	133.550	1,720,925.300	
	CAPGEMINI SA	19,839	175.950	3,490,672.050	
	UNICREDIT SPA	241,149	18.236	4,397,593.160	
	D'IETEREN TRDG	2,736	180.900	494,942.400	
	KONINKLIJKE DSM NV	22,201	118.000	2,619,718.000	
	COMMERZBANK AG	141,036	10.670	1,504,854.120	
	EIFFAGE	11,784	102.500	1,207,860.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	26.320	1,288,311.360	
	UNITED INTERNET	10,010	20.670	206,906.700	
	PUBLICIS GROUPE	29,405	75.360	2,215,960.800	
	IBERDROLA SA	779,592	10.890	8,489,756.880	
	ENI SPA	315,196	13.192	4,158,065.630	

JERONIMO MARTINS	34,644	19.250	666,897.000	
KESKO OYJ-B	35,252	20.180	711,385.360	
KBC GROUPE	32,213	69.020	2,223,341.260	
HANNOVER RUECK SE	7,105	182.300	1,295,241.500	
WARTSILA OYJ	50,956	9.138	465,635.920	
L'OREAL	30,122	372.950	11,233,999.900	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	34,454	777.300	26,781,094.200	
GEA GROUP AG	17,490	41.220	720,937.800	
BOLLORE	114,808	5.110	586,668.880	
MEDIOBANCA SPA	86,792	9.830	853,165.360	
MICHELIN(CGDE)-B	86,908	29.400	2,555,095.200	
CONTINENTAL AG	12,921	66.200	855,370.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	124,772	39.885	4,976,531.220	
OMV AG	17,258	47.110	813,024.380	
VERBUND AG	7,320	79.100	579,012.000	
PERNOD-RICARD	24,888	198.150	4,931,557.200	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	16,854	53.120	895,284.480	
RENAULT SA	27,902	40.575	1,132,123.650	
REPSOL SA	178,713	14.850	2,653,888.050	
REMY COINTREAU	2,866	167.900	481,201.400	
MERCK KGAA	16,230	181.850	2,951,425.500	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	61,460	55.930	3,437,457.800	
RWE AG	77,853	39.900	3,106,334.700	
SEB SA	2,596	108.300	281,146.800	
SOCIETE GENERALE-A	100,409	26.390	2,649,793.510	
VINCI S.A.	66,767	105.640	7,053,265.880	
SODEXO	9,822	87.980	864,139.560	
SOFINA	2,281	228.400	520,980.400	
SOLVAY SA	9,070	105.950	960,966.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	67,865	149.000	10,111,885.000	
VIVENDI SE	98,944	9.706	960,350.460	
SAP SE	130,068	106.920	13,906,870.560	
TELEFONICA S.A	664,975	3.904	2,596,062.400	
TOTALENERGIES SE	310,090	58.190	18,044,137.100	
VALEO	26,570	19.145	508,682.650	
E.ON SE	280,287	10.340	2,898,167.580	
VOEST-ALPINE AG	10,593	33.960	359,738.280	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	65.200	872,115.200	
SIEMENS AG-REG	95,329	141.460	13,485,240.340	
UPM-KYMMENE OYJ	67,758	33.230	2,251,598.340	
ING GROEP NV-CVA	470,718	12.926	6,084,500.860	
PUMA AG	16,210	60.200	975,842.000	
BAYER AG	121,329	58.620	7,112,305.980	
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	12.965	971,856.400	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	68.580	1,347,185.520	

MERCEDES-BENZ GROUP AG	99,529	71.940	7,160,116.260	
BASF SE	116,408	48.070	5,595,732.560	
BEIERSDORF AG	12,940	113.050	1,462,867.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	20,809	64.100	1,333,856.900	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	37.510	894,801.050	
ASM INTERNATIONAL NV	5,978	314.550	1,880,379.900	
ORANGE	255,481	10.882	2,780,144.240	
SAMPO OYJ-A SHS	58,396	45.690	2,668,113.240	
RANDSTAD NV	15,584	57.300	892,963.200	
ALLIANZ SE	50,940	215.200	10,962,288.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.754	1,511,562.820	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	125,884	29.945	3,769,596.380	
HERMES INTL	3,916	1,677.500	6,569,090.000	
ENDESA S.A.	37,701	18.610	701,615.610	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	9.657	698,606.690	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	34.400	1,571,598.400	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17,612	319.500	5,627,034.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	66,878	27.860	1,863,221.080	
DASSAULT SYSTEMES SA	81,900	36.910	3,022,929.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	27.930	658,338.030	
RHEINMETALL STAMM	5,596	244.900	1,370,460.400	
HEINEKEN NV	32,026	97.100	3,109,724.600	
AKZO NOBEL	22,627	68.560	1,551,307.120	
ASML HOLDING NV	50,605	579.000	29,300,295.000	
AEGON NV	232,433	4.822	1,120,791.920	
VOLKSWAGEN AG	3,315	162.650	539,184.750	
VOLKSWAGEN AG PFD	22,269	127.800	2,845,978.200	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	735,118	7.028	5,166,409.300	
KERING	9,382	553.800	5,195,751.600	
ACCIONA S.A.	2,642	182.700	482,693.400	
FORTUM OYJ	54,194	14.170	767,928.980	
AGEAS	18,136	41.630	755,001.680	
UCB SA	16,732	81.800	1,368,677.600	
NEMETSCHEK SE	9,878	53.680	530,251.040	
CARREFOUR SA	75,572	18.260	1,379,944.720	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.110	461,546.470	
NOKIA OYJ	679,569	4.351	2,956,804.710	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	115,512	15.550	1,796,211.600	
WOLTERS KLUWER-CVA	32,047	110.650	3,546,000.550	
SANOFI	142,461	89.910	12,808,668.510	
STMICROELECTRONICS NV	86,919	44.610	3,877,456.590	
ELISA OYJ	20,242	54.220	1,097,521.240	
BANCO SANTANDER SA	2,066,857	3.480	7,192,662.360	

RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	16.120	790,057.320	
QIAGEN N.V.	27,412	43.550	1,193,792.600	
DEUTSCHE BANK AG-REG	253,716	11.294	2,865,468.500	
BMW VORZUG	7,821	89.400	699,197.400	
ENEL SPA	1,019,343	5.234	5,335,241.260	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	403,392	20.945	8,449,045.440	
SARTORIUS AG	2,847	415.100	1,181,789.700	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	20.180	222,625.760	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	159,023	33.595	5,342,377.680	
RATIONAL AG	516	609.000	314,244.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	130.350	634,283.100	
BECHTLE AG	8,139	39.970	325,315.830	
KONINKLIJKE KPN NV	475,739	3.220	1,531,879.580	
EUROFINS SCIENTIFIC	17,824	67.500	1,203,120.000	
TELEPERFORMANCE	7,845	250.100	1,962,034.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	23,884	165.050	3,942,054.200	
EURAZEO	5,673	63.350	359,384.550	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	78.560	889,142.080	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	81.800	887,775.400	
INDITEX	136,321	28.230	3,848,341.830	
ESSILORLUXOTTICA	35,682	164.750	5,878,609.500	
SNAM SPA	256,415	4.684	1,201,047.860	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	11.350	1,631,222.000	
ENAGAS	38,270	16.960	649,059.200	
WENDEL	5,449	101.900	555,253.100	
TENARIS SA	55,855	15.680	875,806.400	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.306	277,935.510	
TERNA SPA	166,064	7.186	1,193,335.900	
BIOMERIEUX	4,870	93.540	455,539.800	
GRIFOLS SA	31,982	12.605	403,133.110	
FERROVIAL SA	63,513	25.990	1,650,702.870	
NESTE OYJ	50,599	44.550	2,254,185.450	
RECORDATI SPA	10,908	39.450	430,320.600	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	10.500	606,637.500	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	230.300	1,679,808.200	
KONE OYJ	43,814	48.650	2,131,551.100	
ELIA GROUP	4,078	125.900	513,420.200	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	323.400	1,005,450.600	
ENGIE	221,751	14.020	3,108,949.020	
ALSTOM	37,007	27.440	1,015,472.080	
IPSEN SA	3,873	108.000	418,284.000	
ARKEMA SA	6,392	95.220	608,646.240	
LEGRAND SA	32,783	86.220	2,826,550.260	
AMPLIFON SPA	12,300	27.090	333,207.000	
ADP	3,975	133.700	531,457.500	
ORION OYJ	13,559	46.060	624,527.540	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	11.510	683,763.060	
SYMRISE AG	17,265	96.220	1,661,238.300	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	34.830	1,129,258.260	
PRYSMIAN SPA	30,728	35.820	1,100,676.960	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	113.300	275,205.700	
CAIXABANK	566,059	3.947	2,234,234.870	
BUREAU VERITAS SA	39,729	26.830	1,065,929.070	
GETLINK	63,509	15.855	1,006,935.190	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	19.695	781,655.160	
AMADEUS IT GROUP SA	54,712	56.900	3,113,112.800	
BRENNTAG SE	17,934	71.480	1,281,922.320	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	20.080	495,714.960	
EDENRED	31,091	54.020	1,679,535.820	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.887	304,503.430	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	69.400	569,704.600	
VONOVIA SE	85,937	23.800	2,045,300.600	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	134,537	9.890	1,330,570.930	
KNORR-BREMSE AG	10,342	66.780	690,638.760	
OCI NV	12,329	31.580	389,349.820	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	34,318	48.600	1,667,854.800	
FERRARI NV	15,435	244.800	3,778,488.000	
CNH INDUSTRIAL NV	124,604	15.480	1,928,869.920	
AROUNDTOWN SA	113,225	2.369	268,230.020	
AIB GROUP PLC	147,578	3.878	572,307.480	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	36.730	635,171.890	
MONCLER SPA	25,014	57.720	1,443,808.080	
NEXI SPA	83,576	7.430	620,969.680	
PROSUS NV	102,526	66.660	6,834,383.160	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	110.500	1,676,727.000	
JDE PEET'S BV	14,385	27.540	396,162.900	
EXOR NV	14,142	76.700	1,084,691.400	
SIEMENS ENERGY AG	59,014	18.745	1,106,217.430	
EURONEXT NV	10,081	69.000	695,589.000	
IMCD NV	6,823	143.400	978,418.200	
WORLDLINE SA	29,916	37.740	1,129,029.840	
NN GROUP NV	36,289	38.090	1,382,248.010	
FINECOBANK SPA	75,180	15.805	1,188,219.900	
ARGENX SE	6,753	346.200	2,337,888.600	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	92,502	22.310	2,063,719.620	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	56,693	30.000	1,700,790.000	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	36.300	356,538.600	
ZALANDO SE	31,321	37.820	1,184,560.220	
STELLANTIS NV	280,695	16.450	4,617,432.750	
AENA SME SA	9,989	141.350	1,411,945.150	

