【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8月13日提出
【計算期間】	第35特定期間（自　2023年11月14日　至　2024年5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】

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

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

＜ファンドの特色＞

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

＊2024年5月末時点

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

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

4 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

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

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

・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ

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

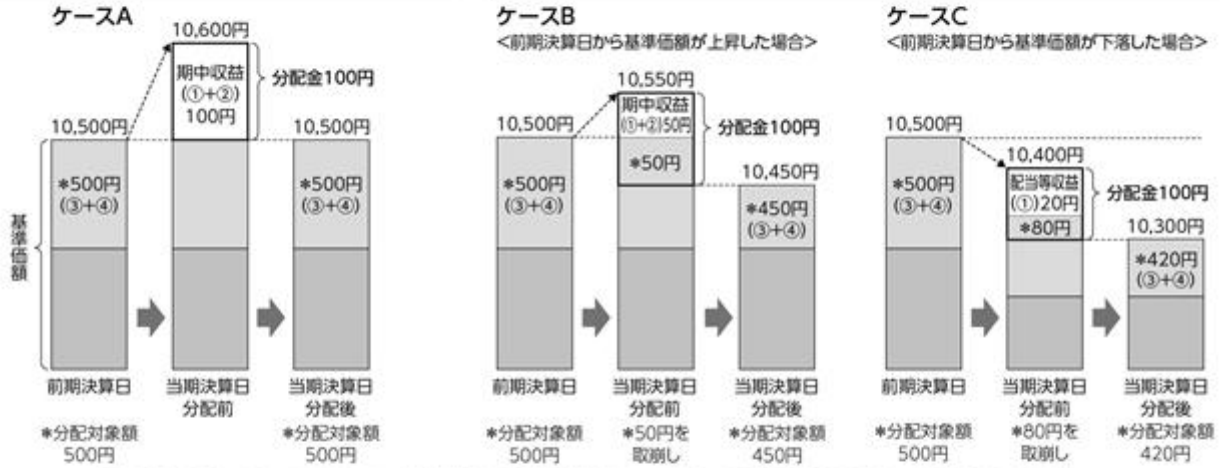
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

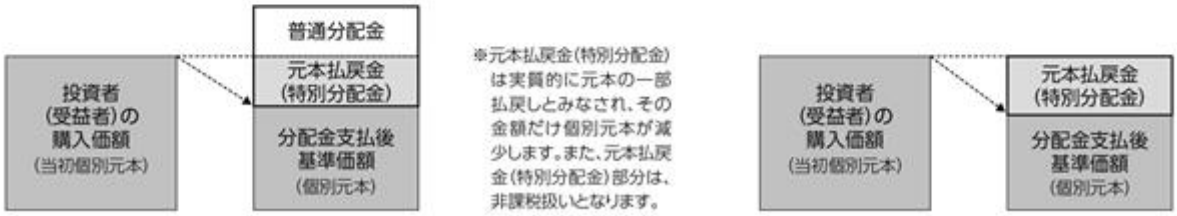
ケースA：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
ケースB：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
ケースC：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

