

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券報告書  
**【提出先】** 関東財務局長殿  
**【提出日】** 2024年2月13日提出  
**【計算期間】** 第34特定期間（自 2023年5月12日 至 2023年11月13日）

**【ファンド名】** マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>  
**【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  
**【連絡場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号  
**【電話番号】** 03-6774-5100  
**【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

## 第一部【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】

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

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

<ファンドの特色>

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

\* 2023年11月末時点

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

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

## 4 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

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

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

•将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

## 収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



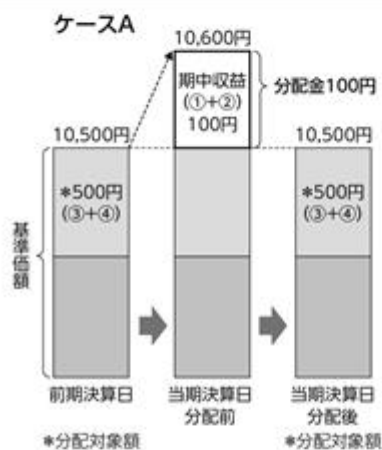
◆分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 分配金額と基準価額の関係(イメージ)

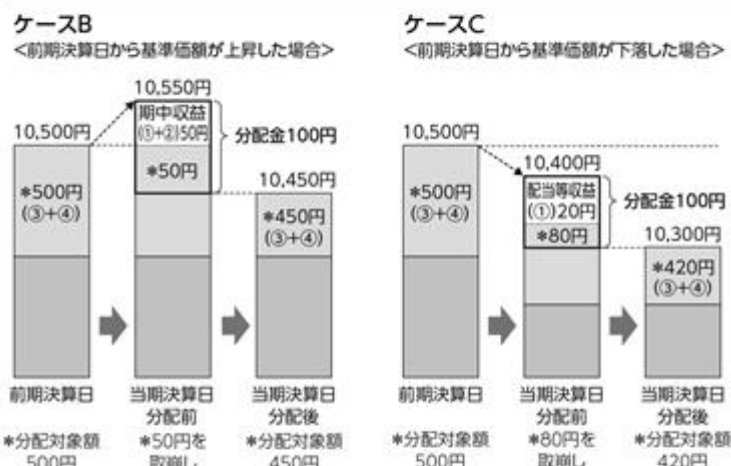
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

#### 計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



#### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



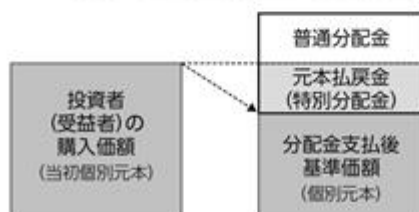
上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

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

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

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

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金 : 個別元本(投資者(受益者)のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金) : 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

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

## 商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	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

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

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

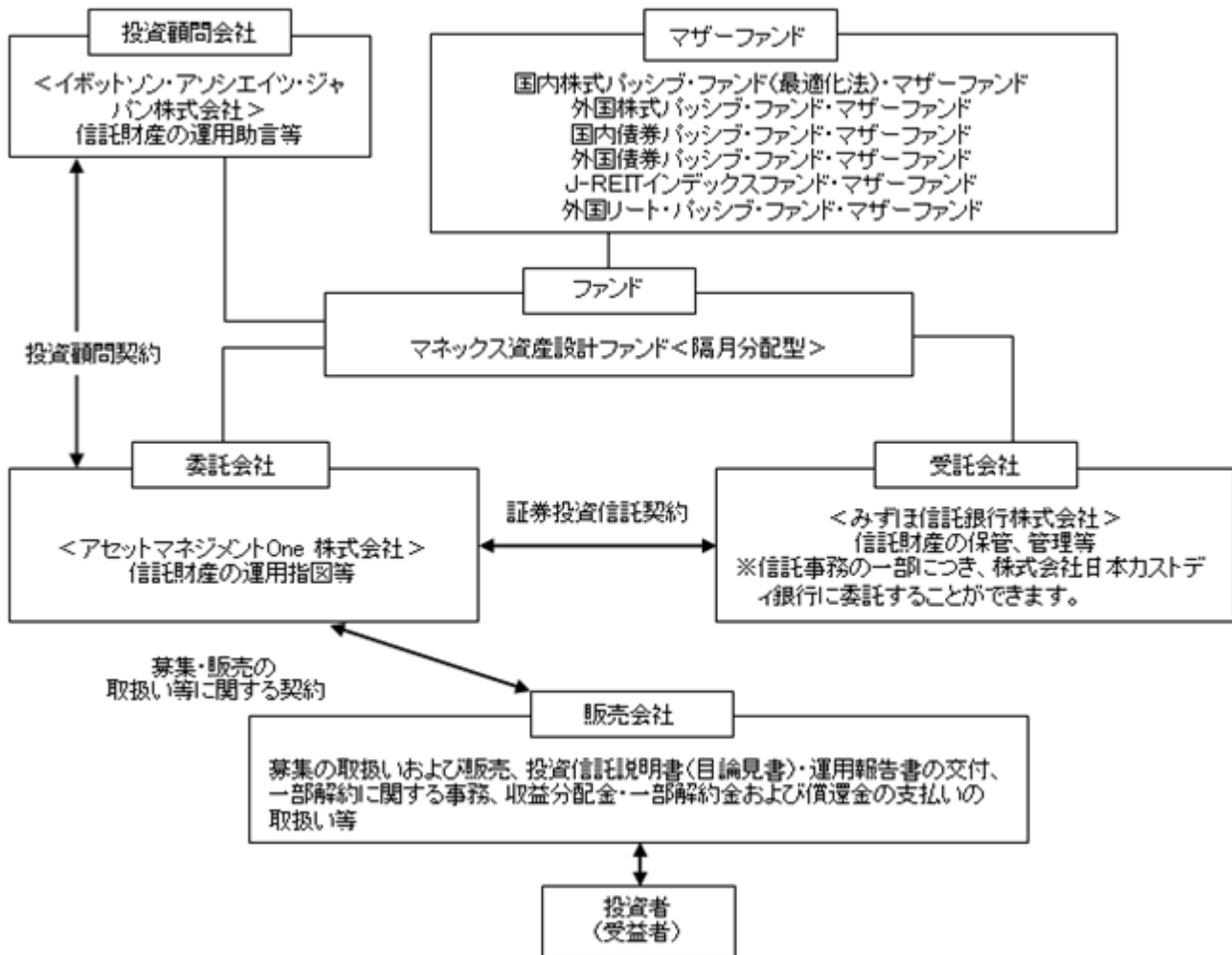
その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、 債券、不動産投信） 資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。  （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年6回（隔月）	目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。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

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

## （２）【ファンドの沿革】

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

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

- ・「投資顧問契約」の概要

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

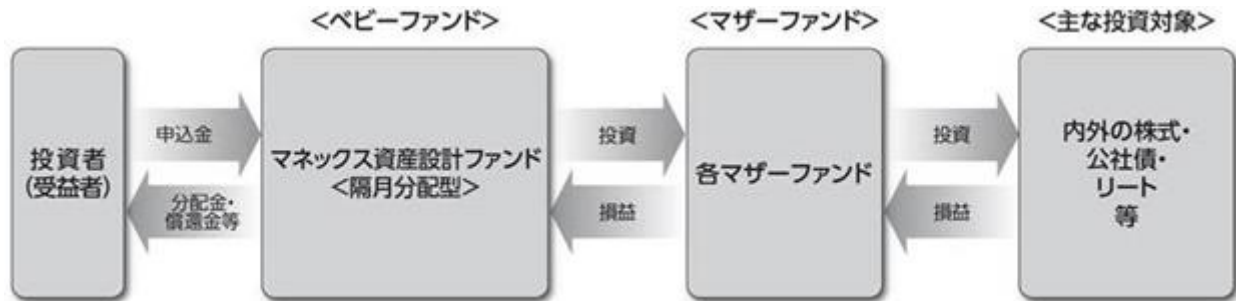
当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。



## ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2023年11月30日現在）

## 委託会社の沿革

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

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

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

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

#### <投資対象>

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

#### <投資態度>

主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよび外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券(不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。)の計6資産への分散投資を行います。

基本資産配分比率は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。

基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。

分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

リート(REIT)とは

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

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

#### <運用プロセス>

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

#### (2)【投資対象】

##### 1.投資の対象とする資産(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

##### 2.有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

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

- 1) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- 2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 5) J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- 6) 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 7) 株券または新株引受権証券
- 8) 国債証券
- 9) 地方債証券
- 10) 特別の法律により法人の発行する債券
- 11) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 12) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 13) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 14) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 15) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 16) コマーシャル・ペーパー
- 17) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ)および新株予約権証券
- 18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)から17)までの証券または証書の性質を有するもの
- 19) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
- 20) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 21) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 22) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
- 23) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 25) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
- 26) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 27) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

28)外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの

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

### 3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

1)預金

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

3)コール・ローン

4)手形割引市場において売買される手形

5)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6)外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

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

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
-------	-----------------------------

基本方針	<p>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）<sup>(注)</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>(注) 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。</p> <p>JPX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。</p> <p>JPX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。</p> <p>JPX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。</p> <p>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。</p> <p>JPX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。</p> <p>JPX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。</p> <p>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。</p>
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

投資態度

1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

運用プロセス

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。

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。

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	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
--------	---

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	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) <sup>(注)</sup> に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

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

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

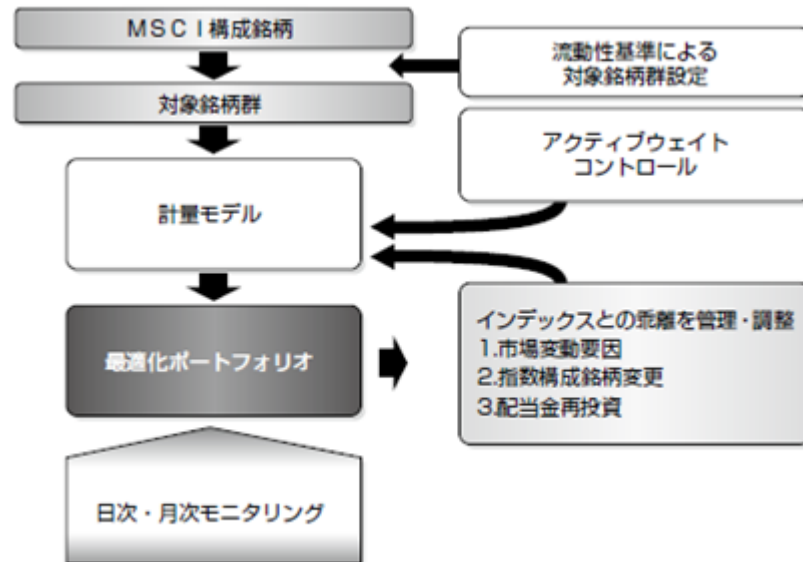
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝す

るためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

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。

組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

運用プロセス



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。

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。

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。

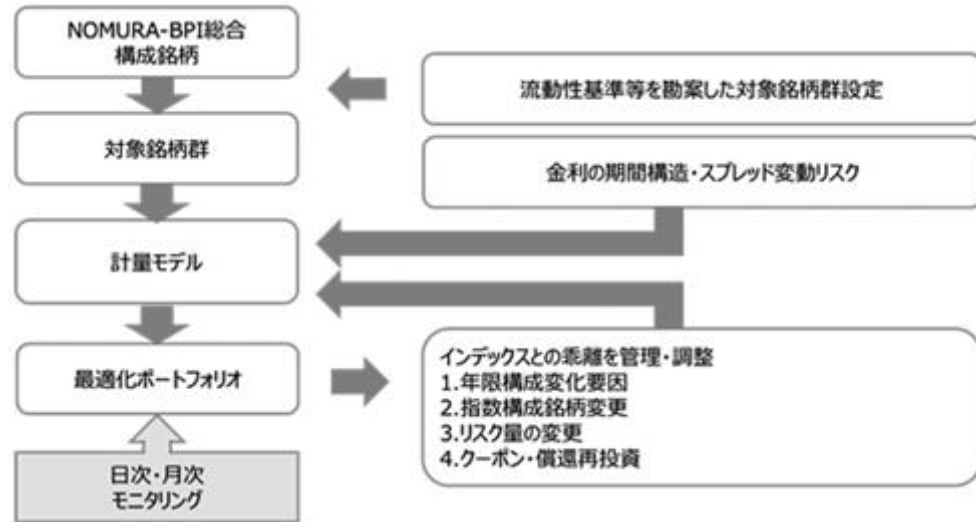
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・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

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合<sup>(注)</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>(注) NOMURA - B P I 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&amp;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&amp;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。</p> </div>
<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

## 運用プロセス



## 流動性基準等による対象銘柄群設定

NOMURA - B P I 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。

## 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。

## 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。

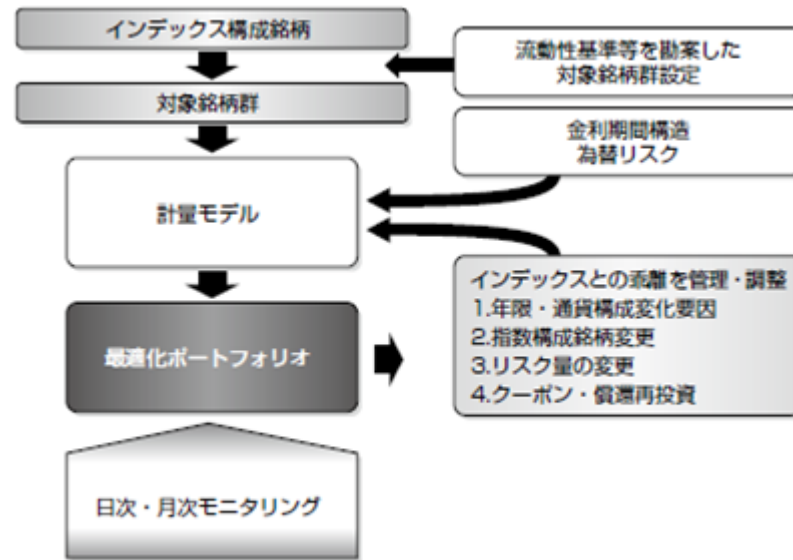
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 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

<p>主な投資制限</p>	<p>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、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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>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)」<sup>(注)</sup>に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div data-bbox="347 1406 1385 1800" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>(注) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div> <p>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。</p> <p>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。</p>

## 運用プロセス



## 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。

## 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。

## 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。

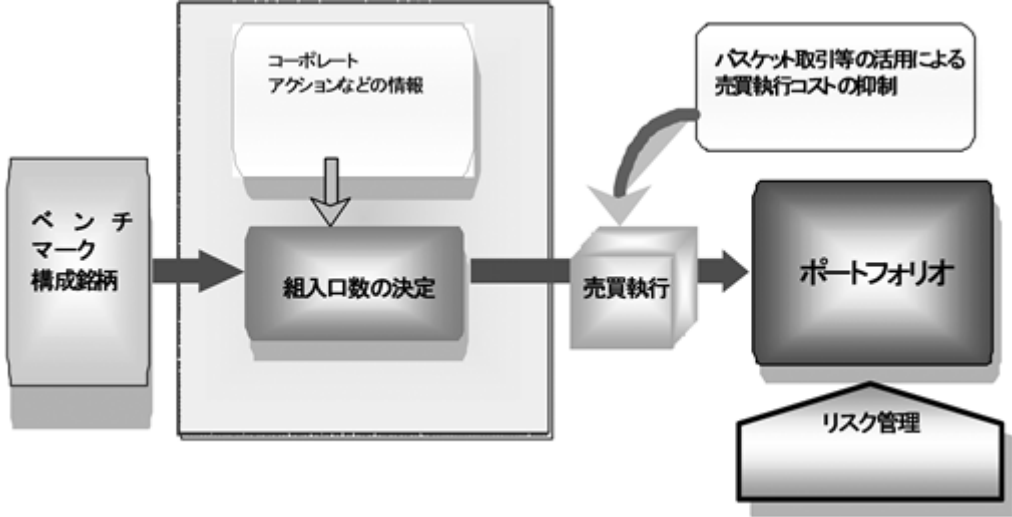
- ・ 年限・通貨構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーボン・償還再投資

主な投資制限	<p>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、</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
--------	--

ファンド名	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
-------	-------------------------------



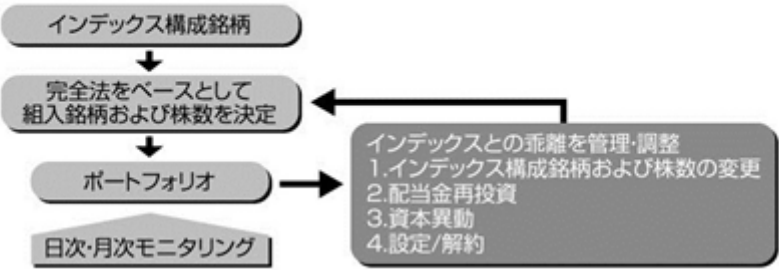
基本方針	<p>この投資信託は、東証REIT指数(配当込み)<sup>(注)</sup>の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注) 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>JPXは、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指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

<p>運用プロセス</p>	<p>原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</p> <p>新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</p> <p>配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</p>  <pre> graph LR     A[ベンチマーク構成銘柄] --&gt; B[組入口数の決定]     C[コーポレートアクションなどの情報] --&gt; B     B --&gt; D[売買執行]     E[バスケット取引等の活用による 売買執行コストの抑制] --&gt; D     D --&gt; F[ポートフォリオ]     F --- G[リスク管理]   </pre>
<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>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。</p>

<p>ファンド名</p>	<p>外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
--------------	--------------------------------

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

(注) S & P 先進国 R E I Tインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 R E I Tインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&PDow Jones Indicesおよび/または特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S & P 先進国 R E I Tインデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I Tインデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I Tインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくは

	<p>はS &amp; P 先進国 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&amp;P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&amp;P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&amp;P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。</p> <p>海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。)および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。)とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S &amp; P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</li> </ol>
<p>運用プロセス</p>	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&amp;P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定]     B --&gt; C[ポートフォリオ]     C --&gt; D[日々・月次モニタリング]     D --&gt; E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約]     E --&gt; B   </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li><li>2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li><li>3. 株式への直接投資は行いません。</li><li>4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S &amp; P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS &amp; P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</li><li>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。</li><li>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。</li><li>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。</li></ol>
--------	---

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



## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

定期的に関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。

## 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11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

### (4) 【分配方針】

#### 収益分配方針

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

##### 1) 分配対象額の範囲

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

##### 2) 分配対象額についての分配方針

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

##### 3) 留保益の運用方針

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

#### 収益の分配方式

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

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



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

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

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の支払い

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

### (5) 【投資制限】

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

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

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

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)

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)

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

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

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

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)

投資する株式等の範囲(約款第19条)

- 1)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 2)上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図および範囲(約款第22条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- 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券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、)の行使により取得可能な株券
  - 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

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

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第24条)

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第25条)

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

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条の2)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

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

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

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

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、

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

公社債の空売りの指図および範囲(約款第27条)

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

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

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

公社債の借入れ(約款第28条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 上記1)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 上記1)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第29条)

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

#### 外国為替予約の指図および範囲(約款第30条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 資金の借入れ(約款第37条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

#### <基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

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

各資産(国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート)への資産配分は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

#### リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

#### 為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

#### 信用リスク

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

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

#### 流動性リスク

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

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

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

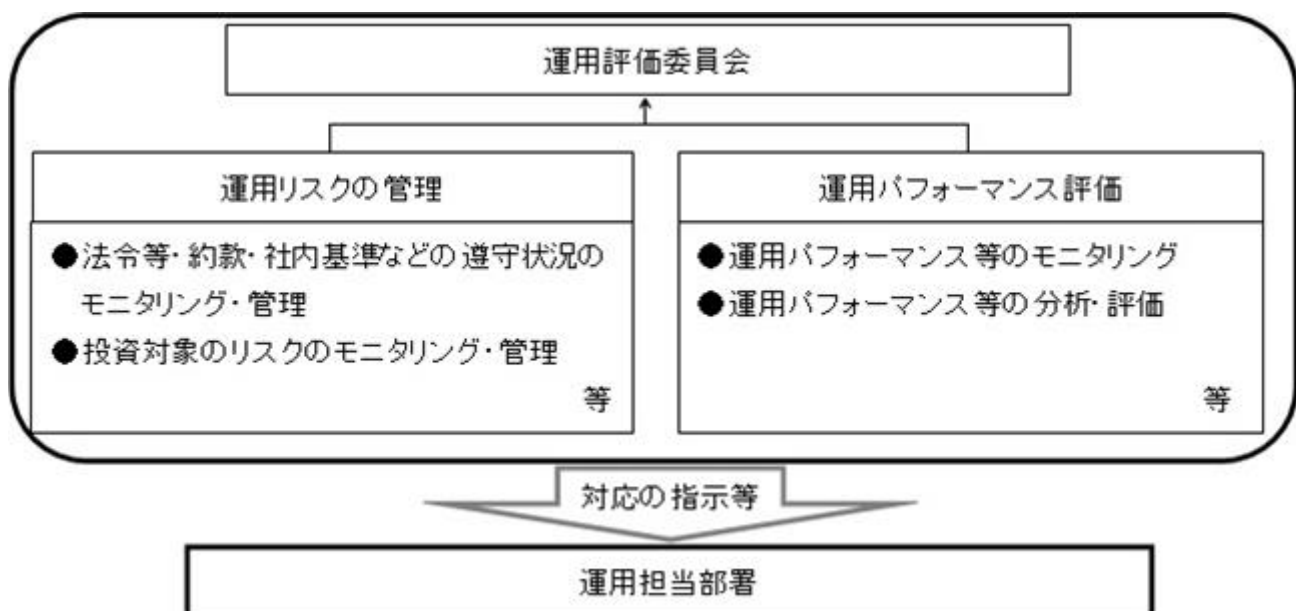
#### 注意事項

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

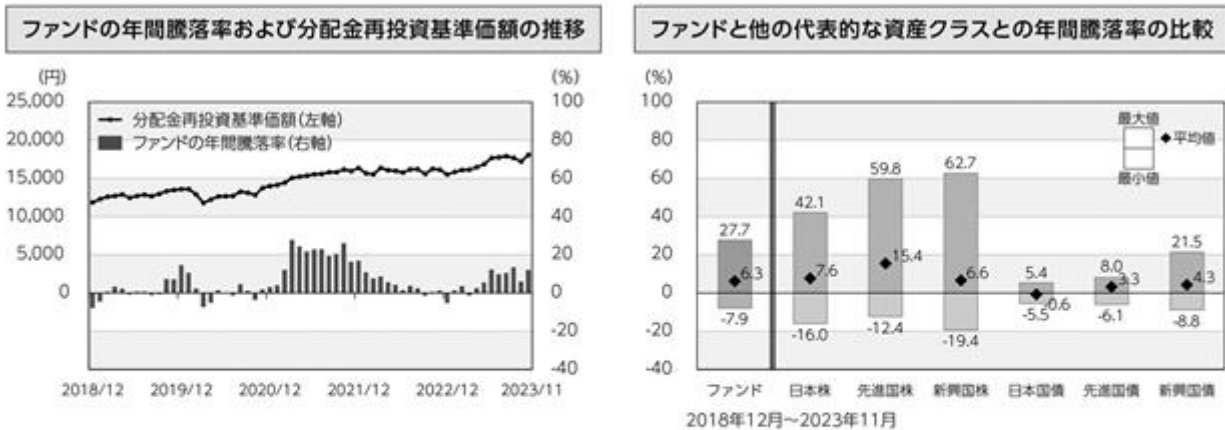


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

リスク管理体制は2023年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。



## <参考情報>



★ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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

★上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

★すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## 1. 信託財産留保額

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

## 2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

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。

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。

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、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2024年1月1日現在のものです。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 >

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。

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。

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、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、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## … (参考情報)ファンドの総経費率 …

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

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年5月12日~2023年11月13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11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	463,189,283	98.37
内 日本	463,189,283	98.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,679,546	1.63
純資産総額	470,868,829	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11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	471,970,053,700	97.67
内 日本	471,970,053,700	97.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,252,681,532	2.33
純資産総額	483,222,735,232	100.00

その他資産の投資状況

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	11,381,040,000	2.36
内 日本	11,381,040,000	2.36

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,153,040,458,823	96.54
内 アメリカ	826,704,621,104	69.22
内 イギリス	46,692,548,512	3.91
内 カナダ	39,850,797,142	3.34
内 スイス	37,348,801,352	3.13
内 フランス	37,247,766,065	3.12
内 ドイツ	28,883,347,750	2.42
内 オランダ	22,581,968,058	1.89
内 オーストラリア	22,174,302,963	1.86
内 アイルランド	21,650,247,741	1.81
内 デンマーク	11,387,327,300	0.95
内 スウェーデン	10,184,900,509	0.85
内 スペイン	9,143,536,236	0.77
内 イタリア	6,530,053,523	0.55
内 香港	5,606,203,563	0.47
内 ジャージー	3,857,987,749	0.32
内 シンガポール	3,673,841,974	0.31

	内 フィンランド	3,657,587,915	0.31
	内 ベルギー	2,618,378,424	0.22
	内 ノルウェー	2,278,357,265	0.19
	内 イスラエル	2,236,495,715	0.19
	内 パミュダ	1,748,933,729	0.15
	内 オランダ領キュラソー	1,618,856,048	0.14
	内 ケイマン諸島	1,527,304,814	0.13
	内 ニュージーランド	850,117,207	0.07
	内 ルクセンブルグ	683,919,408	0.06
	内 ポルトガル	649,072,638	0.05
	内 オーストリア	641,227,507	0.05
	内 リベリア	541,615,059	0.05
	内 パナマ	325,431,095	0.03
	内 マン島	144,910,458	0.01
新株予約権証券		0	0.00
	内 カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		1,876,666,869	0.16
	内 オーストラリア	1,378,255,268	0.12
	内 シンガポール	498,411,601	0.04
投資証券		21,701,674,531	1.82
	内 アメリカ	20,366,911,449	1.71
	内 フランス	485,153,245	0.04
	内 イギリス	395,558,812	0.03
	内 香港	300,564,173	0.03
	内 ベルギー	83,036,477	0.01
	内 カナダ	70,450,375	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		17,731,377,175	1.48
純資産総額		1,194,350,177,398	100.00

## その他資産の投資状況

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	18,654,166,882	1.56
内 アメリカ	14,148,159,737	1.18
内 ドイツ	2,722,921,316	0.23
内 イギリス	792,723,817	0.07
内 カナダ	629,470,555	0.05
内 オーストラリア	360,891,457	0.03

(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11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	463,206,715,650	84.38
内 日本	463,206,715,650	84.38
地方債証券	29,994,713,181	5.46
内 日本	29,994,713,181	5.46

特殊債券		28,798,875,797	5.25
	内 日本	28,798,875,797	5.25
社債券		23,616,291,600	4.30
	内 日本	23,223,209,600	4.23
	内 フランス	393,082,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,351,948,676	0.61
純資産総額		548,968,544,904	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
国債証券	245,812,723,868	98.48	
	内 アメリカ	117,089,327,422	46.91
	内 フランス	20,864,389,805	8.36
	内 イタリア	18,624,368,647	7.46
	内 中国	17,445,780,199	6.99
	内 ドイツ	16,047,112,032	6.43
	内 イギリス	12,521,415,696	5.02
	内 スペイン	12,288,253,612	4.92
	内 カナダ	4,855,361,025	1.95
	内 ベルギー	4,359,548,233	1.75
	内 オランダ	3,722,780,929	1.49
	内 オーストラリア	3,640,803,411	1.46
	内 オーストリア	2,870,205,471	1.15
	内 メキシコ	2,195,257,065	0.88
	内 アイルランド	1,449,341,240	0.58
	内 フィンランド	1,307,172,988	0.52
	内 ポーランド	1,250,069,951	0.50
	内 マレーシア	1,225,212,190	0.49
	内 シンガポール	1,055,566,721	0.42
	内 デンマーク	770,869,493	0.31
	内 イスラエル	755,588,298	0.30
	内 ニュージーランド	572,207,075	0.23
	内 スウェーデン	494,744,870	0.20
	内 ノルウェー	407,347,495	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,802,181,814	1.52	
純資産総額	249,614,905,682	100.00	

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

#### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
投資証券	186,910,660,200	97.19	
	内 日本	186,910,660,200	97.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,408,165,903	2.81	
純資産総額	192,318,826,103	100.00	

#### その他資産の投資状況



2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	5,272,593,500	2.74
内 日本	5,272,593,500	2.74

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

(注3) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	8,355,306,480	10.26
内 オーストラリア	5,423,381,065	6.66
内 シンガポール	2,870,974,247	3.52
内 香港	60,951,168	0.07
投資証券	72,835,664,632	89.40
内 アメリカ	63,074,427,368	77.42
内 イギリス	3,949,387,770	4.85
内 フランス	1,475,778,900	1.81
内 カナダ	1,220,088,535	1.50
内 ベルギー	929,593,968	1.14
内 香港	922,151,467	1.13
内 スペイン	367,830,110	0.45
内 ニュージーランド	240,753,728	0.30
内 韓国	159,235,114	0.20
内 オランダ	158,046,380	0.19
内 ガーンジー	158,019,618	0.19
内 イスラエル	109,411,898	0.13
内 ドイツ	33,053,909	0.04
内 アイルランド	30,632,022	0.04
内 イタリア	7,253,845	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	281,379,794	0.35
純資産総額	81,472,350,906	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】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	17,709,590	7.4601 132,117,083	7.5211 133,195,597	- -	28.29
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	28,853,968	4.0705 117,452,962	4.1378 119,391,948	- -	25.36

3	国内債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	75,882,531	1.2226 92,781,570	1.2385 93,980,514	- -	19.96
4	外国債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	23,923,572	2.2483 53,789,759	2.2569 53,993,109	- -	11.47
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	18,506,812	1.7051 31,557,815	1.7563 32,503,513	- -	6.90
6	J・REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	12,656,864	2.3250 29,428,474	2.3801 30,124,602	- -	6.40

(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11月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.37
合計	98.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	7,680,800	2,015.48 15,480,535,736	2,794.50 21,463,995,600	- -	4.44
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	989,500	12,154.75 12,027,131,364	12,820.00 12,685,390,000	- -	2.63
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,627,900	979.49 8,450,986,115	1,255.00 10,828,014,500	- -	2.24
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	139,900	60,676.65 8,488,664,718	63,350.00 8,862,665,000	- -	1.83
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	41,729,400	157.79 6,584,629,394	173.10 7,223,359,140	- -	1.49
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	296,000	16,461.19 4,872,514,392	24,025.00 7,111,400,000	- -	1.47
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	979,500	5,857.14 5,737,074,620	7,258.00 7,109,211,000	- -	1.47
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	679,000	7,408.87 5,030,623,684	10,285.00 6,983,515,000	- -	1.45
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	977,500	5,154.63 5,038,658,896	6,886.00 6,731,065,000	- -	1.39

10	信越化学工業 日本	株式 化学	1,270,600	4,024.86 5,113,993,769	5,212.00 6,622,367,200	- -	1.37
11	任天堂 日本	株式 その他製 品	883,100	5,699.18 5,032,949,935	6,912.00 6,103,987,200	- -	1.26
12	三井物産 日本	株式 卸売業	1,115,100	4,258.93 4,749,142,843	5,392.00 6,012,619,200	- -	1.24
13	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービ ス業	1,064,600	4,348.38 4,629,288,599	5,505.00 5,860,623,000	- -	1.21
14	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	994,900	4,398.01 4,375,585,195	5,738.00 5,708,736,200	- -	1.18
15	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,241,600	4,228.63 5,250,277,258	4,165.00 5,171,264,000	- -	1.07
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	3,411,100	1,180.54 4,026,943,271	1,509.00 5,147,349,900	- -	1.07
17	K D D I 日本	株式 情報・通 信業	1,084,100	4,058.59 4,399,918,314	4,625.00 5,013,962,500	- -	1.04
18	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,361,800	2,819.55 3,839,673,691	3,648.00 4,967,846,400	- -	1.03
19	第一三共 日本	株式 医薬品	1,222,200	4,127.45 5,044,577,070	4,000.00 4,888,800,000	- -	1.01
20	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,859,600	2,135.68 3,971,521,989	2,512.00 4,671,315,200	- -	0.97
21	H O Y A 日本	株式 精密機器	277,900	14,445.37 4,014,369,302	16,665.00 4,631,203,500	- -	0.96
22	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	692,000	6,207.88 4,295,855,920	6,020.00 4,165,840,000	- -	0.86
23	ソフトバンク 日本	株式 情報・通 信業	2,256,900	1,552.89 3,504,739,095	1,798.50 4,059,034,650	- -	0.84
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービ ス業	761,000	4,440.58 3,379,284,552	5,025.00 3,824,025,000	- -	0.79
25	ダイキン工業 日本	株式 機械	168,700	23,053.33 3,889,098,120	22,155.00 3,737,548,500	- -	0.77
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,272,600	2,596.50 3,304,310,481	2,883.50 3,669,542,100	- -	0.76
27	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	836,900	2,780.59 2,327,077,060	3,801.00 3,181,056,900	- -	0.66
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,572,400	1,572.80 2,473,072,232	2,009.00 3,158,951,600	- -	0.65
29	S M C 日本	株式 機械	42,300	68,754.56 2,908,317,954	74,450.00 3,149,235,000	- -	0.65
30	丸紅 日本	株式 卸売業	1,233,900	1,858.48 2,293,184,180	2,307.00 2,846,607,300	- -	0.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	97.67
合計	97.67

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

2023年11月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	16.90
輸送用機器		8.47
情報・通信業		7.50
銀行業		7.01
卸売業		6.86
化学		5.84
機械		5.09
サービス業		4.70
医薬品		4.65
小売業		4.18
食料品		3.35
陸運業		2.71
保険業		2.39
精密機器		2.28
その他製品		2.24
建設業		2.03
不動産業		1.91
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		0.77
海運業		0.74
ゴム製品		0.71
非鉄金属		0.67
ガラス・土石製品		0.66
金属製品		0.51
石油・石炭製品		0.47
空運業		0.44
繊維製品		0.41
鋳業		0.36
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業	0.08	
合計	97.67	

（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。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,331,541	23,510.37 54,815,405,749	27,850.64 64,934,922,792	- -	5.44
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,047,225	42,186.50 44,178,762,791	55,717.46 58,348,726,997	- -	4.89
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,369,189	15,760.04 21,578,486,353	21,519.28 29,463,964,749	- -	2.47
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	366,286	41,700.77 15,274,410,246	70,799.49 25,932,864,924	- -	2.17
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	881,185	15,290.79 13,474,019,844	19,852.97 17,494,147,564	- -	1.46
6	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	328,040	30,913.70 10,140,932,289	48,856.65 16,026,936,778	- -	1.34
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	783,554	15,212.78 11,920,039,939	20,060.34 15,718,365,916	- -	1.32
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	423,117	31,510.77 13,332,744,535	35,905.66 15,192,299,288	- -	1.27
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイ ダー/ヘル スケ ア・サー ビス	137,987	73,178.27 10,097,650,301	78,679.50 10,856,749,353	- -	0.91
10	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	119,666	58,182.16 6,962,426,993	87,044.85 10,416,309,044	- -	0.87

11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	191,620	46,745.31 8,957,336,933	52,752.53 10,108,441,389	- -	0.85
12	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	432,533	20,987.62 9,077,841,742	22,695.84 9,816,700,800	- -	0.82
13	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	65,729	100,696.46 6,618,677,659	138,367.86 9,094,781,602	- -	0.76
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	239,625	33,966.36 8,139,190,905	37,389.60 8,959,484,361	- -	0.75
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	593,892	16,833.49 9,997,277,164	15,051.14 8,938,753,893	- -	0.75
16	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	356,591	23,631.13 8,426,651,443	22,370.81 7,977,232,254	- -	0.67
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	348,735	20,901.47 7,289,077,388	22,226.68 7,751,224,423	- -	0.65
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	125,305	54,994.39 6,891,072,962	60,272.22 7,552,411,454	- -	0.63
19	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	484,214	11,640.74 5,636,610,726	14,932.40 7,230,479,070	- -	0.61
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	148,947	45,870.05 6,832,206,940	45,741.71 6,813,090,687	- -	0.57
21	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	395,086	18,440.53 7,285,597,789	16,709.35 6,601,631,360	- -	0.55
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	67,635	60,635.22 4,101,063,390	90,799.54 6,141,227,381	- -	0.51
23	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	59,922	99,255.17 5,947,568,806	101,622.09 6,089,398,996	- -	0.51
24	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	269,029	24,796.43 6,670,960,216	21,164.84 5,693,956,735	- -	0.48
25	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	65,588	75,535.57 4,954,227,367	86,456.57 5,670,513,526	- -	0.47
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	375,951	15,887.20 5,972,808,959	14,873.18 5,591,590,315	- -	0.47

27	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	261,732	22,280.49 5,831,518,820	20,369.19 5,331,270,145	- -	0.45
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	607,988	8,709.46 5,295,248,649	8,563.88 5,206,739,982	- -	0.44
29	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	219,021	21,896.48 4,795,791,118	22,954.68 5,027,558,194	- -	0.42
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	203,773	25,693.34 5,235,610,742	24,584.22 5,009,600,506	- -	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.54
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.82
合計	98.52

(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11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	8.89
半導体・半導体製造装置		6.29
コンピュータ・周辺機器		5.70
銀行		5.23
医薬品		4.93
石油・ガス・消耗燃料		4.58
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.26
保険		3.14
資本市場		3.13
金融サービス		3.08
大規模小売り		2.90
ヘルスケア機器・用品		2.16
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.13
ホテル・レストラン・レジャー		2.04
自動車		1.89
化学		1.87
機械		1.77
バイオテクノロジー		1.76
航空宇宙・防衛		1.70
生活必需品流通・小売り		1.66
電力		1.63
飲料		1.57
専門小売り		1.56
金属・鉱業		1.46

食品	1.45
情報技術サービス	1.39
繊維・アパレル・贅沢品	1.23
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.15
家庭用品	1.07
陸上運輸	1.05
娯楽	1.02
専門サービス	1.00
各種電気通信サービス	0.97
コングロマリット	0.90
電気設備	0.86
総合公益事業	0.76
メディア	0.66
通信機器	0.66
パーソナルケア用品	0.61
建設関連製品	0.60
商業サービス・用品	0.57
タバコ	0.56
航空貨物・物流サービス	0.50
電子装置・機器・部品	0.50
商社・流通業	0.42
消費者金融	0.35
不動産管理・開発	0.33
建設・土木	0.32
家庭用耐久財	0.31
建設資材	0.30
エネルギー設備・サービス	0.27
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	0.12
運送インフラ	0.10
ガス	0.10
紙製品・林産品	0.10
水道	0.10
販売	0.08
海上運輸	0.05
旅客航空輸送	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.01
合計	96.54

(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11月30日現在

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



1	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	6,900,000,000	100.14 6,909,867,000	100.17 6,911,799,000	0.1 2025/9/20	1.26
2	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,860,000,000	99.34 5,821,850,000	99.59 5,836,267,000	0.1 2028/3/20	1.06
3	449回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	5,600,000,000	99.96 5,598,040,000	100.00 5,600,392,000	0.005 2025/6/1	1.02
4	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,520,000,000	98.48 5,436,539,000	98.63 5,444,652,000	0.1 2029/12/20	0.99
5	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	97.85 5,381,816,000	97.94 5,387,140,000	0.1 2030/9/20	0.98
6	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,410,000,000	99.46 5,381,104,000	99.57 5,387,007,500	0.005 2027/6/20	0.98
7	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,450,000,000	96.78 5,275,041,000	96.85 5,278,325,000	0.1 2031/9/20	0.96
8	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,330,000,000	98.60 5,255,605,000	98.93 5,273,235,500	0.1 2029/6/20	0.96
9	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,430,000,000	96.39 5,234,201,000	96.60 5,245,597,200	0.1 2031/12/20	0.96
10	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,200,000,000	100.22 5,211,927,000	100.15 5,207,956,000	0.1 2025/12/20	0.95
11	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,190,000,000	99.23 5,150,467,000	99.45 5,161,922,100	0.1 2028/6/20	0.94
12	367回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,300,000,000	96.94 5,138,031,000	96.94 5,137,979,000	0.2 2032/6/20	0.94
13	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,150,000,000	99.38 5,118,505,000	99.71 5,135,477,000	0.1 2027/12/20	0.94
14	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,170,000,000	97.29 5,030,104,000	97.16 5,023,172,000	0.1 2031/6/20	0.92
15	154回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	99.50 4,975,420,000	99.82 4,991,450,000	0.1 2027/9/20	0.91
16	369回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,020,000,000	99.57 4,998,472,000	99.01 4,970,452,600	0.5 2032/12/20	0.91
17	370回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	99.57 4,978,672,000	98.81 4,940,700,000	0.5 2033/3/20	0.90

18	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,080,000,000	97.11 4,933,282,000	97.18 4,936,896,400	0.2 2032/3/20	0.90
19	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,890,000,000	100.15 4,897,774,000	100.04 4,892,200,500	0.1 2026/12/20	0.89
20	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,050,000,000	97.52 4,925,051,000	96.65 4,881,077,500	0.2 2032/9/20	0.89
21	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,950,000,000	97.90 4,846,400,000	98.21 4,861,395,000	0.1 2030/6/20	0.89
22	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 4,839,177,200	0.1 2027/3/20	0.88
23	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,900,000,000	97.41 4,773,149,000	97.67 4,786,026,000	0.1 2030/12/20	0.87
24	453回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	4,700,000,000	99.84 4,692,668,000	99.96 4,698,261,000	0.005 2025/10/1	0.86
25	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,700,000,000	99.67 4,684,776,000	99.91 4,695,817,000	0.1 2027/6/20	0.86
26	371回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,800,000,000	96.95 4,653,830,000	97.70 4,689,936,000	0.4 2033/6/20	0.85
27	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,810,000,000	97.20 4,675,454,000	97.42 4,686,046,300	0.1 2031/3/20	0.85
28	150回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,570,000,000	99.57 4,550,696,000	99.75 4,558,849,200	0.005 2026/12/20	0.83
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	100.17 4,537,701,000	0.1 2025/6/20	0.83
30	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,450,000,000	99.13 4,411,573,000	99.28 4,418,316,000	0.1 2028/9/20	0.80

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	84.38
地方債証券	5.46
特殊債券	5.25
社債券	4.30
合計	99.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,567,766,200	80.76 1,266,211,665	80.39 1,260,367,663	1.25 2031/8/15	0.50
2	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	1,425,108,300	81.49 1,161,368,477	81.06 1,155,311,910	1.125 2031/2/15	0.46
3	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	1,364,809,600	84.87 1,158,448,233	83.48 1,139,429,417	1.875 2032/2/15	0.46
4	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証 券	1,205,974,000	96.08 1,158,709,084	94.06 1,134,369,293	3.5 2033/2/15	0.45
5	US T N/B 1.5 11/30/24 アメリカ	国債証 券	1,176,560,000	94.46 1,111,402,107	96.41 1,134,332,438	1.5 2024/11/30	0.45
6	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	1,394,223,600	80.44 1,121,535,818	79.93 1,114,425,797	0.875 2030/11/15	0.45
7	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証 券	1,117,732,000	103.19 1,153,448,059	98.77 1,104,022,322	4.125 2032/11/15	0.44
8	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証 券	1,351,573,300	82.03 1,108,795,309	80.62 1,089,679,572	1.375 2031/11/15	0.44
9	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	1,183,913,500	92.10 1,090,391,323	90.04 1,066,007,742	2.875 2032/5/15	0.43
10	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証 券	1,153,028,800	91.93 1,060,046,820	88.86 1,024,664,270	2.75 2032/8/15	0.41
11	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証 券	1,019,719,800	99.64 1,016,108,859	99.65 1,016,230,838	2.26 2025/2/24	0.41
12	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	1,182,442,800	83.43 986,579,577	83.35 985,584,539	1.625 2031/5/15	0.39
13	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証 券	980,579,040	99.91 979,724,543	100.00 980,587,571	2.68 2030/5/21	0.39
14	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証 券	1,033,902,100	91.47 945,795,936	92.54 956,844,082	1.5 2026/8/15	0.38
15	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	1,211,856,800	79.49 963,313,540	78.86 955,733,697	0.625 2030/8/15	0.38
16	US T N/B 3.5 04/30/28 アメリカ	国債証 券	955,955,000	95.27 910,786,126	96.93 926,622,867	3.5 2028/4/30	0.37
17	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証 券	882,420,000	97.86 863,615,629	98.28 867,270,639	3.75 2026/4/15	0.35
18	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証 券	844,616,400	101.65 858,621,520	101.53 857,543,085	3.03 2026/3/11	0.34
19	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証 券	933,527,800	90.33 843,313,700	91.51 854,321,700	1.5 2031/5/25	0.34
20	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証 券	895,656,300	92.44 827,997,434	93.88 840,902,311	1.625 2026/2/15	0.34