	CELLNEX TELECOM SAU	69,572	35.890	2,496,939.080	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	19.890	450,906.300	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	16.255	858,832.920	
	SCOUT24 SE	10,048	51.180	514,256.640	
	COVESTRO AG	27,558	40.320	1,111,138.560	
	HELLOFRESH SE	17,856	20.720	369,976.320	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	105,327	56.690	5,970,987.630	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.856	580,409.980	
	AMUNDI SA	10,436	61.300	639,726.800	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.295	431,144.300	
	ADYEN NV	2,593	1,326.200	3,438,836.600	
	DELIVERY HERO SE	22,564	37.220	839,832.080	
ユーロ　小計		22,540,483		581,510,214.570 (83,592,093,344)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	15.540	3,993,780.000	
	CLP HOLDINGS LTD	197,296	56.500	11,147,224.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	42.250	3,942,516.500	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	151,891	319.400	48,513,985.400	
	MTR CORP	192,441	39.900	7,678,395.900	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	128.800	12,248,364.800	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	27.150	4,641,889.800	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	42.550	6,438,666.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	7.370	11,323,312.220	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	53.250	13,893,138.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	26.650	11,192,866.750	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	20.700	3,582,466.200	
	SINO LAND CO	411,200	10.080	4,144,896.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	180,565	108.400	19,573,246.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	64.650	3,427,743.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	180,156	78.250	14,097,207.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	15.380	2,737,640.000	
	AIA GROUP LTD	1,493,316	81.200	121,257,259.200	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	10.320	4,779,563.520	
	SANDS CHINA LTD	335,800	27.700	9,301,660.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	17.460	2,444,400.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	20.600	4,152,960.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	43.050	8,443,611.750	
	ESR GROUP LTD	216,400	13.880	3,003,632.000	

	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	5.070	1,249,755.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	23.150	6,134,750.000	
	WH GROUP LTD	931,500	4.700	4,378,050.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	47.550	14,761,659.750	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	49.400	13,150,033.000	
香港・ドル　小計		9,768,669		375,634,671.790 (6,521,017,902)	
合計		140,786,597		807,379,101,023 (807,379,101,023)	

（２）株式以外の有価証券

2023年2月27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	1,393,906.500	
		GOODMAN GROUP	214,602.000	4,285,601.940	
		GPT GROUP	219,223.000	1,012,810.260	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	973,804.500	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,999,838.730	
		STOCKLAND	259,328.000	995,819.520	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,140,398.050	
	オーストラリア・ドル　小計		2,482,786.000	11,802,179.500 (1,082,259,860)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,535,100.450	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,233,898.400	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	805,970.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	697,460.000	
	シンガポール・ドル　小計		2,107,509.000	4,272,428.850 (431,558,038)	
投資信託受益証券　合計			4,590,295	1,513,817,898 (1,513,817,898)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,835.000	2,858,022.900	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,329,840.810	
		AMERICAN TOWER CORP	58,087.000	11,369,368.510	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58,993.000	1,228,234.260	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,932.000	2,963,100.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	18,531.000	1,236,388.320	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,271.000	1,545,142.530	
		CROWN CASTLE INC	54,164.000	7,104,150.240	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	36,258.000	3,808,540.320	

	EQUINIX INC	11,399.000	7,806,035.200	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,419,884.660	
	EQUITY RESIDENTIAL	46,054.000	2,932,258.180	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,345.000	1,914,843.700	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	16,256.000	2,613,802.240	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30,095.000	1,588,113.150	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42,371.000	833,861.280	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68,971.000	1,693,238.050	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,558,373.460	
	INVITATION HOMES INC	76,646.000	2,418,181.300	
	IRON MOUNTAIN INC	34,514.000	1,805,082.200	
	KIMCO REALTY	79,991.000	1,651,014.240	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	763,049.850	
	MID AMERICA	13,578.000	2,225,705.760	
	PROLOGIS INC	115,173.000	13,979,698.740	
	PUBLIC STORAGE	19,317.000	5,664,517.080	
	REALTY INCOME CORP	76,685.000	4,982,991.300	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,219,489.650	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	13,584.000	3,502,226.880	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	40,894.000	4,982,116.020	
	SUN COMMUNITIES INC	14,694.000	2,153,405.700	
	UDR INC	41,516.000	1,811,343.080	
	VENTAS INC	48,092.000	2,389,691.480	
	VICI PROPERTIES INC	120,602.000	4,014,840.580	
	WELLTOWER INC	58,944.000	4,413,137.280	
	WEYERHAEUSER CO	89,893.000	2,774,996.910	
	WP CAREY INC	23,664.000	1,941,394.560	
アメリカ・ドル　小計		1,612,427.000	118,496,080.420 (16,147,460,880)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	520,753.290	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	518,674.970	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,363,238.890	
イギリス・ポンド　小計		361,284.000	2,402,667.150 (391,490,585)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	428,860.740	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	315,597.120	
カナダ・ドル　小計		23,146.000	744,457.860 (74,609,567)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	303,960.000	
	GECINA SA	5,045.000	539,815.000	
	KLEPIERRE	25,279.000	586,978.380	

		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	788,955.150	
		WAREHOUSES DE PAUW	27,206.000	775,371.000	
	ユーロ　小計		76,131.000	2,995,079.530 (430,542,682)	
	香港・ドル	LINK REIT	262,516.000	13,965,851.200	
	香港・ドル　小計		262,516.000	13,965,851.200 (242,447,177)	
投資証券　合計			2,335,504	17,286,550,891 (17,286,550,891)	
合計				18,800,368,789 (18,800,368,789)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率(%)	組入投資信託受益証券時価比率(%)	組入投資証券時価比率(%)	有価証券の合計金額に対する比率(%)
アメリカ・ドル	株式　601銘柄	68.80	－	－	72.47
	投資証券　36銘柄	－	－	1.91	
イギリス・ポンド	株式　77銘柄	4.52	－	－	4.68
	投資証券　3銘柄	－	－	0.05	
イスラエル・シュケル	株式　10銘柄	0.13	－	－	0.13
オーストラリア・ドル	株式　52銘柄	2.21	－	－	2.40
	投資信託受益証券　7銘柄	－	0.13	－	
カナダ・ドル	株式　86銘柄	3.58	－	－	3.67
	投資証券　2銘柄	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式　16銘柄	0.33	－	－	0.39
	投資信託受益証券　4銘柄	－	0.05	－	
スイス・フラン	株式　43銘柄	2.97	－	－	3.05
スウェーデン・クローナ	株式　45銘柄	1.02	－	－	1.05
デンマーク・クローネ	株式　16銘柄	0.88	－	－	0.90
ニュージーランド・ドル	株式　5銘柄	0.06	－	－	0.06
ノルウェー・クローネ	株式　12銘柄	0.21	－	－	0.22
ユーロ	株式　221銘柄	9.87	－	－	10.17
	投資証券　5銘柄	－	－	0.05	
香港・ドル	株式　29銘柄	0.77	－	－	0.82
	投資証券　1銘柄	－	－	0.03	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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2月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	29,122,146,084
コール・ローン	281,977,231
国債証券	212,473,745,620
未収利息	1,155,979,315
前払費用	170,851,844
流動資産合計	243,204,700,094
資産合計	243,204,700,094
負債の部	
流動負債	
未払金	27,296,700,447
未払解約金	22,883,000
流動負債合計	27,319,583,447
負債合計	27,319,583,447
純資産の部	
元本等	
元本	106,807,686,183
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	109,077,430,464
元本等合計	215,885,116,647
純資産合計	215,885,116,647
負債純資産合計	243,204,700,094

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2月26日 至　2023年2月27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．　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2月27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	70,478,534,058円
同期中追加設定元本額	77,666,339,435円
同期中一部解約元本額	41,337,187,310円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	8,069,985,210円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	4,664,534円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	25,013,145円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	59,017,975円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	61,093,331円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	42,637,226円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	48,023,427円
たわらノーロード　先進国債券	17,032,637,194円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	245,247,641円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,490,096,312円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	65,360,184円
たわらノーロード　バランス（標準型）	335,170,560円
たわらノーロード　バランス（積極型）	71,793,070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）	16,102,836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）	978,013,592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）	1,586,938,015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）	727,024,225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）	431,298,496円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	2,004,570円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	13,848,744円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	178,820,340円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	14,943,880円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	24,735,641円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,617,035,248円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	845,009,994円
Ｏｎｅグローバルバランス	19,675,883円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	743,440,279円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,368,236,637円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,625,122,028円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	419,973,327円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	846,255,978円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	741,934,563円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	14,015,594円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	512,673,651円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	36,330,259円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	146,595,885円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	150,866,647円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	232,224,640円
クルーズコントロール	895,480,870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＞	600,448,211円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	610,839,468円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	181,820,147円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	318,874,880円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,051,013,220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）	259,574,682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）	265,741,005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）	128,786,227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）	162,358,218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）	256,453,982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）	618,270,983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）	198,620,020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）	231,445,712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）	208,546,866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）	5,554,139,474円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	2,584,899,763円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,555,699,464円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,282,464,617円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	81,242,436円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,166,703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）	442,107,851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）	362,944,405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）	238,451,787円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,931,845円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,911,489円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,822,125円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,876円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,713,798円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	43,966,666円

ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,620,029,510円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,399,685,001円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,546,932,972円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	65,747,358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）	124,222,256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）	1,489,912,024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）	298,850,180円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	163,842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）	305,817,896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）	273,773,162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）	379,947,236円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	46,662,175円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	56,505,520円
コア資産形成ファンド	37,769,335円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	2,416,318,794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）	13,056,552,449円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	7,052,612,220円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,364,933,377円
計	106,807,686,183円
２．　受益権の総数	106,807,686,183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2月26日 至　2023年2月27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2月27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2月27日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,370,842,742
合計	△1,370,842,742

（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2月27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2月27日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0213円 (20,213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2月27日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 02/15/24	4,800,000.000	4,576,687.480	
		US T N/B 0.25 03/15/24	3,910,000.000	3,717,860.120	
		US T N/B 0.25 05/15/24	7,500,000.000	7,074,023.400	
		US T N/B 0.25 05/31/25	3,890,000.000	3,522,577.320	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,551,723.410	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,164,765.620	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,423,859.350	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,223,988.260	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,333,759.350	

		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,572,187.480	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,284,472.630	
		US T N/B 0.375 04/15/24	4,140,000.000	3,930,089.030	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,331,800.010	
		US T N/B 0.375 07/15/24	4,000,000.000	3,750,156.240	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,188,932.010	
		US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,830,937.500	
		US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,863,437.500	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,310,000.000	2,778,848.430	
		US T N/B 0.375 11/30/25	3,190,000.000	2,848,321.070	
		US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,676,328.110	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,592,212.050	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,620,139.820	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,027,738.670	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,688,259.370	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,367,343.750	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,589,525.000	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,082,120.290	
		US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,898,531.250	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,453,568.360	
		US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,430,324.190	
		US T N/B 0.625 08/15/30	6,340,000.000	4,968,975.000	
		US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,731,250.000	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,297,632.780	
		US T N/B 0.625 12/31/27	3,320,000.000	2,800,342.170	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,707,088.240	
		US T N/B 0.75 03/31/26	3,220,000.000	2,878,755.430	
		US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,295,457.020	
		US T N/B 0.75 05/31/26	3,630,000.000	3,224,319.110	
		US T N/B 0.75 08/31/26	2,950,000.000	2,599,802.720	
		US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,431,989.820	
		US T N/B 0.875 01/31/24	200,000.000	192,382.810	
		US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	2,946,158.570	
		US T N/B 0.875 09/30/26	8,110,000.000	7,162,777.290	
		US T N/B 0.875 11/15/30	8,280,000.000	6,591,656.240	
		US T N/B 1.0 07/31/28	3,770,000.000	3,189,626.140	
		US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,302,786.690	
		US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,557,081.220	
		US T N/B 1.125 02/15/31	11,890,000.000	9,634,615.610	
		US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,773,029.670	
		US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	971,996.090	
		US T N/B 1.125 02/29/28	8,860,000.000	7,633,097.580	
		US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,082,351.540	
		US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	1,980,431.240	
		US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,172,248.430	
		US T N/B 1.125 10/31/26	3,390,000.000	3,017,100.000	
		US T N/B 1.25 03/31/28	5,810,000.000	5,026,330.800	
		US T N/B 1.25 04/30/28	4,010,000.000	3,461,287.880	
		US T N/B 1.25 05/15/50	6,370,000.000	3,504,992.990	

		US T N/B 1.25 05/31/28	7,300,000.000	6,289,691.370	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,191,034.730	
		US T N/B 1.25 08/15/31	12,130,000.000	9,787,393.750	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,712,598.430	
		US T N/B 1.25 09/30/28	3,980,000.000	3,401,034.370	
		US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,299,792.940	
		US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,463,011.680	
		US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	702,890.620	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	2,770,192.910	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	992,492.180	
		US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,046,368.340	
		US T N/B 1.375 11/15/31	7,990,000.000	6,474,396.870	
		US T N/B 1.375 11/15/40	6,190,000.000	4,046,712.500	
		US T N/B 1.375 12/31/28	4,500,000.000	3,855,937.500	
		US T N/B 1.5 01/31/27	4,940,000.000	4,431,913.240	
		US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,268,113.250	
		US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,157,240.990	
		US T N/B 1.5 02/29/24	4,000,000.000	3,859,687.480	
		US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,380,021.060	
		US T N/B 1.5 09/30/24	4,310,000.000	4,080,694.500	
		US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,607,553.100	
		US T N/B 1.5 11/30/24	9,000,000.000	8,488,125.000	
		US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,456,093.720	
		US T N/B 1.625 02/15/26	2,890,000.000	2,660,380.440	
		US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,360,343.750	
		US T N/B 1.625 05/15/31	9,240,000.000	7,734,168.740	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,414,107.770	
		US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,408,925.770	
		US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,552,359.370	
		US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	2,907,210.890	
		US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,641,019.520	
		US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	3,935,742.160	
		US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,763,906.240	
		US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,282,631.250	
		US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,899,050.770	
		US T N/B 1.75 08/15/41	6,930,000.000	4,778,451.540	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,779,095.690	
		US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,881,171.870	
		US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,920,594.510	
		US T N/B 1.875 02/15/32	7,280,000.000	6,138,803.060	
		US T N/B 1.875 02/15/41	4,700,000.000	3,343,976.520	
		US T N/B 1.875 02/15/51	7,920,000.000	5,136,243.690	
		US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,281,715.620	
		US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,521,562.480	
		US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,731,803.110	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,839,531.240	
		US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	781,882.800	
		US T N/B 1.875 11/15/51	4,670,000.000	3,015,798.430	
		US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,933,218.750	

		US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,499,375.000	
		US T N/B 2.0 04/30/24	4,720,000.000	4,551,850.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	800,000.000	769,750.000	
		US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	278,264.060	
		US T N/B 2.0 08/15/25	4,050,000.000	3,803,835.930	
		US T N/B 2.0 08/15/51	6,110,000.000	4,076,992.900	
		US T N/B 2.0 11/15/26	2,830,000.000	2,598,293.750	
		US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,056,679.680	
		US T N/B 2.125 02/29/24	1,650,000.000	1,602,111.310	
		US T N/B 2.125 03/31/24	3,340,000.000	3,234,581.250	
		US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,735,218.750	
		US T N/B 2.125 05/31/26	1,550,000.000	1,441,136.700	
		US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	364,562.500	
		US T N/B 2.125 09/30/24	590,000.000	564,510.150	
		US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,697,535.920	
		US T N/B 2.25 01/31/24	710,000.000	691,778.500	
		US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,491,775.000	
		US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	3,044,937.500	
		US T N/B 2.25 03/31/24	4,750,000.000	4,606,201.160	
		US T N/B 2.25 03/31/26	1,300,000.000	1,217,582.020	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,191,460.920	
		US T N/B 2.25 05/15/41	5,420,000.000	4,100,568.740	
		US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,891,193.720	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,070,000.000	1,484,739.820	
		US T N/B 2.25 08/15/49	3,040,000.000	2,166,237.470	
		US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,248,839.830	
		US T N/B 2.25 11/15/24	3,080,000.000	2,946,212.500	
		US T N/B 2.25 11/15/25	3,620,000.000	3,406,476.530	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	2,990,133.970	
		US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,861,953.110	
		US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,768,136.700	
		US T N/B 2.375 03/31/29	3,000,000.000	2,712,656.250	
		US T N/B 2.375 04/30/26	1,260,000.000	1,182,923.420	
		US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,098,269.090	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,470,000.000	3,136,554.680	
		US T N/B 2.375 05/15/51	5,560,000.000	4,055,325.000	
		US T N/B 2.375 08/15/24	4,610,000.000	4,436,764.820	
		US T N/B 2.375 11/15/49	3,290,000.000	2,410,953.120	
		US T N/B 2.5 01/31/24	2,550,000.000	2,490,333.960	
		US T N/B 2.5 01/31/25	500,000.000	478,710.930	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,762,277.320	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,360,410.930	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,153,531.240	
		US T N/B 2.5 03/31/27	11,050,000.000	10,289,880.770	
		US T N/B 2.5 04/30/24	4,010,000.000	3,890,326.560	
		US T N/B 2.5 05/15/24	5,100,000.000	4,943,015.620	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,230,000.000	1,686,263.290	
		US T N/B 2.5 05/31/24	4,180,000.000	4,047,415.620	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,334,309.370	

		US T N/B 2.625 02/15/29	4,330,000.000	3,978,525.750	
		US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,714,064.820	
		US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,870,625.000	
		US T N/B 2.625 05/31/27	3,410,000.000	3,185,286.310	
		US T N/B 2.625 07/31/29	2,570,000.000	2,350,947.640	
		US T N/B 2.625 12/31/25	1,000,000.000	950,234.370	
		US T N/B 2.75 02/15/24	2,090,000.000	2,043,873.020	
		US T N/B 2.75 02/15/28	8,370,000.000	7,816,468.280	
		US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,884,203.100	
		US T N/B 2.75 04/30/27	3,000,000.000	2,818,828.110	
		US T N/B 2.75 05/15/25	4,000,000.000	3,834,218.720	
		US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,044,765.620	
		US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	995,556.230	
		US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,581,846.870	
		US T N/B 2.75 08/15/32	5,840,000.000	5,284,971.810	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,540,000.000	1,249,565.620	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,761,700.000	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,749,079.680	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,259,387.500	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,777,851.550	
		US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,923,281.240	
		US T N/B 2.875 04/30/29	3,000,000.000	2,790,468.740	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,860,000.000	4,553,592.150	
		US T N/B 2.875 05/15/32	10,650,000.000	9,753,902.280	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,889,786.690	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,300,000.000	2,683,312.500	
		US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,668,955.440	
		US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,508,426.560	
		US T N/B 2.875 06/15/25	4,920,000.000	4,727,620.270	
		US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,110,625.000	
		US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,237,142.550	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,434,529.680	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	874,800.000	
		US T N/B 2.875 11/30/25	1,360,000.000	1,301,456.240	
		US T N/B 3.0 02/15/47	1,960,000.000	1,623,278.090	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,195,359.360	
		US T N/B 3.0 02/15/49	3,310,000.000	2,755,316.370	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	915,384.360	
		US T N/B 3.0 05/15/45	4,900,000.000	4,068,148.400	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,340,803.120	
		US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,080,249.980	
		US T N/B 3.0 07/31/24	3,820,000.000	3,711,070.290	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,810,000.000	3,159,918.750	
		US T N/B 3.0 08/15/52	5,340,000.000	4,459,317.150	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,681,572.240	
		US T N/B 3.0 10/31/25	1,270,000.000	1,219,497.640	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,300,406.240	
		US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	718,100.000	
		US T N/B 3.125 02/15/42	1,860,000.000	1,611,370.300	