○商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

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

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

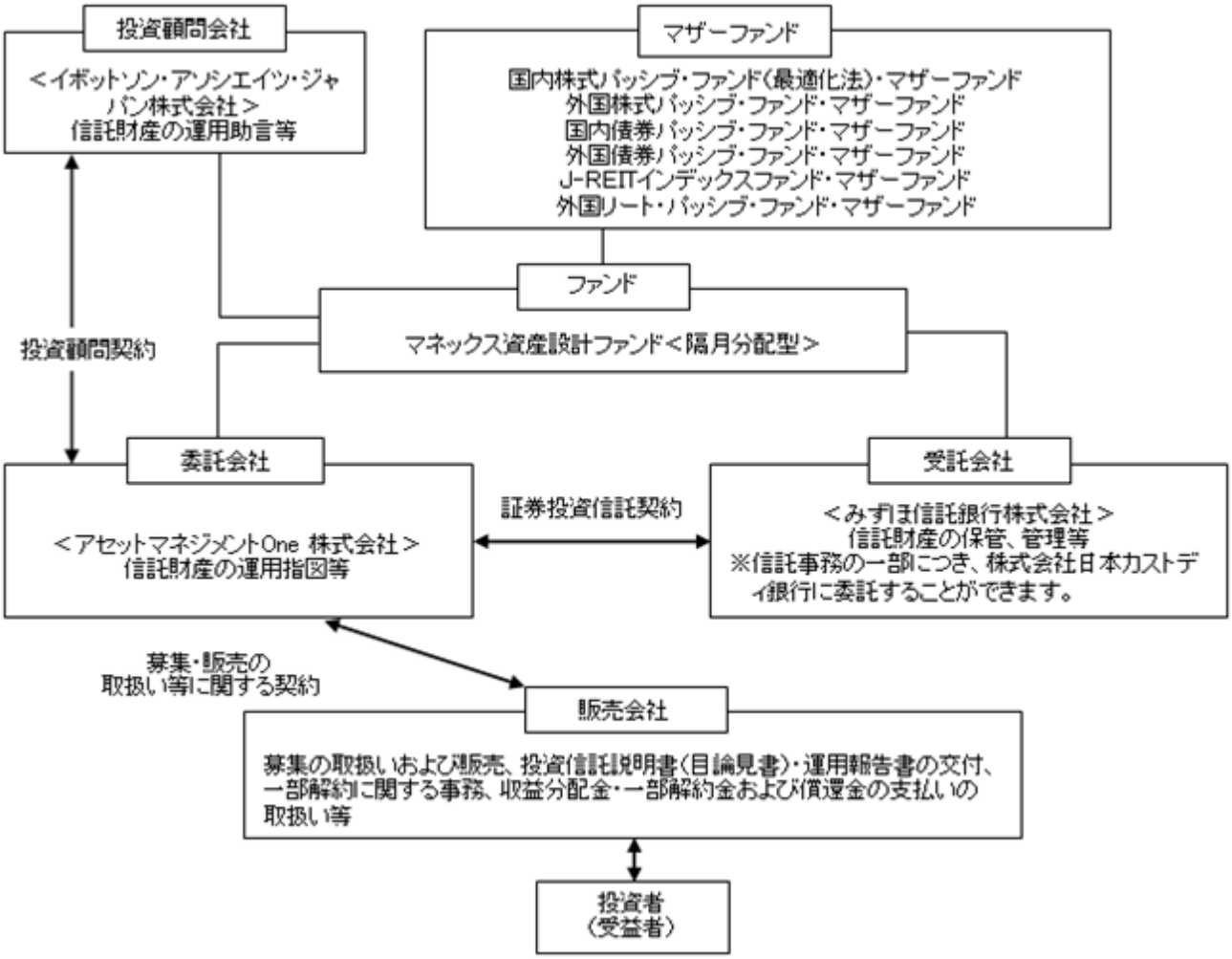
（２）【ファンドの沿革】

2007年1月26日　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2016年4月13日　外国リートの投資対象マザーファンドを「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」から「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」へ変更

2018年10月12日　信託報酬率(税抜）を「年率0.95%」から「年率0.50%」に引き下げ

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

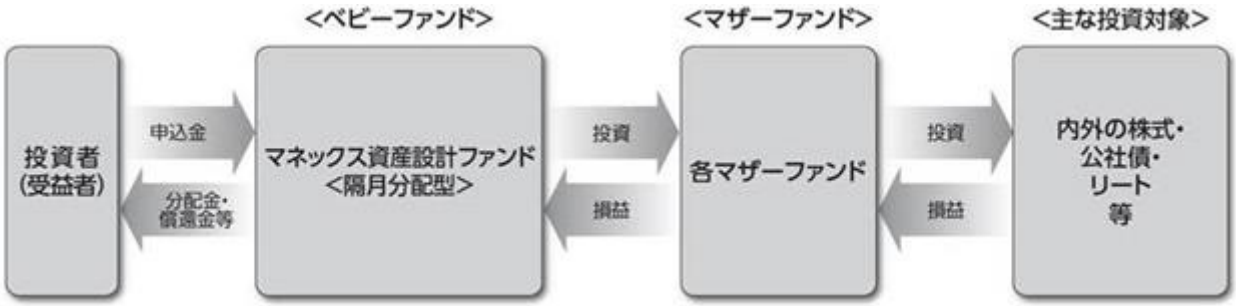
委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメント0ne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（2024年5月31日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメント0ne株式会社に変更

大株主の状況

（2024年5月31日現在）

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

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

＜基本方針＞

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

＜投資対象＞

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

＜投資態度＞

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

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

※投資対象の詳細は、約款をご覧下さい。

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

（２）【投資対象】

1.投資の対象とする資産（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

2.有価証券の指図範囲　（約款第16条第1項）

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

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

28)外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの
なお、7)の証券または証書、18)ならびに23)の証券または証書のうち7)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、8)から12)までの証券および18)ならびに23)の証券または証書のうち8)から12)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、19)の証券および20)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

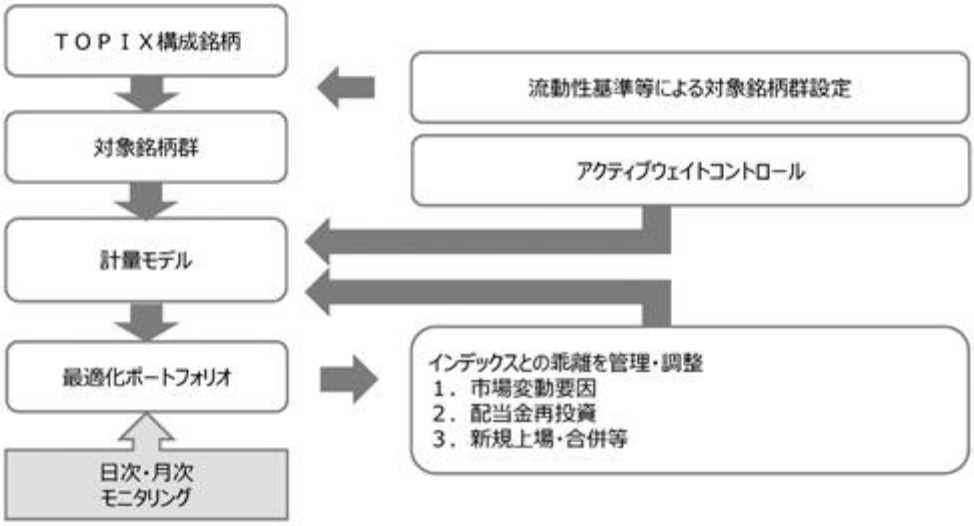
3.金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）
委託会社は、信託金を、上記2．に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
1)預金
2)指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3)コール・ローン
4)手形割引市場において売買される手形
5)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6)外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