21	US T N/B 2.75 04/30/27 アメリカ	国債証券	882,420,000	94.17 831,050,655	94.97 838,109,420	2.75 2027/4/30	0.34
22	US T N/B 3.75 06/30/30 アメリカ	国債証券	838,299,000	93.37 782,795,223	96.91 812,413,240	3.75 2030/6/30	0.33
23	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証券	813,715,800	100.15 815,014,323	99.62 810,696,092	2.3 2026/5/15	0.32
24	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証券	882,420,000	90.27 796,629,880	91.50 807,500,475	0.75 2026/4/30	0.32
25	US T N/B 4.25 12/31/24 アメリカ	国債証券	808,885,000	99.03 801,103,526	99.07 801,380,698	4.25 2024/12/31	0.32
26	US T N/B 0.875 06/30/26 アメリカ	国債証券	854,476,700	89.93 768,511,846	91.43 781,295,441	0.875 2026/6/30	0.31
27	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	844,181,800	90.39 763,131,237	91.60 773,283,712	1.5 2027/1/31	0.31
28	FRANCE OAT 0.5 05/25/26 フランス	国債証券	817,240,600	92.92 759,457,013	94.50 772,335,680	0.5 2026/5/25	0.31
29	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	841,240,400	90.88 764,522,252	91.80 772,265,255	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	838,299,000	89.75 752,376,293	91.40 766,224,934	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11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.48
合計	98.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	20,742	571,421.26 11,852,419,971	621,000.00 12,880,782,000	- -	6.70
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	18,263	542,147.03 9,901,231,278	575,000.00 10,501,225,000	- -	5.46
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	57,497	165,262.62 9,502,105,363	169,800.00 9,762,990,600	- -	5.08
4	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	30,973	301,733.48 9,345,591,341	280,400.00 8,684,829,200	- -	4.52
5	KDX不動産投資法人 日本	投資証券	51,167	161,063.56 8,241,139,535	169,500.00 8,672,806,500	- -	4.51

6	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	85,224	97,884.48 8,342,107,446	98,500.00 8,394,564,000	- -	4.36
7	GLP投資法人 日本	投資証券	60,059	145,165.02 8,718,466,028	139,700.00 8,390,242,300	- -	4.36
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	26,801	287,962.83 7,717,691,879	263,800.00 7,070,103,800	- -	3.68
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	35,427	178,730.36 6,331,880,774	174,400.00 6,178,468,800	- -	3.21
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	39,773	148,936.74 5,923,661,079	145,000.00 5,767,085,000	- -	3.00
11	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	17,444	351,517.30 6,131,867,954	325,000.00 5,669,300,000	- -	2.95
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	86,087	58,602.56 5,044,918,699	60,000.00 5,165,220,000	- -	2.69
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	53,427	81,138.32 4,334,977,049	84,700.00 4,525,266,900	- -	2.35
14	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	12,160	352,219.20 4,282,985,590	371,000.00 4,511,360,000	- -	2.35
15	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	59,519	75,398.71 4,487,656,316	69,400.00 4,130,618,600	- -	2.15
16	アクティブア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	9,328	406,423.19 3,791,115,547	406,500.00 3,791,832,000	- -	1.97
17	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	27,128	151,882.41 4,120,266,251	138,000.00 3,743,664,000	- -	1.95
18	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	6,139	653,293.05 4,010,566,042	608,000.00 3,732,512,000	- -	1.94
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	22,728	159,767.82 3,631,203,018	157,600.00 3,581,932,800	- -	1.86
20	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	7,395	493,557.20 3,649,855,533	467,000.00 3,453,465,000	- -	1.80
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	11,389	315,368.58 3,591,732,778	288,500.00 3,285,726,500	- -	1.71
22	イオンリート投資法人 日本	投資証券	21,810	153,297.98 3,343,429,076	143,800.00 3,136,278,000	- -	1.63
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,597	480,443.84 3,169,488,059	453,500.00 2,991,739,500	- -	1.56
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	20,908	147,422.33 3,082,306,234	140,600.00 2,939,664,800	- -	1.53
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	26,183	112,272.90 2,939,641,555	109,300.00 2,861,801,900	- -	1.49

26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,743	337,784.65 2,953,251,208	318,000.00 2,780,274,000	- -	1.45
27	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	16,635	159,010.35 2,645,137,310	155,100.00 2,580,088,500	- -	1.34
28	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	34,271	71,331.76 2,444,610,978	73,700.00 2,525,772,700	- -	1.31
29	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	3,683	611,173.53 2,250,952,113	677,000.00 2,493,391,000	- -	1.30
30	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	6,139	415,779.83 2,552,472,431	383,000.00 2,351,237,000	- -	1.22

（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11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	97.19
合計	97.19

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	409,349	17,074.93 6,989,608,361	16,624.79 6,805,342,307	- -	8.35
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	41,462	111,857.96 4,637,854,884	118,878.15 4,928,925,925	- -	6.05
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	245,313	12,036.48 2,952,705,232	12,971.57 3,182,095,732	- -	3.91
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	134,186	16,612.11 2,229,112,727	20,325.07 2,727,340,379	- -	3.35
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	70,149	40,716.81 2,856,243,821	37,929.35 2,660,706,183	- -	3.27
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	145,043	16,378.78 2,375,628,667	18,054.31 2,618,651,749	- -	3.21
7	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	314,213	8,283.34 2,602,733,494	7,893.24 2,480,160,788	- -	3.04
8	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	449,024	4,461.68 2,003,405,509	4,356.21 1,956,044,365	- -	2.40
9	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	93,605	19,700.71 1,844,085,200	19,049.97 1,783,173,106	- -	2.19
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	759,459	2,044.79 1,552,934,345	2,272.53 1,725,896,399	- -	2.12

11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	62,911	26,956.00 1,695,829,465	25,123.96 1,580,573,957	- -	1.94
12	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	152,744	9,219.90 1,408,284,446	8,321.22 1,271,016,519	- -	1.56
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	254,737	4,916.76 1,252,481,959	4,847.42 1,234,819,062	- -	1.52
14	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	129,234	8,439.86 1,090,718,051	9,306.58 1,202,727,800	- -	1.48
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	178,169	6,545.74 1,166,248,528	6,678.44 1,189,892,526	- -	1.46
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	68,940	16,022.56 1,104,595,367	16,032.10 1,105,253,022	- -	1.36
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	55,075	18,339.72 1,010,060,607	18,824.96 1,036,784,672	- -	1.27
18	MID AMERICA アメリカ	投資証券	51,640	21,053.34 1,087,194,830	18,216.09 940,678,897	- -	1.15
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	28,404	33,417.91 949,202,389	31,212.66 886,564,567	- -	1.09
20	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	94,646	9,218.65 872,508,823	9,146.28 865,659,129	- -	1.06
21	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	82,425	9,858.66 812,600,458	10,308.13 849,648,134	- -	1.04
22	LINK REIT 香港	投資証券	1,133,620	812.01 920,516,214	732.87 830,802,891	- -	1.02
23	SEGRO PLC イギリス	投資証券	541,889	1,374.61 744,886,449	1,532.83 830,626,619	- -	1.02
24	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	314,849	2,433.66 766,238,538	2,564.90 807,556,451	- -	0.99
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	116,191	7,012.82 814,827,214	6,747.57 784,007,091	- -	0.96
26	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	274,220	2,742.76 752,120,259	2,797.27 767,067,763	- -	0.94
27	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	140,670	5,131.57 721,858,090	5,263.63 740,435,577	- -	0.91
28	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	72,661	8,817.92 640,719,404	9,040.39 656,883,988	- -	0.81
29	UDR INC アメリカ	投資証券	134,037	5,827.05 781,040,557	4,895.96 656,239,830	- -	0.81
30	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC アメリカ	投資証券	91,278	7,464.10 681,308,228	7,160.83 653,626,998	- -	0.80

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	10.26
投資証券	89.40

合計	99.65
----	-------

(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。

**【投資不動産物件】**

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

**【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11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0512月	買建	479	11,051,593,070	11,381,040,000	2.36

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Dec23	買建	422	13,540,131,913	14,148,159,737	1.18
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec23	買建	385	2,603,823,842	2,722,921,316	0.23
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec23	買建	57	796,461,552	792,723,817	0.07



モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec23	買建	24	610,535,969	629,470,555	0.05
シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Dec23	買建	21	355,570,687	360,891,457	0.03

(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場で評価しています。

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

#### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0512月	買建	2,857	5,444,299,200	5,272,593,500	2.74

(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場で評価しています。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

直近日(2023年11月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第15特定期間末 (2014年5月12日)	712	713	0.8414	0.8429
第16特定期間末 (2014年11月11日)	684	685	0.9368	0.9383
第17特定期間末 (2015年5月11日)	622	623	1.0095	1.0110
第18特定期間末 (2015年11月11日)	534	535	0.9947	0.9962
第19特定期間末 (2016年5月11日)	498	499	0.9354	0.9369
第20特定期間末 (2016年11月11日)	482	483	0.9205	0.9220
第21特定期間末 (2017年5月11日)	492	493	1.0090	1.0105
第22特定期間末 (2017年11月13日)	477	478	1.0570	1.0585

第23特定期間末 (2018年5月11日)	448	449	1.0565	1.0580
第24特定期間末 (2018年11月12日)	428	428	1.0434	1.0449
第25特定期間末 (2019年5月13日)	411	411	1.0361	1.0376
第26特定期間末 (2019年11月11日)	430	431	1.0940	1.0955
第27特定期間末 (2020年5月11日)	370	371	0.9993	1.0008
第28特定期間末 (2020年11月11日)	401	401	1.1046	1.1061
第29特定期間末 (2021年5月11日)	421	421	1.2325	1.2340
第30特定期間末 (2021年11月11日)	433	433	1.3083	1.3098
第31特定期間末 (2022年5月11日)	418	419	1.2591	1.2606
第32特定期間末 (2022年11月11日)	434	434	1.3015	1.3030
第33特定期間末 (2023年5月11日)	432	433	1.3207	1.3222
第34特定期間末 (2023年11月13日)	464	465	1.4207	1.4222
2022年11月末日	431	-	1.2935	-
12月末日	407	-	1.2415	-
2023年1月末日	416	-	1.2664	-
2月末日	423	-	1.2871	-
3月末日	422	-	1.2900	-
4月末日	431	-	1.3154	-
5月末日	439	-	1.3464	-
6月末日	452	-	1.4124	-
7月末日	449	-	1.4151	-
8月末日	454	-	1.4280	-
9月末日	455	-	1.4069	-
10月末日	447	-	1.3700	-
11月末日	470	-	1.4389	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第15特定期間	0.0045
第16特定期間	0.0045
第17特定期間	0.0045
第18特定期間	0.0045
第19特定期間	0.0045
第20特定期間	0.0045
第21特定期間	0.0045
第22特定期間	0.0045
第23特定期間	0.0045

第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045
第32特定期間	0.0045
第33特定期間	0.0045
第34特定期間	0.0045

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.9
第17特定期間	8.2
第18特定期間	1.0
第19特定期間	5.5
第20特定期間	1.1
第21特定期間	10.1
第22特定期間	5.2
第23特定期間	0.4
第24特定期間	0.8
第25特定期間	0.3
第26特定期間	6.0
第27特定期間	8.2
第28特定期間	11.0
第29特定期間	12.0
第30特定期間	6.5
第31特定期間	3.4
第32特定期間	3.7
第33特定期間	1.8
第34特定期間	7.9

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第15特定期間	52,399,738	112,932,769
第16特定期間	31,449,359	147,724,782
第17特定期間	44,688,338	158,989,550
第18特定期間	22,117,058	100,883,651
第19特定期間	21,980,050	26,586,206
第20特定期間	10,137,344	18,761,221
第21特定期間	9,179,637	45,104,386
第22特定期間	6,636,994	43,222,568
第23特定期間	4,576,025	31,482,595
第24特定期間	6,951,749	21,627,662

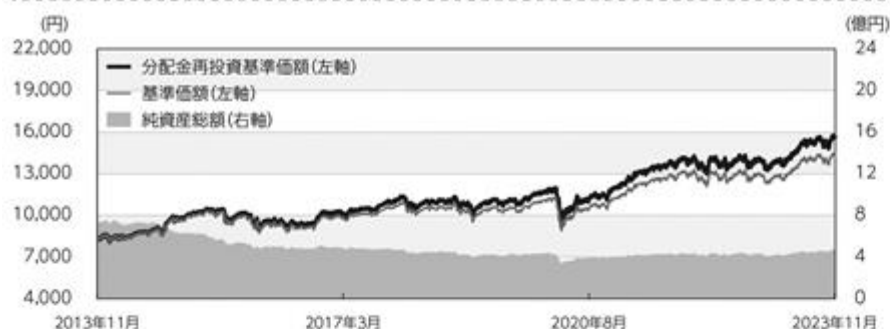
第25特定期間	6,012,015	19,263,147
第26特定期間	13,077,272	16,654,903
第27特定期間	11,204,748	33,518,095
第28特定期間	4,242,197	12,089,221
第29特定期間	7,387,321	28,854,017
第30特定期間	7,665,051	18,275,352
第31特定期間	8,633,053	7,395,440
第32特定期間	8,745,065	7,360,714
第33特定期間	5,725,706	11,750,355
第34特定期間	14,648,116	15,429,713

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2023年11月30日

## 基準価額・純資産の推移 (2013年11月29日～2023年11月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2007年1月26日)

## 分配の推移(税引前)

2023年 3月	15円
2023年 5月	15円
2023年 7月	15円
2023年 9月	15円
2023年11月	15円
直近1年間累計	90円
設定来累計	2,010円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

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

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.29
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	25.36
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.96
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.47
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.90
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.40

## ■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	4.44
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.63
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.24
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.83
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.49

## ■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	5.44
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.89
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.47
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.17
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	1.46

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2023年11月30日

### ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	145回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	1.26
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.06
3	449回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2025/6/1	1.02
4	357回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2029/12/20	0.99
5	360回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2030/9/20	0.98

### ■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 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.50
2	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.46
3	US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	アメリカ	1.875	2032/2/15	0.46
4	US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	アメリカ	3.5	2033/2/15	0.45
5	US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	アメリカ	1.5	2024/11/30	0.45

### ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.70
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.46
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.08
4	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.52
5	KDX不動産投資法人	投資証券	日本	4.51

### ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	8.35
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	6.05
3	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	3.91
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.35
5	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.27

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ・お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

#### ・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### ・お申込手数料

ありません。

#### ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金(解約)手続等】

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

・ 解約価額

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

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

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

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



### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### <主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <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2007年1月26日から無期限です。

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

#### (4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎奇数月の12日から翌奇数月の11日までとします。

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

#### (5)【その他】

##### イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

#### ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対し異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定に従います。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ハ. 関係法人との契約の更改

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

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

#### ニ. 公告

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### 収益分配金請求権

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

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

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

##### 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)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。

##### 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。

##### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2023年5月12日から2023年11月13日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【マネックス資産設計ファンド&lt;隔月分配型&gt;】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2023年5月11日現在	当期 2023年11月13日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,121,028	8,393,170
親投資信託受益証券	426,922,978	457,127,663
流動資産合計	434,044,006	465,520,833
資産合計	434,044,006	465,520,833
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	491,703	490,530
未払解約金	257,547	-
未払受託者報酬	30,060	34,512
未払委託者報酬	345,863	397,037
その他未払費用	2,641	3,042
流動負債合計	1,127,814	925,121
負債合計	1,127,814	925,121
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	327,802,086	327,020,489
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	105,114,106	137,575,223
(分配準備積立金)	110,353,104	135,345,497
元本等合計	432,916,192	464,595,712
純資産合計	432,916,192	464,595,712
負債純資産合計	434,044,006	465,520,833

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2022年11月12日 至 2023年5月11日	当期 自 2023年5月12日 至 2023年11月13日
<b>営業収益</b>		
受取利息	24	46
有価証券売買等損益	8,633,585	35,098,685
<b>営業収益合計</b>	<b>8,633,609</b>	<b>35,098,731</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,301	1,765
受託者報酬	91,833	100,470
委託者報酬	1,056,540	1,155,938
その他費用	8,070	8,858
<b>営業費用合計</b>	<b>1,157,744</b>	<b>1,267,031</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>7,475,865</b>	<b>33,831,700</b>
経常利益又は経常損失( )	7,475,865	33,831,700
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>7,475,865</b>	<b>33,831,700</b>
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( )	250,185	708,280
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>100,639,142</b>	<b>105,114,106</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,597,534	6,084,925
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	1,597,534	6,084,925
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>3,370,307</b>	<b>5,302,832</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,370,307	5,302,832
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1,478,313	1,444,396
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>105,114,106</b>	<b>137,575,223</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 2023年5月12日 至 2023年11月13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	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年5月11日及び11月11日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を2023年11月13日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2023年5月11日現在	2023年11月13日現在
1. 期首元本額	333,826,735円	327,802,086円
期中追加設定元本額	5,725,706円	14,648,116円
期中一部解約元本額	11,750,355円	15,429,713円
2. 受益権の総数	327,802,086口	327,020,489口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2022年11月12日 至 2023年5月11日	自 2023年5月12日 至 2023年11月13日
1. 分配金の計算過程	(自2022年11月12日 至2023年1月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(652,934円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(20,117,956円)及び分配準備積立金(109,459,272円)より分配対象収益は130,230,162円(1万口当たり3,969.61円)であり、うち492,101円(1万口当たり15円)を分配金額としております。	(自2023年5月12日 至2023年7月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,309,869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(17,079,646円)、信託約款に規定される収益調整金(21,114,769円)及び分配準備積立金(106,516,602円)より分配対象収益は146,020,886円(1万口当たり4,600.46円)であり、うち476,106円(1万口当たり15円)を分配金額としております。



<p>(自2023年1月12日 至2023年3月13日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(982,930円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(21,253,585円)及び分配準備積立金(109,121,553円)より分配対象収益は131,358,068円(1万口当たり13,984.49円)であり、うち494,509円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自2023年3月14日 至2023年5月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,181,608円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(21,458,778円)及び分配準備積立金(108,663,199円)より分配対象収益は132,303,585円(1万口当たり14,036.08円)であり、うち491,703円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2023年7月12日 至2023年9月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,110,135円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(10,777,386円)、信託約款に規定される収益調整金(22,207,947円)及び分配準備積立金(123,844,390円)より分配対象収益は157,939,858円(1万口当たり15,495.76円)であり、うち477,760円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自2023年9月12日 至2023年11月13日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,625,399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(27,482,223円)及び分配準備積立金(134,210,628円)より分配対象収益は163,318,250円(1万口当たり16,499.12円)であり、うち490,530円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>
---	---

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自 2022年11月12日 至 2023年5月11日	当期 自 2023年5月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 2023年5月11日現在	当期 2023年11月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 2023年5月11日現在	当期 2023年11月13日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	17,670,586	407,254
合計	17,670,586	407,254

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前期 2023年5月11日現在	当期 2023年11月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3207円 (13,207円)	1,4207円 (14,207円)

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## （１）株式

該当事項はありません。

## （２）株式以外の有価証券

2023年11月13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	28,853,968	117,452,962	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	75,882,531	92,781,570	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	12,656,864	29,428,474	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	17,709,590	132,117,083	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	23,923,572	53,789,759	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	18,506,812	31,557,815	
親投資信託受益証券 合計		177,533,337	457,127,663	
合計			457,127,663	

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

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,455,087,563
株式	464,832,873,580
派生商品評価勘定	186,955,590
未収入金	9,765,000
未収配当金	4,302,637,824
差入委託証拠金	670,263,483
流動資産合計	477,457,583,040
資産合計	477,457,583,040
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,864,830
前受金	105,695,000
未払解約金	93,270,000
流動負債合計	269,829,830
負債合計	269,829,830
純資産の部	
元本等	
元本	117,226,519,868
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	359,961,233,342
元本等合計	477,187,753,210
純資産合計	477,187,753,210
負債純資産合計	477,457,583,040

## 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5月12日 至 2023年11月13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11月13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	119,316,793,450円
同期中追加設定元本額	29,619,376,393円
同期中一部解約元本額	31,709,649,975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	2,499,905,735円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,603,293,699円
One DC 国内株式インデックスファンド	29,574,573,472円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,517,405,172円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,577,038円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	9,370,446円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	22,188,910円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,010,585円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	28,698,928円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	18,804,364円
たわらノーロード TOPIX	2,092,219,035円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,643,535,599円
たわらノーロード バランス(堅実型)	50,391,431円
たわらノーロード バランス(標準型)	361,095,886円
たわらノーロード バランス(積極型)	595,861,880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)	2,975,867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)	173,252,634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)	453,121,420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)	368,901,269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)	515,930,825円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	392,700円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,599,291円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	33,578,607円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,071,295円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	13,489,008円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,565,730,427円
Oneグローバルバランス	33,999,662円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	959,889,411円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,418,991,298円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,918,952,700円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	306,213,801円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	987,702,220円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,100,764,791円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,853,968円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,085,520,568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)	292,513,153円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	335,914,476円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	564,918,464円
投資のソムリエ	6,344,832,449円
クルーズコントロール	290,308,484円
投資のソムリエ<DC年金>	576,560,559円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	334,624,932円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,064,107,550円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	594,497,310円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,074,245,848円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	70,653,969円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	35,353,428円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,815,187円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	84,171,277円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,399,805円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	732,155,870円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	241,685,779円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	63,263,011円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	38,591,935円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	23,401,287円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	483,673,291円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	5,628,774円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,781,674円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	39,185,527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)	22,533,046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)	22,451,954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)	17,749,444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)	13,681,077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)	22,201,351円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	57,321,164円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	163,967,415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)	19,949,635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)	153,515,989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)	388,522,865円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	188,342,125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)	16,465,297円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	24,445,923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)	37,184,717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)	2,944,011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)	38,657,439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)	69,671,327円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,759,882円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,181,284円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,616,042円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	83,454円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,620,579円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	19,246,360円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	316,644,435円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	432,143,555円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,302,738,515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)	11,153,843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)	15,981,457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)	163,272,497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)	31,447,225円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	56,403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)	185,955,333円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	9,895,663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)	40,881,296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)	107,865,638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)	148,085,662円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	19,040,833円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	12,647,006円
動的パッケージファンド<DC年金>	27,443,352円
コア資産形成ファンド	16,711,663円
MHAMトピックスファンド	816,111,446円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	45,122,365円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	3,260,862,552円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,895,394,030円
計	117,226,519,868円
2. 受益権の総数	117,226,519,868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 2023年5月12日 至 2023年11月13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11月13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11月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	59,111,014,208
合計	59,111,014,208

（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11月13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11月13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	12,233,655,000	-	12,349,920,000	116,265,000
合計	12,233,655,000	-	12,349,920,000	116,265,000

## （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11月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.0706円 (40,706円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

2023年11月13日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,500	3,690.00	27,675,000	
ニッセイ	196,100	708.70	138,976,070	
マルハニチロ	29,100	2,816.50	81,960,150	
雪国まいたけ	16,700	935.00	15,614,500	
カネコ種苗	6,000	1,406.00	8,436,000	
サカタのタネ	22,300	4,050.00	90,315,000	
ホクト	15,700	1,770.00	27,789,000	
ホクリヨウ	1,800	980.00	1,764,000	
ショーボンドホールディングス	26,700	6,184.00	165,112,800	
ミライト・ワン	64,800	1,800.50	116,672,400	
タマホーム	12,400	3,625.00	44,950,000	
サンヨーホームズ	1,400	718.00	1,005,200	
日本アクア	4,600	912.00	4,195,200	
ファーストコーポレーション	2,800	750.00	2,100,000	
ベステラ	2,600	987.00	2,566,200	
Robot Home	38,200	195.00	7,449,000	
キャンディル	2,000	588.00	1,176,000	
住石ホールディングス	19,400	648.00	12,571,200	

日鉄鉱業	7,900	5,150.00	40,685,000
三井松島ホールディングス	11,600	2,772.00	32,155,200
I N P E X	725,300	2,028.00	1,470,908,400
石油資源開発	22,700	5,450.00	123,715,000
K & O エナジーグループ	8,900	2,309.00	20,550,100
ダイセキ環境ソリューション	2,200	962.00	2,116,400
第一カッター興業	5,100	1,268.00	6,466,800
明豊ファシリティワークス	4,100	786.00	3,222,600
安藤・間	113,600	1,073.00	121,892,800
東急建設	61,500	795.00	48,892,500
コムシスホールディングス	62,600	3,250.00	203,450,000
ビーアールホールディングス	28,900	349.00	10,086,100
高松コンストラクショングループ	14,500	2,687.00	38,961,500
東建コーポレーション	5,600	8,040.00	45,024,000
ソネック	1,200	949.00	1,138,800
ヤマウラ	10,000	1,250.00	12,500,000
オリエンタル白石	72,600	319.00	23,159,400
大成建設	128,400	5,102.00	655,096,800
大林組	490,700	1,306.50	641,099,550
清水建設	389,000	968.90	376,902,100
飛鳥建設	14,100	1,326.00	18,696,600
長谷工コーポレーション	125,900	1,834.00	230,900,600
松井建設	12,900	762.00	9,829,800
銭高組	1,100	3,460.00	3,806,000
鹿島建設	304,200	2,455.50	746,963,100
不動テトラ	9,500	2,090.00	19,855,000
大末建設	3,100	1,302.00	4,036,200
鉄建建設	9,900	2,022.00	20,017,800
西松建設	26,200	3,680.00	96,416,000
三井住友建設	102,100	403.00	41,146,300
大豊建設	4,800	3,520.00	16,896,000
佐田建設	4,900	660.00	3,234,000
ナカノフドー建設	5,500	394.00	2,167,000
奥村組	22,200	4,560.00	101,232,000
東鉄工業	17,000	2,850.00	48,450,000
イチケン	2,000	2,292.00	4,584,000
富士ピー・エス	3,500	445.00	1,557,500
浅沼組	10,200	3,695.00	37,689,000
戸田建設	185,700	902.50	167,594,250
熊谷組	23,000	3,590.00	82,570,000
北野建設	1,500	3,100.00	4,650,000
植木組	2,200	1,428.00	3,141,600
矢作建設工業	18,700	1,286.00	24,048,200
ピーエス三菱	17,500	945.00	16,537,500
日本ハウスホールディングス	29,300	333.00	9,756,900
大東建託	50,500	15,960.00	805,980,000
新日本建設	19,300	1,161.00	22,407,300
東亜道路工業	5,500	6,680.00	36,740,000
日本道路	16,100	1,883.00	30,316,300
東亜建設工業	10,600	3,725.00	39,485,000

日本国土開発	39,100	606.00	23,694,600
若築建設	4,800	2,928.00	14,054,400
東洋建設	34,600	1,231.00	42,592,600
五洋建設	194,400	800.10	155,539,440
世紀東急工業	17,700	1,625.00	28,762,500
福田組	5,200	5,050.00	26,260,000
日本ドライケミカル	1,900	2,330.00	4,427,000
住友林業	118,500	3,580.00	424,230,000
日本基礎技術	4,700	452.00	2,124,400
巴コーポレーション	9,700	571.00	5,538,700
大和ハウス工業	379,400	4,241.00	1,609,035,400
ライト工業	28,300	1,977.00	55,949,100
積水ハウス	416,100	2,991.00	1,244,555,100
日特建設	13,200	1,026.00	13,543,200
北陸電気工事	9,500	991.00	9,414,500
ユアテック	30,200	959.00	28,961,800
日本リーテック	10,700	1,235.00	13,214,500
四電工	5,700	2,897.00	16,512,900
中電工	21,300	2,406.00	51,247,800
関電工	85,900	1,388.00	119,229,200
きんでん	96,600	2,295.00	221,697,000
東京エネシス	13,600	964.00	13,110,400
トーエネック	4,600	4,150.00	19,090,000
住友電設	13,100	2,580.00	33,798,000
日本電設工業	25,800	1,989.00	51,316,200
エクシオグループ	69,000	3,236.00	223,284,000
新日本空調	8,900	2,201.00	19,588,900
九電工	29,700	4,438.00	131,808,600
三機工業	29,700	1,829.00	54,321,300
日揮ホールディングス	135,800	1,570.50	213,273,900
中外炉工業	4,500	2,119.00	9,535,500
ヤマト	6,300	921.00	5,802,300
太平電業	8,500	3,965.00	33,702,500
高砂熱学工業	36,800	3,100.00	114,080,000
三晃金属工業	1,000	4,785.00	4,785,000
NEC ネットエスアイ	54,600	2,116.00	115,533,600
朝日工業社	6,400	2,599.00	16,633,600
明星工業	26,600	1,120.00	29,792,000
大気社	15,800	4,570.00	72,206,000
ダイダン	18,100	1,504.00	27,222,400
日比谷総合設備	10,000	2,204.00	22,040,000
ニッポン	41,200	2,290.00	94,348,000
日清製粉グループ本社	127,300	2,191.00	278,914,300
日東富士製粉	2,300	4,730.00	10,879,000
昭和産業	13,300	3,005.00	39,966,500
鳥越製粉	6,900	680.00	4,692,000
中部飼料	19,000	1,047.00	19,893,000
フィード・ワン	20,200	761.00	15,372,200
東洋精糖	1,500	1,906.00	2,859,000
日本甜菜製糖	8,000	1,925.00	15,400,000

D M三井製糖ホールディングス	13,600	3,065.00	41,684,000
塩水港精糖	10,100	237.00	2,393,700
ウェルネオシュガー	6,900	2,026.00	13,979,400
L I F U L L	49,100	236.00	11,587,600
M I X I	30,800	2,312.00	71,209,600
ジェイエイシーリクルートメント	13,000	2,394.00	31,122,000
日本M&Aセンターホールディングス	229,100	643.60	147,448,760
メンバーズ	4,900	1,074.00	5,262,600
中広	1,000	426.00	426,000
U Tグループ	19,000	2,137.00	40,603,000
アイティメディア	5,500	937.00	5,153,500
E・Jホールディングス	8,400	1,596.00	13,406,400
オープンアップグループ	43,100	2,056.00	88,613,600
コシダカホールディングス	43,000	1,050.00	45,150,000
アルトナー	3,300	1,765.00	5,824,500
パソナグループ	17,500	1,419.00	24,832,500
C D S	2,000	1,725.00	3,450,000
リンクアンドモチベーション	41,400	416.00	17,222,400
エス・エム・エス	50,400	2,523.00	127,159,200
サニーサイドアップグループ	2,400	794.00	1,905,600
パーソルホールディングス	1,463,800	235.20	344,285,760
リニカル	5,200	598.00	3,109,600
クックパッド	39,500	116.00	4,582,000
エスクリ	3,200	262.00	838,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,900	646.00	2,519,400
森永製菓	29,500	5,663.00	167,058,500
中村屋	3,400	3,085.00	10,489,000
江崎グリコ	39,400	4,149.00	163,470,600
名糖産業	5,400	1,615.00	8,721,000
井村屋グループ	8,200	2,307.00	18,917,400
不二家	9,500	2,494.00	23,693,000
山崎製パン	92,100	3,182.00	293,062,200
第一屋製パン	1,500	489.00	733,500
モロゾフ	4,500	3,805.00	17,122,500
亀田製菓	7,900	3,895.00	30,770,500
寿スピリッツ	65,100	2,342.00	152,464,200
カルビー	63,000	2,682.50	168,997,500
森永乳業	25,000	5,620.00	140,500,000
六甲バター	10,200	1,433.00	14,616,600
ヤクルト本社	196,800	3,711.00	730,324,800
明治ホールディングス	168,900	3,328.00	562,099,200
雪印メグミルク	33,300	2,275.00	75,757,500
プリマハム	18,500	2,228.00	41,218,000
日本ハム	59,200	4,340.00	256,928,000
林兼産業	2,600	572.00	1,487,200
丸大食品	13,800	1,598.00	22,052,400
S F o o d s	15,200	3,250.00	49,400,000
柿安本店	5,400	2,460.00	13,284,000
伊藤ハム米久ホールディングス	21,100	3,950.00	83,345,000
学情	7,300	1,806.00	13,183,800

スタジオアリス	7,200	2,049.00	14,752,800
クロスキャット	8,900	1,124.00	10,003,600
シミックホールディングス	6,900	2,644.00	18,243,600
エブコ	2,300	770.00	1,771,000
システナ	212,200	259.00	54,959,800
N J S	3,100	2,652.00	8,221,200
デジタルアーツ	8,800	4,620.00	40,656,000
日鉄ソリューションズ	23,900	4,610.00	110,179,000
総合警備保障	240,300	861.40	206,994,420
キューブシステム	7,500	1,093.00	8,197,500
いちご	158,600	342.00	54,241,200
日本駐車場開発	145,700	203.00	29,577,100
コア	6,200	1,735.00	10,757,000
カカクコム	94,900	1,618.50	153,595,650
アイロムグループ	5,800	1,963.00	11,385,400
セントケア・ホールディング	10,500	907.00	9,523,500
サイネックス	1,400	790.00	1,106,000
ルネサンス	11,100	870.00	9,657,000
ディップ	22,000	3,060.00	67,320,000
S B S ホールディングス	12,500	2,562.00	32,025,000
デジタルホールディングス	7,500	1,125.00	8,437,500
新日本科学	13,100	1,580.00	20,698,000
キャリアデザインセンター	1,700	1,825.00	3,102,500
ベネフィット・ワン	50,000	1,162.50	58,125,000
エムスリー	284,200	2,483.50	705,810,700
ツカダ・グローバルホールディング	5,200	373.00	1,939,600
プラス	900	645.00	580,500
アウトソーシング	92,200	1,231.00	113,498,200
ウェルネット	6,000	557.00	3,342,000
ワールドホールディングス	6,400	2,464.00	15,769,600
ディー・エヌ・エー	51,100	1,491.50	76,215,650
博報堂D Yホールディングス	183,400	1,281.00	234,935,400
ぐるなび	26,800	291.00	7,798,800
タカミヤ	19,500	470.00	9,165,000
ジャパンベストレスキューシステム	7,200	650.00	4,680,000
ファンコミュニケーションズ	20,200	405.00	8,181,000
ライク	5,300	1,390.00	7,367,000
A o b a B B T	3,000	404.00	1,212,000
エスプール	41,300	381.00	15,735,300
W D B ホールディングス	7,400	2,118.00	15,673,200
手間いらず	2,400	2,472.00	5,932,800
ティア	4,700	450.00	2,115,000
C D G	900	1,207.00	1,086,300
アドウェイズ	19,700	521.00	10,263,700
バリューコマース	12,700	1,190.00	15,113,000
インフォマート	149,300	441.00	65,841,300
サッポロホールディングス	45,300	5,838.00	264,461,400
アサヒグループホールディングス	318,300	5,870.00	1,868,421,000
麒麟ホールディングス	573,800	2,175.00	1,248,015,000
宝ホールディングス	94,000	1,205.50	113,317,000

オエノンホールディングス	41,200	377.00	15,532,400
養命酒製造	4,600	1,851.00	8,514,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	107,900	2,057.50	222,004,250
ライフドリンク カンパニー	2,100	4,000.00	8,400,000
サントリー食品インターナショナル	97,000	4,634.00	449,498,000
ダイドーグループホールディングス	7,800	5,840.00	45,552,000
伊藤園	46,600	4,845.00	225,777,000
キーコーヒー	15,500	2,059.00	31,914,500
ユニカフェ	2,600	952.00	2,475,200
ジャパンフーズ	1,200	1,174.00	1,408,800
日清オイリオグループ	19,400	4,290.00	83,226,000
不二製油グループ本社	32,100	2,418.00	77,617,800
かどや製油	900	3,530.00	3,177,000
J・オイルミルズ	15,800	1,965.00	31,047,000
ローソン	31,500	7,241.00	228,091,500
サンエー	11,300	4,505.00	50,906,500
カワチ薬品	11,500	2,395.00	27,542,500
エービーシー・マート	64,800	2,440.50	158,144,400
ハードオフコーポレーション	4,600	1,483.00	6,821,800
高千穂交易	4,200	3,230.00	13,566,000
アスクル	30,600	2,012.00	61,567,200
ゲオホールディングス	16,600	2,171.00	36,038,600
アダストリア	17,900	3,250.00	58,175,000
ジーフット	6,800	286.00	1,944,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	681.00	681,000
オルバヘルスケアホールディングス	1,200	1,799.00	2,158,800
伊藤忠食品	3,300	7,080.00	23,364,000
くら寿司	17,300	3,530.00	61,069,000
キャンドウ	5,300	2,512.00	13,313,600
エレマテック	13,300	1,698.00	22,583,400
IKホールディングス	2,700	346.00	934,200
パルグループホールディングス	29,100	2,000.00	58,200,000
エディオン	58,600	1,489.00	87,255,400
あらた	11,300	6,320.00	71,416,000
サーラコーポレーション	31,200	730.00	22,776,000
ワッツ	4,100	544.00	2,230,400
トーメンデバイス	2,200	5,060.00	11,132,000
ハローズ	6,800	4,335.00	29,478,000
J Pホールディングス	36,800	359.00	13,211,200
フジオフードグループ本社	16,600	1,417.00	23,522,200
あみやき亭	3,600	3,750.00	13,500,000
東京エレクトロン デバイス	14,700	4,070.00	59,829,000
ひらまつ	19,600	244.00	4,782,400
円谷フィールズホールディングス	25,400	1,536.00	39,014,400
双日	164,700	3,082.00	507,605,400
アルフレッサ ホールディングス	148,500	2,485.50	369,096,750
大黒天物産	4,600	6,190.00	28,474,000
ハニーズホールディングス	11,600	1,609.00	18,664,400
ファーマライズホールディングス	1,800	653.00	1,175,400

キッコーマン	91,300	9,695.00	885,153,500
味の素	327,300	5,736.00	1,877,392,800
ブルドックソース	7,300	2,083.00	15,205,900
キュービー	74,100	2,553.50	189,214,350
ハウス食品グループ本社	47,500	3,334.00	158,365,000
カゴメ	59,200	3,163.00	187,249,600
焼津水産化学工業	3,300	1,184.00	3,907,200
アリアケジャパン	13,700	4,590.00	62,883,000
ピエトロ	1,000	1,811.00	1,811,000
エバラ食品工業	3,300	2,884.00	9,517,200
やまみ	700	2,701.00	1,890,700
ニチレイ	63,200	3,242.00	204,894,400
横浜冷凍	40,300	1,182.00	47,634,600
東洋水産	69,600	8,021.00	558,261,600
イトアンドホールディングス	6,200	1,978.00	12,263,600
大冷	1,100	1,936.00	2,129,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,200	1,085.00	6,727,000
日清食品ホールディングス	48,400	15,025.00	727,210,000
永谷園ホールディングス	6,800	2,192.00	14,905,600
一正蒲鉾	3,300	726.00	2,395,800
フジッコ	14,100	1,973.00	27,819,300
ロック・フィールド	15,400	1,625.00	25,025,000
日本たばこ産業	836,900	3,742.00	3,131,679,800
ケンコーマヨネーズ	9,500	1,557.00	14,791,500
わらべや日洋ホールディングス	9,200	3,455.00	31,786,000
なとり	8,700	2,028.00	17,643,600
イフジ産業	1,500	1,361.00	2,041,500
ファーマフーズ	19,700	1,348.00	26,555,600
北の達人コーポレーション	59,100	192.00	11,347,200
ユーグレナ	85,700	753.00	64,532,100
紀文食品	11,900	1,180.00	14,042,000
ピクルスホールディングス	8,100	1,201.00	9,728,100
スター・マイカ・ホールディングス	16,000	602.00	9,632,000
SREホールディングス	5,900	2,492.00	14,702,800
ADワークスグループ	19,200	245.00	4,704,000
片倉工業	12,900	1,659.00	21,401,100
グンゼ	10,000	4,810.00	48,100,000
ヒューリック	321,300	1,388.00	445,964,400
神栄	1,200	1,773.00	2,127,600
ラサ商事	5,300	1,674.00	8,872,200
アルペン	12,200	1,894.00	23,106,800
ハブ	2,700	729.00	1,968,300
ラクーンホールディングス	11,600	713.00	8,270,800
クオールホールディングス	20,400	1,644.00	33,537,600
アルコニックス	19,400	1,330.00	25,802,000
神戸物産	114,500	3,607.00	413,001,500
ソリトンシステムズ	7,300	1,221.00	8,913,300
ジーンズホールディングス	8,800	4,425.00	38,940,000
ビックカメラ	78,700	1,166.00	91,764,200
DCMホールディングス	78,200	1,154.00	90,242,800



ペッパーフードサービス	33,800	111.00	3,751,800
ハイパー	1,900	299.00	568,100
Monotaro	209,800	1,441.00	302,321,800
東京一番フーズ	1,900	511.00	970,900
DDグループ	5,300	1,364.00	7,229,200
あいホールディングス	23,700	2,354.00	55,789,800
ディービーエックス	2,300	1,032.00	2,373,600
きちりホールディングス	2,000	909.00	1,818,000
J.フロントリテイリング	169,800	1,444.50	245,276,100
ドトール・日レスホールディングス	26,300	2,165.00	56,939,500
マツキヨココカラ&カンパニー	269,200	2,637.00	709,880,400
ブロンコビリー	8,700	3,105.00	27,013,500
ZOZO	97,800	3,009.00	294,280,200
トレジャー・ファクトリー	7,200	1,161.00	8,359,200
物語コーポレーション	24,700	3,755.00	92,748,500
三越伊勢丹ホールディングス	249,200	1,735.00	432,362,000
東洋紡	60,500	1,004.00	60,742,000
ユニチカ	45,400	185.00	8,399,000
富士紡ホールディングス	6,100	3,580.00	21,838,000
日清紡ホールディングス	106,200	1,106.50	117,510,300
倉敷紡績	10,500	2,434.00	25,557,000
ダイワボウホールディングス	65,500	2,956.50	193,650,750
シキボウ	6,400	1,075.00	6,880,000
日東紡績	17,800	4,015.00	71,467,000
トヨタ紡織	58,900	2,677.00	157,675,300
マクニカホールディングス	35,000	6,457.00	225,995,000
Hamee	5,100	981.00	5,003,100
マーケットエンタープライズ	800	1,114.00	891,200
ラクト・ジャパン	5,700	1,987.00	11,325,900
ウエルシアホールディングス	76,800	2,476.50	190,195,200
クリエイトSDホールディングス	24,500	3,110.00	76,195,000
グリムス	6,200	2,010.00	12,462,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	22,400	1,064.00	23,833,600
八洲電機	11,900	1,281.00	15,243,900
メディアスホールディングス	9,500	737.00	7,001,500
レスターホールディングス	12,600	2,507.00	31,588,200
ジオリーブグループ	1,900	1,188.00	2,257,200
丸善CHIホールディングス	9,800	327.00	3,204,600
大光	3,500	664.00	2,324,000
OCHIホールディングス	1,900	1,378.00	2,618,200
TOKAIホールディングス	80,300	982.00	78,854,600
黒谷	2,400	581.00	1,394,400
ミサワ	1,800	638.00	1,148,400
ティーライフ	1,100	1,370.00	1,507,000
Cominix	1,700	757.00	1,286,900
エー・ピーホールディングス	2,000	875.00	1,750,000
三洋貿易	16,700	1,270.00	21,209,000
チムニー	2,600	1,398.00	3,634,800
シュッピン	13,400	1,209.00	16,200,600

ビューティガレージ	4,600	2,443.00	11,237,800	
オイシックス・ラ・大地	19,900	1,385.00	27,561,500	
ウイン・パートナーズ	9,700	1,210.00	11,737,000	
ネクステージ	33,800	2,166.00	73,210,800	
ジョイフル本田	43,100	1,758.00	75,769,800	
鳥貴族ホールディングス	5,500	2,841.00	15,625,500	
ホットランド	11,300	2,043.00	23,085,900	
すかいらーくホールディングス	202,300	2,295.50	464,379,650	
SFPホールディングス	8,100	2,320.00	18,792,000	
綿半ホールディングス	11,500	1,351.00	15,536,500	
日本毛織	37,000	1,381.00	51,097,000	
ダイトウボウ	12,700	86.00	1,092,200	
トーア紡コーポレーション	3,000	454.00	1,362,000	
ダイドーリミテッド	11,200	334.00	3,740,800	
ヨシックスホールディングス	2,700	2,953.00	7,973,100	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,300	1,044.00	43,117,200	
野村不動産ホールディングス	76,700	3,628.00	278,267,600	
三重交通グループホールディングス	29,500	560.00	16,520,000	
サムティ	21,900	2,435.00	53,326,500	
ディア・ライフ	23,500	760.00	17,860,000	
コーセーアールイー	2,400	1,003.00	2,407,200	
地主	10,500	2,065.00	21,682,500	
プレサンスコーポレーション	21,800	1,633.00	35,599,400	
フィル・カンパニー	2,200	519.00	1,141,800	
THEグローバル社	4,500	395.00	1,777,500	
ハウスコム	1,200	807.00	968,400	
JPMC	8,000	1,117.00	8,936,000	
サンセイランディック	2,300	1,036.00	2,382,800	
エストラスト	800	626.00	500,800	
フージャースホールディングス	21,200	1,041.00	22,069,200	
オープンハウスグループ	50,500	5,022.00	253,611,000	
東急不動産ホールディングス	414,100	913.10	378,114,710	
飯田グループホールディングス	132,000	2,272.50	299,970,000	
イーランド	1,100	1,471.00	1,618,100	
ムゲンエステート	5,100	1,169.00	5,961,900	
帝国繊維	15,800	1,917.00	30,288,600	
日本コークス工業	142,300	110.00	15,653,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,600	709.00	4,679,400	
ミタチ産業	2,100	1,045.00	2,194,500	
B E E N O S	6,000	1,393.00	8,358,000	
あさひ	13,700	1,299.00	17,796,300	
日本調剤	10,100	1,266.00	12,786,600	
コスモス薬品	14,600	15,735.00	229,731,000	
シップヘルスケアホールディングス	53,200	2,122.00	112,890,400	
トーエル	3,700	692.00	2,560,400	
ソフトクリエイトホールディングス	11,500	1,765.00	20,297,500	
セブン&アイ・ホールディングス	510,000	5,659.00	2,886,090,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	100,100	1,032.00	103,303,200	