		US T N/B 3.125 02/15/43	1,740,000.000	1,494,632.790	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,400,857.000	
		US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,924,423.430	
		US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,780,745.300	
		US T N/B 3.125 08/31/27	3,940,000.000	3,752,850.000	
		US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,930,081.610	
		US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,142,864.030	
		US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	886,842.180	
		US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	3,309,681.220	
		US T N/B 3.25 06/30/27	3,500,000.000	3,352,207.000	
		US T N/B 3.25 06/30/29	3,000,000.000	2,848,359.360	
		US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,271,247.630	
		US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,618,646.860	
		US T N/B 3.375 11/15/48	3,200,000.000	2,852,749.960	
		US T N/B 3.5 02/15/39	500,000.000	469,765.620	
		US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,920,312.500	
		US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,507,367.960	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,362,850.760	
		US T N/B 3.75 08/15/41	820,000.000	783,996.860	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,379,015.620	
		US T N/B 3.875 01/15/26	8,800,000.000	8,642,562.540	
		US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,258,959.370	
		US T N/B 3.875 09/30/29	3,250,000.000	3,198,520.510	
		US T N/B 3.875 11/30/27	3,000,000.000	2,951,542.980	
		US T N/B 3.875 11/30/29	2,300,000.000	2,263,703.120	
		US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,524,710.920	
		US T N/B 4.0 10/31/29	2,000,000.000	1,983,125.000	
		US T N/B 4.0 11/15/42	3,320,000.000	3,260,862.500	
		US T N/B 4.0 11/15/52	4,860,000.000	4,914,675.000	
		US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,082,428.120	
		US T N/B 4.125 01/31/25	9,000,000.000	8,881,347.690	
		US T N/B 4.125 09/30/27	7,000,000.000	6,951,054.670	
		US T N/B 4.125 10/31/27	3,940,000.000	3,913,143.330	
		US T N/B 4.125 11/15/32	4,500,000.000	4,555,898.460	
		US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	975,679.680	
		US T N/B 4.25 09/30/24	2,200,000.000	2,175,078.130	
		US T N/B 4.25 10/15/25	2,800,000.000	2,775,117.180	
		US T N/B 4.25 11/15/40	600,000.000	613,500.000	
		US T N/B 4.25 12/31/24	9,000,000.000	8,898,398.460	
		US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	627,375.000	
		US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	945,262.500	
		US T N/B 4.375 05/15/41	230,000.000	239,451.560	
		US T N/B 4.375 10/31/24	2,070,000.000	2,050,310.730	
		US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,042,031.250	
		US T N/B 4.5 02/15/36	1,400,000.000	1,493,078.110	
		US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	635,250.000	
		US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,035,967.180	
		US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,562,190.620	
		US T N/B 4.5 11/30/24	4,200,000.000	4,169,484.390	

	US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	955,081.250	
	US T N/B 4.75 02/15/41	830,000.000	904,764.830	
	US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	619,301.940	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	895,488.270	
	US T N/B 5.375 02/15/31	860,000.000	937,937.500	
	US T N/B 6.0 02/15/26	400,000.000	416,218.740	
	US T N/B 6.125 11/15/27	200,000.000	215,875.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	861,227.800	
アメリカ・ドル　小計		887,010,000.000 (120,872,852,700)	784,655,407.690 (106,924,992,405)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,150,000.000	1,040,764.720	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,738,265.400	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,040,000.000	875,539.600	
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	2,400,000.000	2,234,068.800	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,770,000.000	1,333,813.230	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,330,000.000	2,067,525.500	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	956,105.210	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,980,000.000	1,642,734.720	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,960,000.000	999,740.000	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	992,001.000	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,350,000.000	918,558.900	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	450,000.000	196,375.310	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,670,000.000	870,571.000	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	900,000.000	676,397.880	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	2,260,000.000	1,893,983.960	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,370,000.000	1,886,393.440	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	950,000.000	918,605.910	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	760,000.000	500,361.200	
	UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	307,576.820	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,600,000.000	1,444,758.400	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,630,000.000	864,910.600	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,600,000.000	1,012,958.070	

		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,100,000.000	1,025,359.280	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	601,753.790	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,110,000.000	621,534.280	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,130,000.000	1,015,308.600	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	870,000.000	500,615.400	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	438,037.810	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	396,818.100	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	666,539.080	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	1,046,703.360	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,190,000.000	1,142,780.800	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	898,237.500	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	810,000.000	795,825.000	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,940,000.000	2,589,268.580	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,450,000.000	1,321,317.710	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	930,000.000	858,055.200	
		UK TREASURY 3.75 01/29/38	400,000.000	386,604.000	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	920,124.130	
		UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,400,000.000	1,322,300.000	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	912,622.850	
		UK TREASURY 4.125 01/29/27	800,000.000	807,188.000	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,700,000.000	1,756,798.350	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,940,000.000	3,078,285.840	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,260,000.000	1,287,742.680	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	910,000.000	933,148.930	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,091,870.800	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,080,000.000	1,102,137.400	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	1,041,950.250	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,263,718.930	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	957,410.280	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,265,000.000	1,335,916.400	

	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,395,000.000	1,501,949.070	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	980,000.000	1,061,751.600	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,095,000.000	2,146,252.910	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	761,124.000	
イギリス・ポンド　小計		74,724,000.000 (12,175,528,560)	62,959,060.580 (10,258,549,331)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	320,000.000	300,004.800	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	310,000.000	279,074.400	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,743,056.280	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,359,068.140	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,450,000.000	1,077,336.950	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,300,000.000	2,167,823.600	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	560,000.000	455,889.850	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,230,000.000	2,067,096.270	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,360,000.000	2,163,912.320	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	1,320,000.000	1,309,261.800	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	2,090,000.000	2,027,247.750	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,090,000.000	1,313,854.390	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,310,050.640	
イスラエル・シュケル　小計		20,000,000.000 (743,894,000)	18,573,677.190 (690,842,351)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,990,000.000	1,878,903.790	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,360,000.000	1,244,112.180	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,815,000.000	1,628,809.050	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,170,000.000	1,720,835.930	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,358,908.560	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,390,000.000	1,917,296.750	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,610,000.000	1,349,035.520	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,650,000.000	979,605.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,540,574.410	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	880,000.000	818,708.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,668,901.630	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	970,000.000	959,419.560	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	900,000.000	739,106.340	

	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	574,157.110	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,230,000.000	1,181,169.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,260,000.000	1,201,319.620	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,314,320.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,180,000.000	968,886.380	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	2,470,000.000	2,286,222.790	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,700,000.000	1,689,214.510	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,500,000.000	1,464,636.100	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	736,797.930	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	804,660.050	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,200,000.000	1,186,640.960	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,200,000.000	1,224,216.590	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,230,000.000	1,299,399.170	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,000,000.000	3,130,447.500	
オーストラリア・ドル　小計		40,735,000.000 (3,735,399,500)	36,866,304.430 (3,380,640,116)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	10,000,000.000	9,945,000.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	4,200,000.000	4,189,335.730	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	30,000,000.000	29,731,500.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,443,033.320	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	34,500,000.000	34,363,356.880	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	12,000,000.000	11,999,138.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	41,800,000.000	41,492,003.380	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	26,000,000.000	25,706,200.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,313,523.670	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	30,100,000.000	29,854,685.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,236,515.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	7,300,000.000	7,108,765.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	17,500,000.000	17,256,270.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,518,497.650	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,633,250.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	13,000,000.000	12,756,831.880	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,000,000.000	19,751,915.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	20,000,000.000	19,879,000.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	3,000,000.000	2,965,041.870	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	16,000,000.000	15,930,153.280	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	10,994,138.540	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	21,300,000.000	21,094,469.910	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	7,500,000.000	7,542,375.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,104,545.260	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	15,600,000.000	15,710,760.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	1,000,000.000	1,012,550.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	450,000.000	460,012.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,604,650.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	20,320,000.000	20,417,899.720	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	5,100,000.000	5,152,921.170	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	18,950,000.000	19,687,613.590	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,230,000.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,249,715.510	
オフショア・人民元　小計			478,720,000.000 (9,350,694,144)	477,335,668.560 (9,323,654,413)	
カナダ・ドル		CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,265,637.150	
		CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,431,510.000	
		CANADA 0.5 09/01/25	1,910,000.000	1,749,655.500	
		CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,446,035.400	
		CANADA 0.75 02/01/24	200,000.000	193,049.200	
		CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	765,518.040	
		CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	495,576.950	
		CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,157,184.630	
		CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	660,879.800	
		CANADA 1.25 03/01/27	1,210,000.000	1,102,802.470	
		CANADA 1.25 06/01/30	1,850,000.000	1,595,639.800	
		CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,041,537.200	
		CANADA 1.5 05/01/24	940,000.000	907,710.060	

		CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	652,668.100	
		CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,133,672.450	
		CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	421,655.080	
		CANADA 1.5 12/01/31	2,020,000.000	1,730,911.740	
		CANADA 1.75 12/01/53	2,200,000.000	1,549,937.400	
		CANADA 2.0 06/01/28	850,000.000	791,502.150	
		CANADA 2.0 06/01/32	1,940,000.000	1,725,630.000	
		CANADA 2.0 12/01/51	3,260,000.000	2,471,334.280	
		CANADA 2.25 03/01/24	420,000.000	410,345.040	
		CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,270,177.920	
		CANADA 2.25 06/01/29	430,000.000	402,056.880	
		CANADA 2.25 12/01/29	500,000.000	465,221.000	
		CANADA 2.5 06/01/24	970,000.000	946,390.200	
		CANADA 2.5 12/01/32	4,220,000.000	3,909,049.300	
		CANADA 2.75 08/01/24	590,000.000	576,086.030	
		CANADA 2.75 09/01/27	850,000.000	820,378.350	
		CANADA 2.75 12/01/48	630,000.000	566,923.770	
		CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	342,695.730	
		CANADA 3.0 10/01/25	2,300,000.000	2,242,909.400	
		CANADA 3.0 11/01/24	860,000.000	841,118.700	
		CANADA 3.5 03/01/28	1,580,000.000	1,576,817.880	
		CANADA 3.5 12/01/45	700,000.000	713,937.000	
		CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,148,796.720	
		CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	616,443.600	
		CANADA 5.0 06/01/37	280,000.000	330,240.960	
		CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	835,495.520	
		CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	731,509.560	
	カナダ・ドル　小計		48,250,000.000 (4,835,615,000)	44,036,640.960 (4,413,352,157)	
	シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	380,000.000	351,234.000	
		SINGAPORE 1.25 11/01/26	410,000.000	380,070.000	
		SINGAPORE 1.625 07/01/31	350,000.000	308,630.000	
		SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	399,840.000	
		SINGAPORE 1.875 10/01/51	410,000.000	339,113.050	
		SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	275,744.000	
		SINGAPORE 2.125 06/01/26	1,040,000.000	997,880.000	
		SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	527,403.950	
		SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	760,110.000	
		SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	169,290.000	
		SINGAPORE 2.625 05/01/28	420,000.000	407,820.000	
		SINGAPORE 2.75 03/01/46	500,000.000	480,000.000	
		SINGAPORE 2.75 04/01/42	910,000.000	870,378.600	
		SINGAPORE 2.875 07/01/29	590,000.000	577,433.000	
		SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	197,556.000	
		SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	603,880.000	
		SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	132,812.500	
		SINGAPORE 3.0 09/01/24	720,000.000	714,297.600	
		SINGAPORE 3.375 09/01/33	330,000.000	333,465.000	

	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	804,800.000	
シンガポール・ドル　小計		10,135,000.000 (1,023,736,350)	9,631,757.700 (972,903,845)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	5,420,000.000	4,418,568.280	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	2,890,000.000	2,609,781.220	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,010,000.000	2,655,271.430	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	8,710,000.000	8,128,124.420	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	5,000,000.000	4,853,175.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,120,000.000	6,032,579.700	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,420,000.000	3,792,331.980	
スウェーデン・クローナ　小計		34,570,000.000 (449,064,300)	32,489,832.030 (422,042,918)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,200,000.000	2,087,745.000	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,180,000.000	3,314,288.560	
	DENMARK 0.25 11/15/52	3,760,000.000	1,987,388.680	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,350,000.000	5,717,578.100	
	DENMARK 0.5 11/15/29	7,080,000.000	6,120,940.360	
	DENMARK 1.75 11/15/25	4,540,000.000	4,399,177.810	
	DENMARK 4.5 11/15/39	9,760,000.000	11,999,522.750	
デンマーク・クローネ　小計		37,870,000.000 (731,269,700)	35,626,641.260 (687,950,443)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	350,000.000	280,393.800	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/24	650,000.000	614,699.350	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	507,507.140	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	580,000.000	456,750.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	252,092.490	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	350,000.000	282,522.980	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	820,000.000	783,718.180	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	730,000.000	580,612.080	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	440,000.000	306,118.250	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	350,000.000	320,510.250	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	350,000.000	318,800.470	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	125,047.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	700,000.000	695,919.180	
ニュージーランド・ドル　小計		6,430,000.000 (540,248,600)	5,524,691.170 (464,184,552)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,221,375.750	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,720,874.720	
	NORWAY 1.5 02/19/26	7,900,000.000	7,442,913.900	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,245,296.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	6,130,000.000	5,905,995.070	

	NORWAY 1.75 09/06/29	2,620,000.000	2,357,986.900	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,936,278.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	3,260,000.000	2,914,583.440	
	NORWAY 3.0 03/14/24	2,370,000.000	2,356,015.230	
ノルウェー・クローネ　小計		33,710,000.000 (442,612,300)	31,101,319.010 (408,360,319)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,513,080.400	
	POLAND 0.75 04/25/25	3,370,000.000	3,019,351.500	
	POLAND 07/25/24	1,710,000.000	1,574,292.270	
	POLAND 1.25 10/25/30	3,930,000.000	2,713,594.260	
	POLAND 1.75 04/25/32	4,170,000.000	2,831,013.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,150,000.000	2,019,875.100	
	POLAND 2.5 04/25/24	780,000.000	749,236.800	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,464,295.400	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,010,720.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,480,000.000	2,923,739.400	
	POLAND 2.75 10/25/29	630,000.000	504,472.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	6,830,000.000	6,377,307.600	
	POLAND 3.75 05/25/27	1,450,000.000	1,306,015.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,391,328.000	
ポーランド・ズロチ　小計		36,970,000.000 (1,126,135,776)	31,398,321.230 (956,417,983)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	910,387.080	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	1,002,487.200	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	646,110.930	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,364,183.640	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,999,884.820	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,411,565.820	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,777,350.590	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,631,946.190	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	1,100,000.000	1,113,256.980	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	702,232.160	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	600,000.000	605,835.480	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,430,000.000	1,447,707.540	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,681,905.520	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	920,000.000	931,783.720	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,400,000.000	2,431,302.960	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	910,719.630	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,600,000.000	1,517,669.410	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,030,000.000	1,042,549.620	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	683,357.580	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	600,000.000	608,542.920	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,078,132.120	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,252,974.240	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,068,407.100	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	950,000.000	1,003,793.560	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,200,000.000	1,278,158.400	

	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	317,063.130	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,806,688.770	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	620,000.000	674,638.610	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,126,910.600	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,726,837.120	
マレーシア・リンギット　小計		38,200,000.000 (1,168,347,000)	38,754,383.440 (1,185,302,818)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	10,580,000.000	9,040,610.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	9,180,000.000	8,176,763.700	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	5,790,000.000	5,109,935.550	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	6,290,000.000	5,440,944.350	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	5,796,520.570	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	21,702,000.000	21,391,858.880	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	39,842,000.000	35,193,965.320	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	29,646,000.000	27,377,191.620	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,648,000.000	27,982,236.960	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	26,977,000.000	23,168,522.020	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	4,835,000.000	4,312,771.650	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,070,000.000	21,039,922.460	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	21,661,000.000	18,905,720.800	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	19,353,647.950	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,645,839.220	
メキシコ・ペソ　小計		270,507,000.000 (2,005,295,442)	246,936,451.050 (1,830,564,605)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	930,000.000	753,953.790	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	710,000.000	557,823.570	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	1,580,000.000	1,481,221.560	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	570,000.000	482,254.200	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	450,000.000	255,150.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	380,000.000	256,804.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	920,000.000	794,732.800	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,070,000.000	970,210.730	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	410,000.000	180,292.300	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	750,597.360	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	334,407.870	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,190,000.000	1,100,423.940	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	126,241.300	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	900,000.000	746,520.300	
	AUSTRIA 07/15/24	520,000.000	498,519.320	

		AUSTRIA 1.2 10/20/25	940,000.000	899,262.900	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	640,000.000	464,230.400	
		AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	110,314.000	
		AUSTRIA 1.65 10/21/24	930,000.000	909,217.510	
		AUSTRIA 1.85 05/23/49	290,000.000	224,235.830	
		AUSTRIA 2.0 07/15/26	160,000.000	155,215.250	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	278,109.000	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	770,000.000	715,014.300	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	540,000.000	538,925.400	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	240,000.000	274,732.770	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	2,490,000.000	2,739,000.000	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	710,000.000	749,253.770	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	415,000.000	469,692.850	
		BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	506,994.820	
		BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	723,221.900	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	1,300,000.000	1,058,720.000	
		BELGIUM 0.35 06/22/32	600,000.000	466,920.000	
		BELGIUM 0.4 06/22/40	450,000.000	274,480.200	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	750,000.000	719,748.370	
		BELGIUM 0.65 06/22/71	670,000.000	265,799.720	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	1,980,000.000	1,883,439.360	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	960,000.000	877,574.400	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	1,010,000.000	907,485.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	2,600,000.000	2,302,037.400	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	2,430,000.000	2,284,260.750	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,570,000.000	1,338,470.530	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	679,080.510	
		BELGIUM 1.4 06/22/53	1,790,000.000	1,120,600.860	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	380,000.000	299,112.060	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	780,000.000	547,159.080	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	980,000.000	684,350.660	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	504,246.740	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	338,130.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	301,979.730	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	840,000.000	833,948.640	
		BELGIUM 2.75 04/22/39	220,000.000	202,704.920	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	680,000.000	664,347.760	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	740,000.000	776,526.400	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	630,000.000	673,738.380	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,280,000.000	1,422,798.080	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,118,694.630	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,220,000.000	1,427,395.120	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,570,000.000	1,760,528.920	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	2,110,000.000	1,937,148.800	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,495,391.820	
		BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,360,000.000	1,219,842.480	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,360,000.000	1,233,343.200	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,750,000.000	1,625,592.500	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	450,000.000	418,509.000	

		BUNDESOBL 04/05/24	1,260,000.000	1,218,674.080	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,880,000.000	1,772,088.000	
		BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,514,039.340	
		BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,500,000.000	1,453,095.000	
		BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	1,250,000.000	1,204,600.000	
		BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	900,000.000	864,216.000	
		BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	1,350,000.000	1,331,073.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,620,000.000	2,203,105.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,840,000.000	1,512,204.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,900,000.000	2,326,868.650	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,660,000.000	1,214,373.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,580,000.000	1,124,359.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,430,000.000	2,020,715.100	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	590,000.000	491,086.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,190,000.000	1,779,528.300	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	650,946.450	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	4,130,000.000	2,163,438.550	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	710,000.000	371,954.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,040,000.000	518,232.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,433,359.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,060,000.000	1,782,814.640	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,928,776.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,080,000.000	1,817,739.040	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,770,000.000	1,562,219.700	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,811,403.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,660,000.000	2,488,243.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,940,000.000	1,752,111.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,910,000.000	1,741,255.320	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	8,680,000.000	7,910,014.560	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	1,990,000.000	1,693,386.520	
		DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	2,350,000.000	1,876,851.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,820,000.000	1,767,083.500	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,311,366.200	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,430,000.000	1,897,382.880	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,520,000.000	1,491,418.450	
		DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,430,000.000	1,334,790.600	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,430,000.000	1,412,681.620	
		DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	500,000.000	429,225.000	
		DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	800,000.000	777,056.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,070,000.000	2,064,887.100	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,170,000.000	2,185,107.540	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,466,112.200	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,830,000.000	2,127,382.320	