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

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

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

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

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

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

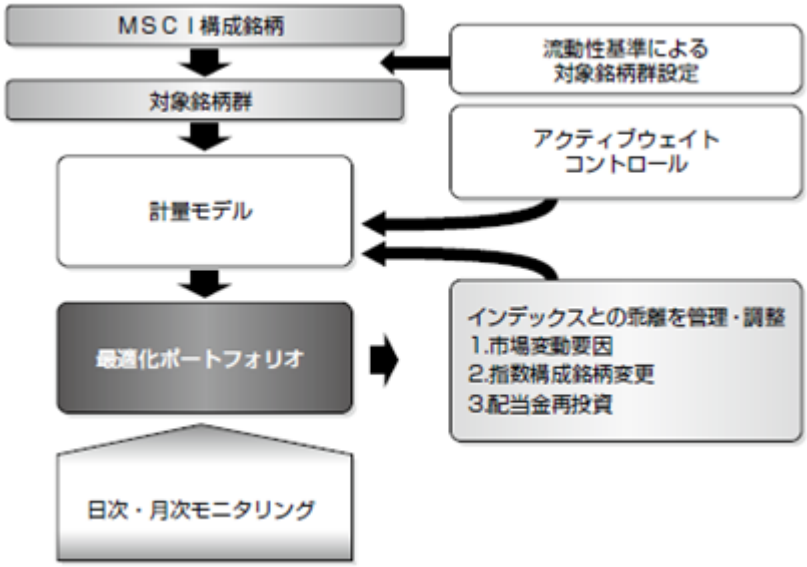
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝す

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

②株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

③組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

運用プロセス



①流動性基準による対象銘柄群設定

取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。

②最適化法によるポートフォリオの構築

インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

③インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

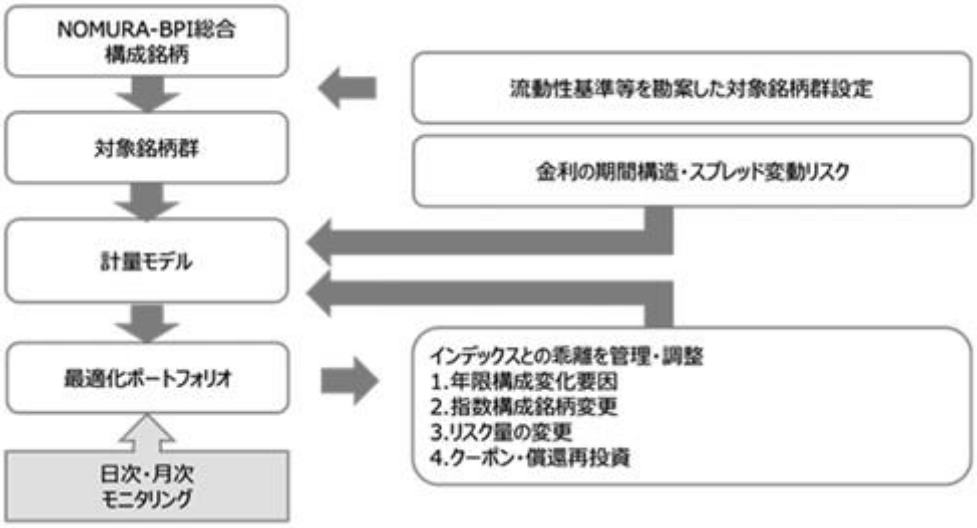
・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施

・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施

・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

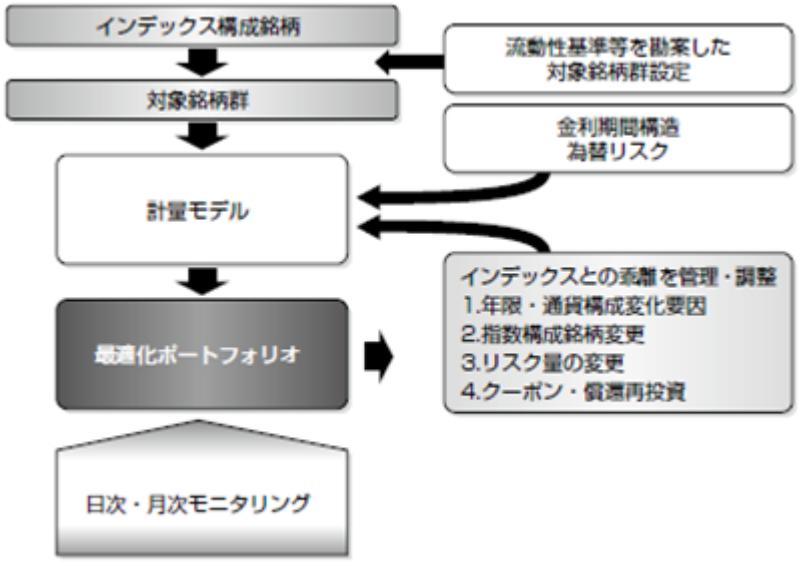
主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④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