明治電機工業	5,500	1,401.00	7,705,500
ツルハホールディングス	31,100	10,840.00	337,124,000
デリカフーズホールディングス	3,500	583.00	2,040,500
スターティアホールディングス	2,200	1,301.00	2,862,200
サンマルクホールディングス	11,900	1,900.00	22,610,000
フェリシモ	1,900	904.00	1,717,600
トリドールホールディングス	41,400	3,693.00	152,890,200
帝人	134,600	1,328.50	178,816,100
東レ	938,800	760.70	714,145,160
クラレ	204,100	1,590.00	324,519,000
旭化成	947,800	1,001.50	949,221,700
TOKYO BASE	17,800	294.00	5,233,200
稲葉製作所	7,600	1,512.00	11,491,200
宮地エンジニアリンググループ	7,300	3,090.00	22,557,000
トーカロ	41,700	1,449.00	60,423,300
アルファ	2,900	1,389.00	4,028,100
SUMCO	256,500	2,115.00	542,497,500
川田テクノロジーズ	3,400	7,040.00	23,936,000
RS Technologies	9,700	2,443.00	23,697,100
ジェイテックコーポレーション	1,000	2,067.00	2,067,000
信和	5,200	734.00	3,816,800
ビーロット	5,200	835.00	4,342,000
ファーストブラザーズ	1,500	1,104.00	1,656,000
And Doホールディングス	8,300	1,009.00	8,374,700
シーアールイー	7,700	1,565.00	12,050,500
ケイアイスター不動産	6,600	4,060.00	26,796,000
アグレ都市デザイン	1,400	1,466.00	2,052,400
グッドコムアセット	12,800	916.00	11,724,800
ジェイ・エス・ビー	6,900	2,418.00	16,684,200
ロードスターキャピタル	8,900	1,997.00	17,773,300
テンポイノベーション	2,300	1,097.00	2,523,100
グローバル・リンク・マネジメント	1,500	1,997.00	2,995,500
フェイスネットワーク	2,100	1,281.00	2,690,100
住江織物	1,600	2,191.00	3,505,600
日本フェルト	4,800	418.00	2,006,400
イチカワ	900	1,654.00	1,488,600
エコナックホールディングス	7,100	142.00	1,008,200
日東製網	800	1,436.00	1,148,800
芦森工業	1,600	2,158.00	3,452,800
アツギ	5,500	432.00	2,376,000
ウイルプラスホールディングス	1,400	1,217.00	1,703,800
JMホールディングス	11,200	2,027.00	22,702,400
コメダホールディングス	36,300	2,778.00	100,841,400
サツドラホールディングス	3,700	763.00	2,823,100
アレンザホールディングス	11,100	999.00	11,088,900
串カツ田中ホールディングス	3,900	1,676.00	6,536,400
バロックジャパンリミテッド	11,500	796.00	9,154,000
クスリのアオキホールディングス	13,200	9,502.00	125,426,400
ダイニック	2,500	756.00	1,890,000
共和レザー	4,600	729.00	3,353,400

ピーバンドットコム	1,000	393.00	393,000	
力の源ホールディングス	6,600	1,761.00	11,622,600	
FOOD & LIFE COMPANIES	78,900	2,666.50	210,386,850	
アセンテック	5,700	524.00	2,986,800	
セーレン	27,000	2,381.00	64,287,000	
ソトー	2,500	697.00	1,742,500	
東海染工	800	950.00	760,000	
小松マテーレ	20,400	798.00	16,279,200	
ワコールホールディングス	28,700	3,277.00	94,049,900	
ホギメディカル	18,500	3,335.00	61,697,500	
クラウドシアホールディングス	1,800	408.00	734,400	
T S Iホールディングス	47,200	815.00	38,468,000	
マツオカコーポレーション	2,400	1,535.00	3,684,000	
ワールド	19,700	1,600.00	31,520,000	
T I S	153,400	2,985.00	457,899,000	
テクミラホールディングス	3,600	444.00	1,598,400	
グリー	37,600	540.00	20,304,000	
G M Oペパボ	1,700	1,232.00	2,094,400	
コーエーテクモホールディングス	87,900	1,962.50	172,503,750	
三菱総合研究所	6,900	4,650.00	32,085,000	
ボルテージ	2,300	263.00	604,900	
電算	800	1,501.00	1,200,800	
A G S	3,200	710.00	2,272,000	
ファインデックス	11,100	806.00	8,946,600	
ブレインパッド	10,500	1,015.00	10,657,500	
K L a b	25,800	270.00	6,966,000	
ポルトゥウィンホールディングス	24,000	475.00	11,400,000	
ネクソン	313,400	2,991.50	937,536,100	
アイスタイル	41,700	449.00	18,723,300	
エムアップホールディングス	17,100	1,192.00	20,383,200	
エイチーム	8,300	653.00	5,419,900	
エニグモ	17,900	352.00	6,300,800	
テクノスジャパン	7,000	612.00	4,284,000	
e n i s h	7,000	149.00	1,043,000	
コロブラ	54,400	582.00	31,660,800	
オルトプラス	6,800	176.00	1,196,800	
ブロードリーフ	66,600	494.00	32,900,400	
クロス・マーケティンググループ	4,700	677.00	3,181,900	
デジタルハーツホールディングス	8,700	819.00	7,125,300	
メディアドゥ	6,300	1,405.00	8,851,500	
じげん	40,900	519.00	21,227,100	
バイキューブ	16,800	382.00	6,417,600	
エンカレッジ・テクノロジー	1,900	512.00	972,800	
サイバーリンクス	3,000	725.00	2,175,000	
ディー・エル・イー	5,600	224.00	1,254,400	
フィックスターズ	15,800	1,146.00	18,106,800	
C A R T A H O L D I N G S	6,500	1,223.00	7,949,500	
オブティム	14,400	867.00	12,484,800	
セレス	5,600	980.00	5,488,000	

S H I F T	9,300	32,530.00	302,529,000	
特種東海製紙	7,700	3,615.00	27,835,500	
ティーガイア	14,600	1,788.00	26,104,800	
セック	1,500	3,930.00	5,895,000	
テクマトリックス	25,700	1,686.00	43,330,200	
プロシップ	6,800	1,315.00	8,942,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,600	2,254.50	82,514,700	
GMOペイメントゲートウェイ	28,000	7,649.00	214,172,000	
ザッパラス	2,200	473.00	1,040,600	
システムリサーチ	4,800	3,205.00	15,384,000	
インターネットイニシアティブ	67,100	2,588.00	173,654,800	
さくらインターネット	15,700	1,187.00	18,635,900	
ヴィンクス	1,900	2,014.00	3,826,600	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,300	2,650.00	11,395,000	
SRAホールディングス	7,200	3,500.00	25,200,000	
システムインテグレータ	2,300	397.00	913,100	
朝日ネット	15,100	622.00	9,392,200	
eBASE	19,700	749.00	14,755,300	
アバントグループ	17,800	1,392.00	24,777,600	
アドソル日進	5,900	1,604.00	9,463,600	
ODKソリューションズ	1,600	550.00	880,000	
フリービット	7,400	1,056.00	7,814,400	
コムチュア	20,300	1,980.00	40,194,000	
サイバーコム	1,200	1,900.00	2,280,000	
アステリア	11,000	742.00	8,162,000	
アイル	6,500	3,865.00	25,122,500	
王子ホールディングス	583,700	577.20	336,911,640	
日本製紙	79,000	1,261.00	99,619,000	
三菱製紙	10,500	561.00	5,890,500	
北越コーポレーション	68,900	1,298.00	89,432,200	
中越パルプ工業	3,100	1,550.00	4,805,000	
巴川製紙所	2,200	652.00	1,434,400	
大王製紙	61,900	1,032.00	63,880,800	
阿波製紙	2,200	423.00	930,600	
マークライnz	7,600	2,867.00	21,789,200	
メディカル・データ・ビジョン	16,700	704.00	11,756,800	
gumi	20,700	417.00	8,631,900	
ショーケース	1,800	296.00	532,800	
モバイルファクトリー	1,700	714.00	1,213,800	
テラスカイ	6,000	1,457.00	8,742,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,100	1,581.00	12,806,100	
PCIホールディングス	3,000	930.00	2,790,000	
アイビーシー	1,200	526.00	631,200	
ネオジャパン	4,700	1,001.00	4,704,700	
P R T I M E S	2,800	1,677.00	4,695,600	
ラクス	66,400	2,178.50	144,652,400	
ランドコンピュータ	4,600	682.00	3,137,200	

ダブルスタンダード	4,300	1,390.00	5,977,000
オープンドア	8,200	875.00	7,175,000
マイネット	2,500	310.00	775,000
アカツキ	6,600	2,187.00	14,434,200
ベネフィットジャパン	500	1,173.00	586,500
Ubicomホールディングス	4,400	1,606.00	7,066,400
カナミックネットワーク	15,100	475.00	7,172,500
ノムラシステムコーポレーション	8,600	109.00	937,400
レンゴー	127,600	922.00	117,647,200
トーモク	8,100	2,121.00	17,180,100
ザ・パック	10,400	3,230.00	33,592,000
チェンジホールディングス	30,500	1,614.00	49,227,000
シンクロ・フード	4,900	600.00	2,940,000
オークネット	5,500	1,827.00	10,048,500
キャピタル・アセット・プランニング	1,600	700.00	1,120,000
セグエグループ	2,500	927.00	2,317,500
エイトレッド	1,100	1,324.00	1,456,400
マクロミル	27,500	660.00	18,150,000
ビーグリー	1,700	1,089.00	1,851,300
オロ	5,100	2,152.00	10,975,200
ユーザーローカル	5,100	1,713.00	8,736,300
テモナ	1,800	246.00	442,800
ニーズウェル	4,300	662.00	2,846,600
マネーフォワード	31,200	4,361.00	136,063,200
サインポスト	3,000	444.00	1,332,000
レゾナック・ホールディングス	135,400	2,629.50	356,034,300
住友化学	1,039,600	386.30	401,597,480
住友精化	6,500	5,030.00	32,695,000
日産化学	65,900	5,760.00	379,584,000
ラサ工業	5,400	1,953.00	10,546,200
クレハ	10,200	8,290.00	84,558,000
多木化学	5,500	3,230.00	17,765,000
テイカ	12,200	1,375.00	16,775,000
石原産業	23,300	1,366.00	31,827,800
片倉コープアグリ	1,900	1,125.00	2,137,500
日本曹達	16,500	5,240.00	86,460,000
東ソー	187,100	1,902.50	355,957,750
トクヤマ	45,300	2,321.50	105,163,950
セントラル硝子	15,000	2,620.00	39,300,000
東亜合成	70,200	1,386.50	97,332,300
大阪ソーダ	9,800	9,250.00	90,650,000
関東電化工業	27,100	771.00	20,894,100
SUNASTERISK	10,000	1,080.00	10,800,000
デンカ	50,900	2,578.50	131,245,650
イビデン	73,600	7,002.00	515,347,200
信越化学工業	1,270,600	4,817.00	6,120,480,200
日本カーバイド工業	5,200	1,489.00	7,742,800
プラスアルファ・コンサルティング	8,300	2,653.00	22,019,900
電算システムホールディングス	6,200	2,829.00	17,539,800
堺化学工業	10,700	1,844.00	19,730,800

第一稀元素化学工業	15,300	988.00	15,116,400
エア・ウォーター	132,200	1,965.50	259,839,100
日本酸素ホールディングス	136,000	3,971.00	540,056,000
日本化学工業	5,100	1,989.00	10,143,900
東邦アセチレン	1,700	1,594.00	2,709,800
日本パーカライジング	62,400	1,137.00	70,948,800
高压ガス工業	20,500	789.00	16,174,500
チタン工業	1,000	1,317.00	1,317,000
四国化成ホールディングス	18,000	1,826.00	32,868,000
戸田工業	3,200	1,672.00	5,350,400
ステラ ケミファ	7,600	3,185.00	24,206,000
保土谷化学工業	4,400	3,045.00	13,398,000
日本触媒	21,300	5,318.00	113,273,400
大日精化工業	9,800	2,139.00	20,962,200
カネカ	35,500	3,807.00	135,148,500
協和キリン	169,500	2,440.00	413,580,000
A P P I E R G R O U P	47,900	1,546.00	74,053,400
三菱瓦斯化学	104,600	2,242.50	234,565,500
三井化学	115,500	4,016.00	463,848,000
J S R	152,600	3,988.00	608,568,800
東京応化工業	22,300	8,655.00	193,006,500
大阪有機化学工業	11,700	2,646.00	30,958,200
三菱ケミカルグループ	1,024,200	967.50	990,913,500
K H ネオケム	21,400	2,265.00	48,471,000
ダイセル	180,100	1,451.50	261,415,150
住友ベークライト	20,800	6,911.00	143,748,800
積水化学工業	284,100	2,071.00	588,371,100
日本ゼオン	96,100	1,336.50	128,437,650
アイカ工業	35,300	3,370.00	118,961,000
U B E	66,700	2,350.50	156,778,350
積水樹脂	20,900	2,487.00	51,978,300
タキロンシーアイ	35,700	594.00	21,205,800
旭有機材	9,300	3,880.00	36,084,000
ニチバン	7,600	1,759.00	13,368,400
リケンテクノス	30,100	877.00	26,397,700
大倉工業	6,400	2,716.00	17,382,400
積水化成品工業	19,700	477.00	9,396,900
群栄化学工業	3,300	3,120.00	10,296,000
タイガースポリマー	3,500	793.00	2,775,500
ミライアル	2,600	1,422.00	3,697,200
ダイキアクシス	3,200	733.00	2,345,600
ダイキョーニシカワ	31,000	774.00	23,994,000
竹本容器	3,000	775.00	2,325,000
森六ホールディングス	8,000	2,453.00	19,624,000
恵和	10,100	1,417.00	14,311,700
日本化薬	107,000	1,318.50	141,079,500
カーリットホールディングス	15,100	958.00	14,465,800
ソルクシーズ	6,300	409.00	2,576,700
C L ホールディングス	3,400	846.00	2,876,400
プレステージ・インターナショナル	67,300	662.00	44,552,600

フェイス	2,200	494.00	1,086,800
プロトコーポレーション	15,400	1,316.00	20,266,400
ハイマックス	4,400	1,360.00	5,984,000
アミューズ	8,800	1,489.00	13,103,200
野村総合研究所	310,800	4,043.00	1,256,564,400
ドリームインキュベータ	4,900	2,930.00	14,357,000
サイバネットシステム	10,100	1,092.00	11,029,200
クイック	10,000	2,180.00	21,800,000
T A C	3,800	202.00	767,600
C Eホールディングス	3,900	572.00	2,230,800
日本システム技術	4,600	2,284.00	10,506,400
電通グループ	141,300	4,491.00	634,578,300
インテージホールディングス	15,900	1,682.00	26,743,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,800	990.00	4,752,000
東邦システムサイエンス	4,600	1,132.00	5,207,200
ぴあ	4,900	3,320.00	16,268,000
イオンファンタジー	5,200	2,788.00	14,497,600
ソースネクスト	64,200	187.00	12,005,400
シーティーエス	18,200	665.00	12,103,000
ネクシィーズグループ	2,500	754.00	1,885,000
インフォコム	18,100	2,481.00	44,906,100
メディカルシステムネットワーク	16,000	507.00	8,112,000
日本精化	9,300	2,756.00	25,630,800
扶桑化学工業	14,900	4,200.00	62,580,000
トリケミカル研究所	17,000	3,335.00	56,695,000
シンプレクス・ホールディングス	21,100	2,419.00	51,040,900
HEROZ	4,700	1,400.00	6,580,000
ラクスル	33,800	1,370.00	46,306,000
メルカリ	85,100	3,279.00	279,042,900
I P S	3,900	2,297.00	8,958,300
F I G	9,100	349.00	3,175,900
システムサポート	5,400	1,991.00	10,751,400
A D E K A	48,800	2,723.50	132,906,800
日油	43,300	6,749.00	292,231,700
ミヨシ油脂	2,900	1,346.00	3,903,400
新日本理化	10,700	191.00	2,043,700
ハリマ化成グループ	7,600	797.00	6,057,200
イーソル	10,200	681.00	6,946,200
東海ソフト	1,100	1,095.00	1,204,500
ウイングアーク1st	14,500	2,934.00	42,543,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,700	1,247.00	4,613,900
サーバーワークス	2,900	3,230.00	9,367,000
東名	600	1,692.00	1,015,200
ヴィッツ	700	941.00	658,700
トピラシステムズ	2,200	839.00	1,845,800
S a n s a n	45,900	1,364.00	62,607,600
L i n k - U	1,900	745.00	1,415,500
ギフティ	12,300	1,415.00	17,404,500
花王	316,800	5,636.00	1,785,484,800



第一工業製薬	5,600	1,783.00	9,984,800	
石原ケミカル	6,400	2,046.00	13,094,400	
日華化学	3,100	956.00	2,963,600	
ニイタカ	1,400	2,035.00	2,849,000	
三洋化成工業	8,600	4,275.00	36,765,000	
メドレー	18,800	4,870.00	91,556,000	
ベース	4,800	4,445.00	21,336,000	
J M D C	23,900	4,711.00	112,592,900	
武田薬品工業	1,241,600	4,131.00	5,129,049,600	
アステラス製薬	1,230,600	1,760.50	2,166,471,300	
住友ファーマ	104,100	442.00	46,012,200	
塩野義製薬	176,900	7,082.00	1,252,805,800	
わかもと製薬	8,300	198.00	1,643,400	
日本新薬	36,800	5,697.00	209,649,600	
中外製薬	439,200	4,720.00	2,073,024,000	
科研製薬	24,000	3,209.00	77,016,000	
エーザイ	170,700	7,927.00	1,353,138,900	
理研ビタミン	11,900	2,280.00	27,132,000	
ロート製薬	135,900	3,280.00	445,752,000	
小野薬品工業	297,700	2,655.50	790,542,350	
久光製薬	31,200	4,656.00	145,267,200	
有機合成薬品工業	6,300	284.00	1,789,200	
持田製薬	16,100	3,285.00	52,888,500	
参天製薬	255,600	1,387.00	354,517,200	
扶桑薬品工業	5,000	1,904.00	9,520,000	
日本ケミファ	800	1,625.00	1,300,000	
ツムラ	44,100	2,802.00	123,568,200	
テルモ	391,100	4,224.00	1,652,006,400	
H . U . グループホールディングス	42,100	2,459.50	103,544,950	
キッセイ薬品工業	23,300	3,060.00	71,298,000	
生化学工業	23,800	759.00	18,064,200	
栄研化学	27,300	1,510.00	41,223,000	
鳥居薬品	7,600	3,590.00	27,284,000	
J C R ファーマ	47,500	1,212.00	57,570,000	
東和薬品	21,500	2,683.00	57,684,500	
富士製薬工業	10,400	1,460.00	15,184,000	
ゼリア新薬工業	19,400	1,889.00	36,646,600	
そーせいグループ	45,200	1,429.00	64,590,800	
第一三共	1,222,200	4,090.00	4,998,798,000	
杏林製薬	30,400	1,797.00	54,628,800	
大幸薬品	28,800	322.00	9,273,600	
ダイト	10,800	1,919.00	20,725,200	
大塚ホールディングス	291,800	5,528.00	1,613,070,400	
大正製薬ホールディングス	31,200	5,497.00	171,506,400	
ペプチドリーム	68,000	1,296.50	88,162,000	
大日本塗料	15,600	919.00	14,336,400	
日本ペイントホールディングス	744,000	1,044.00	776,736,000	
関西ペイント	137,300	2,270.00	311,671,000	
神東塗料	6,800	122.00	829,600	
中国塗料	28,800	1,458.00	41,990,400	

日本特殊塗料	5,600	1,169.00	6,546,400
藤倉化成	17,200	454.00	7,808,800
太陽ホールディングス	24,400	2,871.00	70,052,400
D I C	54,700	2,449.50	133,987,650
サカタインクス	31,200	1,341.00	41,839,200
東洋インキS Cホールディングス	30,400	2,614.00	79,465,600
T & K T O K A	12,100	1,442.00	17,448,200
アルプス技研	13,600	2,715.00	36,924,000
サニックス	23,100	325.00	7,507,500
日本空調サービス	15,600	792.00	12,355,200
オリエンタルランド	761,000	5,089.00	3,872,729,000
フォーカスシステムズ	9,300	971.00	9,030,300
ダスキン	32,000	3,162.00	101,184,000
パーク24	89,400	1,726.50	154,349,100
明光ネットワークジャパン	17,500	699.00	12,232,500
ファルコホールディングス	6,500	2,028.00	13,182,000
クレスコ	11,500	1,875.00	21,562,500
フジ・メディア・ホールディングス	134,700	1,507.00	202,992,900
秀英予備校	1,900	372.00	706,800
田谷	1,400	412.00	576,800
ラウンドワン	135,200	571.00	77,199,200
リゾートトラスト	62,400	2,192.50	136,812,000
オービック	46,800	22,140.00	1,036,152,000
ジャストシステム	20,200	2,871.00	57,994,200
T D C ソフト	13,200	1,765.00	23,298,000
L I N E ヤフー	1,996,900	441.40	881,431,660
ビー・エム・エル	17,700	2,830.00	50,091,000
トレンドマイクロ	66,300	7,085.00	469,735,500
I Dホールディングス	9,500	1,542.00	14,649,000
リソー教育	73,600	237.00	17,443,200
日本オラクル	26,800	10,840.00	290,512,000
早稲田アカデミー	8,000	1,529.00	12,232,000
アルファシステムズ	3,600	2,921.00	10,515,600
フューチャー	29,900	1,777.00	53,132,300
C A C H o l d i n g s	7,600	1,725.00	13,110,000
S B テクノロジー	5,900	2,382.00	14,053,800
トーセ	2,200	707.00	1,555,400
ユー・エス・エス	161,300	2,874.50	463,656,850
オービックビジネスコンサルタント	19,700	6,512.00	128,286,400
アイティフォー	18,000	1,073.00	19,314,000
東京個別指導学院	17,100	484.00	8,276,400
東計電算	2,000	6,600.00	13,200,000
サイバーエージェント	317,700	800.80	254,414,160
楽天グループ	1,231,500	552.50	680,403,750
エクスネット	1,000	1,057.00	1,057,000
クリーク・アンド・リバー社	7,300	1,999.00	14,592,700
S B I グローバルアセットマネジメント	28,300	557.00	15,763,100
テー・オー・ダブリュー	28,300	313.00	8,857,900
大塚商会	69,600	5,914.00	411,614,400

サイボウズ	19,300	2,025.00	39,082,500
山田コンサルティンググループ	6,200	1,679.00	10,409,800
セントラルスポーツ	5,400	2,440.00	13,176,000
バラカ	4,900	1,965.00	9,628,500
電通国際情報サービス	17,000	4,570.00	77,690,000
A C C E S S	14,500	757.00	10,976,500
デジタルガレージ	22,400	2,990.00	66,976,000
イーエムシステムズ	23,400	679.00	15,888,600
ウェザーニューズ	4,400	5,920.00	26,048,000
C I J	23,300	599.00	13,956,700
ビジネスエンジニアリング	2,300	3,750.00	8,625,000
日本エンタープライズ	8,100	118.00	955,800
WOWOW	10,600	1,050.00	11,130,000
スカラ	13,000	766.00	9,958,000
インテリジェント ウェイブ	4,200	968.00	4,065,600
フルキャストホールディングス	13,700	1,837.00	25,166,900
エン・ジャパン	23,400	2,251.00	52,673,400
あすか製薬ホールディングス	14,300	1,857.00	26,555,100
サワイグループホールディングス	32,100	4,994.00	160,307,400
富士フイルムホールディングス	260,300	8,470.00	2,204,741,000
コニカミノルタ	315,500	461.00	145,445,500
資生堂	292,900	4,185.00	1,225,786,500
ライオン	183,600	1,300.00	238,680,000
高砂香料工業	10,500	3,445.00	36,172,500
マンダム	30,300	1,253.00	37,965,900
ミルボン	19,000	3,768.00	71,592,000
ファンケル	61,400	2,156.00	132,378,400
コーセー	28,600	9,911.00	283,454,600
コタ	12,900	1,550.00	19,995,000
シーボン	1,100	1,485.00	1,633,500
ポーラ・オルビスホールディングス	71,900	1,503.00	108,065,700
ノエビアホールディングス	12,500	5,240.00	65,500,000
アジュバンホールディングス	2,000	918.00	1,836,000
新日本製薬	8,000	1,548.00	12,384,000
I - n e	2,800	2,798.00	7,834,400
アクシージア	7,200	942.00	6,782,400
エステー	10,800	1,496.00	16,156,800
アグロ カネショウ	5,600	1,334.00	7,470,400
コニシ	23,500	2,490.00	58,515,000
長谷川香料	26,800	3,295.00	88,306,000
小林製薬	40,800	6,625.00	270,300,000
荒川化学工業	11,800	1,010.00	11,918,000
メック	11,500	4,115.00	47,322,500
日本高純度化学	3,200	2,573.00	8,233,600
タカラバイオ	37,800	1,164.00	43,999,200
J C U	15,700	3,535.00	55,499,500
新田ゼラチン	5,300	711.00	3,768,300
O A T アグリオ	4,100	1,944.00	7,970,400
デクセリアルズ	35,200	4,300.00	151,360,000
アース製薬	12,800	4,785.00	61,248,000

北興化学工業	14,100	917.00	12,929,700
大成ラミック	4,100	2,990.00	12,259,000
クミアイ化学工業	55,700	1,100.00	61,270,000
日本農薬	25,800	594.00	15,325,200
富士興産	2,300	1,844.00	4,241,200
ニチレキ	18,300	2,411.00	44,121,300
ユシロ化学工業	7,300	1,665.00	12,154,500
ビービー・カストロール	3,000	890.00	2,670,000
富士石油	40,900	350.00	14,315,000
MORESCO	2,800	1,254.00	3,511,200
出光興産	155,800	3,430.00	534,394,000
ENEOSホールディングス	2,221,100	547.20	1,215,385,920
コスモエネルギーホールディングス	41,500	5,758.00	238,957,000
ANYCOLOR	4,900	3,625.00	17,762,500
テスホールディングス	29,600	448.00	13,260,800
インフロニア・ホールディングス	158,100	1,587.50	250,983,750
横浜ゴム	70,900	3,148.00	223,193,200
TOYO TIRE	80,600	2,329.50	187,757,700
ブリヂストン	410,700	5,816.00	2,388,631,200
住友ゴム工業	137,500	1,816.50	249,768,750
藤倉コンポジット	9,500	1,358.00	12,901,000
オカモト	6,600	5,380.00	35,508,000
アキレス	8,800	1,584.00	13,939,200
フコク	7,400	1,330.00	9,842,000
ニッタ	14,200	3,680.00	52,256,000
クリエートメディック	2,500	882.00	2,205,000
住友理工	21,800	1,024.00	22,323,200
三ツ星ベルト	17,000	4,355.00	74,035,000
バンドー化学	20,800	1,596.00	33,196,800
AGC	130,900	5,268.00	689,581,200
日本板硝子	66,900	636.00	42,548,400
石塚硝子	1,400	3,145.00	4,403,000
有沢製作所	24,500	1,038.00	25,431,000
日本山村硝子	2,900	1,644.00	4,767,600
日本電気硝子	57,200	2,998.50	171,514,200
オハラ	6,600	1,296.00	8,553,600
住友大阪セメント	23,400	3,683.00	86,182,200
太平洋セメント	83,000	2,827.00	234,641,000
リソルホールディングス	700	5,190.00	3,633,000
日本ヒューム	12,300	892.00	10,971,600
日本コンクリート工業	27,300	335.00	9,145,500
三谷セキサン	5,800	4,325.00	25,085,000
アジアパイルホールディングス	19,900	651.00	12,954,900
東海カーボン	129,400	1,075.50	139,169,700
日本カーボン	7,500	4,520.00	33,900,000
東洋炭素	9,900	4,460.00	44,154,000
ノリタケカンパニーリミテド	7,800	6,630.00	51,714,000
TOTO	92,500	3,871.00	358,067,500
日本碍子	163,200	1,904.00	310,732,800
日本特殊陶業	117,500	3,399.00	399,382,500

ダントーホールディングス	5,200	839.00	4,362,800
MARUWA	5,200	27,870.00	144,924,000
品川リフラクトリーズ	17,200	1,588.00	27,313,600
黒崎播磨	2,900	10,130.00	29,377,000
ヨータイ	8,700	1,421.00	12,362,700
東京窯業	8,500	334.00	2,839,000
ニッカトー	3,500	555.00	1,942,500
フジインコーポレーテッド	37,700	3,040.00	114,608,000
クニミネ工業	2,300	969.00	2,228,700
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,163.00	1,977,100
ニチアス	35,400	3,135.00	110,979,000
日本製鉄	646,300	3,274.00	2,115,986,200
神戸製鋼所	290,200	1,725.50	500,740,100
中山製鋼所	33,000	809.00	26,697,000
合同製鉄	8,100	4,380.00	35,478,000
JFEホールディングス	401,400	2,158.00	866,221,200
東京製鉄	40,600	1,790.00	72,674,000
共英製鋼	16,500	2,146.00	35,409,000
大和工業	27,200	7,309.00	198,804,800
東京鐵鋼	6,300	3,725.00	23,467,500
大阪製鉄	6,800	1,855.00	12,614,000
淀川製鋼所	16,400	3,770.00	61,828,000
中部鋼鈹	9,500	1,979.00	18,800,500
丸一鋼管	43,900	3,817.00	167,566,300
モリ工業	2,600	4,350.00	11,310,000
大同特殊鋼	18,200	6,202.00	112,876,400
日本高周波鋼業	3,100	513.00	1,590,300
日本冶金工業	10,600	4,085.00	43,301,000
山陽特殊製鋼	14,300	2,519.00	36,021,700
愛知製鋼	8,300	3,465.00	28,759,500
日本金属	2,200	803.00	1,766,600
ミガロホールディングス	1,100	1,165.00	1,281,500
大平洋金属	12,400	1,335.00	16,554,000
新日本電工	72,000	273.00	19,656,000
栗本鐵工所	6,800	3,065.00	20,842,000
虹 技	1,000	1,123.00	1,123,000
日本鑄鉄管	800	1,036.00	828,800
日本製鋼所	39,000	2,494.00	97,266,000
三菱製鋼	10,700	1,494.00	15,985,800
日亜鋼業	8,600	303.00	2,605,800
日本精線	2,100	4,775.00	10,027,500
エンビプロ・ホールディングス	7,700	630.00	4,851,000
大紀アルミニウム工業所	18,300	1,206.00	22,069,800
日本輕金属ホールディングス	42,200	1,631.00	68,828,200
三井金属鋳業	42,000	4,208.00	176,736,000
東邦亜鉛	9,200	1,170.00	10,764,000
三菱マテリアル	103,200	2,417.50	249,486,000
住友金属鋳山	167,300	4,177.00	698,812,100
DOWAホールディングス	35,600	5,030.00	179,068,000
古河機械金属	19,100	1,976.00	37,741,600

エス・サイエンス	49,500	23.00	1,138,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	25,000	2,972.00	74,300,000	
東邦チタニウム	29,800	1,814.00	54,057,200	
UACJ	20,300	3,120.00	63,336,000	
CKサンエツ	2,700	3,605.00	9,733,500	
古河電気工業	48,000	2,294.50	110,136,000	
住友電気工業	539,900	1,816.00	980,458,400	
フジクラ	170,200	1,074.50	182,879,900	
SWCC	16,100	2,512.00	40,443,200	
タツタ電線	25,700	687.00	17,655,900	
カナレ電気	1,400	1,491.00	2,087,400	
平河ヒューテック	9,200	1,416.00	13,027,200	
いよぎんホールディングス	163,900	998.00	163,572,200	
しずおかフィナンシャルグループ	306,100	1,218.50	372,982,850	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	116,000	1,097.00	127,252,000	
楽天銀行	47,900	2,424.00	116,109,600	
京都フィナンシャルグループ	43,600	8,263.00	360,266,800	
リョービ	15,400	2,954.00	45,491,600	
アーレスティ	8,800	763.00	6,714,400	
AREホールディングス	54,300	1,872.00	101,649,600	
東洋製罐グループホールディングス	86,100	2,391.50	205,908,150	
ホッカフホールディングス	7,100	1,622.00	11,516,200	
コロナ	8,100	903.00	7,314,300	
横河ブリッジホールディングス	22,500	2,606.00	58,635,000	
駒井ハルテック	1,500	2,177.00	3,265,500	
高田機工	600	3,060.00	1,836,000	
三和ホールディングス	145,000	2,152.50	312,112,500	
文化シャッター	37,700	1,361.00	51,309,700	
三協立山	16,500	834.00	13,761,000	
アルインコ	11,000	995.00	10,945,000	
東洋シャッター	1,900	667.00	1,267,300	
LIXIL	225,300	1,754.50	395,288,850	
日本フィルコン	5,200	484.00	2,516,800	
ノーリツ	23,900	1,521.00	36,351,900	
長府製作所	14,300	2,098.00	30,001,400	
リンナイ	70,600	2,843.00	200,715,800	
ユニプレス	25,100	951.00	23,870,100	
ダイニチ工業	4,200	708.00	2,973,600	
日東精工	21,000	588.00	12,348,000	
三洋工業	900	2,199.00	1,979,100	
岡部	25,800	691.00	17,827,800	
ジーテクト	18,400	1,746.00	32,126,400	
東プレ	25,400	1,646.00	41,808,400	
高周波熱錬	22,200	994.00	22,066,800	
東京製綱	9,300	1,407.00	13,085,100	
サンコール	11,200	472.00	5,286,400	
モリテックスチール	7,200	304.00	2,188,800	
パイオラックス	17,900	2,278.00	40,776,200	
エイチワン	14,900	802.00	11,949,800	
日本発条	127,700	1,161.00	148,259,700	

中央発條	10,700	713.00	7,629,100
アドバネクス	900	916.00	824,400
三浦工業	59,000	2,848.00	168,032,000
タクマ	47,800	1,512.00	72,273,600
テクノプロ・ホールディングス	85,100	3,248.00	276,404,800
アトラグループ	2,400	207.00	496,800
アイ・アールジャパンホールディングス	7,500	1,427.00	10,702,500
Keeper 技研	8,800	5,750.00	50,600,000
ファーストロジック	1,900	496.00	942,400
三機サービス	1,200	1,088.00	1,305,600
Gunosy	11,400	666.00	7,592,400
デザインワン・ジャパン	2,100	160.00	336,000
イー・ガーディアン	5,400	1,521.00	8,213,400
リブセンス	3,700	278.00	1,028,600
ジャパンマテリアル	44,000	2,268.00	99,792,000
ベクトル	17,700	1,083.00	19,169,100
ウチヤマホールディングス	3,400	353.00	1,200,200
チャーム・ケア・コーポレーション	11,900	1,171.00	13,934,900
キャリアリンク	5,300	2,078.00	11,013,400
I B J	11,000	694.00	7,634,000
アサンテ	7,200	1,570.00	11,304,000
バリューHR	12,600	1,301.00	16,392,600
M&Aキャピタルパートナーズ	11,600	2,093.00	24,278,800
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,700	1,023.00	5,831,100
ERIホールディングス	2,100	1,697.00	3,563,700
アピスト	1,200	3,075.00	3,690,000
シグマクシス・ホールディングス	19,400	1,251.00	24,269,400
ウィルグループ	11,900	1,084.00	12,899,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	9,800	141.00	1,381,800
メドピア	12,700	1,063.00	13,500,100
レアジョブ	1,600	945.00	1,512,000
リクルートホールディングス	1,064,600	4,500.00	4,790,700,000
エラン	19,000	900.00	17,100,000
ツガミ	31,400	1,103.00	34,634,200
オークマ	12,400	6,324.00	78,417,600
芝浦機械	14,100	3,495.00	49,279,500
アマダ	225,400	1,454.50	327,844,300
アイダエンジニアリング	32,700	942.00	30,803,400
TAKISAWA	2,400	2,592.00	6,220,800
F U J I	66,500	2,383.00	158,469,500
牧野フライス製作所	15,600	5,710.00	89,076,000
オーエスジー	62,200	1,768.00	109,969,600
ダイジェット工業	800	872.00	697,600
旭ダイヤモンド工業	33,900	885.00	30,001,500
DMG森精機	85,600	2,610.50	223,458,800
ソディック	34,300	764.00	26,205,200
ディスコ	68,000	29,605.00	2,013,140,000
日東工器	6,900	1,818.00	12,544,200

日進工具	13,100	1,023.00	13,401,300
パンチ工業	7,700	423.00	3,257,100
富士ダイス	7,400	652.00	4,824,800
土木管理総合試験所	3,600	318.00	1,144,800
日本郵政	1,689,800	1,305.00	2,205,189,000
ベルシステム24ホールディングス	15,400	1,654.00	25,471,600
鎌倉新書	12,300	596.00	7,330,800
S M N	1,500	300.00	450,000
一蔵	1,000	572.00	572,000
グローバルキッズCOMPANY	1,500	626.00	939,000
エアトリ	10,500	1,896.00	19,908,000
アトラエ	8,500	961.00	8,168,500
ストライク	6,100	3,485.00	21,258,500
ソラスト	39,700	569.00	22,589,300
セラク	4,400	1,232.00	5,420,800
インソース	31,200	1,019.00	31,792,800
豊田自動織機	119,300	11,805.00	1,408,336,500
豊和工業	4,300	753.00	3,237,900
石川製作所	2,000	1,198.00	2,396,000
リケンNPR	15,400	1,887.00	29,059,800
東洋機械金属	6,400	641.00	4,102,400
津田駒工業	1,500	371.00	556,500
エンシュウ	1,900	676.00	1,284,400
島精機製作所	22,500	1,578.00	35,505,000
オプトラン	23,300	1,797.00	41,870,100
NCホールディングス	1,900	1,771.00	3,364,900
イワキ	9,500	1,815.00	17,242,500
フリー	13,300	1,553.00	20,654,900
ヤマシンフィルタ	34,000	312.00	10,608,000
日阪製作所	15,400	962.00	14,814,800
やまびこ	23,100	1,413.00	32,640,300
野村マイクロ・サイエンス	4,800	8,570.00	41,136,000
平田機工	6,800	6,180.00	42,024,000
P E G A S U S	15,600	458.00	7,144,800
マルマエ	6,100	1,413.00	8,619,300
タツモ	8,500	2,906.00	24,701,000
ナブテスコ	88,600	2,715.50	240,593,300
三井海洋開発	17,900	1,899.00	33,992,100
レオン自動機	16,300	1,532.00	24,971,600
S M C	42,300	76,070.00	3,217,761,000
ホソカワミクロン	9,000	4,005.00	36,045,000
ユニオンツール	6,200	3,465.00	21,483,000
瑞光	10,200	1,436.00	14,647,200
オイレス工業	19,100	1,974.00	37,703,400
日精エー・エス・ビー機械	5,600	5,020.00	28,112,000
サトーホールディングス	20,000	2,099.00	41,980,000
技研製作所	13,300	1,810.00	24,073,000
日本エアーテック	6,500	1,385.00	9,002,500
カワタ	2,500	1,039.00	2,597,500
日精樹脂工業	10,500	1,031.00	10,825,500



オカダアイヨン	2,600	2,249.00	5,847,400	
ワイエイシイホールディングス	4,700	2,276.00	10,697,200	
小松製作所	662,200	3,670.00	2,430,274,000	
住友重機械工業	83,600	3,362.00	281,063,200	
日立建機	56,300	4,016.00	226,100,800	
日工	21,000	668.00	14,028,000	
巴工業	5,500	2,801.00	15,405,500	
井関農機	13,200	1,092.00	14,414,400	
T O W A	15,700	5,720.00	89,804,000	
丸山製作所	1,400	2,056.00	2,878,400	
北川鉄工所	5,600	1,304.00	7,302,400	
シンニッタン	10,200	245.00	2,499,000	
ローツェ	7,400	12,630.00	93,462,000	
タカキタ	2,600	451.00	1,172,600	
クボタ	741,300	2,060.50	1,527,448,650	
荏原実業	7,500	2,770.00	20,775,000	
東洋エンジニアリング	20,200	685.00	13,837,000	
三菱化工機	5,000	2,964.00	14,820,000	
月島ホールディングス	19,100	1,273.00	24,314,300	
帝国電機製作所	10,000	2,745.00	27,450,000	
東京機械製作所	2,100	455.00	955,500	
新東工業	28,600	1,037.00	29,658,200	
澁谷工業	13,300	2,480.00	32,984,000	
アイチコーポレーション	19,700	901.00	17,749,700	
小森コーポレーション	35,700	1,168.00	41,697,600	
鶴見製作所	10,800	3,855.00	41,634,000	
日本ギア工業	3,000	466.00	1,398,000	
酒井重工業	2,000	5,780.00	11,560,000	
荏原製作所	58,000	7,163.00	415,454,000	
石井鐵工所	900	2,745.00	2,470,500	
西島製作所	12,200	1,857.00	22,655,400	
北越工業	14,200	1,944.00	27,604,800	
ダイキン工業	168,700	23,165.00	3,907,935,500	
オルガノ	16,900	5,500.00	92,950,000	
トーヨーカネツ	5,400	3,425.00	18,495,000	
栗田工業	79,000	4,916.00	388,364,000	
椿本チエイン	20,000	3,750.00	75,000,000	
大同工業	3,400	717.00	2,437,800	
日機装	32,500	957.00	31,102,500	
木村化工機	10,800	735.00	7,938,000	
レイズネクスト	19,800	1,386.00	27,442,800	
アネスト岩田	21,800	1,100.00	23,980,000	
ダイフク	238,400	2,588.00	616,979,200	
サムコ	3,700	4,295.00	15,891,500	
加藤製作所	3,900	1,137.00	4,434,300	
油研工業	1,200	2,064.00	2,476,800	
タダノ	81,300	1,154.00	93,820,200	
フジテック	33,000	3,503.00	115,599,000	
C K D	39,100	2,113.00	82,618,300	
平和	41,800	2,041.00	85,313,800	

理想科学工業	11,300	2,646.00	29,899,800
SANKYO	34,700	6,387.00	221,628,900
日本金銭機械	17,000	1,080.00	18,360,000
マースグループホールディングス	7,200	2,367.00	17,042,400
フクシマガリレイ	9,200	4,700.00	43,240,000
オーイズミ	2,900	361.00	1,046,900
ダイコク電機	7,000	4,020.00	28,140,000
竹内製作所	25,700	4,340.00	111,538,000
アマノ	40,100	3,126.00	125,352,600
JUKI	21,900	500.00	10,950,000
サンデン	11,800	171.00	2,017,800
ジャノメ	14,300	712.00	10,181,600
ブラザー工業	188,700	2,466.00	465,334,200
マックス	19,900	2,744.00	54,605,600
モリタホールディングス	24,500	1,530.00	37,485,000
グローリー	33,900	2,693.50	91,309,650
新晃工業	14,200	2,620.00	37,204,000
大和冷機工業	21,600	1,370.00	29,592,000
セガサミーホールディングス	126,200	2,176.50	274,674,300
TPR	18,000	1,777.00	31,986,000
ツバキ・ナカシマ	28,400	750.00	21,300,000
ホシザキ	83,400	4,783.00	398,902,200
大豊工業	12,300	853.00	10,491,900
日本精工	261,500	794.50	207,761,750
NTN	306,300	277.70	85,059,510
ジェイテクト	125,700	1,371.00	172,334,700
不二越	10,400	3,860.00	40,144,000
ミネベアミツミ	245,800	2,600.00	639,080,000
日本トムソン	38,400	555.00	21,312,000
THK	81,500	2,895.00	235,942,500
ユーシン精機	11,200	659.00	7,380,800
前澤給装工業	10,800	1,400.00	15,120,000
イーグル工業	15,600	1,592.00	24,835,200
前澤工業	4,500	942.00	4,239,000
日本ピラー工業	13,100	4,220.00	55,282,000
キッツ	47,300	1,108.00	52,408,400
日立製作所	687,100	10,055.00	6,908,790,500
東芝	113,300	4,601.00	521,293,300
三菱電機	1,572,400	1,956.50	3,076,400,600
富士電機	85,900	6,147.00	528,027,300
東洋電機製造	2,500	902.00	2,255,000
安川電機	153,400	5,503.00	844,160,200
シンフォニアテクノロジー	15,600	1,826.00	28,485,600
明電舎	26,200	2,393.00	62,696,600
オリジン	1,800	1,160.00	2,088,000
山洋電気	6,100	5,880.00	35,868,000
デンヨー	10,800	2,226.00	24,040,800
PHCホールディングス	26,400	1,371.00	36,194,400
ソシオネクスト	20,500	13,990.00	286,795,000
ベイカレント・コンサルティング	105,600	4,322.00	456,403,200