		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,700,000.000	2,073,609.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	560,000.000	619,214.400	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,820,000.000	2,212,355.600	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	1,831,942.500	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	4,520,000.000	5,463,550.000	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,485,631.700	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	959,743.200	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	980,101.000	
		FINLAND 0.0 09/15/24	410,000.000	391,281.040	
		FINLAND 0.0 09/15/26	430,000.000	386,914.000	
		FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	167,674.870	
		FINLAND 0.125 04/15/36	290,000.000	195,498.570	
		FINLAND 0.125 04/15/52	760,000.000	344,399.320	
		FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	235,184.060	
		FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	176,085.030	
		FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	427,173.940	
		FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	231,863.900	
		FINLAND 0.5 09/15/27	420,000.000	376,984.770	
		FINLAND 0.5 09/15/28	550,000.000	480,339.750	
		FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	256,187.100	
		FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	167,470.570	
		FINLAND 0.875 09/15/25	1,210,000.000	1,148,331.140	
		FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	389,535.440	
		FINLAND 1.375 04/15/27	110,000.000	103,376.460	
		FINLAND 1.375 04/15/47	390,000.000	281,304.850	
		FINLAND 1.5 09/15/32	50,000.000	43,594.500	
		FINLAND 2.0 04/15/24	370,000.000	365,761.460	
		FINLAND 2.625 07/04/42	430,000.000	398,715.780	
		FINLAND 2.75 07/04/28	490,000.000	485,403.450	
		FINLAND 4.0 07/04/25	410,000.000	420,172.330	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,220,000.000	1,183,278.000	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/25	6,190,000.000	5,825,105.690	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	6,410,000.000	5,869,034.460	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,450,000.000	2,183,829.550	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	7,590,000.000	5,779,785.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,890,000.000	2,384,775.980	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,780,000.000	3,026,268.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,536,905.240	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,620,000.000	2,374,356.660	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	4,230,000.000	3,999,063.150	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,460,000.000	3,200,344.300	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,105,256.660	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,150,000.000	1,368,607.030	

		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	293,861.890	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	3,150,000.000	1,830,861.900	
		FRANCE OAT 0.75 02/25/28	1,980,000.000	1,781,604.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,110,000.000	4,580,733.010	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	4,040,000.000	2,163,860.360	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,950,000.000	1,019,970.900	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	5,400,000.000	4,793,936.400	
		FRANCE OAT 03/25/24	3,020,000.000	2,921,780.540	
		FRANCE OAT 03/25/25	3,320,000.000	3,117,078.280	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,360,000.000	2,181,871.920	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,599,668.160	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,860,000.000	2,359,863.220	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	4,690,000.000	3,706,507.000	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/38	500,000.000	379,750.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,480,000.000	3,129,170.760	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,470,000.000	1,691,297.920	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	663,638.580	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,070,000.000	1,684,483.200	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,380,000.000	2,326,402.400	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,524,393.000	
		FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,600,000.000	1,465,225.600	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,472,750.000	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,550,000.000	4,436,823.300	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/43	250,000.000	219,690.250	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,890,000.000	3,864,532.170	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,470,000.000	2,450,128.850	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,000,000.000	3,046,650.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,729,206.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,170,000.000	1,342,827.720	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,110,673.440	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,064,031.520	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,930,000.000	2,234,140.980	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,880,000.000	4,437,649.120	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,086,803.020	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,332,567.720	
		IRISH 0.0 10/18/31	870,000.000	673,567.050	
		IRISH 0.2 05/15/27	520,000.000	465,012.600	
		IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	448,169.700	
		IRISH 0.35 10/18/32	400,000.000	311,835.200	
		IRISH 0.4 05/15/35	370,000.000	267,502.600	
		IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	156,721.500	
		IRISH 0.9 05/15/28	610,000.000	552,306.810	
		IRISH 1.0 05/15/26	950,000.000	896,684.480	
		IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	655,342.900	
		IRISH 1.3 05/15/33	390,000.000	328,431.090	
		IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	319,222.800	
		IRISH 1.5 05/15/50	580,000.000	394,715.790	
		IRISH 1.7 05/15/37	350,000.000	288,857.800	
		IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	669,169.200	

		IRISH 2.4 05/15/30	590,000.000	570,839.750	
		IRISH 3.0 10/18/43	630,000.000	605,407.320	
		IRISH 3.4 03/18/24	240,000.000	241,061.520	
		IRISH 5.4 03/13/25	1,560,000.000	1,634,303.550	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,520,000.000	1,355,688.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,400,000.000	1,346,282.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,250,000.000	1,101,500.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,460,000.000	1,386,313.800	
		ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,275,367.200	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,220,122.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,800,000.000	1,691,514.050	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,500,000.000	1,221,225.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,467,382.980	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	919,820.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,520,000.000	1,139,422.400	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,310,000.000	1,173,367.000	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,610,000.000	1,255,568.160	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,080,000.000	694,548.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,380,000.000	1,037,346.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,080,540.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,482,432.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,300,112.220	
		ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	989,505.000	
		ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,281,460.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,530,000.000	1,397,677.950	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,550,000.000	1,292,951.100	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	793,520.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	2,280,000.000	2,179,746.120	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	680,000.000	656,264.940	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	475,227.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,460,000.000	1,394,316.410	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,350,000.000	1,262,925.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,790,000.000	1,451,883.320	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,456,146.840	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,020,000.000	581,803.920	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,171,524.790	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	773,720.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	970,685.100	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,191,144.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	5,350,000.000	4,912,862.200	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,587,341.800	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.000	1,394,175.000	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,290,000.000	1,223,730.120	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	206,964.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	319,107.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,290,000.000	1,211,181.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	860,000.000	669,510.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,116,457.860	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	790,280.000	

		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,350,000.000	1,309,773.800	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,607,710.790	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,150,309.600	
		ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,220,000.000	1,157,292.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,590,000.000	1,184,232.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	478,170.000	
		ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,120,320.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,740,000.000	1,640,966.160	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,810,000.000	1,508,816.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,521,306.710	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	2,350,000.000	1,953,322.350	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	515,820.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	969,766.480	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,020,000.000	912,998.130	
		ITALY BTPS 3.4 04/01/28	550,000.000	536,800.000	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,007,746.740	
		ITALY BTPS 3.5 01/15/26	3,900,000.000	3,874,650.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,870,000.000	1,810,694.820	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,624,085.640	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	850,000.000	762,936.200	
		ITALY BTPS 3.85 12/15/29	800,000.000	788,800.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,170,000.000	2,072,350.000	
		ITALY BTPS 4.0 04/30/35	660,000.000	630,960.000	
		ITALY BTPS 4.4 05/01/33	2,700,000.000	2,705,670.000	
		ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,500,000.000	1,470,000.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,710,000.000	1,726,123.590	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,910,000.000	1,951,065.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,750,795.200	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,139,459.400	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	560,000.000	574,809.760	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,740,178.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,970,000.000	3,125,925.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,250,000.000	1,316,875.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,140,000.000	2,304,352.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,460,000.000	1,621,184.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,805,624.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,510,000.000	1,685,462.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	392,280.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/26	2,020,000.000	1,857,133.050	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,080,000.000	967,876.110	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,110,000.000	943,093.740	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	359,886.560	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,000,000.000	478,435.000	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	572,081.220	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,200,000.000	952,980.950	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,490,000.000	1,397,982.930	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,060,000.000	905,826.180	

		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,110,000.000	765,343.890	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,420,000.000	1,311,228.000	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/32	200,000.000	162,342.400	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,062,457.920	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,240,000.000	1,115,308.080	
		NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	565,070.740	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,140,000.000	1,123,374.240	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,078,281.750	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,540,000.000	1,546,742.120	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,520,000.000	1,719,749.280	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,040,000.000	2,293,368.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	780,000.000	873,600.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	2,050,000.000	1,928,681.000	
		SPAIN 0.0 01/31/26	1,960,000.000	1,785,115.080	
		SPAIN 0.0 01/31/27	1,610,000.000	1,420,181.000	
		SPAIN 0.0 01/31/28	1,160,000.000	993,946.000	
		SPAIN 0.0 05/31/24	1,110,000.000	1,067,114.040	
		SPAIN 0.0 05/31/25	670,000.000	623,324.830	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,380,000.000	1,059,150.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	1,080,000.000	1,036,589.400	
		SPAIN 0.5 04/30/30	1,500,000.000	1,235,859.000	
		SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,286,949.000	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,288,475.730	
		SPAIN 0.7 04/30/32	2,650,000.000	2,082,635.000	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,750,000.000	1,577,887.500	
		SPAIN 0.8 07/30/29	700,000.000	600,565.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	600,000.000	405,958.490	
		SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	330,696.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,590,000.000	830,259.840	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	835,647.380	
		SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,509,025.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,730,000.000	1,619,326.710	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,170,000.000	1,068,170.220	
		SPAIN 1.4 07/30/28	3,810,000.000	3,474,720.000	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,400,000.000	1,259,713.690	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,560,000.000	1,441,283.170	
		SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	192,255.560	
		SPAIN 1.5 04/30/27	2,210,000.000	2,064,250.500	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,577,034.780	
		SPAIN 1.85 07/30/35	2,840,000.000	2,329,808.200	
		SPAIN 1.9 10/31/52	670,000.000	431,924.880	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,330,000.000	1,280,242.040	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,612,300.080	
		SPAIN 2.15 10/31/25	2,010,000.000	1,958,913.840	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,470,000.000	1,314,915.000	

		SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,587,561.720	
		SPAIN 2.7 10/31/48	1,190,000.000	967,814.540	
		SPAIN 2.75 10/31/24	2,190,000.000	2,176,135.110	
		SPAIN 2.9 10/31/46	2,380,000.000	2,040,409.700	
		SPAIN 3.45 07/30/43	250,000.000	233,299.060	
		SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	999,764.640	
		SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,481,664.450	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,400,000.000	1,468,423.600	
		SPAIN 4.65 07/30/25	3,995,000.000	4,129,495.670	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,630,000.000	1,813,280.460	
		SPAIN 4.8 01/31/24	1,200,000.000	1,217,737.200	
		SPAIN 4.9 07/30/40	2,440,000.000	2,755,980.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	1,830,000.000	2,009,065.500	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,442,114.300	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,815,000.000	2,151,700.650	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,769,933.870	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,460,000.000	1,673,054.880	
	ユーロ　小計		541,137,000.000 (77,788,443,750)	490,810,346.880 (70,553,987,364)	
国債証券　合計			236,989,137,121.700 (236,989,137,122)	212,473,745,620 (212,473,745,620)	
合計				212,473,745,620 (212,473,745,620)	

（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	262銘柄	49.53	50.32
イギリス・ポンド	国債証券	56銘柄	4.75	4.83
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	0.32	0.33
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	1.57	1.59
オフショア・人民元	国債証券	33銘柄	4.32	4.39
カナダ・ドル	国債証券	40銘柄	2.04	2.08
シンガポール・ドル	国債証券	20銘柄	0.45	0.46
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.20	0.20
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.32	0.32
ニュージーランド・ドル	国債証券	13銘柄	0.22	0.22
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.19	0.19
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	0.44	0.45
マレーシア・リンギット	国債証券	30銘柄	0.55	0.56
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.85	0.86
ユーロ	国債証券	357銘柄	32.68	33.21

（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

該当事項はありません。

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間（2023年2月28日から2023年8月27日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2023年2月27日現在	第6期中間計算期間末 2023年8月27日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	－	9,353,149
コール・ローン	268,207,962	307,463,941
親投資信託受益証券	8,078,488,743	9,396,505,910
流動資産合計	8,346,696,705	9,713,323,000
資産合計	8,346,696,705	9,713,323,000
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,153,411	11,752,308
未払受託者報酬	880,730	990,131
未払委託者報酬	5,284,550	5,941,008
未払利息	－	1,312
その他未払費用	156,679	176,163
流動負債合計	18,475,370	18,860,922
負債合計	18,475,370	18,860,922
純資産の部		
元本等		
元本	7,372,635,592	8,110,591,118
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	955,585,743	1,583,870,960
（分配準備積立金）	177,642,647	168,218,060
元本等合計	8,328,221,335	9,694,462,078
純資産合計	8,328,221,335	9,694,462,078
負債純資産合計	8,346,696,705	9,713,323,000

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自　2022年2月26日 至　2022年8月25日	第6期中間計算期間 自　2023年2月28日 至　2023年8月27日
営業収益		
受取利息	863	1,573
有価証券売買等損益	178,125,184	505,793,167
営業収益合計	178,126,047	505,794,740
営業費用		
支払利息	19,956	75,360
受託者報酬	705,199	990,131
委託者報酬	4,231,358	5,941,008
その他費用	125,449	176,163
営業費用合計	5,081,962	7,182,662
営業利益又は営業損失（△）	173,044,085	498,612,078
経常利益又は経常損失（△）	173,044,085	498,612,078
中間純利益又は中間純損失（△）	173,044,085	498,612,078
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	4,405,634	18,670,039
期首剰余金又は期首欠損金（△）	574,095,070	955,585,743
剰余金増加額又は欠損金減少額	263,091,042	203,660,201
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	263,091,042	203,660,201
剰余金減少額又は欠損金増加額	40,078,706	55,317,023
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	40,078,706	55,317,023
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	965,745,857	1,583,870,960

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第6期中間計算期間 自　2023年2月28日 至　2023年8月27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。
２．　その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2023年2月27日、当中間計算期間末日を2023年8月27日としております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第5期 2023年2月27日現在	第6期中間計算期間末 2023年8月27日現在
１．　期首元本額	4,935,832,876円	7,372,635,592円
期中追加設定元本額	3,132,953,934円	1,158,163,949円
期中一部解約元本額	696,151,218円	420,208,423円
２．　受益権の総数	7,372,635,592口	8,110,591,118口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）
該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 2023年2月27日現在	第6期中間計算期間末 2023年8月27日現在
１．　中間貸借対照表計上額、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。	中間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、中間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。	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

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	第5期 2023年2月27日現在	第6期中間計算期間末 2023年8月27日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1296円 (11,296円)	1.1953円 (11,953円)

（参考）
当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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8月27日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,051,711,536
株式	423,847,901,510
派生商品評価勘定	18,278,700
未収配当金	561,700,249
差入委託証拠金	384,975,000
流動資産合計	433,864,566,995
資産合計	433,864,566,995
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	84,962,910
前受金	5,225,000
未払解約金	46,890,000
未払利息	38,636
流動負債合計	137,116,546
負債合計	137,116,546
純資産の部	
元本等	
元本	110,892,388,609
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	322,835,061,840
元本等合計	433,727,450,449
純資産合計	433,727,450,449
負債純資産合計	433,864,566,995

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年2月28日 至　2023年8月27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8月27日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	116,441,395,034円
同期中追加設定元本額	25,539,457,562円
同期中一部解約元本額	31,088,463,987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	2,551,527,025円
たわらノーロード　国内株式＜ラップ専用＞	2,776,199,626円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	27,956,953,436円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	3,764,519,000円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,401,759円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,675,835円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	20,438,366円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	20,126,491円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	26,324,511円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	16,308,995円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,936,807,402円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,610,631,079円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	51,369,457円
たわらノーロード　バランス（標準型）	359,829,169円
たわらノーロード　バランス（積極型）	585,787,607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）	2,999,740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）	164,440,852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）	433,892,773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）	352,848,912円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	499,165,487円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	370,540円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,563,799円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	32,636,081円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,749,499円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,439,447円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,317,399,479円
Ｏｎｅグローバルバランス	25,431,259円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	978,595,142円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,481,914,473円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,897,764,288円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	312,612,798円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,021,465,140円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,104,836,082円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	28,264,986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）	303,243,438円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	340,413,028円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	564,753,714円
投資のソムリエ	4,261,474,701円
クルーズコントロール	297,839,701円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	356,860,459円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	343,971,108円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	986,995,204円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	340,852,018円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,279,890,507円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	71,537,481円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	35,794,092円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,610,896円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	112,464,093円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	497,019,935円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	805,929,524円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	245,043,933円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	71,727,756円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	38,957,289円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	23,960,048円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	449,659,406円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	5,790,582円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,784,652円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	41,664,012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）	50,353,320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）	51,315,734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）	29,260,453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）	31,335,572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）	49,492,521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）	127,629,264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）	182,933,732円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	44,683,963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）	147,094,024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）	482,863,894円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	118,471,198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）	29,296,796円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,559,935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）	106,449,842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）	83,808,379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）	1,719,038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）	38,627,075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）	80,919,394円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,758,290円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,293,547円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,656,254円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	84,378円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,621,766円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,356,065円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	333,545,968円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	448,649,384円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,338,430,544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）	12,019,534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）	17,604,176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）	175,460,446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）	32,668,773円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	58,364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）	208,467,479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）	13,476,219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）	43,780,463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）	100,987,009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）	147,293,509円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,150,184円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,076,909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）	1,017,269円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	26,648,205円
コア資産形成ファンド	16,458,130円
ＭＨＡＭトピックスファンド	778,278,501円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	45,253,949円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	3,267,833,425円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,961,579,121円
計	110,892,388,609円
２．　受益権の総数	110,892,388,609口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年8月27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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2023年8月27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	9,973,330,000	－	9,906,790,000	△66,540,000
合計	9,973,330,000	－	9,906,790,000	△66,540,000

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年8月27日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.9112円 (39,112円)

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8月27日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,136,036,151
国債証券	487,885,835,700
地方債証券	31,197,792,960
特殊債券	29,479,221,452
社債券	25,291,490,650
未収利息	941,543,440
前払費用	199,808,855
流動資産合計	579,131,729,208
資産合計	579,131,729,208
負債の部	
流動負債	
未払解約金	43,319,000
未払利息	17,654
流動負債合計	43,336,654
負債合計	43,336,654
純資産の部	
元本等	
元本	466,608,647,504
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	112,479,745,050
元本等合計	579,088,392,554
純資産合計	579,088,392,554
負債純資産合計	579,131,729,208

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年2月28日 至　2023年8月27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8月27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	424,094,237,578円
同期中追加設定元本額	319,405,680,716円
同期中一部解約元本額	276,891,270,790円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	25,673,839,628円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	55,667,126円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	89,757,098円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	49,896,746円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	790,407,950円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	272,754,221円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	40,063,917円
たわらノーロード　国内債券	18,954,933,351円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	4,826,271,445円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,421,672,219円
たわらノーロード　バランス（標準型）	2,654,297,837円
たわらノーロード　バランス（積極型）	353,893,329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）	167,875,428円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	2,144,290,903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）	2,260,385,949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）	632,040,512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）	29,173,634円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	21,343,743円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	180,164,369円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,084,561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＞	13,849,932,194円
Ｏｎｅグローバルバランス	75,819,714円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	10,377,021,043円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	14,905,080,323円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	6,553,009,329円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,529,495,198円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,569,459,313円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	472,450,226円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	74,223,820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）	5,008,698,754円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	2,187,264,083円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	437,126,294円
投資のソムリエ	108,537,189,863円
クルーズコントロール	908,394,865円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	9,435,064,388円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	5,995,862,937円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,720,999,843円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	9,670,899,459円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	36,146,572,776円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	365,703,095円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	182,945,368円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	74,111,234円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,594,184,363円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	4,051,004,761円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,919,480,531円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,800,948,202円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	417,547,671円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	199,136,583円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	122,501,436円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,758,219,934円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	29,144,415円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	140,194,279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）	1,158,108,165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）	1,185,857,115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）	1,520,361,147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）	724,118,611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）	1,143,647,712円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	2,957,607,698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）	1,927,916,339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）	1,032,707,439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）	1,975,834,843円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	10,286,257,400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）	2,294,012,068円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	3,139,999,296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）	582,312,369円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	267,995,502円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	4,665,654,869円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	4,676,992,168円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	4,633,549,045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）	1,936,161,890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）	45,550,399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）	911,099,189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）	148,206,927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）	103,346,319円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,557,577円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	59,129,603円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,168,561円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	357,831円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,767,128円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	92,709,605円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,846,424,638円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,149,660,272円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,282,846,829円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	57,692,817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）	140,982,077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）	1,683,647,728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）	104,235,945円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	563,628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）	1,774,918,676円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,900,239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）	279,871,061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）	430,516,577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）	784,979,151円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	202,136,977円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	97,819,628円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	748,262,131円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	340,516,459円
コア資産形成ファンド	206,857,140円
たわらノーロード　国内債券＜ラップ専用＞	20,080,577,191円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	41,449,900,653円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	18,145,209,368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］	640,902,420円
計	466,608,647,504円
２．　受益権の総数	466,608,647,504口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年8月27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。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年8月27日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2411円 (12,411円)