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

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

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

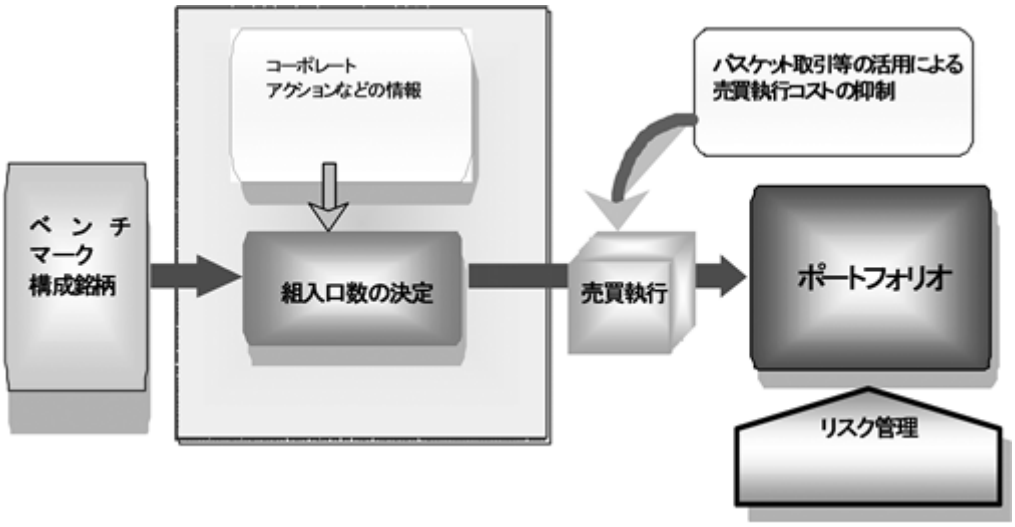
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	①主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 （注）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売ある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

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

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

ファンド名	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

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

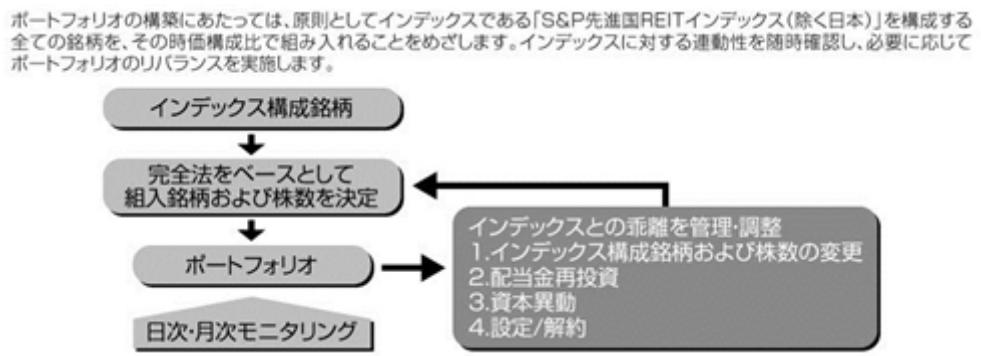
運用プロセス	①原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ②新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ③配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動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

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

（注）Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスがアセットマネジメントOne株式会社（以下「アセットマネジメントOne」）に付与されています。S&P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global，Inc.またはその関連会社(「S&P」)の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、アセットマネジメントOneにより一定の目的でサブライセンスされています。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）がスポンサーとなっておらず、推奨、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、証券全般または具体的に本商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに関する、S&P Dow Jones IndicesとアセットマネジメントOneとの間における唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesおよび／またはそのライセンサーの一定の商標、サービスマーク、および／または商号をライセンス供与していることです。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは、アセットマネジメントOneまたは本商品を考慮することなく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの決定、構成または計算に際して、アセットマネジメントOne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、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資リターンを提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indicesは、（改正米国1940年投資会社法に定義する）投資顧問、商品取引顧問、コモディティ・プール・オペレーター、ブローカー・ディーラー、受認者、プロモーターでも、合衆国法典第15巻第77条k項(a)に列記する「専門家」でも、税務顧問でもありません。S&P Dow Jones Indicesが、証券、商品、暗号通貨又はその他資産を指数に採用した場合にも、それは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券、商品、暗号通貨またはその他の資産を購入、売却または保有するよう推奨したことにはならず、また投資助言もしくは商品取引の助言とはみなされません。

S&P DOW JONES INDICESまたは第三者ライセンサーは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、