Orchestra Holdings	3,100	977.00	3,028,700	
アイモバイル	19,000	477.00	9,063,000	
キャリアインデックス	2,700	248.00	669,600	
MS - Japan	4,600	1,150.00	5,290,000	
船場	1,700	935.00	1,589,500	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	46,600	2,207.00	102,846,200	
フルテック	1,100	1,193.00	1,312,300	
グリーンズ	2,900	1,495.00	4,335,500	
ツナググループ・ホールディングス	2,300	743.00	1,708,900	
GAMEWITH	2,400	326.00	782,400	
MS&Consulting	1,000	667.00	667,000	
ウェルビー	7,200	678.00	4,881,600	
エル・ティール・エス	1,700	3,210.00	5,457,000	
ミダックホールディングス	8,700	1,733.00	15,077,100	
キュービーネットホールディングス	6,900	1,616.00	11,150,400	
RPAホールディングス	19,500	284.00	5,538,000	
三櫻工業	21,400	923.00	19,752,200	
マキタ	161,100	3,691.00	594,620,100	
東芝テック	18,100	3,065.00	55,476,500	
芝浦メカトロニクス	8,000	7,310.00	58,480,000	
マブチモーター	35,100	4,492.00	157,669,200	
ニデック	311,900	5,638.00	1,758,492,200	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,900	434.00	3,862,600	
トレックス・セミコンダクター	7,300	1,954.00	14,264,200	
東光高岳	8,500	2,026.00	17,221,000	
ダブル・スコープ	40,400	866.00	34,986,400	
宮越ホールディングス	6,300	1,122.00	7,068,600	
ダイヘン	14,100	5,380.00	75,858,000	
ヤーマン	24,400	1,032.00	25,180,800	
JVCケンウッド	111,500	636.00	70,914,000	
ミマキエンジニアリング	13,400	753.00	10,090,200	
I - PEX	9,800	1,610.00	15,778,000	
大崎電気工業	31,000	632.00	19,592,000	
オムロン	107,900	5,895.00	636,070,500	
日東工業	19,000	3,435.00	65,265,000	
I D E C	20,900	2,797.00	58,457,300	
正興電機製作所	2,600	1,114.00	2,896,400	
不二電機工業	1,600	1,124.00	1,798,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,300	2,499.00	115,703,700	
サクサホールディングス	1,800	2,304.00	4,147,200	
メルコホールディングス	4,500	3,515.00	15,817,500	
テクノメディカ	3,400	2,429.00	8,258,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,300	828.00	4,388,400	
日本電気	185,500	7,665.00	1,421,857,500	
富士通	130,000	19,455.00	2,529,150,000	
沖電気工業	63,800	945.00	60,291,000	
岩崎通信機	3,700	753.00	2,786,100	

電気興業	6,300	2,416.00	15,220,800
サンケン電気	13,100	7,104.00	93,062,400
ナカヨ	1,200	1,204.00	1,444,800
アイホン	7,700	2,843.00	21,891,100
ルネサスエレクトロニクス	922,000	2,214.00	2,041,308,000
セイコーエプソン	181,300	2,163.50	392,242,550
ワコム	107,400	693.00	74,428,200
アルバック	33,600	6,291.00	211,377,600
アクセル	4,900	1,783.00	8,736,700
E I Z O	10,400	4,850.00	50,440,000
ジャパンディスプレイ	609,100	33.00	20,100,300
日本信号	32,200	954.00	30,718,800
京三製作所	29,600	495.00	14,652,000
能美防災	19,100	1,838.00	35,105,800
ホーチキ	10,600	1,713.00	18,157,800
星和電機	3,400	490.00	1,666,000
エレコム	33,800	1,684.00	56,919,200
パナソニック ホールディングス	1,668,900	1,392.00	2,323,108,800
シャープ	238,200	921.40	219,477,480
アンリツ	99,500	1,203.00	119,698,500
富士通ゼネラル	40,000	2,565.00	102,600,000
ソニーグループ	989,500	12,655.00	12,522,122,500
T D K	223,700	6,330.00	1,416,021,000
帝国通信工業	6,100	1,991.00	12,145,100
タムラ製作所	56,300	555.00	31,246,500
アルプスアルパイン	126,100	1,211.50	152,770,150
池上通信機	2,500	822.00	2,055,000
日本電波工業	16,900	1,165.00	19,688,500
鈴木	7,600	1,167.00	8,869,200
メイコー	14,000	4,290.00	60,060,000
日本トリム	3,200	3,030.00	9,696,000
ローランド ディー . ジー .	7,700	3,445.00	26,526,500
フォスター電機	10,500	895.00	9,397,500
S M K	3,700	2,428.00	8,983,600
ヨコオ	12,500	1,411.00	17,637,500
ティアック	12,600	100.00	1,260,000
ホシデン	32,100	1,712.00	54,955,200
ヒロセ電機	20,900	16,250.00	339,625,000
日本航空電子工業	33,800	2,850.00	96,330,000
T O A	16,100	1,043.00	16,792,300
マクセル	31,200	1,667.00	52,010,400
古野電気	18,400	1,753.00	32,255,200
スミダコーポレーション	18,900	1,124.00	21,243,600
アイコム	5,400	3,165.00	17,091,000
リオン	5,800	2,178.00	12,632,400
横河電機	154,600	2,960.00	457,616,000
新電元工業	5,400	2,925.00	15,795,000
アズビル	97,700	4,896.00	478,339,200
東亜ディーケーケー	3,600	899.00	3,236,400
日本光電工業	60,000	3,696.00	221,760,000

チノー	5,800	2,127.00	12,336,600	
共和電業	7,300	396.00	2,890,800	
日本電子材料	8,600	1,382.00	11,885,200	
堀場製作所	26,700	8,028.00	214,347,600	
アドバンテスト	400,700	4,306.00	1,725,414,200	
小野測器	3,200	434.00	1,388,800	
エスペック	11,200	2,196.00	24,595,200	
キーエンス	139,900	59,490.00	8,322,651,000	
日置電機	6,600	6,480.00	42,768,000	
シスメックス	120,700	7,587.00	915,750,900	
日本マイクロニクス	25,100	2,603.00	65,335,300	
メガチップス	11,000	3,860.00	42,460,000	
OBARA GROUP	7,700	3,595.00	27,681,500	
IMAGICA GROUP	14,000	635.00	8,890,000	
澤藤電機	900	1,239.00	1,115,100	
デンソー	1,154,100	2,339.00	2,699,439,900	
原田工業	3,400	780.00	2,652,000	
コーセル	16,800	1,213.00	20,378,400	
イリソ電子工業	12,900	3,810.00	49,149,000	
オブテックスグループ	25,700	1,701.00	43,715,700	
千代田インテグレ	5,500	2,940.00	16,170,000	
レーザーテック	64,100	29,060.00	1,862,746,000	
スタンレー電気	89,500	2,572.00	230,194,000	
ウシオ電機	71,000	1,889.50	134,154,500	
岡谷電機産業	6,000	282.00	1,692,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	7,800	485.00	3,783,000	
エノモト	2,200	1,515.00	3,333,000	
日本セラミック	11,400	2,764.00	31,509,600	
遠藤照明	3,400	1,153.00	3,920,200	
古河電池	10,300	926.00	9,537,800	
双信電機	3,100	317.00	982,700	
山一電機	12,600	1,766.00	22,251,600	
図研	12,200	3,945.00	48,129,000	
日本電子	35,000	5,539.00	193,865,000	
カシオ計算機	101,100	1,243.50	125,717,850	
ファナック	682,100	3,829.00	2,611,760,900	
日本シイエムケイ	29,700	710.00	21,087,000	
エンプラス	4,100	10,060.00	41,246,000	
大真空	20,800	741.00	15,412,800	
ローム	258,600	2,530.00	654,258,000	
浜松ホトニクス	112,300	5,886.00	660,997,800	
三井ハイテック	12,400	6,803.00	84,357,200	
新光電気工業	49,400	5,275.00	260,585,000	
京セラ	217,300	7,904.00	1,717,539,200	
協栄産業	800	2,328.00	1,862,400	
太陽誘電	68,100	3,854.00	262,457,400	
村田製作所	1,272,600	2,911.00	3,704,538,600	
双葉電子工業	26,700	526.00	14,044,200	
日東電工	90,200	10,400.00	938,080,000	
北陸電気工業	2,900	1,357.00	3,935,300	

東海理化電機製作所	39,500	2,443.00	96,498,500	
ニチコン	36,700	1,406.00	51,600,200	
日本ケミコン	14,900	1,402.00	20,889,800	
K O A	21,200	1,508.00	31,969,600	
三井E & S	66,800	485.00	32,398,000	
日立造船	124,600	846.00	105,411,600	
三菱重工業	247,100	8,208.00	2,028,196,800	
川崎重工業	114,200	3,286.00	375,261,200	
I H I	105,200	2,819.50	296,611,400	
名村造船所	30,400	1,106.00	33,622,400	
サノヤホールディングス	11,500	135.00	1,552,500	
スプリックス	2,300	802.00	1,844,600	
マネジメントソリューションズ	6,100	2,797.00	17,061,700	
プロレド・パートナーズ	3,400	374.00	1,271,600	
and factory	2,400	320.00	768,000	
テノ・ホールディングス	900	485.00	436,500	
フロンティア・マネジメント	3,600	1,650.00	5,940,000	
ピアラ	1,600	397.00	635,200	
コプロ・ホールディングス	2,600	1,214.00	3,156,400	
ギークス	1,000	548.00	548,000	
アンビスホールディングス	15,400	2,848.00	43,859,200	
カーブスホールディングス	39,300	648.00	25,466,400	
フォーラムエンジニアリング	9,800	1,467.00	14,376,600	
FAST FITNESS JAPAN	4,900	1,246.00	6,105,400	
日本車輛製造	4,600	2,079.00	9,563,400	
三菱ロジスネクスト	22,300	1,265.00	28,209,500	
近畿車輛	1,000	1,892.00	1,892,000	
一家ホールディングス	2,100	656.00	1,377,600	
フルサト・マルカホールディングス	13,200	2,803.00	36,999,600	
ヤマエグループホールディングス	8,400	3,570.00	29,988,000	
ジャパクラフトホールディングス	4,800	182.00	873,600	
F P G	46,600	1,483.00	69,107,800	
島根銀行	2,200	525.00	1,155,000	
じもとホールディングス	6,800	500.00	3,400,000	
全国保証	36,000	4,792.00	172,512,000	
めぶきフィナンシャルグループ	683,600	436.60	298,459,760	
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,300	1,623.00	18,339,900	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,700	4,300.00	76,110,000	
九州フィナンシャルグループ	266,600	847.30	225,890,180	
かんぽ生命保険	140,300	2,801.50	393,050,450	
ゆうちょ銀行	1,513,800	1,393.00	2,108,723,400	
あんしん保証	3,400	262.00	890,800	
富山第一銀行	43,700	893.00	39,024,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	739,100	678.70	501,627,170	
ジェイリース	3,600	1,923.00	6,922,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	77,700	1,772.00	137,684,400	

イントラスト	2,900	818.00	2,372,200	
日本モーゲージサービス	4,300	524.00	2,253,200	
CASA	3,000	830.00	2,490,000	
アルヒ	13,200	817.00	10,784,400	
プレミアグループ	23,200	1,652.00	38,326,400	
日産自動車	1,987,100	583.80	1,160,068,980	
いすゞ自動車	406,700	1,865.00	758,495,500	
トヨタ自動車	7,680,800	2,817.00	21,636,813,600	
日野自動車	210,300	467.90	98,399,370	
三菱自動車工業	545,700	494.10	269,630,370	
エフテック	5,400	609.00	3,288,600	
レシップホールディングス	3,400	558.00	1,897,200	
GMB	1,600	1,496.00	2,393,600	
ファルテック	1,500	548.00	822,000	
武蔵精密工業	34,200	1,642.00	56,156,400	
日産車体	16,500	782.00	12,903,000	
新明和工業	40,300	1,202.00	48,440,600	
極東開発工業	23,100	1,907.00	44,051,700	
トビー工業	11,300	2,670.00	30,171,000	
ティラド	3,100	3,105.00	9,625,500	
曙ブレーキ工業	85,500	125.00	10,687,500	
タチエス	25,800	1,679.00	43,318,200	
NOK	54,300	1,934.50	105,043,350	
フタバ産業	37,400	766.00	28,648,400	
カヤバ	13,500	4,345.00	58,657,500	
市光工業	25,100	562.00	14,106,200	
大同メタル工業	27,300	572.00	15,615,600	
プレス工業	55,800	606.00	33,814,800	
ミクニ	9,800	437.00	4,282,600	
太平洋工業	32,100	1,395.00	44,779,500	
河西工業	12,400	245.00	3,038,000	
アイシン	107,900	5,487.00	592,047,300	
マツダ	462,600	1,674.50	774,623,700	
今仙電機製作所	5,000	567.00	2,835,000	
本田技研工業	3,411,100	1,563.50	5,333,254,850	
スズキ	256,900	6,479.00	1,664,455,100	
SUBARU	442,600	2,718.00	1,202,986,800	
安永	3,400	700.00	2,380,000	
ヤマハ発動機	201,500	3,660.00	737,490,000	
小糸製作所	151,400	2,329.50	352,686,300	
TBK	8,500	386.00	3,281,000	
エクセディ	22,900	2,557.00	58,555,300	
ミツバ	26,200	851.00	22,296,200	
豊田合成	40,800	3,094.00	126,235,200	
愛三工業	23,200	1,275.00	29,580,000	
盟和産業	1,100	983.00	1,081,300	
日本プラスト	6,500	604.00	3,926,000	
ヨロズ	13,100	892.00	11,685,200	
エフ・シー・シー	24,700	1,802.00	44,509,400	
新家工業	1,800	2,954.00	5,317,200	

シマノ	56,800	22,225.00	1,262,380,000	
テイ・エス テック	49,800	1,784.00	88,843,200	
三十三フィナンシャルグループ	12,400	1,836.00	22,766,400	
第四北越フィナンシャルグループ	21,600	3,810.00	82,296,000	
ひろぎんホールディングス	196,100	956.40	187,550,040	
マーキュリアホールディングス	3,900	773.00	3,014,700	
おきなわフィナンシャルグループ	11,700	2,475.00	28,957,500	
ダイレクトマーケティングミックス	14,900	462.00	6,883,800	
ポピンズ	2,200	1,459.00	3,209,800	
LITALICO	11,200	2,072.00	23,206,400	
コンフィデンス・インターワークス	500	1,483.00	741,500	
十六フィナンシャルグループ	17,900	3,820.00	68,378,000	
北國フィナンシャルホールディングス	14,500	4,615.00	66,917,500	
ネットプロテクションズホールディングス	45,600	281.00	12,813,600	
プロクレアホールディングス	15,800	1,908.00	30,146,400	
F Pパートナー	2,700	4,055.00	10,948,500	
あいちフィナンシャルグループ	21,200	2,330.00	49,396,000	
ジャムコ	5,900	1,467.00	8,655,300	
小野建	14,600	1,687.00	24,630,200	
はるやまホールディングス	3,900	527.00	2,055,300	
南陽	1,700	2,037.00	3,462,900	
ノジマ	42,900	1,404.00	60,231,600	
佐鳥電機	7,300	1,871.00	13,658,300	
カッパ・クリエイト	23,300	1,646.00	38,351,800	
エコートレーディング	1,600	1,328.00	2,124,800	
伯東	8,500	5,190.00	44,115,000	
コンドーテック	11,300	1,151.00	13,006,300	
中山福	4,700	351.00	1,649,700	
ライトオン	6,200	429.00	2,659,800	
ナガイレーベン	18,700	2,169.00	40,560,300	
三菱食品	13,700	4,435.00	60,759,500	
良品計画	161,500	2,117.50	341,976,250	
パリミキホールディングス	10,300	387.00	3,986,100	
松田産業	11,200	2,422.00	27,126,400	
第一興商	57,200	2,200.50	125,868,600	
メディバルホールディングス	153,300	2,483.50	380,720,550	
アドヴァングループ	14,100	1,033.00	14,565,300	
S P K	6,500	1,797.00	11,680,500	
萩原電気ホールディングス	6,300	4,365.00	27,499,500	
アルピス	4,900	2,574.00	12,612,600	
アズワン	23,200	4,973.00	115,373,600	
スズデン	5,200	2,193.00	11,403,600	
尾家産業	2,000	1,757.00	3,514,000	
シモジマ	10,200	1,185.00	12,087,000	
ドウシシャ	13,700	2,080.00	28,496,000	
小津産業	1,900	1,568.00	2,979,200	
コナカ	8,900	392.00	3,488,800	
高速	8,800	1,997.00	17,573,600	
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,604.00	1,604,000	



G - 7ホールディングス	16,100	1,157.00	18,627,700
たけびし	5,700	1,829.00	10,425,300
イオン北海道	43,700	888.00	38,805,600
コジマ	24,500	650.00	15,925,000
ヒマラヤ	2,600	914.00	2,376,400
コーナン商事	18,200	3,700.00	67,340,000
ネットワンシステムズ	56,600	2,055.50	116,341,300
エコス	5,500	2,180.00	11,990,000
ワタミ	15,700	1,111.00	17,442,700
マルシェ	2,900	272.00	788,800
リックス	2,600	3,405.00	8,853,000
システムソフト	49,000	67.00	3,283,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	298,800	3,221.00	962,434,800
丸文	13,200	1,294.00	17,080,800
西松屋チェーン	29,100	1,855.00	53,980,500
ゼンショーホールディングス	72,900	8,889.00	648,008,100
ハビネット	12,600	2,357.00	29,698,200
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,111.00	12,221,000
ハークスレイ	2,900	724.00	2,099,600
橋本総業ホールディングス	5,800	1,173.00	6,803,400
日本ライフライン	43,300	1,107.00	47,933,100
サイゼリヤ	21,900	5,570.00	121,983,000
タカショー	13,000	589.00	7,657,000
V Tホールディングス	56,200	511.00	28,718,200
アルゴグラフィックス	12,900	3,395.00	43,795,500
魚力	5,200	2,201.00	11,445,200
I D O M	39,200	870.00	34,104,000
日本エム・ディ・エム	11,100	675.00	7,492,500
ポブラ	2,200	193.00	424,600
フジ・コーポレーション	7,300	1,744.00	12,731,200
ユナイテッドアローズ	17,300	1,775.00	30,707,500
進和	9,000	2,376.00	21,384,000
エスケイジャパン	2,100	778.00	1,633,800
ダイトロン	5,800	2,871.00	16,651,800
ハイデイ日高	21,900	2,750.00	60,225,000
シークス	21,100	1,452.00	30,637,200
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	4,500	155.00	697,500
コロワイド	63,700	2,375.00	151,287,500
田中商事	2,400	683.00	1,639,200
オーハシテクニカ	7,900	1,774.00	14,014,600
壱番屋	11,700	5,380.00	62,946,000
白銅	4,300	2,233.00	9,601,900
トップカルチャー	2,400	173.00	415,200
P L A N T	1,900	1,326.00	2,519,400
スギホールディングス	29,800	6,193.00	184,551,400
ダイコー通産	800	1,123.00	898,400
薬王堂ホールディングス	7,300	2,713.00	19,804,900
島津製作所	185,800	3,757.00	698,050,600

JMS	13,000	508.00	6,604,000
クボテック	2,200	263.00	578,600
長野計器	10,200	2,114.00	21,562,800
ブイ・テクノロジー	7,400	2,167.00	16,035,800
スター精密	26,300	1,779.00	46,787,700
東京計器	10,700	1,630.00	17,441,000
愛知時計電機	6,000	2,296.00	13,776,000
インターアクション	6,600	1,017.00	6,712,200
オーバル	6,900	471.00	3,249,900
東京精密	28,600	8,280.00	236,808,000
マニー	56,000	2,041.00	114,296,000
ニコン	202,200	1,398.00	282,675,600
トプコン	68,000	1,500.50	102,034,000
オリンパス	861,000	2,078.00	1,789,158,000
理研計器	9,900	5,970.00	59,103,000
SCREENホールディングス	47,800	9,341.00	446,499,800
キヤノン電子	15,500	1,930.00	29,915,000
タムロン	8,600	4,125.00	35,475,000
HOYA	277,900	15,410.00	4,282,439,000
シード	3,900	719.00	2,804,100
ノーリツ鋼機	13,300	3,120.00	41,496,000
A&Dホロンホールディングス	20,400	1,700.00	34,680,000
朝日インテック	156,300	2,642.00	412,944,600
キヤノン	697,700	3,729.00	2,601,723,300
リコー	350,700	1,216.50	426,626,550
シチズン時計	128,700	894.00	115,057,800
リズム	1,800	2,683.00	4,829,400
大研医器	6,600	528.00	3,484,800
メニコン	48,100	1,845.00	88,744,500
シンシア	900	549.00	494,100
KYORITSU	11,500	173.00	1,989,500
中本パックス	2,600	1,625.00	4,225,000
スノーピーク	19,900	1,004.00	19,979,600
パラマウントベッドホールディングス	29,100	2,636.00	76,707,600
トランザクション	9,200	2,124.00	19,540,800
粧美堂	2,100	491.00	1,031,100
ニホンフラッシュ	13,100	876.00	11,475,600
前田工織	11,800	2,946.00	34,762,800
永大産業	9,000	216.00	1,944,000
アートネイチャー	12,700	782.00	9,931,400
バンダイナムコホールディングス	383,200	3,026.00	1,159,563,200
アイフィスジャパン	2,200	615.00	1,353,000
SHOEI	31,700	2,088.00	66,189,600
フランスベッドホールディングス	18,100	1,260.00	22,806,000
マーベラス	22,700	690.00	15,663,000
パイロットコーポレーション	19,700	4,520.00	89,044,000
萩原工業	9,300	1,575.00	14,647,500
エイベックス	23,900	1,291.00	30,854,900
フジシールインターナショナル	28,400	1,656.00	47,030,400
タカラトミー	63,700	2,086.00	132,878,200

広済堂ホールディングス	6,300	3,245.00	20,443,500
エステールホールディングス	2,000	624.00	1,248,000
レック	18,000	929.00	16,722,000
タカノ	2,900	806.00	2,337,400
三光合成	17,700	537.00	9,504,900
プロネクサス	14,500	1,158.00	16,791,000
ホクシン	6,000	119.00	714,000
ウッドワン	2,800	997.00	2,791,600
きもと	13,000	189.00	2,457,000
TOPPANホールディングス	171,900	3,349.00	575,693,100
大日本印刷	152,900	4,023.00	615,116,700
共同印刷	3,900	3,545.00	13,825,500
NISSHA	24,000	1,502.00	36,048,000
光村印刷	600	1,259.00	755,400
藤森工業	11,100	3,875.00	43,012,500
ヴィア・ホールディングス	12,300	187.00	2,300,100
TAKARA & COMPANY	8,900	2,345.00	20,870,500
前澤化成工業	9,000	1,551.00	13,959,000
未来工業	5,000	3,335.00	16,675,000
アシックス	119,100	4,917.00	585,614,700
ツツミ	2,400	2,153.00	5,167,200
ウェブロックホールディングス	2,900	626.00	1,815,400
JSP	9,900	1,772.00	17,542,800
ニチハ	17,600	2,780.00	48,928,000
ローランド	10,300	4,660.00	47,998,000
エフピコ	26,600	2,855.50	75,956,300
小松ウオール工業	5,700	2,873.00	16,376,100
ヤマハ	88,200	3,499.00	308,611,800
河合楽器製作所	4,300	3,400.00	14,620,000
クリナップ	13,700	675.00	9,247,500
ピジョン	89,100	1,623.50	144,653,850
天馬	10,200	2,451.00	25,000,200
キングジム	12,400	863.00	10,701,200
象印マホービン	38,000	1,536.00	58,368,000
リンテック	28,000	2,474.00	69,272,000
信越ポリマー	30,200	1,368.00	41,313,600
東リ	19,200	344.00	6,604,800
イトーキ	28,700	1,358.00	38,974,600
任天堂	883,100	7,014.00	6,194,063,400
三菱鉛筆	19,800	1,830.00	36,234,000
松風	6,300	2,520.00	15,876,000
タカラスタンダード	29,400	1,772.00	52,096,800
コクヨ	57,200	2,410.00	137,852,000
ナカバヤシ	15,100	517.00	7,806,700
ニフコ	42,000	3,849.00	161,658,000
立川ブラインド工業	6,500	1,440.00	9,360,000
グロープライド	12,600	1,937.00	24,406,200
オカムラ	42,200	2,150.00	90,730,000
バルカー	11,700	3,780.00	44,226,000
MUTOHホールディングス	1,000	2,006.00	2,006,000

伊藤忠商事	994,900	5,900.00	5,869,910,000
丸紅	1,233,900	2,357.00	2,908,302,300
スクロール	22,000	904.00	19,888,000
高島	5,600	977.00	5,471,200
ヨンドシーホールディングス	14,000	1,919.00	26,866,000
三陽商会	4,600	2,595.00	11,937,000
長瀬産業	67,800	2,295.50	155,634,900
ナイガイ	2,600	270.00	702,000
蝶理	9,200	2,839.00	26,118,800
豊田通商	129,600	8,591.00	1,113,393,600
オンワードホールディングス	82,600	484.00	39,978,400
三共生興	20,600	780.00	16,068,000
兼松	61,900	2,013.00	124,604,700
美津濃	13,900	4,055.00	56,364,500
ツカモトコーポレーション	1,100	1,164.00	1,280,400
ルックホールディングス	3,400	2,157.00	7,333,800
三井物産	1,115,100	5,625.00	6,272,437,500
日本紙パルプ商事	7,100	4,650.00	33,015,000
東京エレクトロン	296,000	22,575.00	6,682,200,000
カメイ	15,700	1,553.00	24,382,100
東都水産	400	7,080.00	2,832,000
OUGホールディングス	1,200	2,384.00	2,860,800
スターゼン	10,200	2,485.00	25,347,000
セイコーグループ	19,500	2,296.00	44,772,000
山善	44,900	1,209.00	54,284,100
椿本興業	3,000	5,420.00	16,260,000
住友商事	895,700	3,223.00	2,886,841,100
B I P R O G Y	45,900	4,009.00	184,013,100
内田洋行	6,000	6,840.00	41,040,000
三菱商事	977,500	7,148.00	6,987,170,000
第一実業	13,900	1,928.00	26,799,200
キヤノンマーケティングジャパン	34,300	3,753.00	128,727,900
西華産業	5,800	2,470.00	14,326,000
佐藤商事	10,400	1,492.00	15,516,800
菱洋エレクトロ	14,000	3,505.00	49,070,000
東京産業	13,500	823.00	11,110,500
ユアサ商事	11,500	4,180.00	48,070,000
神鋼商事	3,700	5,610.00	20,757,000
トルク	4,500	263.00	1,183,500
阪和興業	26,600	4,320.00	114,912,000
正栄食品工業	9,900	4,385.00	43,411,500
カナデン	11,100	1,463.00	16,239,300
R Y O D E N	11,900	2,472.00	29,416,800
ニプロ	116,500	1,094.00	127,451,000
岩谷産業	33,700	7,021.00	236,607,700
ナイス	2,600	1,458.00	3,790,800
ニチモウ	1,200	3,930.00	4,716,000
極東貿易	8,800	1,782.00	15,681,600
アステナホールディングス	27,800	515.00	14,317,000
三愛オブリ	35,500	1,560.00	55,380,000

稲畑産業	29,300	3,200.00	93,760,000
G S I クレオス	7,900	2,002.00	15,815,800
明和産業	17,600	651.00	11,457,600
クワザワホールディングス	3,000	519.00	1,557,000
キムラタン	50,500	19.00	959,500
ゴールドウイン	24,800	10,970.00	272,056,000
ユニ・チャーム	292,300	4,831.00	1,412,101,300
デサント	24,100	4,400.00	106,040,000
キング	2,900	696.00	2,018,400
ワキタ	24,500	1,483.00	36,333,500
ヤマトインターナショナル	6,100	294.00	1,793,400
東邦ホールディングス	40,900	3,510.00	143,559,000
サンゲツ	34,100	2,725.00	92,922,500
ミツウロコグループホールディングス	18,900	1,298.00	24,532,200
シナネンホールディングス	4,100	4,020.00	16,482,000
伊藤忠エネクス	36,700	1,546.00	56,738,200
サンリオ	42,000	7,042.00	295,764,000
サンワテクノス	7,600	2,150.00	16,340,000
リョーサン	10,500	4,630.00	48,615,000
新光商事	19,900	1,129.00	22,467,100
トーヨー	5,700	3,155.00	17,983,500
三信電気	5,900	2,226.00	13,133,400
東陽テクニカ	15,100	1,339.00	20,218,900
モスフードサービス	21,800	3,265.00	71,177,000
加賀電子	13,500	6,040.00	81,540,000
三益半導体工業	11,100	2,634.00	29,237,400
都築電気	7,400	2,114.00	15,643,600
ソーダニッカ	10,900	975.00	10,627,500
立花エレテック	9,900	2,696.00	26,690,400
木曽路	22,400	2,590.00	58,016,000
S R S ホールディングス	24,400	1,050.00	25,620,000
千趣会	27,200	411.00	11,179,200
タカキュー	5,700	78.00	444,600
リテールパートナーズ	21,900	1,765.00	38,653,500
ケーヨー	22,200	1,296.00	28,771,200
上新電機	14,600	2,247.00	32,806,200
日本瓦斯	78,400	2,368.00	185,651,200
ロイヤルホールディングス	26,100	2,561.00	66,842,100
東天紅	600	800.00	480,000
いなげや	13,900	1,601.00	22,253,900
チヨダ	14,200	810.00	11,502,000
ライフコーポレーション	15,500	3,430.00	53,165,000
リンガーハット	19,100	2,330.00	44,503,000
M r M a x H D	18,700	616.00	11,519,200
テンアライド	10,700	301.00	3,220,700
A O K I ホールディングス	31,700	1,062.00	33,665,400
オークワ	21,300	834.00	17,764,200
コメリ	22,700	3,110.00	70,597,000
青山商事	31,700	1,397.00	44,284,900
しまむら	17,300	14,930.00	258,289,000

はせがわ	3,900	352.00	1,372,800
高島屋	102,300	2,055.00	210,226,500
松屋	25,100	892.00	22,389,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	65,400	1,645.00	107,583,000
近鉄百貨店	6,300	2,635.00	16,600,500
丸井グループ	98,300	2,424.00	238,279,200
クレディセゾン	87,300	2,475.00	216,067,500
アクシアル リテイリング	10,100	3,925.00	39,642,500
井筒屋	3,900	351.00	1,368,900
イオン	501,700	3,132.00	1,571,324,400
イズミ	26,300	3,703.00	97,388,900
フォーバル	5,800	1,181.00	6,849,800
平和堂	24,700	2,300.00	56,810,000
フジ	22,700	1,900.00	43,130,000
ヤオコー	16,700	7,770.00	129,759,000
ゼビオホールディングス	20,000	924.00	18,480,000
ケーズホールディングス	104,600	1,292.00	135,143,200
PALTAC	19,900	4,839.00	96,296,100
三谷産業	26,000	334.00	8,684,000
Olympicグループ	3,500	507.00	1,774,500
日産東京販売ホールディングス	12,300	437.00	5,375,100
あおぞら銀行	99,000	3,060.00	302,940,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,627,900	1,253.00	10,810,758,700
りそなホールディングス	1,606,500	781.40	1,255,319,100
三井住友トラスト・ホールディングス	247,500	5,478.00	1,355,805,000
三井住友フィナンシャルグループ	979,500	7,068.00	6,923,106,000
千葉銀行	383,900	1,087.50	417,491,250
群馬銀行	267,300	692.40	185,078,520
武蔵野銀行	19,200	2,696.00	51,763,200
千葉興業銀行	22,700	889.00	20,180,300
筑波銀行	60,300	266.00	16,039,800
七十七銀行	40,100	3,620.00	145,162,000
秋田銀行	9,200	2,019.00	18,574,800
山形銀行	15,300	1,141.00	17,457,300
岩手銀行	8,700	2,582.00	22,463,400
東邦銀行	109,100	290.00	31,639,000
東北銀行	3,700	1,182.00	4,373,400
ふくおかフィナンシャルグループ	120,000	3,720.00	446,400,000
スルガ銀行	121,400	678.00	82,309,200
八十二銀行	295,600	800.00	236,480,000
山梨中央銀行	15,400	1,885.00	29,029,000
大垣共立銀行	26,300	1,882.00	49,496,600
福井銀行	12,400	1,564.00	19,393,600
清水銀行	5,500	1,562.00	8,591,000
富山銀行	1,400	1,726.00	2,416,400
滋賀銀行	23,000	3,910.00	89,930,000
南都銀行	20,800	2,541.00	52,852,800
百五銀行	129,500	539.00	69,800,500
紀陽銀行	49,300	1,527.00	75,281,100
ほくほくフィナンシャルグループ	85,300	1,659.50	141,555,350

山陰合同銀行	86,200	966.00	83,269,200
鳥取銀行	2,700	1,330.00	3,591,000
百十四銀行	13,500	2,699.00	36,436,500
四国銀行	20,200	1,017.00	20,543,400
阿波銀行	19,300	2,429.00	46,879,700
大分銀行	8,300	2,691.00	22,335,300
宮崎銀行	8,300	2,798.00	23,223,400
佐賀銀行	8,100	1,967.00	15,932,700
琉球銀行	29,300	1,153.00	33,782,900
セブン銀行	431,800	295.40	127,553,720
みずほフィナンシャルグループ	1,859,600	2,479.00	4,609,948,400
高知銀行	2,600	981.00	2,550,600
山口フィナンシャルグループ	135,000	1,313.00	177,255,000
芙蓉総合リース	12,700	11,960.00	151,892,000
みずほリース	23,100	5,030.00	116,193,000
東京センチュリー	25,800	5,727.00	147,756,600
SBIホールディングス	201,600	3,238.00	652,780,800
日本証券金融	50,600	1,546.00	78,227,600
アイフル	202,800	379.00	76,861,200
日本アジア投資	5,600	230.00	1,288,000
名古屋銀行	8,900	5,840.00	51,976,000
北洋銀行	208,700	378.00	78,888,600
大光銀行	2,500	1,350.00	3,375,000
愛媛銀行	18,600	1,066.00	19,827,600
トマト銀行	2,800	1,144.00	3,203,200
京葉銀行	57,800	689.00	39,824,200
栃木銀行	68,900	337.00	23,219,300
北日本銀行	4,500	2,183.00	9,823,500
東和銀行	25,200	621.00	15,649,200
福島銀行	8,100	259.00	2,097,900
大東銀行	3,300	788.00	2,600,400
リコーリース	13,100	4,530.00	59,343,000
イオンフィナンシャルサービス	79,000	1,254.00	99,066,000
アコム	246,000	342.30	84,205,800
ジャックス	14,600	5,210.00	76,066,000
オリエントコーポレーション	44,900	1,050.00	47,145,000
オリックス	839,700	2,670.00	2,241,999,000
三菱HCキャピタル	613,800	948.50	582,189,300
ジャフコグループ	41,000	1,623.00	66,543,000
九州リースサービス	3,000	920.00	2,760,000
トモニホールディングス	111,400	485.00	54,029,000
大和証券グループ本社	1,067,200	958.10	1,022,484,320
野村ホールディングス	2,316,900	604.00	1,399,407,600
岡三証券グループ	121,000	707.00	85,547,000
丸三証券	45,800	864.00	39,571,200
東洋証券	36,600	302.00	11,053,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	163,500	540.00	88,290,000
光世証券	1,800	540.00	972,000
水戸証券	40,700	440.00	17,908,000

いちよし証券	25,900	710.00	18,389,000
松井証券	67,800	751.00	50,917,800
S O M P Oホールディングス	218,200	6,506.00	1,419,609,200
日本取引所グループ	359,400	3,139.00	1,128,156,600
マネックスグループ	134,900	646.00	87,145,400
極東証券	18,900	1,077.00	20,355,300
岩井コスモホールディングス	15,700	1,752.00	27,506,400
アイザワ証券グループ	19,900	1,151.00	22,904,900
フィデアホールディングス	14,200	1,510.00	21,442,000
池田泉州ホールディングス	190,800	361.00	68,878,800
アニコム ホールディングス	46,700	575.00	26,852,500
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	308,500	5,666.00	1,747,961,000
マネーパートナーズグループ	8,000	285.00	2,280,000
スパークス・グループ	15,400	1,448.00	22,299,200
小林洋行	2,900	233.00	675,700
第一生命ホールディングス	673,200	3,077.00	2,071,436,400
東京海上ホールディングス	1,361,800	3,488.00	4,749,958,400
アドバンテッジリスクマネジメント	4,100	457.00	1,873,700
イー・ギャランティ	22,400	1,808.00	40,499,200
アサックス	3,400	664.00	2,257,600
N E Cキャピタルソリューション	6,800	3,265.00	22,202,000
T & Dホールディングス	400,500	2,618.00	1,048,509,000
アドバンスクリエイト	8,000	947.00	7,576,000
三井不動産	637,100	3,323.00	2,117,083,300
三菱地所	900,600	1,990.00	1,792,194,000
平和不動産	22,300	3,895.00	86,858,500
東京建物	120,400	2,050.00	246,820,000
京阪神ビルディング	25,800	1,315.00	33,927,000
住友不動産	199,200	4,135.00	823,692,000
太平洋興発	3,000	776.00	2,328,000
テーオーシー	24,600	608.00	14,956,800
東京楽天地	2,200	4,150.00	9,130,000
レオパレス21	137,800	395.00	54,431,000
スターツコーポレーション	19,700	2,772.00	54,608,400
フジ住宅	17,300	694.00	12,006,200
空港施設	19,400	560.00	10,864,000
明和地所	6,900	1,155.00	7,969,500
ゴールドクレスト	11,200	2,040.00	22,848,000
リログループ	72,100	1,538.00	110,889,800
エスリード	6,400	3,065.00	19,616,000
日神グループホールディングス	22,200	493.00	10,944,600
日本エスコン	25,800	893.00	23,039,400
M I R A R T Hホールディングス	63,300	442.00	27,978,600
A V A N T I A	4,300	833.00	3,581,900
イオンモール	71,400	1,741.00	124,307,400
毎日コムネット	2,900	705.00	2,044,500
ファースト住建	3,100	1,086.00	3,366,600
ランド	753,800	8.00	6,030,400
カチタス	37,100	2,137.00	79,282,700



東祥	10,100	798.00	8,059,800
トーセイ	23,000	1,907.00	43,861,000
穴吹興産	1,600	1,977.00	3,163,200
サンフロンティア不動産	20,400	1,547.00	31,558,800
FJネクストホールディングス	14,500	1,184.00	17,168,000
インテリックス	2,000	505.00	1,010,000
ランドビジネス	2,900	330.00	957,000
サンネクスタグループ	2,300	942.00	2,166,600
グランディハウス	9,000	620.00	5,580,000
東武鉄道	153,600	3,802.00	583,987,200
相鉄ホールディングス	50,100	2,664.00	133,466,400
東急	392,200	1,763.00	691,448,600
京浜急行電鉄	173,000	1,339.00	231,647,000
小田急電鉄	231,300	2,248.50	520,078,050
京王電鉄	67,200	4,383.00	294,537,600
京成電鉄	90,200	6,178.00	557,255,600
富士急行	17,200	4,270.00	73,444,000
東日本旅客鉄道	257,000	7,849.00	2,017,193,000
西日本旅客鉄道	165,900	5,876.00	974,828,400
東海旅客鉄道	538,800	3,461.00	1,864,786,800
西武ホールディングス	169,200	1,509.50	255,407,400
鴻池運輸	23,800	1,868.00	44,458,400
西日本鉄道	37,400	2,386.00	89,236,400
ハマキョウレックス	11,900	3,870.00	46,053,000
サカイ引越センター	15,500	2,523.00	39,106,500
近鉄グループホールディングス	139,600	4,172.00	582,411,200
阪急阪神ホールディングス	186,200	4,623.00	860,802,600
南海電気鉄道	62,200	2,917.50	181,468,500
京阪ホールディングス	77,000	3,794.00	292,138,000
神戸電鉄	3,800	2,849.00	10,826,200
名古屋鉄道	144,100	2,070.00	298,287,000
山陽電気鉄道	10,500	2,119.00	22,249,500
アルプス物流	11,100	1,599.00	17,748,900
トランコム	4,100	7,430.00	30,463,000
ヤマトホールディングス	178,900	2,572.50	460,220,250
山九	35,500	4,826.00	171,323,000
日新	10,600	2,500.00	26,500,000
丸運	4,400	247.00	1,086,800
丸全昭和運輸	8,600	3,815.00	32,809,000
センコーグループホールディングス	73,900	1,020.00	75,378,000
トナミホールディングス	3,100	4,410.00	13,671,000
ニッコンホールディングス	44,700	3,150.00	140,805,000
日本石油輸送	700	2,889.00	2,022,300
福山通運	15,900	3,420.00	54,378,000
セイノーホールディングス	78,500	2,031.50	159,472,750
エスライングループ本社	2,200	878.00	1,931,600
神奈川中央交通	3,900	3,085.00	12,031,500
AZ-COM丸和ホールディングス	33,800	2,010.00	67,938,000
C&Fロジホールディングス	13,500	1,401.00	18,913,500
日本郵船	400,300	3,677.00	1,471,903,100

商船三井	303,100	3,809.00	1,154,507,900	
川崎汽船	118,000	4,703.00	554,954,000	
NSユニテッド海運	7,500	4,465.00	33,487,500	
明海グループ	8,500	642.00	5,457,000	
飯野海運	51,300	1,132.00	58,071,600	
共栄タンカー	1,400	818.00	1,145,200	
九州旅客鉄道	98,700	3,048.00	300,837,600	
SGホールディングス	234,500	2,051.50	481,076,750	
NIPPON EXPRESSホールディングス	47,400	7,603.00	360,382,200	
ID&Eホールディングス	8,600	3,330.00	28,638,000	
日本航空	343,000	2,832.00	971,376,000	
ANAホールディングス	380,000	3,055.00	1,160,900,000	
ビーウィズ	3,600	2,080.00	7,488,000	
パスコ	1,500	1,575.00	2,362,500	
TREホールディングス	27,500	1,175.00	32,312,500	
人・夢・技術グループ	5,400	1,771.00	9,563,400	
西本Wismettacホールディングス	3,700	5,940.00	21,978,000	
シルバーライフ	2,800	1,043.00	2,920,400	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	2,020.00	1,212,000	
Genky DrugStores	6,400	5,170.00	33,088,000	
コア商事ホールディングス	8,300	771.00	6,399,300	
KPPグループホールディングス	38,300	628.00	24,052,400	
ナルミヤ・インターナショナル	1,400	1,020.00	1,428,000	
ブックオフグループホールディングス	7,500	1,040.00	7,800,000	
ギフトホールディングス	6,200	2,143.00	13,286,600	
三菱倉庫	34,300	4,376.00	150,096,800	
三井倉庫ホールディングス	13,100	4,620.00	60,522,000	
住友倉庫	37,600	2,383.00	89,600,800	
滋澤倉庫	6,300	2,742.00	17,274,600	
ヤマタネ	6,500	2,261.00	14,696,500	
東陽倉庫	2,100	1,484.00	3,116,400	
乾汽船	16,300	1,145.00	18,663,500	
日本トランスシティ	28,100	643.00	18,068,300	
ケイヒン	1,400	1,763.00	2,468,200	
中央倉庫	7,500	1,065.00	7,987,500	
川西倉庫	1,500	1,071.00	1,606,500	
安田倉庫	9,600	1,080.00	10,368,000	
ファイズホールディングス	1,100	996.00	1,095,600	
NISSOホールディングス	12,500	774.00	9,675,000	
大栄環境	26,200	2,289.00	59,971,800	
日本管財ホールディングス	15,100	2,499.00	37,734,900	
東洋埠頭	2,200	1,369.00	3,011,800	
上組	67,000	3,226.00	216,142,000	
サンリツ	1,900	725.00	1,377,500	
キムラユニティー	3,700	1,343.00	4,969,100	
キューソー流通システム	5,600	921.00	5,157,600	
東海運	4,700	283.00	1,330,100	
エーアイティー	8,700	1,624.00	14,128,800	

内外トランスライン	5,600	2,443.00	13,680,800
ショーエイコーポレーション	2,600	582.00	1,513,200
日本コンセプト	5,100	1,759.00	8,970,900
TBSホールディングス	71,800	2,481.50	178,171,700
日本テレビホールディングス	124,200	1,455.00	180,711,000
朝日放送グループホールディングス	13,100	630.00	8,253,000
テレビ朝日ホールディングス	34,100	1,601.00	54,594,100
スカパーJSATホールディングス	109,000	679.00	74,011,000
テレビ東京ホールディングス	10,100	2,688.00	27,148,800
日本BS放送	2,800	881.00	2,466,800
ビジョン	21,200	1,270.00	26,924,000
スマートバリュー	1,900	365.00	693,500
USEN-NEXT HOLDINGS	15,700	3,505.00	55,028,500
ワイヤレスゲート	3,500	179.00	626,500
日本通信	138,000	215.00	29,670,000
クロップス	1,000	991.00	991,000
日本電信電話	41,729,400	174.10	7,265,088,540
KDDI	1,084,100	4,640.00	5,030,224,000
ソフトバンク	2,256,900	1,763.00	3,978,914,700
光通信	14,100	21,435.00	302,233,500
エムティーアイ	9,700	576.00	5,587,200
GMOインターネットグループ	51,800	2,307.00	119,502,600
ファイバーゲート	7,600	1,115.00	8,474,000
アйдママーケティングコミュニケーション	2,200	230.00	506,000
KADOKAWA	74,200	2,697.50	200,154,500
学研ホールディングス	23,300	925.00	21,552,500
ゼンリン	23,900	883.00	21,103,700
昭文社ホールディングス	3,400	360.00	1,224,000
インプレスホールディングス	7,900	179.00	1,414,100
東京電力ホールディングス	1,260,900	662.30	835,094,070
中部電力	515,500	1,825.50	941,045,250
関西電力	540,100	1,932.50	1,043,743,250
中国電力	243,100	996.40	242,224,840
北陸電力	143,000	772.90	110,524,700
東北電力	368,200	945.50	348,133,100
四国電力	130,300	1,051.00	136,945,300
九州電力	322,400	1,010.50	325,785,200
北海道電力	135,100	637.40	86,112,740
沖縄電力	35,700	1,071.00	38,234,700
電源開発	114,900	2,311.00	265,533,900
エフオン	9,000	463.00	4,167,000
イーレックス	24,900	633.00	15,761,700
レノバ	37,300	1,059.00	39,500,700
東京瓦斯	295,700	3,314.00	979,949,800
大阪瓦斯	283,400	2,866.00	812,224,400
東邦瓦斯	60,600	2,762.00	167,377,200
北海道瓦斯	8,300	2,350.00	19,505,000
広島ガス	29,600	377.00	11,159,200