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8月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	16,827,318,827
コール・ローン	1,004,388,031
株式	1,066,121,888,826
投資信託受益証券	1,742,054,762
投資証券	20,462,331,127
派生商品評価勘定	7,813,728
未収入金	4,728,590
未収配当金	1,547,814,827
差入委託証拠金	8,698,284,862
流動資産合計	1,116,416,623,580
資産合計	1,116,416,623,580
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	781,795,073
未払解約金	25,926,000
未払利息	4,286
流動負債合計	807,725,359
負債合計	807,725,359
純資産の部	
元本等	
元本	155,652,950,237
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	959,955,947,984
元本等合計	1,115,608,898,221
純資産合計	1,115,608,898,221
負債純資産合計	1,116,416,623,580

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年2月28日 至　2023年8月27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8月27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	137,380,038,509円
同期中追加設定元本額	34,401,578,047円
同期中一部解約元本額	16,128,666,319円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,711,388,869円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,909,129円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,067,544円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	21,277,818円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	27,413,549円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	24,395,388円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	16,940,414円
たわらノーロード　先進国株式	50,600,410,928円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	301,449,030円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,943,041,908円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	868,870,678円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	83,810,670円
たわらノーロード　バランス（標準型）	753,165,084円
たわらノーロード　バランス（積極型）	976,967,298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）	33,896,337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）	219,836,111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）	228,835,674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）	393,241,064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）	286,219円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	13,992,014円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,543,855円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	10,892,396円
たわらノーロード　全世界株式	971,234,575円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	55,753,538,857円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	3,049,564,779円
Ｏｎｅグローバルバランス	13,514,084円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	146,263,824円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	786,232,335円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,032,766,834円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	86,111,473円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	246,740,224円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	243,006,363円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,341,713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	119,662,334円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	165,827,462円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	187,965,045円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	308,839,264円
投資のソムリエ	10,951,740,896円
クルーズコントロール	82,033,413円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	917,689,543円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	188,356,456円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	257,158,892円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	993,193,955円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,727,810,949円
ワールドアセットバランス（基本コース）	127,778,961円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	277,411,807円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	56,260,549円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	28,162,156円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	7,594,687円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	140,115,570円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	134,921,999円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	963,194,644円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	133,723,068円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	60,829,965円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	30,659,541円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	18,859,931円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	123,325,224円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,530,445円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	36,476,832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）	653,645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）	752,790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）	496,066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）	708,336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）	1,530,912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）	597,645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）	338,861,826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）	39,923,930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）	1,108,377,029円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	197,797,429円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,269,282,508円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	304,541,722円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	363,221円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,038,997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）	1,234,941円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	4,418,200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）	21,308,941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）	44,636,790円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,521,723円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,176,815円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,007,957円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,116円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	894,636円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,018,572円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	122,435,940円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	215,804,917円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	738,543,183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）	32,539,406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）	28,799,013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）	193,837,021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）	5,954,377円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	143,944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）	76,630,560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）	7,381,992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）	24,159,584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）	37,133,138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）	81,274,537円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	11,828,154円
コア資産形成ファンド	7,091,308円
たわらノーロード　先進国株式（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	2,862,318,406円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	137,461,118円
たわらノーロード　先進国株式（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	12,177,759円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,416,599,274円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,974,296,113円
計	155,652,950,237円
２．　受益権の総数	155,652,950,237口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年8月27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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年8月27日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,109,269,018	－	1,115,408,123	6,139,105
アメリカ・ドル	827,773,420	－	833,458,922	5,685,502
イギリス・ポンド	47,318,968	－	47,289,670	△29,298
オーストラリア・ドル	27,849,670	－	27,855,080	5,410
カナダ・ドル	27,114,738	－	27,225,071	110,333
ユーロ	179,212,222	－	179,579,380	367,158
合計	1,109,269,018	－	1,115,408,123	6,139,105

（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8月27日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	28,220,732,470	－	27,440,612,020	△780,120,450
合計	28,220,732,470	－	27,440,612,020	△780,120,450

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年8月27日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	7.1673円 (71,673円)

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8月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,202,808,787
コール・ローン	635,344,115
国債証券	240,277,123,312
未収利息	1,461,499,750
前払費用	213,324,891
流動資産合計	243,790,100,855
資産合計	243,790,100,855
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,894,000
未払利息	2,710
流動負債合計	14,896,710
負債合計	14,896,710
純資産の部	
元本等	
元本	110,880,690,838
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	132,894,513,307
元本等合計	243,775,204,145
純資産合計	243,775,204,145
負債純資産合計	243,790,100,855

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年2月28日 至　2023年8月27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．　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8月27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	106,807,686,183円
同期中追加設定元本額	21,729,440,799円
同期中一部解約元本額	17,656,436,144円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,537,518,602円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,204,974円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	14,819,705円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	36,771,547円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	31,576,035円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	45,059,663円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	29,526,921円
たわらノーロード　先進国債券	18,673,270,503円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	350,950,377円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,863,687,648円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	68,352,431円
たわらノーロード　バランス（標準型）	368,496,911円
たわらノーロード　バランス（積極型）	81,272,406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）	16,759,581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）	1,031,331,136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）	1,812,370,823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）	885,975,151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）	551,467,677円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,838,977円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	13,577,077円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	195,166,279円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	15,523,796円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	23,766,077円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,688,015,963円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	1,136,518,478円
Ｏｎｅグローバルバランス	44,198,869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	2,729,058,633円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	423,224,032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	793,870,608円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	23,420,160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）	155,498,113円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	253,905,913円
クルーズコントロール	804,717,205円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	182,522,998円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	710,989,378円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	663,378,305円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	178,900,668円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	404,894,920円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	8,859,011円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	79,632,205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）	452,134,360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）	462,653,035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）	135,377,843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）	282,603,282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）	446,480,134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）	1,107,744,078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）	379,756,288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）	402,812,653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）	506,030,195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）	4,980,407,095円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	1,384,343,283円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,360,182,626円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,277,145,907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）	103,934,930円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	47,264,311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）	755,887,158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）	344,551,905円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	240,514,661円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,932,514円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,876,206円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,759,445円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,308円

ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,511,966円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,835,730円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,445,599,785円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,351,812,788円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,485,880,194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）	55,650,993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）	114,365,944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）	1,302,188,591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）	219,338,596円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	163,302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）	256,855,659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）	249,882,824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）	364,353,998円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,635,472円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	72,239,496円
コア資産形成ファンド	44,135,444円
たわらノーロード　外国債券（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	2,322,465,335円
たわらノーロード　外国債券（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	12,099,021,284円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	8,762,925,930円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	4,899,178,610円
計	110,880,690,838円
２．　受益権の総数	110,880,690,838口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年8月27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。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年8月27日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1985円 (21,985円)

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	9,860,090,138円
Ⅱ　負債総額	9,272,643円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,850,817,495円
Ⅳ　発行済数量	8,156,559,620口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2077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8月31日現在

Ⅰ　資産総額	448,019,121,102円
Ⅱ　負債総額	513,477,742円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	447,505,643,360円
Ⅳ　発行済数量	111,174,148,705口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0253円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	581,697,753,344円
Ⅱ　負債総額	38,897,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	581,658,856,344円
Ⅳ　発行済数量	468,526,051,242口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2415円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,157,569,328,114円
Ⅱ　負債総額	1,635,434,472円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,155,933,893,642円
Ⅳ　発行済数量	156,299,567,649口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	7.3956円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	247,022,223,071円
Ⅱ　負債総額	1,513,847,752円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	245,508,375,319円
Ⅳ　発行済数量	110,804,725,648口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2157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8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8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8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	1,540,529,501,058
追加型株式投資信託	779	15,373,139,666,443
単位型公社債投資信託	22	39,167,674,424
単位型株式投資信託	208	1,101,924,931,090
合計	1,035	18,054,761,773,015

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

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社に対する出資比率が、2023年10月6日付で49.9%から23.4%に引き下がりました。

(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（2023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
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
労働金庫連合会	（※1）120,000	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央機関です。
富国生命保険相互会社	（※2）128,000	日本において保険業務を営んでおります。

（注）資本金の額は2023年3月末日現在

（※1）出資の総額

（※2）「基金」および「基金償却積立て額」の総額

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2) 信託財産の計算

(3) 信託財産に関する報告書の作成

(4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1) 募集の取扱い

(2) 追加設定の申込事務

(3) 信託契約の一部解約事務

(4) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払い

(5) 受益者に対する収益分配金の再投資

(6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7) その他上記に付帯する業務

３【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

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

・目論見書の使用開始日

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

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

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

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

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

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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4月２８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４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞の２０２２年２月２６日から２０２３年２月２７日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞の２０２３年２月２７日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

２０２３年１０月２７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

中間監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞の２０２３年２月２８日から２０２３年８月２７日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞の２０２３年８月２７日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（２０２３年２月２８日から２０２３年８月２７日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

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

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

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

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