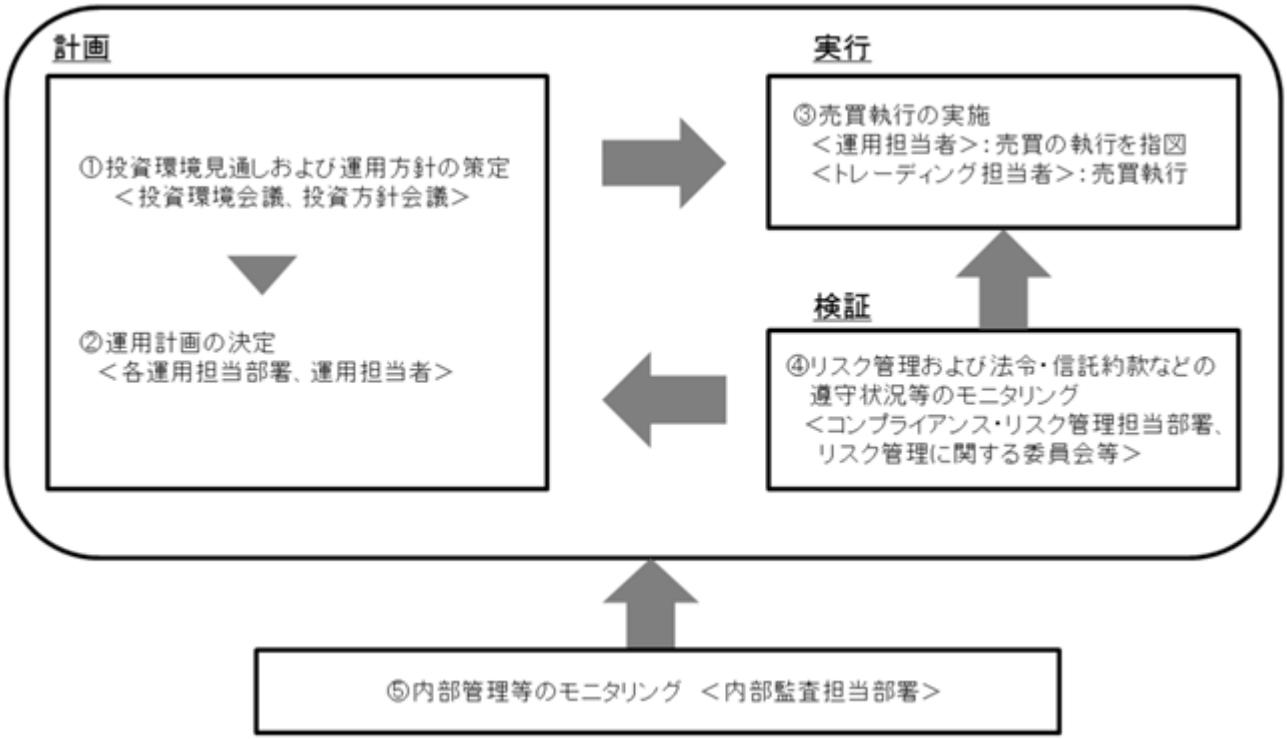
	その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、アセットマネジメントOne、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られるべき結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、ライセンシーの商品の有価証券届出書、目論見書またはその他の募集資料を審査しておらず、いかなる部分も作成および／または証明しておらず、またS&P DOW JONES INDIESはそれらを管理していません。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESとアセットマネジメントOneとの間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。）とします。
投資態度	1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
運用プロセス	

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2024年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

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

1)分配対象額の範囲

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

2)分配対象額についての分配方針

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

3)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

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

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

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

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

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

c.毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

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

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

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

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

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

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

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

⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。（約款「運用の基本方針」 2.運用方法 (3)投資制限）

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

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

⑪投資する株式等の範囲（約款第19条）

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

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

⑫信用取引の指図および範囲（約款第22条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

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

⑬先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

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

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

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

⑭スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

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

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

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

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

⑮金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

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

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

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

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

⑯デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条の2）

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

⑰有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

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

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

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

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

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

⑱公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

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

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

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

⑲公社債の借入れ（約款第28条）

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

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

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

4)上記1)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

⑳特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

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

㉑外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

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

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

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

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

㉒資金の借入れ　（約款第37条）

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

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

3)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権（株主総会において決

議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

○資産配分リスク

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

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

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

○リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

○信用リスク

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

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

○流動性リスク

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

○当ファンドのお取引に関しては金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
○当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
○有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
○当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。
○資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