西部ガスホールディングス	14,500	1,898.00	27,521,000
静岡ガス	27,900	998.00	27,844,200
メタウォーター	16,700	2,000.00	33,400,000
M & A 総研ホールディングス	6,900	3,670.00	25,323,000
アイネット	8,500	1,820.00	15,470,000
松竹	7,300	9,844.00	71,861,200
東宝	78,000	5,082.00	396,396,000
エイチ・アイ・エス	41,800	1,754.00	73,317,200
東映	4,700	18,140.00	85,258,000
ラックランド	6,500	2,700.00	17,550,000
NTTデータグループ	366,800	1,821.50	668,126,200
共立メンテナンス	22,500	6,025.00	135,562,500
イチネンホールディングス	15,200	1,492.00	22,678,400
建設技術研究所	7,400	4,785.00	35,409,000
スペース	9,300	901.00	8,379,300
アインホールディングス	20,400	4,183.00	85,333,200
燦ホールディングス	13,500	1,074.00	14,499,000
ピー・シー・エー	8,100	1,121.00	9,080,100
スバル興業	600	13,860.00	8,316,000
東京テアトル	3,000	1,068.00	3,204,000
タナベコンサルティンググループ	4,400	997.00	4,386,800
ビジネスブレイン太田昭和	5,500	2,091.00	11,500,500
ナガワ	4,500	6,400.00	28,800,000
東京都競馬	12,000	4,100.00	49,200,000
常磐興産	3,000	1,225.00	3,675,000
カナモト	22,200	2,516.00	55,855,200
D T S	29,900	3,240.00	96,876,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	64,100	5,386.00	345,242,600
シーイーシー	17,800	1,641.00	29,209,800
カブコン	125,500	5,038.00	632,269,000
ニシオホールディングス	13,400	3,400.00	45,560,000
アイ・エス・ピー	7,200	1,430.00	10,296,000
アゴーラ ホスピタリティグループ	51,800	23.00	1,191,400
日本空港ビルデング	48,700	6,644.00	323,562,800
トランス・コスモス	17,900	3,125.00	55,937,500
乃村工藝社	62,700	859.00	53,859,300
ジャステック	8,600	1,520.00	13,072,000
S C S K	98,200	2,703.00	265,434,600
藤田観光	5,700	3,930.00	22,401,000
K N T - C Tホールディングス	8,600	1,252.00	10,767,200
トーカイ	12,800	1,877.00	24,025,600
白洋舎	1,200	2,457.00	2,948,400
セコム	146,500	10,795.00	1,581,467,500
N S W	6,200	2,824.00	17,508,800
セントラル警備保障	7,800	2,549.00	19,882,200
アイネス	10,900	1,565.00	17,058,500
丹青社	27,800	868.00	24,130,400
メイテックグループホールディングス	51,700	2,810.00	145,277,000

TKC	22,200	3,540.00	78,588,000
富士ソフト	28,300	5,390.00	152,537,000
応用地質	13,400	2,132.00	28,568,800
船井総研ホールディングス	29,900	2,482.00	74,211,800
NSD	50,100	2,598.00	130,159,800
進学会ホールディングス	2,200	279.00	613,800
丸紅建材リース	600	2,496.00	1,497,600
オオバ	5,000	930.00	4,650,000
コナミグループ	52,600	7,982.00	419,853,200
いであ	2,200	1,631.00	3,588,200
学究社	5,700	1,912.00	10,898,400
ベネッセホールディングス	48,300	2,348.00	113,408,400
イオンディライト	15,900	3,350.00	53,265,000
ナック	6,100	977.00	5,959,700
福井コンピュータホールディングス	8,600	2,582.00	22,205,200
ダイセキ	29,400	4,085.00	120,099,000
ステップ	5,300	1,858.00	9,847,400
泉州電業	7,400	3,215.00	23,791,000
元気寿司	8,300	3,455.00	28,676,500
トラスコ中山	31,100	2,318.00	72,089,800
ヤマダホールディングス	455,200	426.20	194,006,240
オートバックスセブン	51,500	1,512.00	77,868,000
モリト	10,600	1,327.00	14,066,200
アークランズ	44,000	1,581.00	69,564,000
ニトリホールディングス	53,900	14,875.00	801,762,500
グルメ杵屋	11,900	1,081.00	12,863,900
愛眼	6,100	172.00	1,049,200
ケーユーホールディングス	7,000	1,130.00	7,910,000
吉野家ホールディングス	54,500	3,387.00	184,591,500
加藤産業	18,300	4,560.00	83,448,000
北恵	2,100	998.00	2,095,800
イノテック	9,300	1,647.00	15,317,100
イエローハット	23,500	1,723.00	40,490,500
松屋フーズホールディングス	7,000	4,815.00	33,705,000
JBCホールディングス	9,200	3,120.00	28,704,000
JKホールディングス	11,400	954.00	10,875,600
サガミホールディングス	22,200	1,337.00	29,681,400
日伝	10,000	2,549.00	25,490,000
関西フードマーケット	10,100	1,393.00	14,069,300
ミロク情報サービス	12,800	1,515.00	19,392,000
北沢産業	5,000	278.00	1,390,000
杉本商事	7,200	2,179.00	15,688,800
因幡電機産業	38,300	3,210.00	122,943,000
王将フードサービス	11,000	8,000.00	88,000,000
ミニストップ	10,800	1,520.00	16,416,000
アークス	27,100	2,764.00	74,904,400
バローホールディングス	28,300	2,319.00	65,627,700
東テック	5,000	4,940.00	24,700,000
ミスミグループ本社	223,400	2,409.00	538,170,600
アルテック	4,400	235.00	1,034,000

ベルク	7,400	6,590.00	48,766,000	
大 庄	6,200	1,264.00	7,836,800	
タキヒヨー	2,000	991.00	1,982,000	
ファーストリテイリング	66,600	35,490.00	2,363,634,000	
ソフトバンクグループ	692,000	5,762.00	3,987,304,000	
蔵王産業	1,500	2,429.00	3,643,500	
スズケン	56,300	4,855.00	273,336,500	
サンドラッグ	50,000	4,057.00	202,850,000	
サックスパー ホールディングス	12,500	813.00	10,162,500	
ジェコス	8,800	954.00	8,395,200	
ヤマザワ	1,800	1,255.00	2,259,000	
やまや	1,700	2,919.00	4,962,300	
グローセル	15,200	432.00	6,566,400	
ベルーナ	35,600	613.00	21,822,800	
合計	212,353,800		464,832,873,580	

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,590,896,471
コール・ローン	611,128,815
株式	1,145,801,688,216
投資信託受益証券	1,801,607,897
投資証券	20,843,818,365
派生商品評価勘定	395,085,744
未収入金	7,784,118
未収配当金	964,578,472
差入委託証拠金	7,736,239,267
流動資産合計	1,183,752,827,365
資産合計	1,183,752,827,365
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,978,469
未払金	98,401,483
未払解約金	150,590,000
流動負債合計	263,969,952
負債合計	263,969,952
純資産の部	
元本等	
元本	158,641,305,618
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,024,847,551,795
元本等合計	1,183,488,857,413
純資産合計	1,183,488,857,413
負債純資産合計	1,183,752,827,365

## 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5月12日 至 2023年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>新株予約権証券 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月13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	146,939,276,979円
同期中追加設定元本額	45,008,557,858円
同期中一部解約元本額	33,306,529,219円



## 元本の内訳

## ファンド名

D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,846,791,658円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,865,878円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	7,563,940円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	20,049,315円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,037,325円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	23,163,510円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,877,852円
たわらノーロード 先進国株式	53,919,418,823円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	287,629,129円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,866,204,770円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	909,648,205円
たわらノーロード バランス(堅実型)	86,800,206円
たわらノーロード バランス(標準型)	782,131,507円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,017,426,794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)	35,535,208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)	234,223,165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)	244,407,582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)	415,049,349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)	298,902円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	14,702,414円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,787,997円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,064,378円
たわらノーロード 全世界株式	1,220,380,707円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	56,414,918,170円
O n e D C 先進国株式インデックスファンド	3,172,519,147円
O n e グローバルバランス	19,155,846円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	141,675,638円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	782,692,927円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,030,919,793円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	85,303,134円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	238,308,026円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	243,460,338円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,709,590円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	665,830,785円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	120,769,833円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	162,604,554円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	186,602,354円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	313,264,885円
投資のソムリエ	10,034,767,621円
クルーズコントロール	80,010,803円
投資のソムリエ<DC年金>	912,156,533円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	186,201,595円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	282,741,350円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	995,798,943円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,471,962,269円
ワールドアセットバランス(基本コース)	111,623,980円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	179,027,460円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	55,188,050円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	27,617,304円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	8,065,663円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	167,669,251円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	139,485,397円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	654,569,192円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	134,509,121円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	57,228,517円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	30,143,568円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	18,279,302円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	133,843,713円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,397,624円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	34,969,360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)	1,879,558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)	1,898,510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)	1,165,991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)	1,906,249円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	4,860,733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)	1,743,578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)	330,443,883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)	35,393,692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)	1,106,969,473円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	197,708,557円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,268,187,075円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	297,796,144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)	768,989円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	5,884,820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)	3,214,782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)	4,656,604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)	21,757,872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)	39,215,007円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,553,378円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,286,984円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,016,050円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	31,268円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	912,215円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	16,254,337円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	118,759,292円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	212,785,591円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	733,276,650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)	30,983,929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)	26,423,563円

D I A M 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)	185,550,431円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	5,891,063円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	141,051円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	69,768,779円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	5,577,238円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	23,007,475円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	40,468,225円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	83,347,719円
動的パッケージファンド<DC年金>	14,184,867円
コア資産形成ファンド	8,328,147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>	2,673,314,578円
MHAM外国株式インデックスファンド	136,278,183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>	11,310,282円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,672,117,081円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,927,232,693円
計	158,641,305,618円
2. 受益権の総数	158,641,305,618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 2023年5月12日 至 2023年11月13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11月13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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年11月13日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	38,473,934,166	
投資信託受益証券	56,805,667	
投資証券	2,684,254,053	
合計	35,732,874,446	

（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11月13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11月13日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建					
イギリス・ポンド	81,374,273	-	81,373,532		741
オーストラリア・ドル	54,689,755	-	54,691,230		1,475
イギリス・ポンド	26,684,518	-	26,682,302		2,216
買建	532,452,011	-	533,211,403		759,392
アメリカ・ドル	393,824,960	-	394,358,136		533,176
イギリス・ポンド	12,761,964	-	12,794,118		32,154
オーストラリア・ドル	7,502,430	-	7,514,364		11,934
カナダ・ドル	25,359,035	-	25,371,240		12,205
ユーロ	93,003,622	-	93,173,545		169,923
合計	613,826,284	-	614,584,935		760,133

## （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。

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。

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11月13日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	14,638,819,584	-		15,018,166,726	379,347,142
合計	14,638,819,584	-		15,018,166,726	379,347,142

（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11月13日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	7.4602円 (74,602円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### （1）株式

2023年11月13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	1,369,189	143.560	196,560,772.840	
	ABBOTT LABORATORIES	257,696	93.970	24,215,693.120	
	AES CORP	90,680	15.700	1,423,676.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	134,350	149.020	20,020,837.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	239,309	118.590	28,379,654.310	
	ADOBE INC	67,635	597.220	40,392,974.700	
	CHUBB LTD	61,414	222.440	13,660,930.160	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	32,968	265.460	8,751,685.280	

ALLSTATE CORP	37,592	130.320	4,898,989.440	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	98,492	186.710	18,389,441.320	
AMGEN INC	79,330	267.310	21,205,702.300	
HESS CORP	41,496	141.590	5,875,418.640	
AMERICAN EXPRESS CO	93,688	154.380	14,463,553.440	
AMERICAN ELECTRIC POWER	77,342	77.700	6,009,473.400	
AFLAC INC	84,730	81.480	6,903,800.400	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	63.820	6,902,133.000	
ANALOG DEVICES	74,327	172.320	12,808,028.640	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	102,432	51.250	5,249,640.000	
VALERO ENERGY CORP	54,042	122.670	6,629,332.140	
ANSYS INC	13,252	291.500	3,862,958.000	
APPLE INC	2,331,541	186.400	434,599,242.400	
APPLIED MATERIALS INC	124,811	150.680	18,806,521.480	
ALBEMARLE CORP	16,936	116.980	1,981,173.280	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	72.500	5,909,040.000	
AMEREN CORP	40,644	76.270	3,099,917.880	
ARROW ELECTRONICS INC	7,306	120.540	880,665.240	
AUTODESK INC	32,074	210.580	6,754,142.920	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	61,235	228.490	13,991,585.150	
AUTOZONE INC	2,716	2,702.340	7,339,555.440	
AVERY DENNISON CORP	11,542	180.090	2,078,598.780	
BALL CORP	46,288	48.810	2,259,317.280	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	191,620	350.560	67,174,307.200	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	116,387	45.660	5,314,230.420	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	32.820	2,341,280.340	
BECTON DICKINSON & CO	42,082	234.650	9,874,541.300	
AMETEK INC	34,476	150.800	5,198,980.800	
VERIZON COMM INC	624,821	35.710	22,312,357.910	
WR BERKLEY CORP	31,607	68.150	2,154,017.050	
BEST BUY CO INC	30,568	64.120	1,960,020.160	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	304.040	918,504.840	
YUM! BRANDS INC	42,053	125.950	5,296,575.350	
FIRSTENERGY CORP	83,697	35.300	2,954,504.100	
BOEING CO	84,887	196.650	16,693,028.550	
ROBERT HALF INC	14,456	76.990	1,112,967.440	
BORGWARNER INC	37,010	32.370	1,198,013.700	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	213,388	51.560	11,002,285.280	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	79.960	1,377,950.680	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	24,197	147.880	3,578,252.360	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,044.110	3,561,459.210	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	312,164	50.610	15,798,620.040	
ONEOK INC	82,535	64.360	5,311,952.600	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	108.450	1,052,941.050	
UNITED RENTALS INC	9,765	456.530	4,458,015.450	
SEMPRA	93,163	70.340	6,553,085.420	
FEDEX CORP	35,569	246.030	8,751,041.070	
VERISIGN INC	13,302	207.260	2,756,972.520	
AMPHENOL CORP	88,014	86.610	7,622,892.540	
BROWN-FORMAN CORP	48,308	57.020	2,754,522.160	
QUANTA SERVICES INC	20,709	174.070	3,604,815.630	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.630	471,171.950	
CSX CORP	304,211	30.700	9,339,277.700	
COTERRA ENERGY INC	114,711	26.970	3,093,755.670	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	40.420	1,090,450.760	
CONSTELLATION BRANDS INC	24,629	239.320	5,894,212.280	
CARDINAL HEALTH INC	38,298	104.120	3,987,587.760	
CARLISLE COS INC	7,520	268.520	2,019,270.400	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	12.760	1,893,686.080	
CATERPILLAR INC	76,504	239.680	18,336,478.720	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	142.050	1,794,233.550	
JPMORGAN CHASE & CO	432,533	146.430	63,335,807.190	
CHURCH & DWIGHT CO INC	35,778	89.720	3,210,002.160	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,876	99.730	2,281,423.480	
CINTAS CORP	13,507	533.480	7,205,714.360	
CISCO SYSTEMS INC	602,573	52.590	31,689,314.070	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	16.550	1,148,090.050	
CLOROX COMPANY	18,305	133.460	2,442,985.300	
COCA-COLA CO/THE	607,988	56.720	34,485,079.360	
COPART INC	128,373	48.730	6,255,616.290	
COGNEX CORP	25,772	36.380	937,585.360	
COLGATE-PALMOLIVE CO	117,230	75.430	8,842,658.900	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	38,376	197.600	7,583,097.600	
MOLINA HEALTHCARE INC	8,928	358.080	3,196,938.240	
NRG ENERGY, INC.	34,874	45.550	1,588,510.700	
COMCAST CORP-CL A	616,451	41.910	25,835,461.410	
CONAGRA BRANDS INC	73,639	27.810	2,047,900.590	
CONSOLIDATED EDISON INC	51,736	89.350	4,622,611.600	
CMS ENERGY CORP	44,128	55.600	2,453,516.800	
COOPER COS INC	7,240	329.280	2,383,987.200	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	58.970	1,490,820.570	
CORNING INC	116,325	27.680	3,219,876.000	
WOLFSPEED INC	15,684	32.380	507,847.920	

SEALED AIR CORP	17,610	32.340	569,507.400	
HEICO CORP-CL A	9,463	133.020	1,258,768.260	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	214.360	2,023,987.120	
CUMMINS INC	21,250	219.020	4,654,175.000	
DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	42.020	1,000,328.120	
DR HORTON INC	45,784	122.700	5,617,696.800	
DANAHER CORP	103,928	197.000	20,473,816.000	
MOODY'S CORP	24,521	344.570	8,449,200.970	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,997	65.950	5,012,002.150	
TARGET CORP	69,096	108.330	7,485,169.680	
DEERE & CO	41,361	373.990	15,468,600.390	
MORGAN STANLEY	185,673	75.330	13,986,747.090	
REPUBLIC SERVICES INC	31,486	157.790	4,968,175.940	
COSTAR GROUP INC	58,012	79.650	4,620,655.800	
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	632.740	2,358,221.980	
THE WALT DISNEY CO	271,326	88.270	23,949,946.020	
DOLLAR TREE INC	31,756	114.080	3,622,724.480	
DOVER CORP	20,350	131.630	2,678,670.500	
OMNICOM GROUP	30,586	75.740	2,316,583.640	
DTE ENERGY CO	30,044	98.570	2,961,437.080	
DUKE ENERGY CORP	113,639	88.270	10,030,914.530	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,701	150.100	2,656,920.100	
EBAY INC	75,181	39.850	2,995,962.850	
BANK OF AMERICA CORP	1,063,728	27.680	29,443,991.040	
CITIGROUP INC	288,199	42.080	12,127,413.920	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	77.130	1,295,012.700	
EATON CORP PLC	59,302	221.820	13,154,369.640	
CADENCE DESIGN SYS INC	40,689	261.560	10,642,614.840	
ECOLAB INC	38,151	177.900	6,787,062.900	
REVVITY INC	17,972	84.490	1,518,454.280	
ELECTRONIC ARTS INC	36,801	132.780	4,886,436.780	
SALESFORCE INC	144,718	213.630	30,916,106.340	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	278.360	938,629.920	
EMERSON ELECTRIC CO	84,776	86.500	7,333,124.000	
ATMOS ENERGY CORP	21,199	111.410	2,361,780.590	
ENTERGY CORP	30,736	96.610	2,969,404.960	
EOG RESOURCES INC	86,645	122.700	10,631,341.500	
EQUIFAX INC	18,730	184.910	3,463,364.300	
EQT CORP	51,269	39.130	2,006,155.970	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	35,846	114.750	4,113,328.500	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	115.350	2,585,570.250	
EXXON MOBIL CORP	593,892	103.750	61,616,295.000	
FMC CORP	17,711	51.240	907,511.640	
NEXTERA ENERGY INC	300,997	55.140	16,596,974.580	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	453.020	2,451,744.240	
FAIR ISAAC CORP	3,775	996.700	3,762,542.500	



ASSURANT INC	8,766	163.060	1,429,383.960	
FASTENAL CO	85,603	60.010	5,137,036.030	
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	25.060	2,641,574.600	
M&T BANK CORP	24,958	118.350	2,953,779.300	
FIRST HORIZON CORP	69,634	11.290	786,167.860	
FISERV INC	91,718	121.510	11,144,654.180	
FORD MOTOR CO	585,908	9.860	5,777,052.880	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	22.920	1,088,172.840	
FREEMPORT-MCMORAN INC	214,628	33.680	7,228,671.040	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,405.470	2,226,264.480	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	31,707	248.270	7,871,896.890	
DENTSPLY SIRONA INC	34,681	28.390	984,593.590	
GENERAL DYNAMICS CORP	34,634	243.550	8,435,110.700	
GENERAL MILLS INC	88,517	65.280	5,778,389.760	
GENUINE PARTS CO	20,769	136.160	2,827,907.040	
GILEAD SCIENCES INC	185,219	75.920	14,061,826.480	
GARTNER INC	11,246	411.630	4,629,190.980	
MCKESSON CORP	20,139	469.290	9,451,031.310	
NVIDIA CORP	366,286	483.350	177,044,338.100	
GRACO INC	23,985	77.870	1,867,711.950	
GENERAL ELECTRIC CO	161,665	115.270	18,635,124.550	
VW GRAINGER INC	6,777	792.250	5,369,078.250	
HALLIBURTON CO	129,305	38.290	4,951,088.450	
MONSTER BEVERAGE CORP	117,637	55.280	6,502,973.360	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	49,219	325.510	16,021,276.690	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28,728	182.170	5,233,379.760	
HASBRO INC	16,359	43.110	705,236.490	
HENRY SCHEIN INC	17,431	64.070	1,116,804.170	
HEICO CORP	6,878	165.330	1,137,139.740	
HERSHEY FOODS CORP	22,500	191.480	4,308,300.000	
HP INC	124,613	27.620	3,441,811.060	
F5 INC	8,981	159.050	1,428,428.050	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	80.420	1,457,612.500	
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,222	222.840	1,386,510.480	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	27.140	1,186,425.100	
HOLOGIC INC	38,399	72.130	2,769,719.870	
HOME DEPOT INC	148,947	291.590	43,431,455.730	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	83.980	2,210,269.620	
HORMEL FOODS CORP	49,054	32.500	1,594,255.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	27.120	2,651,685.120	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	396.610	1,950,131.370	
HUBBELL INC	7,820	289.520	2,264,046.400	
HUMANA INC	18,641	493.110	9,192,063.510	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	173.820	2,133,814.320	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	215,385	10.270	2,212,003.950	
BIOGEN INC	21,910	224.790	4,925,148.900	
IDEX CORP	11,045	191.720	2,117,547.400	
ILLINOIS TOOL WORKS	44,869	232.490	10,431,593.810	
INTUIT INC	41,569	528.890	21,985,428.410	
IDEXX LABORATORIES INC	12,500	428.730	5,359,125.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	33,856	225.480	7,633,850.880	
INTEL CORP	619,142	38.860	24,059,858.120	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	35,897	71.740	2,575,250.780	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	33.090	1,461,022.770	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	28.980	1,566,745.740	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	147.990	1,754,717.430	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	128.260	2,512,100.360	
INCYTE CORP	31,654	52.440	1,659,935.760	
JOHNSON & JOHNSON	356,591	147.250	52,508,024.750	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,659	73.970	3,377,396.230	
KLA CORPORATION	20,432	534.250	10,915,796.000	
DEVON ENERGY CORP	96,985	45.620	4,424,455.700	
KELLANOVA	42,451	51.820	2,199,810.820	
KEYCORP	144,072	10.950	1,577,588.400	
KIMBERLY-CLARK CORP	50,460	120.840	6,097,586.400	
BLACKROCK INC/NEW YORK	22,139	665.000	14,722,435.000	
KROGER CO	97,173	43.890	4,264,922.970	
LAM RESEARCH CORP	20,026	685.430	13,726,421.180	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	382.800	2,511,550.800	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,451	155.630	2,093,379.130	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	56.950	1,153,807.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,313	110.770	2,582,381.010	
LENNAR CORP	37,667	122.200	4,602,907.400	
ELI LILLY & CO	119,666	597.710	71,525,564.860	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	31.040	873,962.240	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	107,486	138.110	14,844,891.460	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,825	108.470	4,862,167.750	
LOCKHEED MARTIN CORP	33,842	444.870	15,055,290.540	
LOEWS CORP	30,289	65.890	1,995,742.210	
LOWE'S COS INC	86,951	194.600	16,920,664.600	
DOMINION ENERGY INC	126,501	44.960	5,687,484.960	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	38.740	1,565,134.740	
MCCORMICK & CO INC	35,510	64.930	2,305,664.300	

MCDONALD'S CORPORATION	108,041	267.790	28,932,299.390	
S&P GLOBAL INC	48,610	393.970	19,150,881.700	
EVEREST GROUP LTD	6,670	384.680	2,565,815.600	
MARKEL GROUP INC	2,013	1,339.720	2,696,856.360	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	91,510	64.210	5,875,857.100	
MARSH & MCLENNAN COS	72,722	200.450	14,577,124.900	
MASCO CORP	34,561	56.170	1,941,291.370	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,365	453.870	4,250,492.550	
METLIFE INC	97,405	60.490	5,892,028.450	
MEDTRONIC PLC	197,294	70.680	13,944,739.920	
CVS HEALTH CORP	190,547	67.680	12,896,220.960	
MERCK & CO. INC.	375,951	101.390	38,117,671.890	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	65,250	67.380	4,396,545.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,876	204.780	2,636,747.280	
MICROSOFT CORP	1,047,225	369.670	387,127,665.750	
MICRON TECH INC	163,017	75.360	12,284,961.120	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	81,668	77.560	6,334,170.080	
3M CO	82,577	92.810	7,663,971.370	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	80.660	509,045.260	
ENTEGRIS INC	20,987	95.520	2,004,678.240	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	171.990	1,319,851.260	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,847	311.020	7,727,913.940	
ILLUMINA INC	24,379	98.370	2,398,162.230	
XCEL ENERGY INC	82,777	59.200	4,900,398.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	107.170	1,566,075.210	
NETAPP INC	32,785	77.140	2,529,034.900	
NEWMONT CORP	163,728	34.200	5,599,497.600	
NVR INC	483	6,035.290	2,915,045.070	
NIKE INC-CL B	182,817	106.110	19,398,711.870	
NORDSON CORP	7,548	225.110	1,699,130.280	
NORFOLK SOUTHERN CORP	34,140	196.880	6,721,483.200	
EVERSOURCE ENERGY	51,861	53.800	2,790,121.800	
NISOURCE INC	64,543	25.000	1,613,575.000	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	70.700	2,323,767.600	
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,526	463.270	9,972,350.020	
WELLS FARGO & CO	543,255	40.890	22,213,696.950	
NUCOR CORP	37,496	152.620	5,722,639.520	
CHENIERE ENERGY INC	36,422	171.620	6,250,743.640	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54,649	104.580	5,715,192.420	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,774	60.980	6,084,218.520	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,060	392.630	5,520,377.800	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,084	986.220	8,958,822.480	
ORACLE CORP	241,712	113.070	27,330,375.840	
PACCAR INC	77,744	88.260	6,861,685.440	
PTC INC	15,968	151.610	2,420,908.480	
EXELON CORP	147,025	39.430	5,797,195.750	
PARKER HANNIFIN CORP	19,211	419.450	8,058,053.950	
PAYCHEX INC	45,745	115.430	5,280,345.350	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,491	192.130	2,015,635.830	
PPL CORPORATION	113,687	25.340	2,880,828.580	
PEPSICO INC	203,773	166.920	34,013,789.160	
PENTAIR PLC	25,545	61.400	1,568,463.000	
PFIZER INC	838,053	29.480	24,705,802.440	
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	33.670	1,357,540.730	
CONOCOPHILLIPS	179,242	115.610	20,722,167.620	
PG&E CORP	283,772	16.780	4,761,694.160	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34,773	233.560	8,121,581.880	
ALTRIA GROUP INC	263,679	40.020	10,552,433.580	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	59,805	120.430	7,202,316.150	
BROWN & BROWN INC	36,907	72.850	2,688,674.950	
GARMIN LTD	23,281	116.620	2,715,030.220	
PPG INDUSTRIES INC	33,627	128.810	4,331,493.870	
COSTCO WHOLESALE CORP	65,588	577.120	37,852,146.560	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,293	92.620	3,176,217.660	
QUEST DIAGNOSTICS	16,574	132.820	2,201,358.680	
PROCTER & GAMBLE CO	348,735	151.410	52,801,966.350	
PROGRESSIVE CORP	87,083	160.390	13,967,242.370	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	74,243	61.610	4,574,111.230	
PULTE GROUP INC	33,950	82.370	2,796,461.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,240	109.180	4,065,863.200	
QUALCOMM INC	165,351	124.210	20,538,247.710	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,141	100.500	2,928,670.500	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	59.760	1,556,449.200	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	8,747	267.210	2,337,285.870	
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,052	798.940	12,824,584.880	
REPLIGEN CORP	6,730	147.560	993,078.800	
RESMED INC	22,899	143.600	3,288,296.400	
US BANCORP	229,227	34.200	7,839,563.400	
SEAGEN INC	19,998	213.720	4,273,972.560	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,309	85.950	4,839,758.550	
ROSS STORES INC	50,878	123.330	6,274,783.740	
ROLLINS INC	45,708	38.400	1,755,187.200	

ROPER TECHNOLOGIES INC	15,771	517.150	8,155,972.650	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,327	258.430	4,477,816.610	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	34,772	94.910	3,300,210.520	
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	97.750	1,882,469.500	
ACCENTURE PLC-CL A	93,496	319.690	29,889,736.240	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	202,099	69.120	13,969,082.880	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	240.210	3,895,485.570	
AXON ENTERPRISE INC	9,471	217.940	2,064,109.740	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	34,835	169.960	5,920,556.600	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	89,354	52.410	4,683,043.140	
BOOKING HOLDINGS INC	5,486	3,074.230	16,865,225.780	
SCHLUMBERGER LTD	212,211	53.300	11,310,846.300	
SCHWAB (CHARLES) CORP	224,033	54.410	12,189,635.530	
POOL CORP	5,406	330.540	1,786,899.240	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	105.420	3,385,457.880	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	56.550	818,674.350	
ELEVANCE HEALTH INC	35,171	458.250	16,117,110.750	
CENCORA INC	25,701	197.570	5,077,746.570	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,591	69.570	2,476,065.870	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	36,435	255.750	9,318,251.250	
CENTENE CORP	82,487	71.870	5,928,340.690	
SMITH (A.O.) CORP	19,563	72.820	1,424,577.660	
SNAP-ON INC	8,204	270.040	2,215,408.160	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,392	92.030	5,005,695.760	
EDISON INTERNATIONAL	57,612	63.720	3,671,036.640	
SOUTHERN CO	160,721	68.100	10,945,100.100	
TRUIST FINANCIAL CORP	198,729	29.390	5,840,645.310	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	23.160	456,252.000	
AT&T INC	1,063,626	15.640	16,635,110.640	
CHEVRON CORP	269,029	142.950	38,457,695.550	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,592	85.070	1,921,901.440	
STATE STREET CORP	50,416	67.600	3,408,121.600	
STARBUCKS CORP	170,073	104.330	17,743,716.090	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	109.020	2,500,591.740	
STRYKER CORP	50,652	273.620	13,859,400.240	
NETFLIX INC	66,002	447.240	29,518,734.480	
GEN DIGITAL INC	92,583	19.280	1,785,000.240	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	49.870	1,366,438.000	
SYNOPSYS INC	22,666	518.830	11,759,800.780	
SYSCO CORP	76,419	67.340	5,146,055.460	

INTUITIVE SURGICAL INC	52,093	277.490	14,455,286.570	
TELEFLEX INC	6,985	200.050	1,397,349.250	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	8.680	1,469,090.000	
TERADYNE INC	22,066	88.120	1,944,455.920	
TEXAS INSTRUMENTS INC	134,433	147.190	19,787,193.270	
TEXTRON INC	30,883	76.120	2,350,813.960	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	57,220	448.430	25,659,164.600	
GLOBE LIFE INC	12,153	116.640	1,417,525.920	
TORO CO	14,644	83.820	1,227,460.080	
DAVITA INC	6,813	82.990	565,410.870	
TRACTOR SUPPLY CO	16,808	198.540	3,337,060.320	
BIO-TECHNE CORP	25,934	57.490	1,490,945.660	
TRIMBLE INC	37,504	41.850	1,569,542.400	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,175	418.700	2,585,472.500	
TYSON FOODS INC	41,316	46.950	1,939,786.200	
MARATHON OIL CORP	92,952	25.090	2,332,165.680	
UNION PACIFIC CORP	90,300	211.490	19,097,547.000	
RTX CORP	217,454	82.220	17,879,067.880	
UNITEDHEALTH GROUP INC	137,987	541.210	74,679,944.270	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	130.230	1,054,342.080	
VF CORP	51,762	14.900	771,253.800	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	12.100	984,044.600	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	38,348	373.650	14,328,730.200	
VULCAN MATERIALS CO	20,095	211.660	4,253,307.700	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	20.760	2,223,894.240	
WALMART INC	219,021	166.190	36,399,099.990	
WASTE MANAGEMENT INC	60,476	171.770	10,387,962.520	
WATERS CORP	8,786	255.920	2,248,513.120	
WATSCO INC	4,889	376.430	1,840,366.270	
WEBSTER FINANCIAL CORP	28,834	39.350	1,134,617.900	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,626	341.650	3,630,372.900	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,604	108.740	1,696,778.960	
VAIL RESORTS INC	6,523	221.150	1,442,561.450	
WESTERN DIGITAL CORP	49,451	45.000	2,225,295.000	
WABTEC CORP	25,714	112.530	2,893,596.420	
WHIRLPOOL CORP	9,534	109.790	1,046,737.860	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	90.030	2,001,817.050	
WYNN RESORTS LTD	15,379	85.490	1,314,750.710	
NASDAQ INC	47,600	52.110	2,480,436.000	
CME GROUP INC	53,291	217.110	11,570,009.010	
WILLIAMS COS INC	180,781	34.880	6,305,641.280	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	112.580	962,671.580	

LKQ CORP	37,072	44.830	1,661,937.760	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	48.570	1,968,250.680	
WEC ENERGY GROUP INC	47,882	80.310	3,845,403.420	
CARMAX INC	22,414	63.370	1,420,375.180	
TJX COMPANIES INC	169,870	91.200	15,492,144.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	206.180	1,605,111.300	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.230	504,038.270	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	39.970	940,414.160	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,271	161.890	3,119,782.190	
CBRE GROUP INC	44,502	73.490	3,270,451.980	
REGIONS FINANCIAL CORP	133,681	15.120	2,021,256.720	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	378.510	1,944,405.870	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,469	504.580	3,264,128.020	
WESTLAKE CORP	6,030	121.980	735,539.400	
T-MOBILE US INC	80,697	147.610	11,911,684.170	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	47.750	2,283,405.000	
MOSAIC CO/THE	48,502	33.640	1,631,607.280	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	222.940	1,085,940.740	
CELANESE CORP	16,273	118.510	1,928,513.230	
DEXCOM INC	58,553	94.050	5,506,909.650	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	124.320	2,430,953.280	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	118.680	2,608,349.040	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	79.530	2,462,964.570	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,536	336.360	5,225,688.960	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	17.000	612,578.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	84,672	109.780	9,295,292.160	
LIVE NATION	23,597	87.520	2,065,209.440	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,117	2,120.580	8,730,427.860	
TRANSDIGM GROUP INC	8,166	992.500	8,104,755.000	
MASTERCARD INC	125,305	394.380	49,417,785.900	
OWENS CORNING	13,227	124.300	1,644,116.100	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	103.550	1,870,216.550	
AERCAP HOLDINGS NV	24,379	66.860	1,629,979.940	
FIRST SOLAR INC	15,579	133.920	2,086,339.680	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17,070	177.120	3,023,438.400	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,263	266.030	1,932,175.890	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	80.310	1,694,059.140	
DELTA AIR LINES INC	21,592	34.060	735,423.520	
INSULET CORP	10,158	155.100	1,575,505.800	
DISCOVER FINANCIAL	39,188	83.510	3,272,589.880	

TE CONNECTIVITY LTD	47,054	126.650	5,959,389.100	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,255	413.670	7,137,875.850	
VMWARE INC	35,499	149.660	5,312,780.340	
MERCADOLIBRE INC	6,748	1,374.390	9,274,383.720	
ULTA BEAUTY INC	7,263	389.710	2,830,463.730	
INVESCO LTD	57,267	13.080	749,052.360	
MSCI INC	11,948	514.260	6,144,378.480	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	229,491	89.700	20,585,342.700	
VISA INC	239,625	245.250	58,768,031.250	
KEURIG DR PEPPER INC	131,027	30.970	4,057,906.190	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	27,995	123.500	3,457,382.500	
MARATHON PETROLEUM CORP	63,096	145.130	9,157,122.480	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	61.000	1,307,230.000	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	298,312	16.440	4,904,249.280	
XYLEM INC	33,760	98.460	3,324,009.600	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,272	93.820	3,496,859.040	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	229.930	1,490,176.330	
SPLUNK INC	22,702	147.000	3,337,194.000	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	235.360	1,921,008.320	
HCA HEALTHCARE INC	30,702	232.820	7,148,039.640	
VERISK ANALYTICS INC	21,663	237.930	5,154,277.590	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,706	120.200	1,286,861.200	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,295	231.210	2,380,306.950	
NXP SEMICONDUCTOR NV	38,938	186.670	7,268,556.460	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,242	126.000	2,424,492.000	
TARGA RESOURCES CORP	33,263	84.560	2,812,719.280	
LEAR CORP	9,398	127.460	1,197,869.080	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,608	174.970	2,730,931.760	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	52.790	1,810,433.050	
DOLLAR GENERAL CORP	33,444	117.940	3,944,385.360	
FORTINET INC	100,599	50.820	5,112,441.180	
HYATT HOTELS CORP	6,647	107.990	717,809.530	
TESLA INC	423,117	214.650	90,822,064.050	
GENERAC HOLDINGS INC	9,111	103.550	943,444.050	
ENPHASE ENERGY INC	18,600	77.980	1,450,428.000	
GENERAL MOTORS CO	208,056	26.850	5,586,303.600	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	25.530	1,001,541.900	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	228.570	2,718,840.150	
APTIV PLC	43,097	75.930	3,272,355.210	



PHILLIPS 66	68,358	113.440	7,754,531.520	
META PLATFORMS INC	328,040	328.770	107,849,710.800	
IQVIA HOLDINGS INC	27,848	195.980	5,457,651.040	
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,850	157.710	3,919,093.500	
SERVICENOW INC	30,328	634.760	19,251,001.280	
PALO ALTO NETWORKS INC	45,643	253.510	11,570,956.930	
WORKDAY INC	31,060	230.010	7,144,110.600	
ABBVIE INC	261,732	138.590	36,273,437.880	
ZOETIS INC	68,687	169.320	11,630,082.840	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	20.920	1,134,094.120	
CDW CORP	20,262	211.670	4,288,857.540	
HOWMET AEROSPACE INC	55,049	49.550	2,727,677.950	
TWILIO INC	25,710	58.840	1,512,776.400	
SNAP INC	152,250	11.320	1,723,470.000	
TRADE DESK INC A	66,855	64.010	4,279,388.550	
OKTA INC	21,831	67.770	1,479,486.870	
BAKER HUGHES CO	152,160	34.340	5,225,174.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	94.070	2,049,314.950	
BROADCOM INC	61,179	957.520	58,580,116.080	
ARES MANAGEMENT CORP	23,161	107.750	2,495,597.750	
MONGODB INC	10,075	376.890	3,797,166.750	
BURLINGTON STORES INC	10,565	130.710	1,380,951.150	
VEEVA SYSTEMS INC	20,705	165.080	3,417,981.400	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,938	31.550	786,793.900	
EVERGY INC	33,192	49.410	1,640,016.720	
ALLEGION PLC	13,423	103.490	1,389,146.270	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	22,002	65.450	1,440,030.900	
STERIS PLC	14,158	199.320	2,821,972.560	
DOCUSIGN INC	26,362	40.980	1,080,314.760	
WIX.COM LTD	8,997	89.290	803,342.130	
DROPBOX INC	41,801	26.610	1,112,324.610	
KKR & CO INC	90,373	63.550	5,743,204.150	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	57.960	292,698.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	62.060	2,101,165.420	
MODERNA INC	46,344	70.050	3,246,397.200	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	37,708	161.800	6,101,154.400	
ARAMARK	31,641	28.520	902,401.320	
CIGNA GROUP	43,912	293.210	12,875,437.520	
DELL TECHNOLOGIES INC	38,669	73.500	2,842,171.500	
DOW INC	100,232	49.480	4,959,479.360	
OVINTIV INC	39,160	44.590	1,746,144.400	
AMCOR PLC	223,348	9.070	2,025,766.360	
PINTEREST INC	90,936	31.070	2,825,381.520	
FOX CORP-A	36,501	30.130	1,099,775.130	
FOX CORP-B	27,507	28.080	772,396.560	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	6.570	279,790.020	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	33,813	196.310	6,637,830.030	
CHEWY INC	9,648	19.960	192,574.080	
AVANTOR INC	97,157	18.560	1,803,233.920	
DYNATRACE INC	39,362	50.510	1,988,174.620	
CLOUDFLARE INC	39,310	63.080	2,479,674.800	
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	93.250	1,577,603.500	
CARRIER GLOBAL CORP	124,379	51.500	6,405,518.500	
OTIS WORLDWIDE CORP	58,737	82.030	4,818,196.110	
UBER TECHNOLOGIES INC	271,114	51.580	13,984,060.120	
CORTEVA INC	108,001	43.550	4,703,443.550	
MATCH GROUP INC	44,764	29.700	1,329,490.800	
FERGUSON PLC	29,134	159.940	4,659,691.960	
BILL HOLDINGS INC	11,865	56.480	670,135.200	
BLACKSTONE INC	105,031	98.640	10,360,257.840	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,809	149.320	867,399.880	
CARLYLE GROUP INC	34,847	30.160	1,050,985.520	
DATADOG INC	38,635	103.650	4,004,517.750	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	72.420	1,860,397.380	
INGERSOLL RAND INC	57,353	68.340	3,919,504.020	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	58,591	69.520	4,073,246.320	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	171.160	1,530,341.560	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	15.400	1,438,760.400	
DRAFTKINGS INC	63,900	35.030	2,238,417.000	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	27.010	832,961.390	
AON PLC	30,296	334.040	10,120,075.840	
WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	10.130	3,559,894.730	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,641.000	1,486,746.000	
BENTLEY SYSTEMS INC	33,634	51.900	1,745,604.600	
COINBASE GLOBAL INC	23,696	92.920	2,201,832.320	
UIPATH INC	53,439	17.300	924,494.700	
AIRBNB INC	61,583	118.150	7,276,031.450	
CONSTELLATION ENERGY CORP	45,938	121.770	5,593,870.260	
MONDAY.COM LTD	3,043	140.120	426,385.160	
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	27.220	1,692,349.060	
ROBLOX CORP	59,573	38.420	2,288,794.660	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	41,904	12.760	534,695.040	
VIATRIS INC	184,148	9.200	1,694,161.600	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	43.300	1,498,353.200	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	79.090	1,253,260.140	
HF SINCLAIR CORP	20,299	53.800	1,092,086.200	
SNOWFLAKE INC	39,207	160.400	6,288,802.800	
DOORDASH INC	36,227	87.470	3,168,775.690	
ARISTA NETWORKS INC	39,238	206.840	8,115,987.920	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	59,548	84.960	5,059,198.080	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	35.180	559,115.740	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	273,108	19.670	5,372,034.360	
FNF GROUP	38,907	43.940	1,709,573.580	
JACOBS SOLUTIONS INC	18,723	133.940	2,507,758.620	
MARVELL TECHNOLOGY INC	129,101	54.620	7,051,496.620	
APA CORP	49,146	36.920	1,814,470.320	
CONFLUENT INC	27,524	17.680	486,624.320	
LINDE PLC	72,413	399.840	28,953,613.920	
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	8.230	605,448.180	
LUCID GROUP INC	143,927	3.800	546,922.600	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	49.020	587,308.620	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	166.740	620,439.540	
TOAST INC	45,399	14.110	640,579.890	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.270	914,014.050	
CATALENT INC	27,357	33.550	917,827.350	
SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	29.570	2,031,488.570	
VERALTO CORP	32,610	70.550	2,300,635.500	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM	19,871	25.435	505,418.880	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	28,191	67.850	1,912,759.350	
BUNGE GLOBAL SA	21,715	104.530	2,269,868.950	
KENVUE INC	220,472	19.150	4,222,038.800	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	25.170	1,837,737.210	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	183.950	963,346.150	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	124.250	3,443,340.250	
HUBSPOT INC	6,836	428.920	2,932,097.120	
QORVO INC	14,144	91.660	1,296,439.040	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,444	82.730	1,525,872.120	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	7,789	71.140	554,109.460	
GODADDY INC	19,713	87.650	1,727,844.450	
ETSY INC	18,558	63.240	1,173,607.920	
TRANSUNION	31,262	52.710	1,647,820.020	
ALBERTSONS COS INC	40,041	21.180	848,068.380	
BLOCK INC	78,278	51.500	4,031,317.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	68.740	4,690,473.900	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	60.780	1,884,909.360	
WESTROCK CO	34,286	38.230	1,310,753.780	
KRAFT HEINZ CO	129,447	32.890	4,257,511.830	
FORTIVE CORP	50,061	65.830	3,295,515.630	
WASTE CONNECTIONS INC	38,848	130.540	5,071,217.920	

	ALPHABET INC-CL A	881,185	132.590	116,836,319.150	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	186,711	15.960	2,979,907.560	
	PAYPAL HOLDINGS INC	158,507	54.770	8,681,428.390	
	SEA LTD ADR	50,316	45.480	2,288,371.680	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	26.570	1,496,661.530	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	36.700	821,125.800	
	ALPHABET INC-CL C	783,554	134.060	105,043,249.240	
	ZSCALER INC	12,304	175.040	2,153,692.160	
	ATLASSIAN CORP PLC	21,642	176.290	3,815,268.180	
	ROKU INC	19,331	81.310	1,571,803.610	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,042	409.810	5,754,552.020	
	VISTRA CORP	49,633	34.480	1,711,345.840	
アメリカ・ドル	小計	50,606,811		5,663,017,963.270 (859,136,455,206)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	12.990	796,222.050	
	ASHTAD GROUP	66,851	49.260	3,293,080.260	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	26.350	1,200,189.800	
	BARCLAYS PLC	2,229,023	1.355	3,020,326.160	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.441	551,554.430	
	BT GROUP PLC	904,198	1.215	1,098,600.570	
	BUNZL PLC	46,691	29.210	1,363,844.110	
	CRH PLC	108,593	48.140	5,227,667.020	
	AVIVA PLC	429,205	4.043	1,735,275.810	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	45.080	927,430.840	
	DIAGEO PLC	333,830	28.500	9,514,155.000	
	SCHRODERS PLC	110,366	3.880	428,220.080	
	DCC PLC	17,471	46.030	804,190.130	
	NATIONAL GRID PLC	547,462	9.844	5,389,215.920	
	KINGFISHER PLC	336,026	2.260	759,418.760	
	BAE SYSTEMS PLC	457,388	11.035	5,047,276.580	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	314,741	24.770	7,796,134.570	
	HALMA PLC	51,066	19.315	986,339.790	
	NEXT PLC	18,588	73.820	1,372,166.160	
	IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	17.545	2,213,810.550	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	15.400	307,630.400	
	ANGLO AMERICAN PLC	193,117	20.185	3,898,066.640	
	COMPASS GROUP PLC	259,074	20.820	5,393,920.680	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,924,664	5.992	17,524,586.680	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.205	1,888,359.790	
	CENTRICA PLC	793,776	1.521	1,207,333.290	
	UNILEVER PLC	370,589	39.490	14,634,559.610	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.685	967,729.760	

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	23.300	1,282,501.900	
PEARSON PLC	84,159	9.696	816,005.660	
PERSIMMON PLC	56,989	11.490	654,803.610	
PRUDENTIAL PLC	393,799	8.824	3,474,882.370	
RIO TINTO PLC	167,240	52.590	8,795,151.600	
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.763	2,733,754.980	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	107,096	54.920	5,881,712.320	
RELX PLC	280,647	29.550	8,293,118.850	
RENTOKIL INITIAL PLC	374,845	4.465	1,673,682.920	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,221,103	2.320	2,832,958.960	
NATWEST GROUP PLC	896,355	1.970	1,765,819.350	
ST JAMES'S PLACE PLC	89,082	6.502	579,211.160	
SSE PLC	154,856	16.800	2,601,580.800	
BP PLC	2,571,529	4.778	12,286,765.560	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	9.940	1,512,828.240	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.330	844,179.350	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	85.360	917,705.360	
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	6.218	2,254,199.100	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,179,291	0.417	3,827,764.340	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.171	667,309.570	
TESCO PLC	1,030,735	2.777	2,862,351.090	
3I GROUP PLC	139,893	20.260	2,834,232.180	
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	9.890	1,245,447.700	
GSK PLC	607,325	13.984	8,492,832.800	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	63,356	85.540	5,419,472.240	
WPP PLC	142,785	7.012	1,001,208.420	
ASTRAZENECA PLC	229,936	100.900	23,200,542.400	
WHITBREAD PLC	31,475	32.640	1,027,344.000	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	38.070	887,373.630	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	16.775	876,141.470	
INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	58.580	1,574,278.920	
SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.670	709,704.690	
ADMIRAL GROUP PLC	32,350	25.500	824,925.000	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	42.420	699,463.380	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	17.525	323,423.870	
ABRDN PLC	285,831	1.657	473,621.960	
EXPERIAN PLC	140,133	26.830	3,759,768.390	
MONDI PLC	74,310	13.825	1,027,335.750	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.134	263,544.220	
OCADO GROUP PLC	69,766	5.146	359,015.830	
INFORMA PLC	223,961	7.118	1,594,154.390	
GLENCORE PLC	1,570,188	4.271	6,706,272.940	
ENTAIN PLC	96,924	9.256	897,128.540	

	COCA-COLA HBC AG	31,035	20.850	647,079.750	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	4.642	630,513.570	
	M&G PLC	270,401	2.036	550,536.430	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	16.510	463,518.250	
	WISE PLC	96,207	6.726	647,088.280	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.339	511,593.060	
	HALEON PLC	836,729	3.249	2,718,532.520	
	SHELL PLC	993,556	26.295	26,125,555.020	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	6.820	976,542.160	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	5.150	1,113,038.600	
イギリス・ポンド 小計		40,657,641		264,486,822.890 (49,049,081,305)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	29.550	5,537,788.200	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	27.060	6,469,585.980	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	730.000	2,430,900.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.430	3,003,057.920	
	ICL GROUP LTD	103,067	18.720	1,929,414.240	
	NICE LTD	9,053	649.400	5,879,018.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	131.400	3,868,941.600	
	AZRIELI GROUP	4,672	188.000	878,336.000	
イスラエル・シュケル 小計		738,997		29,997,042.140 (1,177,728,870)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	53.930	1,526,542.580	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	520,190	20.860	10,851,163.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	253,090	23.750	6,010,887.500	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.940	2,363,420.820	
	ASX LTD	31,215	57.460	1,793,613.900	
	BHP GROUP LTD	747,868	45.270	33,855,984.360	
	AMPOL LTD	31,828	33.390	1,062,736.920	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	24.820	2,274,107.680	
	CSL LIMITED	72,171	252.140	18,197,195.940	
	REA GROUP LTD	9,317	156.220	1,455,501.740	
	TRANSURBAN GROUP	476,258	12.580	5,991,325.640	
	COCHLEAR LTD	10,446	252.720	2,639,913.120	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	8.650	2,229,035.800	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	246,769	101.320	25,002,635.080	
	RIO TINTO LIMITED	53,206	120.420	6,407,066.520	
	APA GROUP	164,300	8.240	1,353,832.000	
	ARISTOCRAT LEISU	86,829	40.290	3,498,340.410	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.790	2,084,874.780	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	45.610	2,771,582.870		

IGO LTD	91,947	8.970	824,764.590		
ORICA LTD	63,862	15.450	986,667.900		
LEND LEASE CORP LTD	107,181	6.290	674,168.490		
BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	19.940	1,527,144.780		
MACQUARIE GROUP LTD	52,487	162.750	8,542,259.250		
SUNCORP GROUP LTD	199,628	13.320	2,659,044.960		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	465,095	28.460	13,236,603.700		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.280	594,839.520		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	219,807	15.520	3,411,404.640		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	11.650	1,894,627.850		
REECE LTD	31,558	18.910	596,761.780		
SANTOS LTD	478,809	7.220	3,457,000.980		
SONIC HEALTHCARE	64,897	30.440	1,975,464.680		
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	34.350	1,354,077.000		
WESFARMERS LTD	161,727	53.080	8,584,469.160		
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	282,153	32.030	9,037,360.590		
WOOLWORTHS GROUP LTD	183,840	35.500	6,526,320.000		
SEEK LTD	58,513	21.780	1,274,413.140		
MINERAL RESOURCES LTD	28,865	58.350	1,684,272.750		
BRAMBLES LTD	220,767	13.590	3,000,223.530		
PILBARA MINERALS LTD	404,496	3.510	1,419,780.960		
AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.560	793,342.440		
TREASURY WINE ESTATES LTD	86,411	10.960	947,064.560		
XERO LTD	23,149	99.930	2,313,279.570		
IDP EDUCATION LTD	44,923	23.510	1,056,139.730		
LOTTERY CORP LTD	291,270	4.590	1,336,929.300		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	4.830	1,128,481.200		
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	443,450	25.470	11,294,671.500		
TREASURY WINE ESTATES LTD-RTS	9,144	0.275	2,514.600		
MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.490	1,440,500.990		
SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.150	2,150,624.700		
COLES GROUP LTD	197,589	15.410	3,044,846.490		
WISETECH GLOBAL LTD	21,310	62.220	1,325,908.200		
オーストラリア・ドル 小計	10,277,962		231,465,734.590 (22,301,723,528)		
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	75,291	64.900	4,886,385.900	
	BARRICK GOLD CORP	267,495	20.980	5,612,045.100	
	BANK OF MONTREAL	105,551	107.320	11,327,733.320	
	BANK OF NOVA SCOTIA	176,307	58.950	10,393,297.650	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,706	88.650	4,583,736.900	
	BCE INC	14,197	53.120	754,144.640	

BROOKFIELD CORP	211,045	44.220	9,332,409.900	
SAPUTO INC	34,582	27.350	945,817.700	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	7.730	713,564.030	
DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	107.320	1,235,038.560	
CGI INC	31,091	137.750	4,282,785.250	
CCL INDUSTRIES INC	21,058	53.960	1,136,289.680	
CAE INC	40,808	30.130	1,229,545.040	
CAMECO CORP	66,084	58.680	3,877,809.120	
ROGERS COMM-CL B	53,375	56.930	3,038,638.750	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	136,114	51.980	7,075,205.720	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	164,344	89.090	14,641,406.960	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	140.310	1,250,302.410	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	30.710	501,494.300	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,693	154.140	12,900,439.020	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	46.740	1,408,837.080	
OPEN TEXT CORP	40,459	50.530	2,044,393.270	
EMPIRE CO LTD	20,608	40.530	835,242.240	
KINROSS GOLD CORP	192,737	7.150	1,378,069.550	
RB GLOBAL INC	26,641	82.990	2,210,936.590	
FORTIS INC	72,078	55.700	4,014,744.600	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	16.280	1,390,653.880	
TELUS CORP	31,890	23.790	758,663.100	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	40.570	1,387,818.560	
IMPERIAL OIL LTD	27,434	77.280	2,120,099.520	
ENBRIDGE INC	314,754	46.100	14,510,159.400	
IGM FINANCIAL INC	12,478	32.430	404,661.540	
MANULIFE FINANCIAL CORP	271,363	25.790	6,998,451.770	
LOBLAW CO LTD	24,803	121.310	3,008,851.930	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	116,251	78.650	9,143,141.150	
MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	72.620	3,070,300.980	
SUN LIFE FINANCIAL INC	84,814	65.720	5,573,976.080	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,133	1,242.770	3,893,598.410	
METRO INC	35,059	74.530	2,612,947.270	
EMERA INC	44,643	48.080	2,146,435.440	
ONEX CORP	10,157	85.500	868,423.500	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	18.380	1,017,755.740	
POWER CORP OF CANADA	89,864	34.090	3,063,463.760	
QUEBECOR INC-B	30,598	31.060	950,373.880	
ROYAL BANK OF CANADA	203,329	116.780	23,744,760.620	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	138,820	97.540	13,540,502.800	
STANTEC INC	18,358	94.660	1,737,768.280	



SUNCOR ENERGY INC	198,439	45.780	9,084,537.420	
LUNDIN MINING CORP	77,139	8.360	644,882.040	
TECK RESOURCES LTD-CL B	65,896	48.790	3,215,065.840	
THOMSON REUTERS CORP	22,378	180.580	4,041,019.240	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	112.990	1,479,830.030	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	270,486	81.960	22,169,032.560	
TC ENERGY CORP	145,828	49.490	7,217,027.720	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	101.030	818,545.060	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	165.280	1,626,189.920	
INTACT FINANCIAL CORP	26,758	206.370	5,522,048.460	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	66,562	59.310	3,947,792.220	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,041	3,034.000	9,226,394.000	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,420	164.690	4,845,179.800	
TOURMALINE OIL CORP	49,085	68.410	3,357,904.850	
KEYERA CORP	39,997	31.820	1,272,704.540	
PARKLAND CORP	15,665	43.520	681,740.800	
ALTAGAS LTD	47,249	26.390	1,246,901.110	
PEMBINA PIPELINE CORP	82,164	43.940	3,610,286.160	
DOLLARAMA INC	41,508	98.870	4,103,895.960	
CENOVUS ENERGY INC W/I	204,922	24.920	5,106,656.240	
ARC RESOURCES LTD	96,301	21.690	2,088,768.690	
NORTHLAND POWER INC	34,152	21.570	736,658.640	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	20.510	1,050,993.930	
TMX GROUP LTD	46,884	29.200	1,369,012.800	
BRP INC	4,307	97.020	417,865.140	
IVANHOE MINES LTD	98,820	10.000	988,200.000	
NUTRIEN LTD	71,301	73.850	5,265,578.850	
TFI INTERNATIONAL INC	11,591	153.790	1,782,579.890	
WSP GLOBAL INC	17,782	188.900	3,359,019.800	
IA FINANCIAL CORP INC	16,448	85.080	1,399,395.840	
GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	39.630	1,413,483.210	
NUVEI CORP	7,929	25.640	203,299.560	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	32.430	522,220.290	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	42.840	2,238,347.160	
AIR CANADA	41,858	18.110	758,048.380	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,113	94.790	4,276,261.270	
SHOPIFY INC	179,237	84.670	15,175,996.790	
FIRSTSERVICE CORP	5,237	198.760	1,040,906.120	
HYDRO ONE LTD	46,225	37.640	1,739,909.000	
カナダ・ドル 小計	6,015,517		352,597,300.220 (38,736,339,402)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.760	645,968.000	
	SEBPCORP INDUSTRIES	162,200	5.050	819,110.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	268,710	33.170	8,913,110.700	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	101,000	6.070	613,070.000	
	SEATRIUM LTD	7,235,222	0.108	781,403.970	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	28.960	448,880.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.710	1,358,429.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.850	647,014.050	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.260	1,157,474.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	502,098	12.970	6,512,211.060	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,131,630	2.360	2,670,646.800	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.210	1,515,240.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	27.400	5,248,908.400	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	5.970	260,292.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.590	928,015.000	
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.940	1,191,552.600		
シンガポール・ドル 小計	11,817,109		33,711,325.580 (3,759,487,029)		
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	73.440	1,743,024.960	
	NESTLE SA-REGISTERED	395,086	99.380	39,263,646.680	
	CIE FINANC RICHEMONT	77,733	106.700	8,294,111.100	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	104,214	236.750	24,672,664.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	191.350	1,016,259.850	
	SIKA INHABER	22,077	225.000	4,967,325.000	
	SGS SA-REG	22,978	75.220	1,728,405.160	
	NOVARTIS AG-REG SHS	303,021	83.860	25,411,341.060	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	131.000	763,730.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,425.000	655,500.000	
	CLARIANT AG-REG	22,909	13.300	304,689.700	
	SWISSCOM AG-REG	3,604	512.200	1,845,968.800	
	ABB LTD	238,635	32.140	7,669,728.900	
	ADECCO GROUP AG-REG	26,454	39.670	1,049,430.180	
	GEBERIT AG	5,105	460.000	2,348,300.000	
	LONZA GROUP AG-REG	10,855	334.600	3,632,083.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	10,540.000	1,443,980.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	104,200.000	1,667,200.000	
	GIVAUDAN-REG	1,392	3,180.000	4,426,560.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	22,160	431.000	9,550,960.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	251.600	1,210,196.000	
	HOLCIM LTD	77,519	59.980	4,649,589.620	
TEMENOS GROUP	10,930	66.840	730,561.200		

	BACHEM HOLDING AG	4,673	71.900	335,988.700	
	SONOVA HOLDING AG	8,100	226.900	1,837,890.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	239.800	1,892,022.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,475	113.150	1,864,146.250	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	227.500	978,250.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	43.650	404,155.350	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	123.000	603,438.000	
	SCHINDLER NAMEN	4,209	183.700	773,193.300	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	551.600	2,483,854.800	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	100.300	491,770.900	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	607.000	755,715.000	
	SWISS PRIME SITE AG	9,861	83.900	827,337.900	
	AVOLTA AG	12,933	29.340	379,454.220	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,433	1,050.000	3,604,650.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	51.800	1,663,505.200	
	SWISS RE LTD	45,502	97.960	4,457,375.920	
	BKW AG	3,194	154.500	493,473.000	
	SIG GROUP AG	50,969	20.620	1,050,980.780	
	ALCON INC	74,922	64.940	4,865,434.680	
	SANDOZ GROUP AG	57,347	24.480	1,403,854.560	
	UBS GROUP AG	487,869	22.020	10,742,875.380	
	VAT GROUP AG	4,131	352.600	1,456,590.600	
スイス・フラン	小計	2,237,708		192,411,212.250 (32,332,780,106)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	396,072	152.000	60,202,944.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	241,869	132.050	31,938,801.450	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	50.330	21,037,940.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	205.500	5,292,652.500	
	LUNDBERGS B	14,872	462.100	6,872,351.200	
	SKF AB-B SHS	46,594	182.800	8,517,383.200	
	SANDVIK AB	169,218	195.500	33,082,119.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	124.000	27,571,152.000	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	154.350	6,781,675.950	
	SWEDBANK AB	115,534	180.050	20,801,896.700	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	92,795	156.000	14,476,020.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	96.100	21,031,100.600	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	228.600	5,531,662.800	
	VOLVO AB-B SHS	219,089	221.600	48,550,122.400	
	HOLMEN AB-B SHS	17,320	421.600	7,302,112.000	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	79.900	5,405,554.600	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	292.300	4,469,851.600	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	292.500	6,237,562.500	
	SAAB AB-B	11,789	561.600	6,620,702.400	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	87.220	6,636,133.700	

	INVESTOR AB-B SHS	243,361	206.900	50,351,390.900	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	155.160	16,240,442.040	
	ASSA ABLOY AB-B	153,368	245.300	37,621,170.400	
	TELIA CO AB	344,810	24.080	8,303,024.800	
	BOLIDEN AB	36,260	274.900	9,967,874.000	
	ALFA LAVAL AB	44,407	367.500	16,319,572.500	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	54.920	4,005,974.640	
	INDUTRADE AB	39,178	205.500	8,051,079.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	74.200	3,544,459.800	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	65.340	13,906,442.880	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	236.200	8,593,192.200	
	HEXAGON AB-B SHS	307,116	95.140	29,219,016.240	
	SAGAX AB	28,022	230.600	6,461,873.200	
	EPIROC AB-A	103,115	185.750	19,153,611.250	
	EPIROC AB-B	61,487	157.800	9,702,648.600	
	ESSITY AB-B	86,900	250.400	21,759,760.000	
	EQT AB	55,194	224.000	12,363,456.000	
	VOLVO CAR AB	63,710	37.820	2,409,512.200	
	BEIJER REF AB	50,493	109.600	5,534,032.800	
	LIFCO AB	39,631	218.400	8,655,410.400	
	EVOLUTION AB	28,266	998.100	28,212,294.600	
	NORDEA BANK ABP	481,923	117.320	56,539,206.360	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	208.000	5,748,704.000	
	スウェーデン・クローナ 小計	5,128,064		731,023,887.410 (10,168,542,274)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	15,167	822.000	12,467,274.000	
	A P MOLLER A/S	663	9,988.000	6,622,044.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	9,905.000	5,378,415.000	
	DANSKE BANK A/S	102,303	165.350	16,915,801.050	
	GENMAB A/S	9,783	2,153.000	21,062,799.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	343.100	10,222,664.500	
	ROCKWOOL AS	873	1,620.000	1,414,260.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	484,214	691.600	334,882,402.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	167.060	25,814,278.260	
	COLOPLAST-B	21,291	697.400	14,848,343.400	
	DSV A/S	28,190	1,070.000	30,163,300.000	
	DEMANT A/S	11,367	261.900	2,977,017.300	
	TRYG A/S	58,222	140.550	8,183,102.100	
	PANDORA A/S	12,473	860.800	10,736,758.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	16,295	523.000	8,522,285.000	
	ORSTED A/S	26,911	293.800	7,906,451.800	
	デンマーク・クローネ 小計	972,611		518,117,196.210 (11,258,686,674)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.740	1,271,999.340	
	EBOS GROUP LTD	25,631	37.200	953,473.200	

	FISHER & PAYKEL	78,460	21.720	1,704,151.200	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.110	1,119,284.180	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.880	369,463.920	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	4.960	1,186,967.680	
ニュージーランド・ドル 小計		789,612		6,605,339.520 (589,922,873)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	188.100	10,604,137.500	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	60.520	13,385,934.640	
	TELENOR ASA	119,576	114.850	13,733,303.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	460.200	5,147,337.000	
	ORKLA ASA	116,068	78.320	9,090,445.760	
	EQUINOR ASA	129,895	364.300	47,320,748.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	364.300	7,225,526.200	
	AKER BP ASA	40,933	307.800	12,599,177.400	
	SALMAR ASA	12,897	568.600	7,333,234.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	169.000	4,346,849.000	
	ADEVINTA ASA	54,715	107.500	5,881,862.500	
DNB BANK ASA	143,909	200.400	28,839,363.600		
ノルウェー・クローネ 小計		952,290		165,507,919.900 (2,257,528,027)	
ユーロ	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	25,137	138.800	3,489,015.600	
	KERRY GROUP PLC-A	25,025	72.460	1,813,311.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	66.080	1,444,508.800	
	UMICORE	33,545	22.770	763,819.650	
	AIR LIQUIDE	77,642	166.600	12,935,157.200	
	AIRBUS SE	88,164	128.480	11,327,310.720	
	AXA SA	271,713	27.725	7,533,242.920	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	98,192	27.030	2,654,129.760	
	ADIDAS AG	24,550	170.900	4,195,595.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	19.105	2,762,831.360	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	182.900	570,648.000	
	DANONE	92,137	57.370	5,285,899.690	
	SAFRAN SA	51,062	153.080	7,816,570.960	
	INTESA SANPAOLO	2,330,103	2.566	5,979,044.290	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	45,524	91.180	4,150,878.320	
	ACCOR SA	31,427	29.960	941,552.920	
	BOUYGUES	29,123	33.970	989,308.310	
	BNP PARIBAS	155,810	55.610	8,664,594.100	
	THALES SA	15,023	138.600	2,082,187.800	
	CAPGEMINI SA	25,063	171.850	4,307,076.550	
LOTUS BAKERIES NV	77	7,350.000	565,950.000		
UNICREDIT SPA	275,839	23.865	6,582,897.730		
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	113.150	1,403,399.450		
D'IETEREN TRDG	2,736	151.200	413,683.200		

COMMERZBANK AG	158,792	10.660	1,692,722.720	
EIFFAGE	12,706	86.160	1,094,748.960	
FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	25.040	1,472,702.560	
PUBLICIS GROUPE	33,467	70.360	2,354,738.120	
IBERDROLA SA	899,504	10.650	9,579,717.600	
ENI SPA	353,207	14.998	5,297,398.580	
JERONIMO MARTINS	45,606	22.100	1,007,892.600	
KESKO OYJ-B	35,252	16.420	578,837.840	
KBC GROUPE	35,962	51.280	1,844,131.360	
HANNOVER RUECK SE	8,405	202.100	1,698,650.500	
WARTSILA OYJ	77,148	11.415	880,644.420	
L'OREAL	35,752	414.250	14,810,266.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	41,008	687.100	28,176,596.800	
GEA GROUP AG	25,513	34.290	874,840.770	
BOLLORE	114,808	5.270	605,038.160	
MEDIOBANCA SPA	86,792	11.540	1,001,579.680	
MICHELIN(CGDE)-B	98,359	28.480	2,801,264.320	
CONTINENTAL AG	17,635	63.380	1,117,706.300	
DEUTSCHE POST AG-REG	141,942	38.965	5,530,770.030	
OMV AG	23,354	42.430	990,910.220	
VERBUND AG	10,663	84.000	895,692.000	
PERNOD-RICARD	30,948	164.300	5,084,756.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	43.780	1,020,555.580	
RENAULT SA	27,902	34.005	948,807.510	
REPSOL SA	195,049	13.645	2,661,443.600	
REMY COINTREAU	2,866	108.650	311,390.900	
MERCK KGAA	18,505	149.500	2,766,497.500	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	69,501	54.230	3,769,039.230	
RWE AG	90,040	36.280	3,266,651.200	
SEB SA	2,596	98.500	255,706.000	
SOCIETE GENERALE-A	104,069	21.260	2,212,506.940	
VINCI S.A.	78,581	106.560	8,373,591.360	
SODEXO	12,910	99.800	1,288,418.000	
SOFINA	2,281	191.900	437,723.900	
SOLVAY SA	11,217	99.340	1,114,296.780	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	81,059	160.800	13,034,287.200	
VIVENDI SE	98,944	8.578	848,741.630	
SAP SE	155,241	134.860	20,935,801.260	
TELEFONICA S.A	755,720	3.706	2,800,698.320	
TOTALENERGIES SE	332,576	62.040	20,633,015.040	
VALEO	26,570	12.385	329,069.450	
E.ON SE	339,366	11.450	3,885,740.700	
VOEST-ALPINE AG	18,032	24.780	446,832.960	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	61.920	1,107,501.120	
SIEMENS AG-REG	113,016	130.800	14,782,492.800	
UPM-KYMMENE OYJ	77,973	32.400	2,526,325.200	

ING GROEP NV-CVA	540,815	12.160	6,576,310.400	
PUMA AG	17,210	54.360	935,535.600	
BAYER AG	147,329	40.155	5,915,995.990	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	11.915	1,143,601.700	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	70.700	1,710,303.700	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	119,618	56.490	6,757,220.820	
BASF SE	135,442	43.715	5,920,847.030	
BEIERSDORF AG	15,743	123.700	1,947,409.100	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	70.140	1,514,042.040	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	33,632	31.980	1,075,551.360	
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	437.050	2,906,819.550	
ORANGE	286,957	11.052	3,171,448.760	
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	38.620	2,474,769.600	
RANDSTAD NV	15,584	51.840	807,874.560	
ALLIANZ SE	59,640	222.000	13,240,080.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	433,193	4.153	1,799,050.520	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	26.750	3,923,342.250	
HERMES INTL	4,712	1,845.400	8,695,524.800	
ENDESA S.A.	50,946	18.620	948,614.520	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.560	546,905.520	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	33.860	1,546,927.960	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	20,381	371.400	7,569,503.400	
ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	20.285	1,645,701.760	
DASSAULT SYSTEMES SA	101,597	40.490	4,113,662.530	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	33.260	1,158,645.360	
RHEINMETALL STAMM	6,662	273.600	1,822,723.200	
HEINEKEN NV	43,759	84.720	3,707,262.480	
AKZO NOBEL	26,032	65.940	1,716,550.080	
ASML HOLDING NV	59,922	608.000	36,432,576.000	
AEGON LTD	232,433	4.696	1,091,505.360	
VOLKSWAGEN AG	3,315	114.600	379,899.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	30,425	103.660	3,153,855.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	885,310	7.900	6,993,949.000	
KERING	10,616	393.100	4,173,149.600	
ACCIONA S.A.	5,005	127.200	636,636.000	
FORTUM OYJ	54,194	12.185	660,353.890	
AGEAS	24,086	37.530	903,947.580	
UCB SA	16,732	65.780	1,100,630.960	
NEMETSCHEK SE	10,222	73.240	748,659.280	
CARREFOUR SA	90,642	17.105	1,550,431.410	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.580	469,854.660	
NOKIA OYJ	827,068	3.241	2,680,527.380	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	134,920	18.404	2,483,067.680	

WOLTERS KLUWER-CVA	38,724	123.750	4,792,095.000	
SANOFI	169,265	85.140	14,411,222.100	
STMICROELECTRONICS NV	97,199	38.615	3,753,339.380	
ELISA OYJ	20,242	42.240	855,022.080	
BANCO SANTANDER SA	2,412,875	3.609	8,708,065.870	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	14.770	968,749.530	
QIAGEN N.V.	35,613	35.210	1,253,933.730	
DEUTSCHE BANK AG-REG	282,637	10.496	2,966,557.950	
BMW VORZUG	7,821	83.150	650,316.150	
ENEL SPA	1,202,825	6.129	7,372,114.420	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	482,293	21.435	10,337,950.450	
SARTORIUS AG	3,651	251.400	917,861.400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	197,936	29.305	5,800,514.480	
RATIONAL AG	542	589.500	319,509.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	84.520	411,274.320	
BECHTLE AG	14,521	43.100	625,855.100	
KONINKLIJKE KPN NV	496,095	3.200	1,587,504.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	49.670	1,144,297.460	
TELEPERFORMANCE	7,845	125.450	984,155.250	
DEUTSCHE BOERSE AG	28,751	165.850	4,768,353.350	
EURAZEO	5,673	56.350	319,673.550	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	72.160	932,162.880	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	71.700	1,268,373.000	
INDITEX	162,141	34.270	5,556,572.070	
ESSILORLUXOTTICA	43,937	174.900	7,684,581.300	
SNAM SPA	317,518	4.348	1,380,568.260	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	11.710	1,954,644.910	
ENAGAS	38,270	15.835	606,005.450	
WENDEL	5,449	74.600	406,495.400	
TENARIS SA	76,002	16.090	1,222,872.180	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.252	228,888.070	
TERNA SPA	207,655	7.342	1,524,603.010	
BIOMERIEUX	4,870	92.780	451,838.600	
GRIFOLS SA	31,982	11.535	368,912.370	
NESTE OYJ	66,248	32.880	2,178,234.240	
RECORDATI SPA	18,197	44.260	805,399.220	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	10.540	884,727.600	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	182.050	1,327,872.700	
KONE OYJ	49,300	41.840	2,062,712.000	
ELIA GROUP	4,078	94.550	385,574.900	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	185.000	713,175.000	
ENGIE	257,242	15.298	3,935,288.110	
ALSTOM	47,494	13.105	622,408.870	
IPSEN SA	5,964	104.300	622,045.200	
ARKEMA SA	10,489	90.400	948,205.600	
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	119.050	356,078.550	



LEGRAND SA	41,105	83.600	3,436,378.000	
AMPLIFON SPA	20,249	27.100	548,747.900	
ADP	3,975	110.100	437,647.500	
ORION OYJ	13,559	36.710	497,750.890	
METSO CORPORATION	102,831	8.662	890,722.120	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	13.760	1,095,089.600	
SYMRISE AG	19,547	96.280	1,881,985.160	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39,869	32.400	1,291,755.600	
PRYSMIAN SPA	38,343	34.840	1,335,870.120	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	84.820	206,027.780	
CAIXABANK	630,095	3.856	2,429,646.320	
BUREAU VERITAS SA	39,729	22.060	876,421.740	
GETLINK	63,968	15.560	995,342.080	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	15.470	613,973.360	
AMADEUS IT GROUP SA	68,848	60.260	4,148,780.480	
BRENTAG SE	21,559	71.700	1,545,780.300	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	18.055	773,403.980	
EDENRED	35,618	49.420	1,760,241.560	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	137,436	2.348	322,699.720	
TALANX AG	6,683	59.450	397,304.350	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	65.940	785,675.100	
VONOVIA SE	107,478	23.230	2,496,713.940	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	8.454	1,387,774.820	
KNORR-BREMSE AG	10,342	54.320	561,777.440	
OCI NV	12,329	21.220	261,621.380	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	39,737	47.610	1,891,878.570	
FERRARI NV	18,850	314.700	5,932,095.000	
ASR NEDERLAND NV	27,365	35.320	966,531.800	
CNH INDUSTRIAL NV	143,842	9.280	1,334,853.760	
AIB GROUP PLC	226,914	4.158	943,508.410	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	31.460	544,037.780	
MONCLER SPA	29,763	49.460	1,472,077.980	
NEXI SPA	83,576	6.586	550,431.530	
PROSUS NV	228,638	28.415	6,496,748.770	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	87.420	1,326,511.080	
JDE PEET'S BV	14,385	25.720	369,982.200	
EXOR NV	14,142	83.780	1,184,816.760	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	9.390	703,235.880	
EURONEXT NV	14,077	71.600	1,007,913.200	
IMCD NV	9,332	126.800	1,183,297.600	
WORLDLINE SA	36,232	12.755	462,139.160	
NN GROUP NV	36,289	30.990	1,124,596.110	
FINECOBANK SPA	96,393	11.765	1,134,063.640	
ARGENX SE	8,001	454.300	3,634,854.300	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	114,291	23.500	2,685,838.500	

	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,616	28.220	2,133,883.520	
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	26.540	260,675.880	
	DSM-FIRMENICH AG	28,846	92.230	2,660,466.580	
	ZALANDO SE	31,321	21.420	670,895.820	
	STELLANTIS NV	327,741	17.982	5,893,438.660	
	FERROVIAL SE	73,817	28.800	2,125,929.600	
	AENA SME SA	9,989	147.300	1,471,379.700	
	CELLNEX TELECOM SAU	81,974	30.430	2,494,468.820	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	12.085	638,510.970	
	SCOUT24 SE	10,048	62.320	626,191.360	
	COVESTRO AG	27,558	47.180	1,300,186.440	
	HELLOFRESH SE	17,856	19.845	354,352.320	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	129,506	55.410	7,175,927.460	
	POSTE ITALIANE SPA	61,361	9.882	606,369.400	
	AMUNDI SA	11,288	53.150	599,957.200	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.650	446,011.350	
	ADYEN NV	3,176	936.000	2,972,736.000	
	DELIVERY HERO SE	22,564	27.285	615,658.740	
	ユーロ 小計	26,104,990		666,924,808.990 (108,088,503,793)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	10.300	2,647,100.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	57.600	13,927,449.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	36.000	3,359,304.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	183,491	282.600	51,854,556.600	
	MTR CORP	207,441	28.650	5,943,184.650	
	HANG SENG BANK LTD	122,096	86.750	10,591,828.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	20.650	6,153,121.800	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	38.250	8,140,365.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	5.300	8,142,951.800	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	41.250	13,897,290.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	498,995	20.550	10,254,347.250	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	14.540	2,516,379.640	
	SINO LAND CO	659,200	7.960	5,247,232.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	76.900	15,731,048.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	49.900	2,645,698.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	72.000	15,491,232.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	8.930	1,589,540.000	
	AIA GROUP LTD	1,729,116	69.350	119,914,194.600	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	8.100	3,751,401.600	

SANDS CHINA LTD	335,800	20.500	6,883,900.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	11.780	1,649,200.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	14.880	2,999,808.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	25.650	6,569,862.750	
ESR GROUP LTD	465,200	9.990	4,647,348.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	15.120	4,006,800.000	
WH GROUP LTD	1,001,000	4.620	4,624,620.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	38.800	14,334,466.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	37.950	10,102,100.250	
香港・ドル 小計	10,963,869		357,616,330.040 (6,944,909,129)	
合計	167,263,181		1,145,801,688,216 (1,145,801,688,216)	

## (2) 株式以外の有価証券

2023年11月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル 小計		2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券 合計			2,968	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,161,042.120	
		GOODMAN GROUP	255,895.000	5,757,637.500	
		GPT GROUP	349,447.000	1,355,854.360	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	933,141.160	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,104,907.700	
		STOCKLAND	369,843.000	1,409,101.830	
	オーストラリア・ドル 小計		2,985,154.000	13,695,660.990 (1,319,576,937)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,409,143.490	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,643,799.820	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	730,114.000	
シンガポール・ドル 小計		2,277,909.000	4,322,372.310 (482,030,960)		
投資信託受益証券 合計			5,263,063	1,801,607,897 (1,801,607,897)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,234.000	2,318,224.440	

	AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,779,725.500	
	AMERICAN TOWER CORP	69,325.000	12,741,241.750	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,364,423.130	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,503.000	3,280,404.600	
	BOSTON PROPERTIES INC	24,473.000	1,283,364.120	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,490,302.440	
	CROWN CASTLE INC	65,066.000	6,222,912.240	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	41,585.000	5,354,068.750	
	EQUINIX INC	13,861.000	10,635,129.470	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,791,861.400	
	EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	2,950,832.160	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,083,960.450	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	30,376.000	3,618,085.360	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,574,564.250	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	67,654.000	982,336.080	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,133.000	1,436,720.020	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	1,811,910.150	
	INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,741,302.080	
	IRON MOUNTAIN INC	43,616.000	2,592,535.040	
	KIMCO REALTY	95,524.000	1,709,879.600	
	MID AMERICA	17,537.000	2,152,140.640	
	PROLOGIS INC	136,638.000	14,285,502.900	
	PUBLIC STORAGE	23,534.000	5,760,652.520	
	REALTY INCOME CORP	100,840.000	5,048,050.400	
	REGENCY CENTERS CORP	21,907.000	1,324,278.150	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	16,539.000	3,621,875.610	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	46,584.000	5,372,532.720	
	SUN COMMUNITIES INC	18,509.000	2,123,352.480	
	UDR INC	50,449.000	1,652,709.240	
	VENTAS INC	60,757.000	2,585,817.920	
	VICI PROPERTIES INC	140,502.000	3,998,686.920	
	WELLTOWER INC	73,965.000	6,359,510.700	
	WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,084,797.250	
	WP CAREY INC	32,996.000	1,786,073.480	
アメリカ・ドル	小計	1,899,511.000	128,919,763.960 (19,558,417,390)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	727,827.310	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,277,726.940	
イギリス・ポンド	小計	286,426.000	2,005,554.250 (371,930,036)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	392,228.340	

	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	249,246.720	
カナダ・ドル 小計		23,146.000	641,475.060 (70,472,450)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	214,697.080	
	GECINA SA	8,697.000	843,174.150	
	KLEPIERRE	36,407.000	821,341.920	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	18,477.000	933,827.580	
	WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	493,979.920	
ユーロ 小計		88,793.000	3,307,020.650 (535,968,837)	
香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	15,809,971.800	
香港・ドル 小計		410,116.000	15,809,971.800 (307,029,652)	
投資証券 合計		2,707,992	20,843,818,365 (20,843,818,365)	
合計			22,645,426,262 (22,645,426,262)	

(注) 新株予約権証券、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 (%)	組入新株 予約権証券 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 604銘柄	72.59	-	-	-	75.20
	投資証券 35銘柄	-	-	-	1.65	
イギリス・ポンド	株式 81銘柄	4.14	-	-	-	4.23
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.03	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	-	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	1.88	-	-	-	2.02
	投資信託受益証券 7銘柄	-	-	0.11	-	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.27	-	-	-	3.32
	新株予約権証券 1銘柄	-	0.00	-	-	
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	0.32	-	-	-	0.36
	投資信託受益証券 4銘柄	-	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 45銘柄	2.73	-	-	-	2.77
スウェーデン・クローナ	株式 43銘柄	0.86	-	-	-	0.87
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.95	-	-	-	0.96

ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.05	-	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.19	-	-	-	0.19
ユーロ	株式	222銘柄	9.13	-	-	-	9.30
	投資証券	5銘柄	-	-	-	0.05	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.59	-	-	-	0.62
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.03	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,665,496,322
国債証券	449,504,516,150
地方債証券	30,128,100,157
特殊債証券	28,490,256,333
社債証券	24,085,713,490
未収利息	747,916,452
前払費用	131,040,825
流動資産合計	535,753,039,729
資産合計	535,753,039,729
負債の部	
流動負債	
未払解約金	57,305,000
流動負債合計	57,305,000
負債合計	57,305,000
純資産の部	
元本等	
元本	438,127,800,594
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	97,567,934,135
元本等合計	535,695,734,729
純資産合計	535,695,734,729
負債純資産合計	535,753,039,729

## 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5月12日 至 2023年11月13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11月13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	469,534,984,076円
同期中追加設定元本額	201,594,558,208円
同期中一部解約元本額	233,001,741,690円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	26,201,968,544円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	56,117,188円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	86,648,665円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	48,477,463円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	783,327,260円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	265,357,375円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	41,090,742円
たわらノーロード 国内債券	19,038,306,097円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,192,909,666円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,486,976,826円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,805,413,335円
たわらノーロード バランス（積極型）	368,455,838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）	168,118,163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）	2,237,975,244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）	2,381,238,179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）	667,172,497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）	30,649,326円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	22,029,341円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	187,166,586円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	5,495,533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>	13,680,413,350円
Oneグローバルバランス	74,500,940円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	10,586,168,424円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	15,587,210,751円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	6,862,150,763円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,571,332,885円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,644,433,665円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	495,917,205円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	75,882,531円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,859,473,215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）	5,140,138,301円



DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,247,433,102円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	455,345,604円
投資のソムリエ	96,651,426,491円
クルーズコントロール	945,604,294円
投資のソムリエ<DC年金>	8,804,068,176円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	6,131,863,789円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,920,674,179円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,734,321,911円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	33,843,657,307円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	494,182,919円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	247,534,442円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	79,014,285円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,038,037,307円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,276,553,626円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,361,106,801円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,992,311,336円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	537,115,716円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	270,727,411円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	164,115,791円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,913,974,412円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	39,354,556円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	142,397,182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)	1,167,534,651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)	1,172,032,430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)	1,552,681,806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)	706,532,898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)	1,152,339,265円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	2,980,757,352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)	1,960,125,052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)	1,035,526,887円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	2,008,043,556円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,273,768,642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)	2,880,153,489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)	594,422,164円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	260,244,071円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(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(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(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)	1,927,959,684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)	45,030,010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)	150,198,795円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	90,081,664円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	20,867,630円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	59,158,293円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	29,282,601円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	360,180円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	7,872,702円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	93,474,044円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,734,334,213円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,098,490,683円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,216,507,763円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	54,190,575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)	129,518,890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)	1,597,146,325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)	101,779,246円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	548,116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)	1,605,453,024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)	32,051,842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)	264,839,337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)	465,519,383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)	798,935,275円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	203,070,561円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	95,507,648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>	252,040,406円
コア資産形成ファンド	148,890,039円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	18,384,500,862円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	29,908,755,893円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	18,532,995,722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]	448,028,025円
計	438,127,800,594円
2. 受益権の総数	438,127,800,594口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年5月12日 至 2023年11月13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11月13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11月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	10,582,602,150
地方債証券	314,266,007
特殊債券	445,225,351
社債券	210,492,790
合計	11,552,586,298

(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11月13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11月13日現在
1口当たり純資産額	1.2227円

(1万口当たり純資産額)

(12,227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11月13日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	444回 利付国庫債券(2年)	2,700,000,000	2,701,053,000	
	445回 利付国庫債券(2年)	2,400,000,000	2,400,720,000	
	446回 利付国庫債券(2年)	1,900,000,000	1,900,361,000	
	447回 利付国庫債券(2年)	2,600,000,000	2,600,338,000	
	448回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,140,000	
	449回 利付国庫債券(2年)	5,600,000,000	5,599,552,000	
	450回 利付国庫債券(2年)	2,200,000,000	2,199,450,000	
	452回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	499,550,000	
	453回 利付国庫債券(2年)	4,700,000,000	4,693,373,000	
	142回 利付国庫債券(5年)	2,930,000,000	2,934,482,900	
	143回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,705,439,000	
	144回 利付国庫債券(5年)	4,530,000,000	4,536,477,900	
	145回 利付国庫債券(5年)	6,900,000,000	6,906,348,000	
	146回 利付国庫債券(5年)	5,200,000,000	5,202,132,000	
	147回 利付国庫債券(5年)	3,250,000,000	3,242,005,000	
	148回 利付国庫債券(5年)	4,210,000,000	4,195,812,300	
	149回 利付国庫債券(5年)	2,380,000,000	2,369,528,000	
	150回 利付国庫債券(5年)	4,570,000,000	4,543,951,000	
	151回 利付国庫債券(5年)	1,900,000,000	1,886,111,000	
	152回 利付国庫債券(5年)	1,890,000,000	1,882,137,600	

153回 利付国庫債券(5年)	5,410,000,000	5,360,823,100	
154回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	4,963,800,000	
155回 利付国庫債券(5年)	1,800,000,000	1,798,542,000	
156回 利付国庫債券(5年)	3,600,000,000	3,582,504,000	
157回 利付国庫債券(5年)	1,900,000,000	1,887,384,000	
158回 利付国庫債券(5年)	3,600,000,000	3,560,688,000	
159回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,072,952,000	
160回 利付国庫債券(5年)	900,000,000	892,476,000	
161回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	995,930,000	
162回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	994,060,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	125,747,600	
2回 利付国庫債券(40年)	330,000,000	363,082,500	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	592,903,800	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	790,149,600	
5回 利付国庫債券(40年)	710,000,000	748,588,500	
6回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	969,215,200	
7回 利付国庫債券(40年)	1,080,000,000	1,061,920,800	
8回 利付国庫債券(40年)	1,190,000,000	1,082,673,900	
9回 利付国庫債券(40年)	2,090,000,000	1,384,290,600	
10回 利付国庫債券(40年)	1,830,000,000	1,425,881,100	
11回 利付国庫債券(40年)	1,240,000,000	926,664,400	
12回 利付国庫債券(40年)	1,520,000,000	1,008,200,800	
13回 利付国庫債券(40年)	2,090,000,000	1,371,019,100	
14回 利付国庫債券(40年)	2,000,000,000	1,403,660,000	
15回 利付国庫債券(40年)	2,240,000,000	1,731,318,400	
16回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	762,120,000	
338回 利付国庫債券(10年)	3,230,000,000	3,247,797,300	
339回 利付国庫債券(10年)	3,980,000,000	4,004,755,600	
340回 利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,321,318,000	
341回 利付国庫債券(10年)	3,620,000,000	3,636,652,000	