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

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

○注意事項

・当ファンドは、実質的に株式、債券、リートなど値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

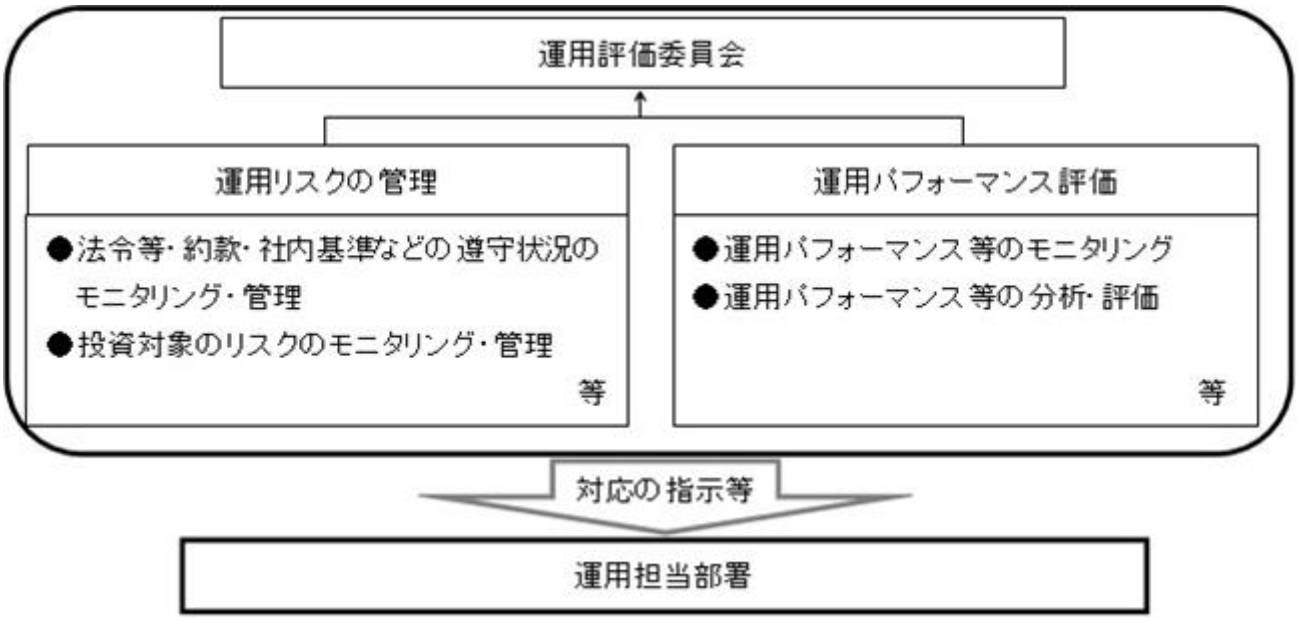
＜リスク管理体制＞

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

・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。

・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。

・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運

用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

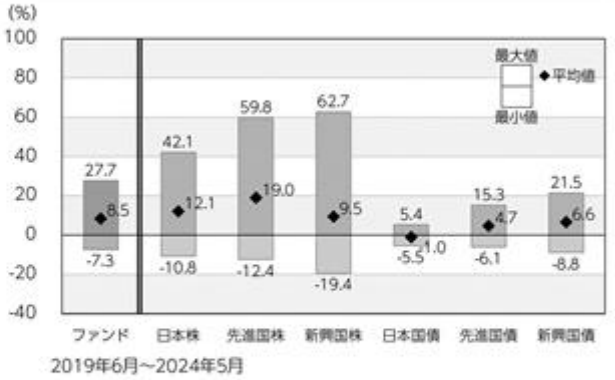
※リスク管理体制は2024年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）

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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

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

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

1.信託財産留保額

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

2.その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」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5月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

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

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

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

③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

…（参考情報）ファンドの総経費率

総経費率（①+②）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.57%	0.55%	0.02%

（表示桁数未満を四捨五入）

※対象期間:2023年11月14日～2024年5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】

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		511,788,169	98.38
	内　日本	511,788,169	98.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,443,481	1.62
純資産総額		520,231,650	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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		585,108,608,590	96.96
	内　日本	585,108,608,590	96.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		18,316,757,491	3.04
純資産総額		603,425,366,081	100.00

その他資産の投資状況

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		18,322,920,000	3.04
	内　日本	18,322,920,000	3.04

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		1,460,447,694,816	95.72
	内　アメリカ	1,060,464,179,197	69.50
	内　イギリス	57,311,246,520	3.76
	内　カナダ	48,718,889,848	3.19
	内　フランス	44,783,314,498	2.94
	内　スイス	44,478,681,929	2.92
	内　ドイツ	35,066,344,477	2.30
	内　オランダ	29,962,399,270	1.96
	内　オーストラリア	26,798,427,075	1.76
	内　アイルランド	26,305,554,528	1.72
	内　デンマーク	15,505,122,067	1.02
	内　スウェーデン	12,974,206,943	0.85
	内　スペイン	10,838,329,999	0.71
	内　イタリア	8,637,648,878	0.57
	内　香港	6,036,174,204	0.40
	内　ジャージィー	4,814,249,077	0.32
	内　シンガポール	4,457,182,926	0.29

	内　フィンランド	4,259,559,282	0.28
	内　ベルギー	3,217,163,432	0.21
	内　イスラエル	2,887,716,967	0.19
	内　ノルウェー	2,499,303,920	0.16
	内　ケイマン諸島	2,043,479,494	0.13
	内　バミューダ	1,993,136,553	0.13
	内　オランダ領キュラソー	1,613,716,438	0.11
	内　ニュージーランド	1,135,198,709	0.07
	内　リベリア	866,077,114	0.06
	内　オーストリア	822,326,152	0.05
	内　ルクセンブルグ	742,481,346	0.05
	内　ポルトガル	732,732,982	0.05
	内　パナマ	353,574,342	0.02
	内　マン島	129,276,649	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		2,417,845,297	0.16
	内　オーストラリア	1,920,492,728	0.13
	内　シンガポール	497,352,569	0.03
投資証券		25,012,440,342	1.64
	内　アメリカ	23,382,445,951	1.53
	内　フランス	598,523,248	0.04
	内　イギリス	538,882,118	0.04
	内　香港	279,164,935	0.02
	内　ベルギー	141,565,107	0.01
	内　カナダ	71,858,983	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		37,938,357,799	2.49
純資産総額		1,525,816,338,254	100.00

その他資産の投資状況

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		37,847,390,016	2.48
	内　アメリカ	29,064,439,266	1.90
	内　ドイツ	5,238,857,317	0.34
	内　イギリス	1,596,314,105	0.10
	内　カナダ	1,211,297,520	0.08
	内　オーストラリア	736,481,808	0.05

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		476,474,640,100	85.80
	内　日本	476,474,640,100	85.80
地方債証券		27,327,994,363	4.92
	内　日本	27,327,994,363	4.92

特殊債券		26,653,837,849	4.80
	内　日本	26,653,837,849	4.80
社債券		22,216,927,400	4.00
	内　日本	21,823,371,400	3.93
	内　フランス	393,556,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,635,956,475	0.47
純資産総額		555,309,356,187	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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		259,849,019,371	98.72
	内　アメリカ	122,328,037,359	46.47
	内　中国	24,753,570,056	9.40
	内　フランス	20,662,813,906	7.85
	内　イタリア	18,790,965,392	7.14
	内　ドイツ	16,012,437,642	6.08
	内　イギリス	13,292,993,363	5.05
	内　スペイン	12,575,661,367	4.78
	内　カナダ	5,234,549,278	1.99
	内　ベルギー	4,510,394,003	1.71
	内　オランダ	3,850,287,755	1.46
	内　オーストラリア	3,365,500,602	1.28
	内　オーストリア	2,968,929,158	1.13
	内　メキシコ	2,153,624,203	0.82
	内　フィンランド	1,344,053,739	0.51
	内　ポーランド	1,336,811,688	0.51
	内　アイルランド	1,294,155,771	0.49
	内　マレーシア	1,253,437,898	0.48
	内　シンガポール	1,048,305,102	0.40
	内　イスラエル	860,906,728	0.33
	内　デンマーク	677,287,366	0.26
	内　ニュージーランド	625,624,041	0.24
	内　スウェーデン	495,865,950	0.19
	内　ノルウェー	412,807,004	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,376,599,104	1.28
純資産総額		263,225,618,475	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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		177,344,404,200	97.18
	内　日本	177,344,404,200	97.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,137,756,357	2.82
純資産総額		182,482,160,557	100.00

その他資産の投資状況

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		4,974,037,000	2.73
	内　日本	4,974,037,000	2.73

（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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		8,909,593,638	10.82
	内　オーストラリア	6,263,998,180	7.61
	内　シンガポール	2,598,315,754	3.16
	内　香港	47,279,704	0.06
投資証券		72,825,478,731	88.46
	内　アメリカ	62,806,489,558	76.29
	内　イギリス	4,262,352,917	5.18
	内　フランス	1,619,401,072	1.97
	内　カナダ	1,161,175,179	1.41
	内　ベルギー	909,827,738	1.11
	内　香港	767,035,682	0.93
	内　スペイン	389,491,478	0.47
	内　ニュージーランド	237,373,304	0.29
	内　ガーンジィ	202,251,254	0.25
	内　韓国	154,635,652	0.19
	内　オランダ	154,146,175	0.19
	内　イスラエル	92,961,801	0.11
	内　ドイツ	32,524,596	0.04
	内　アイルランド	28,881,527	0.04
	内　イタリア	6,930,798	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		593,523,849	0.72
純資産総額		82,328,596,218	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2024年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	16,139,878	9.1413 147,541,080	9.1997 148,482,035	－ －	28.54
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	26,070,549	4.8024 125,203,811	4.8888 127,453,699	－ －	24.50

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	94,093,897	1.2158 114,408,769	1.2033 113,223,186	－ －	21.76
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	25,663,517	2.4056 61,738,722	2.4163 62,010,756	－ －	11.92
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	15,876,493	1.9925 31,635,499	1.9877 31,557,705	－ －	6.07
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	12,646,122	2.3928 30,260,905	2.2980 29,060,788	－ －	5.59

（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

2024年5月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	98.38
合計	98.38

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（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

2024年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	8,223,500	3,277.39 26,951,681,734	3,401.00 27,968,123,500	－ －	4.63
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,982,700	1,410.79 12,672,736,268	1,658.00 14,893,316,600	－ －	2.47
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,048,800	14,229.36 14,923,756,514	12,895.00 13,524,276,000	－ －	2.24
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	726,900	11,815.00 8,588,327,662	16,145.00 11,735,800,500	－ －	1.94
5	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	317,000	28,852.79 9,146,337,210	33,630.00 10,660,710,000	－ －	1.77
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,032,900	7,740.40 7,995,068,336	10,290.00 10,628,541,000	－ －	1.76
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	149,800	64,303.96 9,632,733,796	70,690.00 10,589,362,000	－ －	1.75
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,042,500	2,816.79 8,570,094,402	3,303.00 10,049,377,500	－ －	1.67
9	三井物産 日本	株式 卸売業	1,186,700	5,910.95 7,014,533,783	7,970.00 9,457,999,000	－ －	1.57