342回 利付国庫債券(10年)	3,520,000,000	3,519,155,200	
343回 利付国庫債券(10年)	4,090,000,000	4,086,278,100	
344回 利付国庫債券(10年)	3,570,000,000	3,563,895,300	
345回 利付国庫債券(10年)	4,890,000,000	4,876,405,800	
346回 利付国庫債券(10年)	4,840,000,000	4,819,865,600	
347回 利付国庫債券(10年)	4,700,000,000	4,673,163,000	
348回 利付国庫債券(10年)	4,070,000,000	4,040,533,200	
349回 利付国庫債券(10年)	5,150,000,000	5,104,113,500	
350回 利付国庫債券(10年)	5,860,000,000	5,796,008,800	
351回 利付国庫債券(10年)	5,190,000,000	5,123,152,800	
352回 利付国庫債券(10年)	4,450,000,000	4,382,315,500	
353回 利付国庫債券(10年)	3,690,000,000	3,627,417,600	
354回 利付国庫債券(10年)	4,260,000,000	4,179,954,600	
355回 利付国庫債券(10年)	5,330,000,000	5,219,562,400	
356回 利付国庫債券(10年)	3,700,000,000	3,614,826,000	
357回 利付国庫債券(10年)	4,220,000,000	4,112,769,800	
358回 利付国庫債券(10年)	4,450,000,000	4,325,889,500	
359回 利付国庫債券(10年)	4,950,000,000	4,799,025,000	
360回 利付国庫債券(10年)	5,300,000,000	5,122,238,000	
361回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,623,984,000	
362回 利付国庫債券(10年)	4,810,000,000	4,616,445,600	
363回 利付国庫債券(10年)	4,170,000,000	3,988,062,900	
364回 利付国庫債券(10年)	5,450,000,000	5,193,141,500	
365回 利付国庫債券(10年)	5,430,000,000	5,156,545,200	
366回 利付国庫債券(10年)	5,080,000,000	4,849,114,000	

367回 利付国庫債券(10年)	5,300,000,000	5,044,169,000	
368回 利付国庫債券(10年)	5,050,000,000	4,791,642,000	
369回 利付国庫債券(10年)	5,020,000,000	4,879,841,600	
370回 利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	4,848,450,000	
371回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,602,192,000	
372回 利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,589,824,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	124,555,200	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	111,446,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	231,204,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	225,892,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	269,572,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	256,712,200	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	166,119,000	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	389,925,600	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	301,119,000	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	278,229,600	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	310,551,300	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	456,004,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	319,485,600	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	383,862,600	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	354,066,500	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	337,983,400	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	408,051,000	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	377,064,600	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	716,292,200	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	723,881,000	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	898,551,500	

29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	991,313,400	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,001,545,600	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	807,811,200	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,100,018,800	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,284,394,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,338,648,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,148,361,600	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,480,257,600	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,444,170,400	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	886,235,500	
39回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,279,417,700	
40回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,069,891,900	
41回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,081,878,400	
42回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,326,052,000	
43回 利付国庫債券(30年)	1,310,000,000	1,334,418,400	
44回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,150,362,600	
45回 利付国庫債券(30年)	1,350,000,000	1,324,525,500	
46回 利付国庫債券(30年)	1,770,000,000	1,733,555,700	
47回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,533,840,000	
48回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	1,552,462,200	
49回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,530,256,000	
50回 利付国庫債券(30年)	1,550,000,000	1,307,161,500	
51回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	1,210,204,800	
52回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,251,072,000	
53回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	973,987,000	



54回 利付国庫債券(30年)	1,590,000,000	1,327,538,700	
55回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	898,884,000	
56回 利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	945,823,800	
57回 利付国庫債券(30年)	1,530,000,000	1,265,386,500	
58回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,121,238,400	
59回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	897,713,600	
60回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	864,159,700	
61回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	843,823,600	
62回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	842,385,600	
63回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	800,668,000	
64回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	942,357,000	
65回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	939,289,000	
66回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	783,677,300	
67回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,039,706,700	
68回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,164,378,600	
69回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,131,412,400	
70回 利付国庫債券(30年)	1,440,000,000	1,113,004,800	
71回 利付国庫債券(30年)	1,480,000,000	1,140,902,400	
72回 利付国庫債券(30年)	1,490,000,000	1,145,571,600	
73回 利付国庫債券(30年)	1,590,000,000	1,219,259,700	
74回 利付国庫債券(30年)	1,390,000,000	1,156,327,100	
75回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,363,637,600	
76回 利付国庫債券(30年)	1,420,000,000	1,304,710,200	
77回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,445,460,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,283,828,000	

79回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,306,035,000	
80回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	402,736,000	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	185,108,400	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	71,798,300	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,081,600	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	257,545,000	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,589,000	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	93,003,300	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	414,408,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	145,301,800	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	72,962,400	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	176,837,400	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	617,458,600	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	126,146,400	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	125,865,600	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	623,140,300	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,535,800	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	497,264,700	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	116,692,400	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,228,440,000	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	391,867,000	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	711,828,100	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	590,194,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	127,914,000	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	708,252,600	

98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	171,089,600	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	804,330,000	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	896,101,200	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	250,286,000	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	545,880,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	173,958,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	118,602,000	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	691,590,400	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	542,680,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	650,316,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	740,970,300	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	376,684,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	478,143,600	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	503,672,400	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	806,222,600	
113回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,496,272,900	
114回 利付国庫債券(20年)	410,000,000	448,687,600	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	396,100,800	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	584,510,500	
117回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	515,453,700	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	606,420,750	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	507,397,900	
121回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	695,648,000	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	615,805,200	
123回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	385,612,500	

125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	666,126,000	
126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	558,852,900	
127回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	587,935,800	
128回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	403,044,700	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	984,838,400	
132回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,249,700	
133回 利付国庫債券(20年)	630,000,000	682,327,800	
134回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	216,748,000	
135回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	139,808,500	
136回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	384,332,400	
137回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	516,619,200	
138回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,123,292,600	
139回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,046,424,400	
140回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,422,350,000	
141回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,141,874,400	
142回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	466,863,900	
143回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,314,414,900	
144回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	794,610,000	
145回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,426,152,500	
146回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,415,235,200	
147回 利付国庫債券(20年)	2,490,000,000	2,661,187,500	
148回 利付国庫債券(20年)	2,530,000,000	2,677,448,400	
149回 利付国庫債券(20年)	2,590,000,000	2,739,002,700	
150回 利付国庫債券(20年)	2,730,000,000	2,856,426,300	
151回 利付国庫債券(20年)	3,060,000,000	3,133,654,200	

152回 利付国庫債券(20年)	2,540,000,000	2,597,048,400	
153回 利付国庫債券(20年)	2,340,000,000	2,414,201,400	
154回 利付国庫債券(20年)	2,520,000,000	2,567,930,400	
155回 利付国庫債券(20年)	2,480,000,000	2,466,682,400	
156回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,105,374,800	
157回 利付国庫債券(20年)	2,180,000,000	1,953,192,800	
158回 利付国庫債券(20年)	2,540,000,000	2,356,485,000	
159回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,097,356,800	
160回 利付国庫債券(20年)	2,120,000,000	2,003,824,000	
161回 利付国庫債券(20年)	2,460,000,000	2,286,102,600	
162回 利付国庫債券(20年)	2,130,000,000	1,971,187,200	
163回 利付国庫債券(20年)	2,230,000,000	2,055,011,900	
164回 利付国庫債券(20年)	2,450,000,000	2,217,029,500	
165回 利付国庫債券(20年)	2,050,000,000	1,846,517,000	
166回 利付国庫債券(20年)	1,740,000,000	1,607,046,600	
167回 利付国庫債券(20年)	2,150,000,000	1,919,584,500	
168回 利付国庫債券(20年)	1,790,000,000	1,565,856,200	
169回 利付国庫債券(20年)	1,920,000,000	1,644,345,600	
170回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,618,401,000	
171回 利付国庫債券(20年)	1,840,000,000	1,558,719,200	
172回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,354,518,200	
173回 利付国庫債券(20年)	1,560,000,000	1,331,070,000	
174回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,038,056,000	
175回 利付国庫債券(20年)	2,320,000,000	1,994,782,400	
176回 利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	1,968,501,000	

	177回 利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,463,647,500	
	178回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,036,280,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,026,632,000	
	180回 利付国庫債券(20年)	2,220,000,000	1,973,713,200	
	181回 利付国庫債券(20年)	2,010,000,000	1,813,522,500	
	182回 利付国庫債券(20年)	2,020,000,000	1,881,892,600	
	183回 利付国庫債券(20年)	1,960,000,000	1,918,075,600	
	184回 利付国庫債券(20年)	1,980,000,000	1,833,737,400	
	185回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,937,565,000	
	186回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	592,746,000	
	<b>国債証券 合計</b>	<b>465,895,000,000</b>	<b>449,504,516,150</b>	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,364,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	108,618,400	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	193,400,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	386,628,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	288,042,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	222,290,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	106,113,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,707,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	103,697,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	211,356,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	317,499,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,588,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	109,142,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	202,974,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,431,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	394,464,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	392,528,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	95,417,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	239,750,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,589,000	
	237回 神奈川県公募公債	200,000,000	195,780,000	

251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	191,578,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	284,715,000	
3回 神奈川県公募公債 30 年	100,000,000	116,161,000	
11回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	108,185,000	
16回 神奈川県公募公債 2 0年	300,000,000	327,456,000	
19回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	107,358,000	
413回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	99,204,000	
419回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	99,423,000	
464回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	190,062,000	
467回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	190,640,000	
469回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	189,666,000	
472回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	188,436,000	
474回 大阪府公募公債 1 0年	300,000,000	282,426,000	
10回 大阪府公募公債 20 年	200,000,000	213,056,000	
13回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	100,228,000	
14回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	91,564,000	
190回 大阪府公募公債 5 年	300,000,000	297,081,000	
26年度11回 京都府公募公 債	350,000,000	351,557,500	
29年度13回 京都府公募公 債	109,330,000	108,096,757	
令和2年度1回 京都府公募公 債	400,000,000	386,380,000	
令和2年度14回 京都府公募 公債	200,000,000	191,876,000	
26年度17回 兵庫県公募公 債	200,000,000	200,924,000	
令和元年度16回 兵庫県公募 公債	200,000,000	193,194,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公 債	100,000,000	95,402,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	111,923,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	207,496,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	310,776,000	

9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	102,238,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	101,082,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	193,512,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	96,055,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	190,692,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	103,675,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	103,779,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	201,616,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	103,724,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	325,572,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	327,312,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	107,707,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	209,506,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	145,852,500	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,590,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	195,154,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	210,354,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	98,666,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	191,790,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	80,636,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	84,409,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	193,680,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	169,200,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	215,235,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	109,262,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	105,578,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	314,349,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	100,402,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	99,711,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	196,424,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	193,804,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	95,908,000	



24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	103,573,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	142,778,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	107,444,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	109,537,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	317,676,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	201,596,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,706,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	188,734,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	101,400,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	99,971,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	90,256,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	191,242,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	104,569,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,580,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,012,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	604,086,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,575,000	
150回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,953,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,587,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,562,000	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,090,000	
160回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,255,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,815,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,530,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	397,336,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,010,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,112,000	

179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,370,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,258,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	292,206,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	484,810,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,505,000	
227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	474,520,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	472,185,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	98,140,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	191,576,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	100,304,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	198,062,000	
令和2年2回 大阪市公募公債	300,000,000	289,362,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	216,530,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	192,562,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	104,525,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	100,588,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	106,327,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	218,990,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	213,094,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	296,010,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	150,194,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	386,652,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	114,430,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	107,570,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	104,584,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	107,837,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	272,679,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	196,686,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	217,524,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	107,621,000	

	6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	107,291,000	
	11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	326,124,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	104,474,000	
	22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	110,985,000	
	30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	181,146,000	
	2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	83,659,000	
	26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	100,435,000	
	29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	182,530,000	
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	297,096,000	
	30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	90,917,000	
	令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	296,979,000	
	17回 さいたま市公募公債	200,000,000	193,540,000	
	令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	191,576,000	
	26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	100,430,000	
	30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	195,516,000	
地方債証券 合計		30,489,330,000	30,128,100,157	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	205,382,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	203,562,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	298,128,000	
	125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	416,145,000	
	127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,695,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	75,589,000	
	156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	378,076,000	
	33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,776,000	
	1回 高速道路機構債	300,000,000	361,263,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	174,678,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	231,118,000	
	36回 高速道路機構債	300,000,000	354,903,000	
	50回 高速道路機構債	300,000,000	257,124,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,779,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,172,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,863,000	
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	96,838,000		

162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	97,956,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	89,303,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	176,568,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	89,828,000	
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,739,000	
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,127,000	
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	536,015,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,304,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,909,000	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	301,632,000	
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	502,545,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,572,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,554,000	
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	188,134,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	496,755,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	91,898,000	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	298,719,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	178,672,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,418,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	794,656,000	
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	183,758,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	90,625,000	
398回 政保道路債	300,000,000	214,011,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	135,918,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	147,718,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	149,674,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	581,305,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	214,606,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	326,646,000	

2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	327,087,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	108,968,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,392,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	214,076,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	105,794,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	211,990,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,052,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,753,000	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	104,368,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	513,795,000	
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	294,312,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,442,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	201,790,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	295,368,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	398,292,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,401,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	91,824,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	496,425,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,269,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,933,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,483,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	245,409,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	216,441,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,840,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	214,656,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,581,820	

23回 国際協力銀行債券	100,000,000	103,884,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	102,469,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	202,058,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	151,614,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	105,353,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	100,501,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	216,744,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,341,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	379,799,000	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,608,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,729,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,792,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	258,572,500	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,034,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,564,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,564,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,745,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,802,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,062,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	495,695,000	
325回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	495,695,000	
40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,736,000	40,962,084	
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,851,000	15,376,131	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,970,000	97,993,795	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,608,000	146,977,775	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,971,000	20,634,436	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,072,000	17,656,545	
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,000,000	20,570,400	
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,051,000	21,635,375	
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,722,000	26,298,944	

6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,348,000	64,129,714	
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,596,000	29,059,541	
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,842,000	34,961,508	
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,509,000	35,623,694	
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,185,000	39,206,943	
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,581,000	40,313,165	
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,985,000	44,796,747	
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,773,000	50,808,986	
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,635,000	52,933,990	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	202,995,000	193,133,502	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,919,000	65,904,482	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,499,000	65,596,012	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,716,000	65,733,038	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	214,935,000	204,254,879	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	214,599,000	203,811,108	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,480,000	138,958,252	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	219,489,000	207,801,210	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	217,704,000	206,178,750	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	379,130,000	360,052,178	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,501,000	71,624,778	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,957,000	73,081,569	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	251,874,000	234,333,494	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	335,216,000	312,773,288	
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	258,324,000	241,122,204	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	263,907,000	246,362,462	

	170回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	805,419,000	749,837,034	
	6回 沖縄振興開発金融公庫債 券	400,000,000	412,064,000	
	21回 沖縄振興開発金融公庫 債券	100,000,000	100,743,000	
	い第843号 利付商工債	100,000,000	99,742,000	
	い第851号 利付商工債	300,000,000	297,885,000	
	い第854号 利付商工債	300,000,000	297,393,000	
	い第855号 利付商工債	200,000,000	198,154,000	
	369回 利附信金中金債(5 年)	400,000,000	398,896,000	
	377回 利附信金中金債(5 年)	300,000,000	298,101,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	106,027,000	
	72回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,628,000	
	77回 東日本高速道路社債	300,000,000	295,116,000	
	85回 中日本高速道路債券	300,000,000	298,959,000	
	87回 中日本高速道路債券	400,000,000	397,764,000	
	78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	100,291,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	189,972,000	
	<b>特殊債券 合計</b>	<b>28,911,099,000</b>	<b>28,490,256,333</b>	
社債券	25回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2 017)	300,000,000	292,572,000	
	11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債(20 16)	100,000,000	98,495,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	398,244,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	82,988,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,446,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	193,536,000	
	79回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,873,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,582,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,474,000	
	91回 中日本高速道路債券	500,000,000	495,635,000	
	25回 西日本高速道路社債	200,000,000	200,866,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	100,664,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	298,986,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	199,526,000	
	61回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,325,000	
	62回 西日本高速道路債券	500,000,000	495,630,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,264,000	
	10回 キリンホールディング ス社債	100,000,000	100,507,000	
	3回 ダイドーグループHD社 債	300,000,000	288,579,000	
	9回 野村不動産ホールディン グス社債	100,000,000	92,020,000	



12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	100,830,000	
14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,202,000	
30回 東レ社債	300,000,000	297,024,000	
42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	198,446,000	
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	179,558,000	
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,007,000	
17回 ダイセル社債	300,000,000	286,671,000	
16回 武田薬品工業社債	500,000,000	468,625,000	
4回 ENEOSホールディングス社債	300,000,000	286,044,000	
14回 プリヂストン社債	300,000,000	292,602,000	
35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	297,165,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	99,733,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	95,034,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	187,722,000	
58回 川崎重工業社債	300,000,000	280,812,000	
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	98,363,000	
26回 トヨタ自動車社債	200,000,000	198,604,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	88,817,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	387,252,000	
12回 新生銀行社債	400,000,000	398,592,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	105,977,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,246,000	
20回 三井住友信託銀行社債	300,000,000	296,889,000	
11回 セブン銀行社債	200,000,000	200,654,000	
28回 芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,522,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	295,800,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	383,388,000	
69回 ホンダファイナンス社債	300,000,000	297,237,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,767,000	
96回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,244,000	
80回 日立キャピタル社債	200,000,000	191,382,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	284,019,000	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	97,167,000	
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,240,000	
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,654,000	

31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	190,870,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	296,046,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	295,917,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	99,829,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	198,684,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	102,122,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	86,702,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	308,727,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	206,732,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	107,764,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,372,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	215,274,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	90,188,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	82,789,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	88,826,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,137,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	67,783,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,732,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	164,338,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	144,130,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,757,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	191,942,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	73,522,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	68,148,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	94,303,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	163,840,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,606,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	126,154,800	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	66,453,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	287,520,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	190,104,000	
12回 ソフトバンク社債	400,000,000	387,000,000	
30回 光通信社債	200,000,000	182,514,000	
527回 中部電力社債	100,000,000	87,621,000	
532回 中部電力社債	200,000,000	192,028,000	
497回 関西電力社債	100,000,000	101,069,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	298,128,000	
530回 関西電力社債	400,000,000	387,368,000	
531回 関西電力社債	200,000,000	164,002,000	
541回 関西電力社債	300,000,000	278,823,000	
396回 中国電力社債	200,000,000	187,622,000	
425回 中国電力社債	100,000,000	95,293,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	101,562,000	
311回 北陸電力社債	100,000,000	100,533,000	
488回 東北電力社債	100,000,000	99,327,000	

5 2 1回	東北電力社債	400,000,000	383,124,000	
5 2 5回	東北電力社債	200,000,000	196,158,000	
5 3 6回	東北電力社債	300,000,000	277,374,000	
3 2 0回	四国電力社債	300,000,000	280,056,000	
4 6 3回	九州電力社債	100,000,000	85,613,000	
4 6 6回	九州電力社債	100,000,000	84,389,000	
4 9 1回	九州電力社債	300,000,000	280,137,000	
4 9 2回	九州電力社債	100,000,000	78,750,000	
4 9 3回	九州電力社債	200,000,000	198,100,000	
5 0 7回	九州電力社債	200,000,000	187,754,000	
3 2 1回	北海道電力社債	261,000,000	262,902,690	
3 4 0回	北海道電力社債	300,000,000	298,383,000	
3 5 0回	北海道電力社債	200,000,000	170,640,000	
1 3回	電源開発社債	200,000,000	205,574,000	
5 4回	電源開発社債	100,000,000	98,634,000	
7 5回	電源開発社債	200,000,000	185,034,000	
4 1回	東京瓦斯社債	200,000,000	178,626,000	
5 2回	東京瓦斯社債	100,000,000	84,000,000	
5 5回	東京瓦斯社債	100,000,000	80,563,000	
5 7回	東京瓦斯社債	300,000,000	190,395,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	197,026,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	178,778,000	
社債券 合計		25,181,000,000	24,085,713,490	
合計			532,208,586,130	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,042,889,459
コール・ローン	3,736,562,282
国債証券	247,047,830,394
派生商品評価勘定	8,518,226
未収利息	1,875,036,679
前払費用	248,761,774
流動資産合計	253,959,598,814
資産合計	253,959,598,814
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,292
未払金	3,624,821,460
未払解約金	88,507,000
流動負債合計	3,713,466,752
負債合計	3,713,466,752
純資産の部	
元本等	
元本	111,298,961,852
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	138,947,170,210
元本等合計	250,246,132,062
純資産合計	250,246,132,062
負債純資産合計	253,959,598,814

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年5月12日 至 2023年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月13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	102,110,959,132円
同期中追加設定元本額	23,497,764,660円
同期中一部解約元本額	14,309,761,940円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,784,598,315円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,189,821円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	14,092,058円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	34,788,517円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	30,569,496円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	42,934,640円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	29,483,387円
たわらノーロード 先進国債券	19,441,971,650円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	362,345,318円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,981,453,885円
たわらノーロード バランス（堅実型）	68,713,345円
たわらノーロード バランス（標準型）	372,922,404円
たわらノーロード バランス（積極型）	82,137,976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）	16,118,053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）	1,034,152,062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）	1,834,924,103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）	898,429,226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）	552,553,875円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,853,155円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,450,561円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	194,708,399円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	16,171,035円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	25,009,425円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,770,354,605円
O n e D C 先進国債券インデックスファンド	1,243,476,505円

Oneグローバルバランス	44,761,523円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	741,020,446円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,399,514,656円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,802,663,389円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	416,179,266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	799,847,587円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,923,572円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	900,485,447円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	36,065,068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)	160,868,965円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	255,538,529円
クルーズコントロール	800,542,215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>	763,238,250円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	684,522,847円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	178,379,721円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	434,500,962円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	8,667,120円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	72,395,001円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	989,890,513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)	599,931,342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)	601,838,414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)	147,240,694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)	362,720,797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)	592,108,761円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	1,576,337,988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)	460,369,384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)	532,026,838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)	538,748,017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)	4,723,514,997円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,383,320,273円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,513,277,087円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,275,066,610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)	200,985,545円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	44,153,123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)	990,653,939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)	334,920,368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)	200,921,136円

DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,631,277円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	21,974,269円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,528,922円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	50,401円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	4,387,631円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	34,719,816円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,330,726,053円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,265,119,410円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,344,539,773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)	50,322,676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)	101,048,537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)	1,183,954,762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)	205,618,093円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	152,854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)	223,065,907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)	258,829,926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)	355,340,774円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	34,496,911円
動的パッケージファンド<DC年金>	51,874,906円
コア資産形成ファンド	29,680,821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>	3,341,547,259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>	11,752,744,392円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	6,130,196,583円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	4,923,826,659円
計	111,298,961,852円
2. 受益権の総数	111,298,961,852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 2023年5月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月13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)は短時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11月13日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	5,972,267,651	
合計	5,972,267,651	

(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11月13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11月13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	3,154,400,000	-	3,162,779,934	8,379,934
アメリカ・ドル	1,539,814,000	-	1,543,439,425	3,625,425
イギリス・ポンド	173,089,000	-	173,525,100	436,100
イスラエル・シェケル	47,843,000	-	47,704,708	138,292
オフショア・人民元	227,923,000	-	228,079,051	156,051
カナダ・ドル	68,263,000	-	68,427,021	164,021
メキシコ・ペソ	30,994,000	-	31,295,234	301,234



ユーロ	1,066,474,000	-	1,070,309,395	3,835,395
合計	3,154,400,000	-	3,162,779,934	8,379,934

## (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。

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。

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2023年11月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,2484円 (22,484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11月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/31/25	1,690,000.000	1,566,649.800	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,233,876.940	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,498,746.100	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,293,123.830	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,402,492.190	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,644,531.240	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,155,828.110	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,386,750.000	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,223,483.600	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,227,337.870	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,725,738.290	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,632,812.480	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,675,820.670	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,680,523.810	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,050,836.910	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,569,784.370	
US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,390,257.030			

US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,614,028.890	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,106,139.080	
US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,790,249.980	
US T N/B 0.625 05/15/30	6,150,000.000	4,761,445.300	
US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,558,125.000	
US T N/B 0.625 08/15/30	8,240,000.000	6,325,487.470	
US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,316,980.450	
US T N/B 0.625 12/31/27	5,320,000.000	4,510,985.930	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,722,828.910	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,194,028.150	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,428,593.710	
US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,077,556.250	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,425,416.020	
US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,492,977.670	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,810,000.000	4,344,594.910	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,010,000.000	3,592,082.810	
US T N/B 0.875 11/15/30	9,480,000.000	7,371,440.560	
US T N/B 1.0 07/31/28	4,770,000.000	4,031,022.630	
US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,399,668.750	
US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,649,057.800	
US T N/B 1.125 02/15/31	9,690,000.000	7,640,337.850	
US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,825,587.090	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	979,343.750	
US T N/B 1.125 02/29/28	4,090,000.000	3,526,826.170	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	1,891,183.590	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,460,000.000	2,535,928.120	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,163,360.550	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,037,141.380	
US T N/B 1.25 03/31/28	5,010,000.000	4,331,888.660	
US T N/B 1.25 04/30/28	5,100,000.000	4,398,152.330	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,880,000.000	2,291,026.570	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,560,480.850	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,183,136.510	
US T N/B 1.25 08/15/31	10,660,000.000	8,329,374.230	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,237,668.750	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,231,101.580	
US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,496,897.240	
US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	715,400.380	
US T N/B 1.375 08/15/50	6,870,000.000	3,336,243.750	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,800,000.000	2,548,437.490	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,024,290.220	
US T N/B 1.375 11/15/31	9,190,000.000	7,199,431.640	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	2,562,806.240	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	3,910,718.740	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,740,000.000	5,184,385.890	
US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,340,273.430	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,130,000.000	3,425,157.420	
US T N/B 1.5 08/15/26	7,030,000.000	6,425,859.370	
US T N/B 1.5 11/30/24	8,000,000.000	7,686,640.080	

US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,289,453.100	
US T N/B 1.625 02/15/26	6,090,000.000	5,659,893.750	
US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,773,767.990	
US T N/B 1.625 05/15/31	11,040,000.000	8,953,612.410	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,363,679.670	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,418,794.910	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,199,313.260	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,980,000.000	3,119,177.310	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,648,231.250	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	3,893,730.480	
US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,819,296.880	
US T N/B 1.75 08/15/41	6,110,000.000	3,808,725.800	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,850,000.000	2,424,726.560	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,912,421.080	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,925,375.000	
US T N/B 1.875 02/15/32	9,280,000.000	7,528,037.500	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,200,000.000	3,359,484.380	
US T N/B 1.875 02/15/51	5,780,000.000	3,224,382.000	
US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,294,125.000	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,476,562.480	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,670,637.500	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,500,000.000	2,311,914.050	
US T N/B 1.875 11/15/51	4,670,000.000	2,591,667.570	
US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,958,599.220	
US T N/B 2.0 02/15/50	4,420,000.000	2,564,635.930	
US T N/B 2.0 08/15/25	3,550,000.000	3,365,913.080	
US T N/B 2.0 08/15/51	6,110,000.000	3,510,266.580	
US T N/B 2.0 11/15/26	3,830,000.000	3,530,033.200	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	2,762,998.050	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,776,030.250	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,250,000.000	2,102,080.060	
US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,721,263.750	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,494,285.140	
US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	2,627,703.120	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,104,449.220	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,034,088.250	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,880,593.760	
US T N/B 2.25 08/15/46	3,370,000.000	2,127,575.750	
US T N/B 2.25 08/15/49	4,140,000.000	2,557,420.310	
US T N/B 2.25 11/15/24	2,080,000.000	2,016,885.650	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	4,848,999.960	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	2,976,594.140	
US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,899,570.320	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,496,822.630	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,562,890.640	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,939,940.620	
US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,090,482.040	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,270,000.000	2,905,062.890	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,560,000.000	3,511,270.310	

US T N/B 2.375 11/15/49	3,790,000.000	2,408,278.510	
US T N/B 2.5 01/31/25	500,000.000	483,496.090	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,564,664.050	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,183,445.500	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,160,210.920	
US T N/B 2.5 03/31/27	4,000,000.000	3,722,343.750	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,230,000.000	1,486,739.260	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,339,978.900	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,830,000.000	4,368,508.560	
US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,727,524.800	
US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,893,652.340	
US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,572,149.810	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,753,286.330	
US T N/B 2.625 12/31/25	3,000,000.000	2,856,445.320	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,200,032.040	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,897,792.960	
US T N/B 2.75 04/30/27	6,000,000.000	5,618,906.280	
US T N/B 2.75 05/15/25	2,200,000.000	2,122,226.560	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	2,988,626.940	
US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,001,304.680	
US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,562,896.080	
US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	6,772,718.750	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	908,300.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,546,888.270	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,756,085.160	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,134,238.890	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,559,487.290	
US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,934,101.560	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,800,000.000	3,468,687.500	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,860,000.000	4,502,524.190	
US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,049,410.100	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,694,689.440	
US T N/B 2.875 05/15/49	6,100,000.000	4,316,226.530	
US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,184,130.440	
US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,516,736.520	
US T N/B 2.875 06/15/25	2,420,000.000	2,335,016.400	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,119,261.710	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,642,631.040	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,278,583.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	771,967.960	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,360,000.000	3,220,087.510	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,660,000.000	1,942,994.920	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	1,925,028.300	
US T N/B 3.0 02/15/49	4,610,000.000	3,341,349.600	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	826,706.240	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	955,809.370	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,181,460.940	
US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,090,375.000	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,810,000.000	2,763,663.840	

US T N/B 3.0 08/15/52	3,740,000.000	2,713,107.020	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,684,990.220	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,183,278.900	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,160,737.490	
US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	633,947.650	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,066,218.740	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,740,000.000	1,345,339.430	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,104,149.200	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,929,216.980	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,592,604.490	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,940,000.000	3,720,991.390	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,862,900.790	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,480,000.000	5,098,326.540	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	802,453.120	
US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	2,988,759.350	
US T N/B 3.25 06/30/27	4,200,000.000	3,993,773.440	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,300,000.000	3,063,714.850	
US T N/B 3.375 05/15/33	3,500,000.000	3,163,945.330	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,930,000.000	1,535,028.510	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,359,953.110	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,950,000.000	3,074,288.050	
US T N/B 3.5 01/31/28	3,380,000.000	3,225,523.450	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,500,000.000	2,338,964.850	
US T N/B 3.5 02/15/33	8,200,000.000	7,499,476.520	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,000,000.000	861,367.180	
US T N/B 3.5 04/30/28	6,500,000.000	6,194,042.980	
US T N/B 3.5 04/30/30	2,000,000.000	1,867,968.760	
US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,916,562.500	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,351,849.410	
US T N/B 3.625 02/15/53	3,700,000.000	3,042,671.860	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,800,000.000	3,641,468.750	
US T N/B 3.625 03/31/30	3,500,000.000	3,294,580.060	
US T N/B 3.625 05/15/26	3,500,000.000	3,395,957.040	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,510,000.000	2,886,975.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,223,516.590	
US T N/B 3.75 04/15/26	6,000,000.000	5,840,625.000	
US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,315,087.890	
US T N/B 3.75 06/30/30	5,700,000.000	5,396,074.230	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,220,000.000	1,054,466.010	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,236,665.620	
US T N/B 3.875 01/15/26	4,300,000.000	4,201,738.290	
US T N/B 3.875 02/15/43	3,500,000.000	3,034,609.370	
US T N/B 3.875 03/31/25	1,050,000.000	1,030,476.560	
US T N/B 3.875 05/15/43	800,000.000	692,812.490	
US T N/B 3.875 08/15/33	2,500,000.000	2,352,343.750	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,142,002.710	
US T N/B 3.875 09/30/29	2,950,000.000	2,825,085.930	
US T N/B 3.875 11/30/27	3,000,000.000	2,907,539.070	
US T N/B 3.875 11/30/29	4,800,000.000	4,592,249.990	

US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,457,148.420	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,676,953.130	
US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	3,918,046.880	
US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	2,886,210.930	
US T N/B 4.0 02/29/28	3,200,000.000	3,114,124.990	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,500,000.000	2,409,667.970	
US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	2,758,153.130	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,860,000.000	4,284,963.270	
US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,057,200.000	
US T N/B 4.125 01/31/25	1,800,000.000	1,774,652.340	
US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,613,710.910	
US T N/B 4.125 09/30/27	3,920,000.000	3,836,546.880	
US T N/B 4.125 10/31/27	4,940,000.000	4,833,288.280	
US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,305,203.140	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	892,666.000	
US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,940,312.470	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,300,000.000	1,205,039.040	
US T N/B 4.25 12/31/24	5,500,000.000	5,434,472.670	
US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	579,468.740	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,210,000.000	1,143,969.910	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,630,000.000	1,530,417.180	
US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	3,949,218.760	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	949,101.560	
US T N/B 4.5 02/15/36	700,000.000	694,667.960	
US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	585,773.430	
US T N/B 4.5 07/15/26	7,100,000.000	7,035,101.590	
US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	945,470.290	
US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,533,463.260	
US T N/B 4.5 11/30/24	4,200,000.000	4,161,490.780	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,690,000.000	1,649,400.380	
US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,604,618.350	
US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,480,039.080	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,211,982.410	
US T N/B 5.0 05/15/37	755,000.000	781,690.420	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,380,533.200	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,160,000.000	1,212,653.110	
US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,449,593.730	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,200,000.000	1,258,968.740	
US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	823,930.070	
アメリカ・ドル 小計	912,200,000.000 (138,389,862,000)	785,575,858.190 (119,179,713,448)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,597,364.300
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,131,760.510
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	1,800,000.000	1,706,130.000
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,661,681.280

UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,130,000.000	1,901,250.780	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,520,000.000	1,176,409.040	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,980,000.000	1,637,695.620	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	527,152.000	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	998,268.140	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,650,000.000	1,076,988.000	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,190,000.000	452,577.460	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,370,000.000	646,420.800	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,800,000.000	1,309,820.400	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,330,000.000	1,103,429.440	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,670,000.000	2,073,762.300	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,610,000.000	997,300.650	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	257,842.340	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	990,055.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,930,000.000	899,959.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,200,000.000	703,476.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,000,000.000	1,859,716.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,700,000.000	917,849.710	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,110,000.000	541,779.900	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	915,469.150	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	635,495.300	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	369,184.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	830,000.000	466,717.300	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	576,069.930	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,890,000.000	1,346,747.850	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,060,926.900	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	766,712.500	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,840,000.000	1,481,384.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,100,000.000	1,931,567.400	

	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,550,000.000	1,288,050.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,480,000.000	1,175,593.600	
	UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,500,000.000	1,469,025.000	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,100,000.000	1,000,049.600	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	819,120.940	
	UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,511,172.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	795,583.960	
	UK TREASURY 4.0 10/22/63	520,000.000	457,860.000	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,190,000.000	2,171,767.810	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,300,000.000	1,271,140.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,820,000.000	1,824,928.560	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,012,248.470	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,310,000.000	1,310,929.830	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,014,619.570	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,186,029.560	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,317,000.000	1,214,047.470	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,512,000.000	1,394,246.630	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,050,000.000	1,058,493.030	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,209,240.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,865,000.000	1,811,579.680	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,495,000.000	1,547,957.080	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,380,000.000	1,399,747.800	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,485,000.000	1,490,571.110	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,080,000.000	1,167,824.520	
	イギリス・ボンド 小計	82,614,000.000 (15,320,766,300)	66,320,789.220 (12,299,190,361)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	320,000.000	309,826.240	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,930,000.000	1,787,048.760	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,800,240.120	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,362,111.180	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,200,000.000	949,209.600	



	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,720,000.000	1,189,873.640	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,925,808.000	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	960,000.000	650,253.120	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,560,000.000	1,466,551.320	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,360,000.000	2,180,979.840	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,910,000.000	1,621,714.150	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,110,000.000	1,223,079.030	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,299,486.660	
	イスラエル・シュケル 小計	21,040,000.000 (826,061,960)	18,766,181.660 (736,788,441)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,390,000.000	1,332,676.810	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,346,811.040	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	2,315,000.000	2,084,811.900	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,170,000.000	1,657,448.850	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,320,208.240	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,634,972.260	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,010,000.000	1,623,415.090	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	2,020,000.000	1,050,445.330	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,250,000.000	1,780,762.700	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,230,000.000	1,128,588.400	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,060,000.000	1,837,099.440	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,020,000.000	761,093.090	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	538,920.850	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,430,000.000	1,351,052.090	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	900,000.000	837,413.580	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,280,065.570	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,340,000.000	974,956.400	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	2,070,000.000	1,803,878.410	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,700,000.000	1,673,374.270	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,400,000.000	1,326,688.610	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	677,234.960	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,100,000.000	991,213.020	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	748,024.610		
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,800,000.000	1,669,224.180		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,600,371.660		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,647,109.610		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,790,000.000	1,819,020.370		
	オーストラリア・ドル 小計	42,215,000.000 (4,067,415,250)	36,496,881.340 (3,516,474,517)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	30,000,000.000	29,795,347.200	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	19,931,066.590	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,472,133.890	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	49,500,000.000	49,440,400.510	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,732,542.660	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	39,500,000.000	39,493,598.620	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	25,000,000.000	24,891,399.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	26,000,000.000	25,951,284.320	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,108,800.060	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,421,737.790	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	14,300,000.000	14,188,355.750	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	17,500,000.000	17,515,660.750	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	47,600,000.000	47,689,340.440	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	33,600,000.000	33,858,659.520	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	27,000,000.000	26,980,842.420	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,000,000.000	20,094,126.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	22,000,000.000	22,177,751.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,047,691.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	26,000,000.000	26,242,041.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,137,755.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,103,242.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	33,300,000.000	33,629,480.190	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	23,500,000.000	23,821,731.450	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	3,000,000.000	3,055,859.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	15,100,000.000	15,342,368.590	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	29,100,000.000	29,637,971.700	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	30,500,000.000	31,220,968.150	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	16,500,000.000	16,964,169.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	41,000,000.000	41,689,066.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	7,500,000.000	7,638,265.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,272,840.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	18,923,493.420	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,150,080.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	19,320,000.000	20,376,249.510	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	16,100,000.000	17,123,813.490	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	16,450,000.000	17,932,615.470	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,240,856.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	6,600,000.000	7,429,589.640	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	12,500,000.000	14,254,166.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	5,800,000.000	6,654,857.360	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	4,000,000.000	4,743,067.600	
	オフショア・人民元 小計	844,020,000.000 (17,518,732,326)	857,375,289.940 (17,795,938,731)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,283,909.980	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,148,788.850	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,062,678.400	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	495,654.080	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,670,000.000	1,528,789.720	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	669,199.230	
	CANADA 1.25 03/01/27	910,000.000	829,556.990	
	CANADA 1.25 06/01/30	2,350,000.000	1,995,522.560	
	CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,051,916.960	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,587,360.480	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,770,000.000	2,341,662.170	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,420,000.000	2,026,174.140	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,440,417.690	
	CANADA 2.0 06/01/28	830,000.000	765,256.730	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,540,000.000	1,331,845.520	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,460,000.000	2,468,191.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,272,737.970	

	CANADA 2.25 06/01/29	530,000.000	488,361.610	
	CANADA 2.25 12/01/29	700,000.000	641,200.980	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,362,271.420	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,180,000.000	1,077,082.420	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,250,000.000	1,192,672.070	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,160,000.000	988,577.290	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	319,797.020	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,400,000.000	1,356,117.320	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,660,000.000	1,613,720.420	
	CANADA 3.0 11/01/24	860,000.000	843,952.860	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,800,000.000	1,746,232.820	
	CANADA 3.25 12/01/33	1,100,000.000	1,047,315.990	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,130,000.000	1,107,781.430	
	CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	392,362.180	
	CANADA 3.5 12/01/45	980,000.000	949,532.110	
	CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,144,730.010	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	587,141.860	
	CANADA 5.0 06/01/37	530,000.000	592,509.370	
	CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	809,108.040	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	701,105.240	
	カナダ・ドル 小計	49,490,000.000 (5,436,971,400)	44,261,234.930 (4,862,539,269)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	280,000.000	264,416.600	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	480,675.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	1,140,000.000	1,026,000.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	840,000.000	671,364.170	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	409,667.700	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	590,000.000	572,595.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	890,000.000	811,680.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	765,492.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	173,700.850	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	340,000.000	333,098.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	460,000.000	438,880.440	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	632,289.900	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	590,000.000	582,920.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	198,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	611,320.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	130,375.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	580,000.000	593,864.900	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	806,560.000		
	シンガポール・ドル 小計	10,105,000.000 (1,126,909,600)	9,503,299.560 (1,059,807,967)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,039,615.200	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,088,449.240	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,910,000.000	3,470,304.340	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	8,210,000.000	7,727,589.160	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	2,500,000.000	2,266,190.960	

	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,050,000.000	3,874,604.220	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,834,613.460	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,670,000.000	3,912,513.600	
スウェーデン・クローナ 小計		36,570,000.000 (508,688,700)	34,213,880.180 (475,915,073)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,200,000.000	2,126,049.850	
	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,056,634.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,260,000.000	2,021,812.180	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,850,000.000	4,433,304.000	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,290,000.000	4,629,916.960	
	DENMARK 1.75 11/15/25	6,740,000.000	6,567,860.400	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,400,000.000	1,315,928.600	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,230,000.000	9,687,749.440	
デンマーク・クローネ 小計		38,050,000.000 (826,826,500)	34,839,255.430 (757,057,020)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	650,000.000	527,747.240	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	518,679.960	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	684,904.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	239,905.640	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	910,000.000	717,874.560	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	720,000.000	695,002.710	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	810,000.000	616,696.930	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	540,000.000	347,722.770	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	650,000.000	589,463.510	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	450,000.000	396,215.210	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	120,624.930	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	788,221.370	
ニュージーランド・ドル 小計		7,520,000.000 (671,611,200)	6,243,058.830 (557,567,584)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,950,000.000	2,439,886.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,510,000.000	3,861,944.570	
	NORWAY 1.5 02/19/26	6,710,000.000	6,340,111.250	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,600,000.000	3,354,120.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,130,000.000	1,094,245.670	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,605,209.400	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,911,624.300	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,830,000.000	2,481,451.540	
	NORWAY 3.0 08/15/33	2,900,000.000	2,701,321.000	
NORWAY 3.5 10/06/42	2,200,000.000	2,172,398.800		
ノルウェー・クローネ 小計		31,820,000.000 (434,024,800)	28,962,312.530 (395,045,943)	

ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,629,136.560	
	POLAND 0.75 04/25/25	4,170,000.000	3,912,610.920	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,370,000.000	3,356,439.680	
	POLAND 1.75 04/25/32	4,820,000.000	3,606,940.960	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,290,000.000	3,066,806.400	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,142,290.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,113,512.140	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,743,032.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,538,134.200	
	POLAND 3.75 05/25/27	3,650,000.000	3,472,905.650	
	POLAND 5.75 04/25/29	2,190,000.000	2,220,103.740	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,400,000.000	3,686,013.100	
ポーランド・ズロチ 小計		37,180,000.000 (1,360,483,124)	33,487,925.350 (1,225,383,467)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,100,000.000	1,006,591.040	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	645,095.480	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,357,519.330	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,992,515.960	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,404,587.370	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,778,021.200	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,645,624.890	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	699,573.430	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,007,192.800	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,742,117.780	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,673,060.540	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,920,000.000	1,939,131.260	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,950,000.000	1,967,751.430	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,609,585.620	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	681,634.270	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,400,000.000	1,428,507.640	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,068,342.550	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	2,000,000.000	2,021,905.600	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,240,024.320	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,033,414.200	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	950,000.000	1,007,806.740		
MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,600,000.000	1,692,076.300		
MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	314,674.080		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,808,844.370		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,142,247.730		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,734,460.320		
マレーシア・リングgit 小計		38,200,000.000 (1,230,227,180)	38,642,306.250 (1,244,471,609)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	25,080,000.000	22,084,695.600	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	11,680,000.000	10,903,280.000	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	16,790,000.000	14,561,463.300	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	12,290,000.000	10,257,479.800	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	8,000,000.000	7,406,000.000	

	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	5,622,344.400	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	14,702,000.000	14,557,495.500	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	36,282,000.000	32,980,621.720	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	28,146,000.000	26,209,836.660	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	35,148,000.000	31,624,413.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	23,907,000.000	19,767,742.020	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	9,335,000.000	8,141,706.950	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	21,061,000.000	17,668,283.510	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	23,159,000.000	22,106,655.040	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,123,005.380	
	メキシコ・ペソ 小計	286,707,000.000 (2,464,160,653)	258,015,022.880 (2,217,561,717)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,180,000.000	971,053.860	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,310,000.000	1,040,595.880	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	140,000.000	133,545.580	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	570,000.000	490,690.770	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	450,000.000	249,660.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	680,000.000	453,832.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,420,000.000	1,243,851.840	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,070,000.000	982,201.150	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	410,000.000	161,312.040	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	935,000.000	850,934.150	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	307,270.230	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,190,000.000	1,113,830.480	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	122,023.750	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	1,100,000.000	914,124.200	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	940,000.000	905,815.960	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	740,000.000	501,124.300	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	99,693.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	590,000.000	423,578.700	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	447,372.540	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	254,367.360	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	870,000.000	797,537.750	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,100,000.000	1,064,923.200	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	640,000.000	604,058.880	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	200,000.000	184,711.600	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	310,000.000	325,612.220	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,078,960.470	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,210,000.000	1,256,061.180	

AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	682,392.930	
BELGIUM 0.0 10/22/27	1,080,000.000	962,137.440	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	809,501.680	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,300,000.000	1,071,655.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,250,000.000	980,875.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	1,150,000.000	684,937.700	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	320,086.920	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,380,000.000	1,327,518.720	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,260,000.000	1,167,629.400	
BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	852,016.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,200,000.000	1,071,366.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,460,000.000	1,386,141.150	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,570,000.000	1,343,425.450	
BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	679,641.840	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,490,000.000	857,539.700	
BELGIUM 1.45 06/22/37	480,000.000	371,741.760	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	608,699.600	
BELGIUM 1.7 06/22/50	880,000.000	571,287.200	
BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	491,592.900	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	301,455.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	277,313.010	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	286,490.880	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,300,000.000	1,266,128.500	
BELGIUM 3.0 06/22/34	980,000.000	946,974.980	
BELGIUM 3.3 06/22/54	270,000.000	242,284.500	
BELGIUM 3.45 06/22/43	100,000.000	95,482.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	636,654.720	
BELGIUM 4.0 03/28/32	930,000.000	983,330.850	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,280,000.000	1,369,340.160	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,103,908.300	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,420,000.000	1,623,562.680	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,770,000.000	1,955,485.380	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,510,000.000	3,276,830.700	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,519,226.890	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,610,000.000	1,468,638.780	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,860,000.000	1,715,496.600	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,650,000.000	2,500,752.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,275,642.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,280,000.000	2,164,837.200	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,700,000.000	1,614,048.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,100,000.000	2,059,470.000	
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	1,350,000.000	1,331,424.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,520,000.000	1,295,876.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,340,000.000	1,943,089.200	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,500,000.000	2,018,482.500	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,360,000.000	989,876.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,880,000.000	1,321,997.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,030,000.000	1,709,300.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	890,000.000	750,020.800	



DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,690,000.000	2,203,486.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	655,681.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,478,170.700	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,010,000.000	478,053.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,340,000.000	1,040,972.400	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,458,291.600	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,560,000.000	2,251,448.320	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,957,502.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,430,000.000	1,267,865.170	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,570,000.000	2,302,103.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,833,671.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,860,000.000	3,657,234.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,470,000.000	2,260,346.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	3,210,000.000	2,964,053.090	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,290,000.000	3,047,555.510	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,490,000.000	2,149,958.130	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,660,000.000	1,287,097.600	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,332,492.800	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,820,000.000	2,011,020.960	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,330,000.000	2,160,282.800	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,850,000.000	1,445,053.500	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	2,000,000.000	1,942,620.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	2,550,000.000	2,473,755.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	500,000.000	485,210.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	300,000.000	295,374.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,370,000.000	2,210,238.300	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,370,000.000	2,204,197.170	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,730,000.000	1,802,314.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,230,000.000	2,502,983.220	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,500,000.000	1,745,385.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,286,731.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,020,000.000	2,387,700.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,510,000.000	1,868,745.800	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,820,000.000	3,340,910.400	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,458,920.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,680,000.000	2,022,804.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	650,000.000	732,043.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	410,000.000	332,323.450	

FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	187,251.680	
FINLAND 0.125 04/15/52	560,000.000	231,672.850	
FINLAND 0.125 09/15/31	600,000.000	474,500.400	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	171,676.660	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	433,310.800	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	220,396.200	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	364,091.600	
FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	576,222.400	
FINLAND 0.5 09/15/29	800,000.000	692,099.670	
FINLAND 0.75 04/15/31	600,000.000	506,478.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	910,000.000	872,871.540	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	389,316.480	
FINLAND 1.375 04/15/27	210,000.000	198,750.510	
FINLAND 1.375 04/15/47	380,000.000	255,778.000	
FINLAND 1.5 09/15/32	550,000.000	477,953.300	
FINLAND 2.625 07/04/42	430,000.000	379,883.990	
FINLAND 2.75 04/15/38	270,000.000	246,780.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	390,000.000	385,689.330	
FINLAND 4.0 07/04/25	510,000.000	515,495.250	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	2,190,000.000	2,098,537.270	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	3,530,000.000	3,291,813.250	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	3,500,000.000	3,174,416.000	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,590,000.000	2,750,658.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,590,000.000	3,000,112.740	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,780,000.000	3,864,152.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	4,770,000.000	3,723,376.140	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,220,000.000	2,963,964.920	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,430,000.000	3,289,409.440	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,060,000.000	4,747,041.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,690,000.000	3,224,750.040	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,950,000.000	1,201,504.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	261,979.320	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,390,000.000	759,325.030	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,880,000.000	3,533,201.720	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,110,000.000	4,628,913.940	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,470,000.000	1,677,734.590	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,550,000.000	1,203,023.700	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,500,000.000	4,033,606.500	
FRANCE OAT 03/25/25	3,570,000.000	3,412,323.810	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,760,000.000	3,510,057.760	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,624,903.560	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,560,000.000	2,912,565.290	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,780,000.000	2,937,060.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,300,000.000	960,180.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,480,000.000	4,905,328.840	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,470,000.000	2,181,953.350	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,390,000.000	836,717.450	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,570,000.000	2,024,828.470	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	980,000.000	962,436.130	

FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,650,000.000	1,924,639.350	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,550,000.000	2,312,520.390	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,650,000.000	4,503,854.680	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,200,000.000	1,001,170.800	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,520,000.000	4,448,000.920	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	2,900,000.000	2,859,057.800	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,790,000.000	2,764,139.490	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	1,500,000.000	1,470,709.500	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,140,000.000	2,000,778.020	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,850,000.000	3,886,251.600	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,592,779.720	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,527,257.820	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,040,000.000	2,146,390.080	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,740,000.000	3,047,981.480	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,627,769.340	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,100,000.000	3,476,625.200	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,610,000.000	3,121,766.190	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,283,378.160	
IRISH 0.0 10/18/31	870,000.000	684,499.470	
IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	381,778.740	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	288,145.200	
IRISH 0.35 10/18/32	600,000.000	472,426.200	
IRISH 0.4 05/15/35	370,000.000	269,154.280	
IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	154,557.750	
IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	649,358.740	
IRISH 1.0 05/15/26	1,000,000.000	951,197.800	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	660,530.280	
IRISH 1.3 05/15/33	90,000.000	76,427.460	
IRISH 1.35 03/18/31	660,000.000	587,605.920	
IRISH 1.5 05/15/50	670,000.000	430,527.930	
IRISH 1.7 05/15/37	680,000.000	553,472.400	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	641,182.920	
IRISH 2.4 05/15/30	860,000.000	827,219.570	
IRISH 3.0 10/18/43	310,000.000	289,623.080	
IRISH 5.4 03/13/25	820,000.000	842,341.050	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,852,138.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,850,000.000	2,581,530.000	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,306,579.200	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,253,848.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,600,000.000	1,536,324.190	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,700,000.000	1,420,690.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,501,990.450	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	944,130.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,920,000.000	1,468,422.720	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,565,163.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,110,000.000	1,675,333.670	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,580,000.000	1,004,564.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,880,000.000	1,435,568.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,102,005.000	

ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,513,176.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,322,202.200	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,009,305.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,302,240.800	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,630,000.000	1,516,478.650	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,569,911.850	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,320,000.000	928,356.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,880,000.000	1,819,625.680	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	480,000.000	469,253.620	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,110,000.000	623,376.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,560,000.000	1,508,440.440	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,850,000.000	2,708,355.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,990,000.000	1,631,230.860	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,140,000.000	1,814,807.740	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,120,000.000	605,055.360	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	745,430.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,203,668.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,340,000.000	2,178,067.320	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,606,157.900	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,601,309.900	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,790,000.000	1,718,559.310	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	190,260.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	300,594.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,510,659.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,046,248.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,430,000.000	1,208,684.620	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	746,350.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,515,669.300	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,616,552.230	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,157,358.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,820,000.000	1,743,378.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,490,000.000	1,050,450.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	400,000.000	255,440.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,128,960.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,845,095.200	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,520,000.000	1,223,904.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,710,000.000	1,625,893.650	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,260,000.000	1,015,458.560	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	505,740.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,079,153.100	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	2,120,000.000	1,886,289.080	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,150,000.000	1,133,325.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	954,879.800	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,310,000.000	1,305,939.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,105,759.320	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	300,000.000	292,800.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,504,320.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,430,000.000	1,216,579.650	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	800,000.000	803,040.000	

ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,681,300.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,470,000.000	2,311,179.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,160,000.000	1,099,680.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,100,000.000	1,082,730.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,100,000.000	1,100,880.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	800,000.000	751,600.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,146,503.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	670,000.000	622,430.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,680,000.000	2,783,662.400	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,460,000.000	1,429,887.500	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	560,000.000	568,814.400	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,460,000.000	2,555,694.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,790,000.000	1,823,473.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,650,000.000	1,676,235.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,815,032.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,460,000.000	1,611,256.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,774,376.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,210,000.000	2,429,232.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	384,370.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	2,460,000.000	2,303,088.900	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,077,230.480	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,310,000.000	1,131,081.510	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	351,723.900	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,600,000.000	683,545.600	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	578,810.400	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,900,000.000	1,523,418.690	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,360,000.000	1,175,344.640	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,210,000.000	802,521.610	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,820,000.000	1,705,340.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,100,000.000	894,854.810	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,460,000.000	1,352,619.920	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,580,000.000	1,435,206.880	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	514,046.400	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	910,000.000	875,605.640	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	450,000.000	429,856.650	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,810,000.000	1,692,483.940	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,420,000.000	1,527,522.400	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,420,000.000	1,546,380.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	940,000.000	1,035,880.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	2,050,000.000	1,965,273.500	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,524,816.240	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,810,000.000	1,629,452.500	
SPAIN 0.0 01/31/28	2,180,000.000	1,906,192.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	824,854.910	

SPAIN 0.1 04/30/31	1,880,000.000	1,463,580.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,499,400.000	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,297,659.840	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,302,804.180	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,465,192.600	
SPAIN 0.8 07/30/27	2,050,000.000	1,876,262.500	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,476,875.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,100,000.000	735,343.400	
SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	317,736.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,790,000.000	859,661.820	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,810,000.000	1,161,564.770	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,150,000.000	1,866,845.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,930,000.000	1,823,352.560	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	2,000,891.900	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,670,000.000	1,536,483.500	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,400,000.000	1,268,737.950	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,734,019.580	
SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	173,599.180	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,310,000.000	2,175,211.500	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,586,738.170	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,890,000.000	1,534,039.290	
SPAIN 1.9 10/31/52	970,000.000	579,795.190	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,730,000.000	1,674,769.750	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,614,036.450	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,770,732.050	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,070,000.000	952,300.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,578,186.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,710,000.000	1,293,543.600	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,190,000.000	1,179,656.520	
SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,775,340.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,430,000.000	1,143,528.100	
SPAIN 3.15 04/30/33	2,170,000.000	2,075,070.870	
SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	659,223.120	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	908,325.880	
SPAIN 3.5 05/31/29	500,000.000	502,630.500	
SPAIN 3.55 10/31/33	1,520,000.000	1,493,552.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,600,000.000	1,636,336.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,933,026.960	
SPAIN 4.7 07/30/41	2,230,000.000	2,374,227.480	
SPAIN 4.9 07/30/40	1,710,000.000	1,854,495.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	2,060,000.000	2,231,289.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	1,410,000.000	1,584,190.390	
SPAIN 5.75 07/30/32	1,815,000.000	2,104,517.000	
SPAIN 5.9 07/30/26	2,630,000.000	2,801,268.230	
SPAIN 6.0 01/31/29	2,160,000.000	2,431,635.120	
ユーロ 小計	556,387,000.000 (90,173,641,090)	498,083,391.420 (80,724,375,247)	
国債証券 合計	280,356,382,082.900 (280,356,382,083)	247,047,830,394 (247,047,830,394)	

合計		247,047,830,394 (247,047,830,394)	
----	--	--------------------------------------	--

(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 252銘柄	47.62	48.24
イギリス・ポンド	国債証券 57銘柄	4.91	4.98
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	0.29	0.30
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.41	1.42
オフショア・人民元	国債証券 41銘柄	7.11	7.20
カナダ・ドル	国債証券 37銘柄	1.94	1.97
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.42	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.19	0.19
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.30	0.31
ニュージーランド・ドル	国債証券 12銘柄	0.22	0.23
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.16	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.49	0.50
マレーシア・リングgit	国債証券 26銘柄	0.50	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.89	0.90
ユーロ	国債証券 350銘柄	32.26	32.68

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,940,883,075
投資証券	181,998,854,200
未収入金	509,134,507
未収配当金	2,055,624,029
前払金	278,528,930
差入委託証拠金	300,537,232
流動資産合計	189,083,561,973
資産合計	189,083,561,973
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	294,556,700
未払金	929,097,993
未払解約金	62,999,000
流動負債合計	1,286,653,693
負債合計	1,286,653,693
純資産の部	
元本等	
元本	80,768,851,376
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	107,028,056,904
元本等合計	187,796,908,280
純資産合計	187,796,908,280
負債純資産合計	189,083,561,973



## 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5月12日 至 2023年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	87,246,759,652円
同期中追加設定元本額	24,137,520,213円
同期中一部解約元本額	30,615,428,489円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	206,061円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	828,294円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	2,180,270円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	2,872,294円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	2,521,420円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,857,642円
たわらノーロード 国内リート	5,871,532,247円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,069,138,137円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,831,838,253円
たわらノーロード バランス(堅実型)	43,238,977円
たわらノーロード バランス(標準型)	891,041,564円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,037,199,692円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	285,351,211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)	697,424,111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)	510,669,062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)	578,093,805円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	3,585,536円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	62,714,252円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,240,250円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	17,333,289円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,656,864円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	476,326,758円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,803円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	143,513,616円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	223,882,060円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	428,751,986円
投資のソムリエ	5,474,121,506円
投資のソムリエ<DC年金>	497,620,398円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	168,765,080円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	559,481,158円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,952,524,062円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	47,124,066円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	23,603,635円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,532,063円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	91,817,887円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	123,960,621円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	49,702,288円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	25,815,786円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	15,559,061円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,745,299円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	50,349,708円
Jリートインデックスファンド(DC)	69,076,232円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	681,241,242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)	60,460,728円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	179,906,013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)	60,644,588円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	40,997,718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)	36,449,495円
固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)	178,539,746円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	69,096,468円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	180,182,634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)	59,745,021円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	154,282,491円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	49,453,872円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	81,607,654円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	56,807,778円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	69,045,979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)	53,404,608円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	56,662,200円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-12(適格機関投資家限定)	81,842,339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)	135,830,268円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	3,152,110,234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)	162,630,557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)	81,929,189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)	416,866,344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)	99,766,000円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,539,148円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	1,252,403,385円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	7,570,798,166円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	35,709,628,877円
たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>	2,609,228,887円
計	3,062,646,282円
2. 受益権の総数	80,768,851,376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 2023年5月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月13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る場合、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11月13日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券	6,096,499,526	
合計	6,096,499,526	

(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6月7日から2023年11月13日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	2023年11月13日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	5,443,984,930	-		5,149,742,500	294,242,430
合計	5,443,984,930	-		5,149,742,500	294,242,430

## (注)時価の算定方法

## 不動産投信指数先物取引

- 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。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 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11月13日現在	
---------------	--

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,3251円 (23,251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11月13日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	7,610	1,216,839,000	
	GLP投資法人	59,715	8,157,069,000	
	KDX不動産投資法人	50,873	8,139,680,000	
	NTT都市開発リート投資法人	17,922	2,286,847,200	
	Oneリート投資法人	3,084	795,055,200	
	SOSILA物流リート投資法人	8,820	1,051,344,000	
	いちごオフィスリート投資法人	14,485	1,205,152,000	
	いちごホテルリート投資法人	2,929	302,565,700	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	9,274	3,700,326,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	17,344	5,628,128,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	7,746	964,377,000	
	イオンリート投資法人	21,685	3,077,101,500	
	インヴィンシブル投資法人	85,593	4,921,597,500	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,593	421,458,900	
	オリックス不動産投資法人	35,223	5,977,343,100	
	グローバル・ワン不動産投資法人	13,053	1,465,851,900	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	8,693	2,746,988,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,817	519,754,300	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,663	508,537,400	
	ザイマックス・リート投資法人	2,867	333,718,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	59,178	3,988,597,200	
	ジャパンエクセレント投資法人	15,363	2,003,335,200	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	18,159	10,096,404,000	
	スターアジア不動産投資法人	27,244	1,550,183,600	
スターツプロシード投資法人	3,064	618,928,000		
タカラレーベン不動産投資法人	8,382	813,892,200		
トーセイ・リート投資法人	3,722	504,703,200		

ヒューリックリート投資法人	16,540	2,495,886,000	
フロンティア不動産投資法人	6,559	2,958,109,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	4,359	624,644,700	
マリモ地方創生リート投資法人	2,725	343,895,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	39,544	5,923,691,200	
ラサールロジポート投資法人	22,598	3,396,479,400	
阪急阪神リート投資法人	8,429	1,185,960,300	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7,353	3,437,527,500	
三菱地所物流リート投資法人	6,104	2,301,208,000	
産業ファンド投資法人	26,973	3,630,565,800	
森トラストリート投資法人	34,075	2,494,290,000	
森ヒルズリート投資法人	20,788	2,883,295,600	
星野リゾート・リート投資法人	3,261	1,963,122,000	
積水ハウス・リート投資法人	53,121	4,122,189,600	
大江戸温泉リート投資法人	2,703	176,235,600	
大和ハウスリート投資法人	26,647	7,258,642,800	
大和証券オフィス投資法人	3,662	2,387,624,000	
大和証券リビング投資法人	26,034	2,806,465,200	
投資法人みらい	22,607	1,008,272,200	
東海道リート投資法人	2,631	328,348,800	
東急リアル・エステート投資法人	11,852	2,107,285,600	
日本アコモデーションファンド投資法人	6,104	3,717,336,000	
日本ビルファンド投資法人	20,623	12,497,538,000	
日本プライムリアルティ投資法人	12,090	4,183,140,000	
日本プロロジスリート投資法人	30,796	8,370,352,800	
日本リート投資法人	5,742	1,963,764,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	11,324	3,221,678,000	
日本都市ファンド投資法人	84,736	8,287,180,800	
福岡リート投資法人	9,143	1,473,851,600	
平和不動産リート投資法人	13,208	1,850,440,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	57,167	9,604,056,000	
投資証券 合計	1,115,599	181,998,854,200	
合計		181,998,854,200	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	119,619,888
コール・ローン	72,850,446
投資信託受益証券	8,252,789,346
投資証券	72,885,776,827
未収入金	14,030,007
未収配当金	93,679,549
流動資産合計	81,438,746,063
資産合計	81,438,746,063
負債の部	
流動負債	
未払金	1,562,675
未払解約金	36,901,000
流動負債合計	38,463,675
負債合計	38,463,675
純資産の部	
元本等	
元本	47,736,993,571
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	33,663,288,817
元本等合計	81,400,282,388
純資産合計	81,400,282,388
負債純資産合計	81,438,746,063

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年5月12日 至 2023年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>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。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月13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	47,920,374,095円
同期中追加設定元本額	25,894,041,242円
同期中一部解約元本額	26,077,421,766円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	3,122,025,933円
たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	34,827,385円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,652,111円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	14,809,568円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	39,255,251円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	51,309,274円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	45,387,678円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	33,287,993円
たわらノーロード 先進国リート	15,186,178,302円
たわらノーロード 先進国リート＜ラップ向け＞	1,728,970,007円
たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	306,387,518円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,982,228,447円
たわらノーロード バランス（堅実型）	30,207,569円
たわらノーロード バランス（標準型）	613,649,833円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,308,537,977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）	103,001,715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）	744,612,545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）	642,770,743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）	1,091,168,025円



たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,310,177円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	55,239,770円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	8,397,402円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	33,290,316円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,788,854,442円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,506,812円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	694,837,158円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	57,534,103円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	214,120,117円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	326,630,622円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	614,927,873円
投資のソムリエ	7,534,322,555円
投資のソムリエ<DC年金>	683,875,667円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	246,293,663円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	641,995,098円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,239,369,137円
ワールドアセットバランス(基本コース)	306,471,994円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	509,473,653円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	48,688,494円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	24,362,421円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,202,578円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	131,267,455円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	176,726,756円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	56,166,058円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	26,596,094円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	16,127,634円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,876,452円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	96,541,787円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	292,516,230円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	350,485,647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)	217,802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)	647,540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)	125,270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)	285,547円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	711,941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)	506,310円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	223,904,467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)	2,413,905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)	572,716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)	3,496,591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)	51,686,438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)	152,571,665円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,013,577,340円
計	47,736,993,571円

2. 受益権の総数	47,736,993,571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 2023年5月12日 至 2023年11月13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11月13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11月13日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資信託受益証券	441,400,388	
投資証券	3,873,077,851	
合計	4,314,478,239	

(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6月23日から2023年11月13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11月13日現在
1口当たり純資産額	1.7052円
（1万口当たり純資産額）	（17,052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11月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	340,400.000	178,710.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	391,900.000	97,975.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	66,281.000		
		PRIME US REIT	317,600.000	40,652.800		
		アメリカ・ドル	小計	1,961,600.000	383,618.800 (58,198,808)	
	オーストラリア・ドル		ABACUS GROUP	215,615.000	217,771.150	
			ABACUS STORAGE KING	224,215.000	235,425.750	
			ARENA REIT	166,636.000	551,565.160	
			BWP TRUST	218,012.000	741,240.800	
			CENTURIA CAPITAL GROUP	381,129.000	468,788.670	
			CENTURIA INDUSTRIAL REIT	241,652.000	722,539.480	
			CENTURIA OFFICE REIT	185,985.000	228,761.550	
			CHARTER HALL GROUP	217,708.000	2,153,132.120	
			CHARTER HALL LONG WALE REIT	298,981.000	980,657.680	
			CHARTER HALL RETAIL REIT	242,269.000	780,106.180	
			CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	134,754.000	339,580.080	
			CROMWELL PROPERTY GROUP	618,825.000	232,059.370	
			DEXUS	493,282.000	3,492,436.560	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	93,159.000	240,350.220		
	GDI PROPERTY GROUP	222,442.000	122,343.100			
	GOODMAN GROUP	779,252.000	17,533,170.000			
	GPT GROUP	878,580.000	3,408,890.400			

	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	119,794.000	264,744.740	
	HEALTHCO REIT	202,023.000	284,852.430	
	HMC CAPITAL LTD	115,404.000	535,474.560	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	803,393.000	895,783.190	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	235,248.180	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	169,987.000	691,847.090	
	MIRVAC GROUP	1,809,195.000	3,555,068.170	
	NATIONAL STORAGE REIT	561,839.000	1,185,480.290	
	REGION RE LTD	515,481.000	1,087,664.910	
	RURAL FUNDS GROUP	152,896.000	281,328.640	
	SCENTRE GROUP	2,373,854.000	6,053,327.700	
	STOCKLAND	1,093,641.000	4,166,772.210	
	VICINITY CENTRES	1,775,269.000	3,168,855.160	
	WAYPOINT REIT LTD	299,993.000	698,983.690	
	オーストラリア・ドル 小計	15,691,122.000	55,554,249.230 (5,352,651,913)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	327,895.000	406,589.800	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,020,316.000	918,284.400	
	CAPITALAND CHINA TRUST	497,080.000	385,237.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,315,109.000	4,144,045.110	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,611,960.000	4,336,172.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	291,800.000	283,046.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	31,472.000	
	ESR LOGOS REIT	2,702,540.000	729,685.800	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	474,300.000	286,951.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	482,300.000	1,017,653.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,296,364.000	1,361,182.200	
	KEPPEL DC REIT	600,800.000	1,069,424.000	
	KEPPEL REIT	1,035,700.000	838,917.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	816,400.000	449,020.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	951,020.000	2,063,713.400	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,525,320.000	2,348,992.800	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,029,200.000	1,368,836.000	
	PARAGON REIT	589,900.000	474,869.500	
	PARKWAY LIFE REIT	181,700.000	628,682.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	188,700.000	124,542.000	

		STARHILL GLOBAL REIT	675,100.000	317,297.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	996,490.000	1,096,139.000	
	シンガポール・ドル 小計		19,722,394.000	24,680,751.910 (2,752,397,453)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	153,640.000	187,440.800	
	ユーロ 小計		153,640.000	187,440.800 (30,378,530)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	674,000.000	3,046,480.000	
	香港・ドル 小計		674,000.000	3,046,480.000 (59,162,642)	
投資信託受益証券 合計			38,202,756	8,252,789,346 (8,252,789,346)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	44,291.000	636,904.580	
		AGREE REALTY CORP	44,112.000	2,498,944.800	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	33,905.000	546,548.600	
		ALEXANDER'S INC.	1,048.000	200,765.360	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	71,116.000	6,802,956.560	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,384.000	66,899.840	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,830.000	420,072.000	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	145,336.000	5,072,226.400	
		AMERICOLD REALTY TRUST	116,314.000	2,911,339.420	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	68,471.000	2,021,948.630	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	64,228.000	405,920.960	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	97,797.000	1,553,016.360	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	28,991.000	298,027.480	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	24,559.320	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	64,554.000	10,857,982.800	
		BOSTON PROPERTIES INC	66,017.000	3,461,931.480	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	47,180.640	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	73,547.000	282,420.480	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	137,648.000	2,897,490.400	
		BROADSTONE NET LEASE INC	83,316.000	1,210,581.480	
		BRT APARTMENTS CORP	4,006.000	67,260.740	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	48,822.000	4,317,817.680	
		CARETRUST REIT INC	44,396.000	986,479.120	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	10,705.000	233,261.950			

CENTERSPACE	7,073.000	362,986.360	
CHATHAM LODGING TRUST	23,615.000	224,342.500	
CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	71,508.650	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	25,175.700	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	111,398.000	528,026.520	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10,042.000	262,297.040	
COPT DEFENCE PROPERTIES	50,088.000	1,178,570.640	
COUSINS PROPERTIES INC	67,471.000	1,252,936.470	
CTO REALTY GROUTH INC	9,356.000	153,251.280	
CUBESMART	102,848.000	3,746,752.640	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	93,836.000	768,516.840	
DIGITAL REALTY TRUST INC	137,664.000	17,724,240.000	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	82,523.000	170,822.610	
DOUGLAS EMMETT INC	74,419.000	840,934.700	
EAST GROUP	20,775.000	3,489,161.250	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	43,727.000	477,498.840	
ELME COMMUNITIES	41,055.000	541,926.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	60,646.000	516,097.460	
EPR PROPERTIES	34,628.000	1,561,376.520	
EQUINIX INC	42,566.000	32,659,614.820	
EQUITY COMMONWEALTH	48,988.000	928,322.600	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	85,111.000	5,588,388.260	
EQUITY RESIDENTIAL	156,731.000	8,548,108.740	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	71,698.000	1,626,110.640	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	29,319.000	6,176,047.350	
EXTRA SPACE STORAGE INC	96,032.000	11,438,371.520	
FARMLAND PARTNERS INC	20,744.000	229,428.640	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	33,587.000	3,108,812.720	
FIRST INDUSTRIAL RT	60,596.000	2,623,200.840	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	40,457.000	884,794.590	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	30,562.000	64,791.440	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	120,010.000	5,430,452.500	
GETTY REALTY CORP	21,428.000	595,484.120	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	18,651.000	223,252.470	
GLADSTONE LAND CORP	16,125.000	223,008.750	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,662.000	246,623.500	

GLOBAL NET LEASE INC	87,053.000	703,388.240	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	174,494.000	2,533,652.880	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	250,162.000	3,987,582.280	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,536.000	164,202.480	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	47,176.000	848,696.240	
HOST HOTELS & RESORTS INC	325,172.000	5,336,072.520	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	52,743.000	277,955.610	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	99,750.000	1,294,755.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	73,385.130	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	12,506.000	947,954.800	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	30,243.000	740,046.210	
INVITATION HOMES INC	261,374.000	8,280,328.320	
IRON MOUNTAIN INC	133,255.000	7,920,677.200	
JBG SMITH PROPERTIES	43,876.000	578,724.440	
KILROY REALTY CORP	49,037.000	1,399,025.610	
KIMCO REALTY	283,281.000	5,070,729.900	
KITE REALTY GROUP TRUST	100,617.000	2,095,852.110	
LTC PROPERTIES INC	19,296.000	609,753.600	
LXP INDUSTRIAL TRUST	130,363.000	1,076,798.380	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	265,823.000	1,127,089.520	
MID AMERICA	53,294.000	6,540,239.680	
NATIONAL HEALTH INVS INC	19,365.000	984,516.600	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	36,961.000	1,122,135.960	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	5,706.000	86,217.660	
NETSTREIT CORP	31,405.000	474,215.500	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	14,807.000	118,307.930	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	9,758.000	293,423.060	
NNN REIT INC	83,495.000	3,189,509.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	114,060.480	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	112,045.000	3,556,308.300	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,801.000	109,348.850	
ORION OFFICE REIT INC	20,368.000	101,840.000	
PARAMOUNT GROUP INC	75,433.000	331,905.200	
PARK HOTELS & RESORTS INC	95,919.000	1,262,294.040	

PEAKSTONE REALTY TRUST	16,780.000	236,598.000	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	56,008.000	652,493.200	
PHILLIPS EDISON & CO INC	53,908.000	1,810,230.640	
PHYSICIANS REALTY TRUST	106,080.000	1,166,880.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	52,948.000	297,567.760	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,197.000	319,288.970	
POSTAL REALTY TRUST INC	6,866.000	94,407.500	
PROLOGIS INC	420,340.000	43,946,547.000	
PUBLIC STORAGE	71,967.000	17,616,082.260	
REALTY INCOME CORP	322,320.000	16,135,339.200	
REGENCY CENTERS CORP	75,119.000	4,540,943.550	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	58,510.000	703,290.200	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	94,398.000	4,256,405.820	
RLJ LODGING TRUST	73,106.000	723,749.400	
RPT REALTY	37,596.000	404,532.960	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	27,364.000	2,574,952.400	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	105,365.000	1,489,861.100	
SAFEHOLD INC	18,989.000	321,293.880	
SAUL CENTERS INC	6,050.000	212,476.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	77,180.000	542,575.400	
SIMON PROPERTY GROUP INC	148,795.000	17,160,527.350	
SITE CENTERS CORP	80,257.000	1,047,353.850	
SL GREEN	28,726.000	891,080.520	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	64,773.000	2,465,908.110	
STAG INDUSTRIAL INC	82,287.000	2,845,484.460	
STAR HOLDINGS	5,322.000	60,032.160	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	46,872.000	279,357.120	
SUN COMMUNITIES INC	56,826.000	6,519,078.720	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	92,547.000	893,078.550	
TANGER FACTORY OUTLET	46,850.000	1,152,041.500	
TERRENO REALTY CORP	38,496.000	2,086,483.200	
THE MACERICH COMPANY	95,928.000	990,936.240	
UDR INC	138,583.000	4,539,979.080	
UMH PROPERTIES INC	27,937.000	405,086.500	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,948.000	193,565.760	
URBAN EDGE PROPERTIES	52,560.000	849,369.600	
VENTAS INC	183,716.000	7,818,952.960	
VERIS RESIDENTIAL INC	37,449.000	522,413.550	
VICI PROPERTIES INC	460,766.000	13,113,400.360	



	VORNADO REALTY TRUST	73,547.000	1,508,448.970	
	WELLTOWER INC	251,895.000	21,657,932.100	
	WHITESTONE REIT	21,086.000	218,450.960	
	WP CAREY INC	97,760.000	5,291,748.800	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	50,003.000	599,535.970	
アメリカ・ドル	小計	10,104,866.000	416,820,526.960 (63,235,842,144)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	184,841.000	86,875.270	
	AEW UK REIT PLC	78,980.000	75,978.760	
	ASSURA PLC	1,328,830.000	586,014.030	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	335,753.000	212,867.400	
	BIG YELLOW GROUP PLC	78,076.000	807,305.840	
	BRITISH LAND CO PLC	431,260.000	1,352,862.620	
	CLS HOLDINGS PLC	45,585.000	40,479.480	
	CUSTODIAN REIT PLC	191,703.000	165,823.090	
	DERWENT LONDON PLC	51,719.000	1,061,273.880	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	287,221.000	264,243.320	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	114,229.000	470,851.930	
	HAMMERSON PLC	1,738,721.000	425,986.640	
	HELICAL PLC	48,089.000	100,506.010	
	HOME REIT PLC	286,621.000	54,457.990	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	169,602.000	143,483.290	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	344,290.000	2,065,051.420	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	147,597.000	100,070.760	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	438,616.000	770,648.310	
	LXI REIT PLC	765,854.000	716,073.490	
	NEWRIVER REIT PLC	120,604.000	96,845.010	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	239,715.000	153,417.600	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	599,040.000	568,488.960	
	PRS REIT PLC/THE	249,183.000	201,589.040	
	REGIONAL REIT LTD	236,558.000	73,806.090	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	97,375.000	717,653.750	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	203,492.000	85,466.640	
	SEGRO PLC	556,471.000	4,307,085.540	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	899,959.000	1,025,953.260	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	561,733.000	446,016.000	

	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	296,269.000	232,274.890	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	173,559.000	105,003.190	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	875,290.000	1,275,297.530	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	404,303.000	229,239.800	
	UNITE GROUP PLC	181,933.000	1,735,640.820	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	224,460.000	256,782.240	
	WAREHOUSE REIT PLC	182,285.000	146,921.710	
	WORKSPACE GROUP PLC	64,102.000	358,330.180	
イギリス・ポンド 小計		13,464,958.000	21,516,665.780 (3,990,265,669)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314,331.000	451,693.640	
	REIT 1 LTD	80,666.000	1,230,156.500	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	103,336.000	776,156.690	
イスラエル・シュケル 小計		498,333.000	2,458,006.830 (96,505,035)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	29,621.000	488,746.500	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,895.000	137,281.650	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,117.000	682,492.820	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,104.000	119,777.120	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	45,497.850	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	37,798.000	1,699,776.060	
	CHOICE PROPERTIES REIT	72,061.000	920,218.970	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	25,093.000	335,493.410	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25,455.000	344,151.600	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	58,271.000	706,244.520	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	8,533.000	70,567.910	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	47,026.000	641,904.900	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,014.000	901,520.620	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	58,511.000	515,481.910	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,320.000	398,174.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,413.000	451,926.430	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,341.000	133,296.070		

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,705.000	116,037.650	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	98,583.100	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	46,246.000	198,857.800	
	PRIMARIS REIT	22,168.000	298,381.280	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,769.000	70,960.500	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	65,670.000	1,134,777.600	
	SLATE GROCERY REIT	15,129.000	159,157.080	
	SMARTCENTRES REIT	31,957.000	732,454.440	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	21,434.000	31,293.640	
	カナダ・ドル 小計	742,529.000	11,433,055.430 (1,256,035,470)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	406,900.000	441,486.500	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	474,291.000	981,782.370	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	723,771.000	593,492.220	
	PRECINCT PROPERTIES	584,851.000	660,881.630	
	ニュージーランド・ドル 小計	2,189,813.000	2,677,642.720 (239,140,271)	
ユーロ	AEDIFICA	21,840.000	1,244,880.000	
	ALTAREA	2,084.000	147,964.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	15,092.000	190,461.040	
	CARMILA SA	26,243.000	372,125.740	
	COFINIMMO SA	15,148.000	954,324.000	
	COVIVIO	21,617.000	916,128.460	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	19,494.000	421,070.400	
	GECINA SA	23,531.000	2,281,330.450	
	HAMBORNER REIT AG	31,150.000	203,409.500	
	ICADE	14,129.000	452,128.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	44,296.020	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	132,603.000	724,012.380	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	13,549.000	273,689.800	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	195,526.000	191,615.480	
	KLEPIERRE	89,441.000	2,017,788.960	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	22,313.000	127,184.100	
	MERCIALYS	39,645.000	326,080.120	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	150,641.000	1,261,618.370	
MONTEA SCA	6,867.000	473,136.300		

	NSI NV	8,986.000	156,715.840	
	RETAIL ESTATES	5,574.000	351,162.000	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	46,513.000	2,350,767.020	
	VASTNED RETAIL	7,728.000	149,768.640	
	WAREHOUSES DE PAUW	74,150.000	1,818,158.000	
	WERELDHAVE NV	18,282.000	267,465.660	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	13,258.000	403,706.100	
	ユーロ 小計	1,035,959.000	18,120,986.380 (2,936,868,263)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	26,312.000	79,593,800.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	69,322.000	230,842,260.000	
	JR REIT XXVII	76,448.000	307,703,200.000	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	22,542.000	123,304,740.000	
	LOTTE REIT CO LTD	61,145.000	187,103,700.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	20,887.000	70,911,365.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	33,139.000	206,455,970.000	
	SK REITS CO LTD	48,785.000	191,237,200.000	
	韓国・ウォン 小計	358,580.000	1,397,152,235.000 (160,812,222)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	814,070.000	2,010,752.900	
	LINK REIT	1,170,420.000	45,119,691.000	
	PROSPERITY REIT	538,000.000	710,160.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	445,000.000	930,050.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,038,000.000	1,193,700.000	
	香港・ドル 小計	4,005,490.000	49,964,353.900 (970,307,753)	
投資証券 合計		32,400,528	72,885,776,827 (72,885,776,827)	
合計			81,138,566,173 (81,138,566,173)	

(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)

- 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。
- 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。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券	5銘柄	0.07	-
	投資証券	138銘柄	-	77.69
イギリス・ポンド	投資証券	38銘柄	-	4.90
イスラエル・シケル	投資証券	3銘柄	-	0.12
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	31銘柄	6.58	-

カナダ・ドル	投資証券	26銘柄	-	1.54	1.55
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	22銘柄	3.38	-	3.39
ニュージーランド・ドル	投資証券	4銘柄	-	0.29	0.29
ユーロ	投資信託受益証券	1銘柄	0.04	-	3.66
	投資証券	26銘柄	-	3.61	
韓国・ウォン	投資証券	8銘柄	-	0.20	0.20
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.07	-	1.27
	投資証券	5銘柄	-	1.19	

(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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2023年11月30日現在

資産総額	471,833,284円
負債総額	964,455円
純資産総額( - )	470,868,829円
発行済数量	327,252,063口
1口当たり純資産額( / )	1.4389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11月30日現在

資産総額	483,445,824,627円
負債総額	223,089,395円
純資産総額( - )	483,222,735,232円
発行済数量	116,783,287,505口
1口当たり純資産額( / )	4.1378円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産総額	1,195,069,303,196円
負債総額	719,125,798円
純資産総額( - )	1,194,350,177,398円
発行済数量	158,799,662,749口
1口当たり純資産額( / )	7.5211円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産総額	557,664,365,904円
負債総額	8,695,821,000円
純資産総額( - )	548,968,544,904円
発行済数量	443,253,798,014口
1口当たり純資産額( / )	1.2385円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産総額	249,816,099,538円
負債総額	201,193,856円
純資産総額( - )	249,614,905,682円
発行済数量	110,603,062,983口
1口当たり純資産額( / )	2.2569円

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産総額	193,133,404,968円
負債総額	814,578,865円
純資産総額( - )	192,318,826,103円
発行済数量	80,804,351,922口
1口当たり純資産額( / )	2.3801円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産総額	81,543,078,521円
負債総額	70,727,615円
純資産総額( - )	81,472,350,906円
発行済数量	46,387,327,403口
1口当たり純資産額( / )	1.7563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。

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

上記の振替について、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る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。

## 第二部【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11月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2023年11月30日現在）

###### 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。

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、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11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,517,087,272,118
追加型株式投資信託	779	15,334,220,929,811
単位型公社債投資信託	21	35,808,950,249
単位型株式投資信託	208	1,075,655,152,816
合計	1,034	17,962,772,304,994

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第39期中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第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		
建物	1,109	1,001
器具備品	158	118
リース資産	-	7
無形固定資産		
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	1,449	1,651
電話加入権	3	2
投資その他の資産		
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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 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			
						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	<p>(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</p> <p>(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</p>
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	<p>(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</p> <p>(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ェアについては、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。</p> <p>(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。</p>
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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。 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。 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、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(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。</p>

6. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
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あります。

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あります。

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あります。

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

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おります。

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おります。

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。

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あります。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 其他有価証券	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 其他有価証券	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 其他有価証券(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 其他有価証券(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	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
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	-	-	-	-
其他有価証券	-	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(其他有価証券)		
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	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
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	第38期
	(2022年3月31日現在)	(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

MHAM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、TB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、DIAM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」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」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IA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」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」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、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	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
<b>合計</b>	<b>126,879百万円</b>	<b>113,962百万円</b>

（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

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。

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。

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,013
金銭の信託		28,384
未収委託者報酬		17,669
未収運用受託報酬		3,747
未収投資助言報酬		305
未収収益		13
前払費用		1,318
その他		2,504
	流動資産計	81,956
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	947
器具備品	1	100
リース資産	1	6
無形固定資産		
ソフトウェア		4,959
ソフトウェア仮勘定		2,954
電話加入権		2,002
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		8,557
関係会社株式		184
長期差入保証金		4,888
長期差入保証金		772
繰延税金資産		2,592
その他		120
	固定資産計	14,572
資産合計		96,529

（単位：百万円）

	第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	418
リース債務	1
未払金	7,850
未払収益分配金	1
未払償還金	0
未払手数料	7,654
その他未払金	193
未払費用	7,452
未払法人税等	2,372
未払消費税等	1,076
契約負債	20
賞与引当金	861
役員賞与引当金	26
流動負債計	20,081
固定負債	
リース債務	5
退職給付引当金	2,701
時効後支払損引当金	72
固定負債計	2,780
負債合計	22,861
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	52,115
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,991
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,311
株主資本計	73,668
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
評価・換算差額等計	0
純資産合計	73,668
負債・純資産合計	96,529

## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	49,984	
運用受託報酬	8,063	
投資助言報酬	1,082	
その他営業収益	13	
		営業収益計 59,144
営業費用		
支払手数料	21,623	
広告宣伝費	107	
公告費	0	
調査費	17,657	
調査費	6,728	
委託調査費	10,928	
委託計算費	280	
営業雑経費	372	
通信費	17	
印刷費	253	
協会費	33	
諸会費	29	
支払販売手数料	38	
		営業費用計 40,042
一般管理費		
給料	4,831	
役員報酬	77	
給料・手当	4,735	
賞与	19	
交際費	14	
寄付金	3	
旅費交通費	63	
租税公課	175	
不動産賃借料	508	
退職給付費用	206	
固定資産減価償却費	1 749	
福利厚生費	17	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	861	
役員賞与引当金繰入額	26	
機器リース料	0	
事務委託費	1,714	
事務用消耗品費	24	
器具備品費	0	
諸経費	120	
		一般管理費計 9,319
営業利益		9,782

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	3	
受取配当金	3	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	35	
雑収入	10	
	営業外収益計	53
営業外費用		
為替差損	7	
金銭の信託運用損	785	
早期割増退職金	0	
雑損失	3	
	営業外費用計	797
経常利益		9,038
特別損失		
固定資産除却損	2	
関係会社株式評価損	922	
	特別損失計	924
税引前中間純利益		8,113
法人税、住民税及び事業税		2,136
法人税等調整額		303
法人税等合計		2,440
中間純利益		5,673

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,040
中間純利益							5,673
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	5,366
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,311

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	57,481	79,034	0	0	79,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,040	11,040			11,040
中間純利益	5,673	5,673			5,673
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	5,366	5,366	0	0	5,366
当中間期末残高	52,115	73,668	0	0	73,668



## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(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</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
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	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物           ...     8～18年 器具備品     ...     2～20年</p> <p>(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ェアについては、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。</p> <p>(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。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

## 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。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

項目	第39期中間会計期間末 （2023年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	577百万円
	器具備品	...	764百万円
	リース資産	...	2百万円

## （中間損益計算書関係）

項目	第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	71百万円
	無形固定資産	...	678百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

## 1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2.配当に関する事項

## （1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類 株式				

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

（金融商品関係）

第39期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

1.金融商品の時価等に関する事項

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	28,384	28,384	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,386	28,386	-

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

2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	28,384	-	28,384
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,386	-	28,386

（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、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開  
示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	182
関係会社株式	
非上場株式	4,888

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末

(2023年9月30日現在)

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(中間貸借対照表計上額4,888百万円)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

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額182百万円)については、市場価格がないことから、上  
表に含めておりません。

(持分法損益等)

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社と  
しておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

MHAM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、TB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、DIAM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」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」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IA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」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」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	65,400百万円
資産合計	65,400百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	3,358百万円
負債合計	3,358百万円
純資産	62,041百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額49,546百万円及び顧客関連資産の金額19,028百万円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	3,824百万円
経常利益	3,824百万円
税引前中間純利益	3,824百万円
中間純利益	3,237百万円
1株当たり中間純利益	80,925円14銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額1,918百万円が含まれております。

## (資産除去債務関係)

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

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

## (収益認識関係)

## 1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第39期中間会計期間  
(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

委託者報酬	49,984百万円
運用受託報酬	7,464百万円
投資助言報酬	1,082百万円
成功報酬(注)	599百万円
その他営業収益	13百万円
合計	59,144百万円

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

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

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



(セグメント情報等)

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

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。

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,841,700円33銭
1株当たり中間純利益金額	141,837円37銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益金額	5,673百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	5,673百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 )。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 )。
- (3) 通常の見積り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
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2023年3月末日現在

#### (3) 投資顧問会社

名称	イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社
資本金の額	9,557.5百万円(2023年3月末日現在)
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2023年5月25日	臨時報告書
2023年7月26日	臨時報告書
2023年8月10日	有価証券報告書
2023年8月10日	有価証券届出書
2023年9月26日	臨時報告書

## 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、継続企業的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) X B R L 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

2024年1月12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 公認会計士 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の2023年5月12日から2023年11月13日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の2023年11月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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



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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注1) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR L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11月22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 森重 俊寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

#### 利害関係

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

以上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。