10	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,108,800	5,813.19 6,445,674,522	7,948.00 8,812,742,400	－ －	1.46
11	任天堂 日本	株式 その他製品	945,600	8,341.60 7,887,823,710	8,555.00 8,089,608,000	－ －	1.34
12	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,065,200	6,739.03 7,178,424,359	7,410.00 7,893,132,000	－ －	1.31
13	信越化学工業 日本	株式 化学	1,345,200	5,840.31 7,856,387,409	5,855.00 7,876,146,000	－ －	1.31
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,440,100	3,910.84 5,632,011,283	5,429.00 7,818,302,900	－ －	1.30
15	第一三共 日本	株式 医薬品	1,308,500	4,525.05 5,921,038,853	5,578.00 7,298,813,000	－ －	1.21
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	44,678,600	182.90 8,171,998,709	154.30 6,893,907,980	－ －	1.14
17	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	741,000	6,697.29 4,962,696,056	9,042.00 6,700,122,000	－ －	1.11
18	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,991,000	2,732.41 5,440,231,014	3,214.00 6,399,074,000	－ －	1.06
19	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,548,500	1,715.78 6,088,456,979	1,769.50 6,279,070,750	－ －	1.04
20	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	294,900	18,371.67 5,417,807,769	19,060.00 5,620,794,000	－ －	0.93
21	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,329,400	4,214.87 5,603,255,242	4,173.00 5,547,586,200	－ －	0.92
22	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,160,600	4,589.54 5,326,626,060	4,337.00 5,033,522,200	－ －	0.83
23	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,683,700	2,033.97 3,424,597,941	2,730.00 4,596,501,000	－ －	0.76
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,397,300	1,943.20 4,658,441,057	1,887.50 4,524,903,750	－ －	0.75
25	ディスコ 日本	株式 機械	72,900	43,295.78 3,156,262,960	61,490.00 4,482,621,000	－ －	0.74
26	ダイキン工業 日本	株式 機械	180,500	21,133.74 3,814,640,096	22,945.00 4,141,572,500	－ －	0.69
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,362,600	2,979.82 4,060,306,654	2,966.50 4,042,152,900	－ －	0.67
28	丸紅 日本	株式 卸売業	1,314,400	2,398.68 3,152,830,415	3,060.00 4,022,064,000	－ －	0.67
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	896,100	3,947.79 3,537,617,692	4,452.00 3,989,437,200	－ －	0.66
30	住友商事 日本	株式 卸売業	959,000	3,377.01 3,238,560,597	4,081.00 3,913,679,000	－ －	0.65

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年5月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.96
合計	96.96

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年5月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	16.84
輸送用機器		8.56
銀行業		7.82
卸売業		7.58
情報・通信業		6.65
機械		5.44
化学		5.38
サービス業		4.26
医薬品		4.18
小売業		3.91
食料品		3.03
保険業		2.95
その他製品		2.32
陸運業		2.22
精密機器		2.17
建設業		1.98
不動産業		1.90
電気・ガス業		1.53
その他金融業		1.14
証券、商品先物取引業		0.92
鉄鋼		0.87
非鉄金属		0.77
海運業		0.76
ゴム製品		0.68
ガラス・土石製品		0.66
石油・石炭製品		0.53
金属製品		0.51
空運業		0.36
繊維製品		0.35
鉱業		0.34
パルプ・紙		0.15
倉庫・運輸関連業		0.13
水産・農林業		0.08
合計		96.96

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,101,726	64,199.07 70,729,786,106	64,995.37 71,607,095,398	－ －	4.69
2	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	2,292,065	28,868.10 66,167,565,128	29,982.79 68,722,514,104	－ －	4.50
3	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	385,483	116,256.06 44,814,735,042	173,197.69 66,764,768,989	－ －	4.38
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小売り	1,451,547	26,842.34 38,962,918,830	28,106.61 40,798,075,296	－ －	2.67
5	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	346,441	74,194.55 25,704,036,479	73,205.41 25,361,357,870	－ －	1.66
6	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	926,180	22,923.37 21,231,167,869	26,976.52 24,985,114,590	－ －	1.64
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	801,655	23,103.31 18,520,889,966	27,203.79 21,808,057,799	－ －	1.43
8	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	125,975	118,695.71 14,952,692,988	127,752.50 16,093,621,741	－ －	1.05
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	69,434	198,069.27 13,752,741,910	213,805.89 14,845,398,805	－ －	0.97
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	450,997	27,648.11 12,469,219,010	31,242.98 14,090,492,145	－ －	0.92
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	204,254	62,533.23 12,772,664,234	64,045.53 13,081,555,970	－ －	0.86

12	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	447,226	29,564.92 13,222,201,799	28,023.54 12,532,857,757	－ －	0.82
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	699,989	15,773.03 11,040,952,935	17,866.79 12,506,558,285	－ －	0.82
14	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	144,554	80,979.62 11,705,929,183	75,493.82 10,912,933,800	－ －	0.72
15	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	509,501	19,288.30 9,827,408,552	20,868.64 10,632,594,986	－ －	0.70
16	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	246,967	43,508.50 10,745,163,814	42,523.56 10,501,916,536	－ －	0.69
17	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	62,985	144,917.61 9,127,635,707	149,576.17 9,421,055,697	－ －	0.62
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	367,769	24,418.96 8,980,536,732	25,482.78 9,371,779,901	－ －	0.61
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	130,562	72,907.11 9,518,898,367	69,294.75 9,047,261,671	－ －	0.59
20	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	69,370	113,350.71 7,863,139,266	127,796.39 8,865,235,685	－ －	0.58
21	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	375,953	24,410.35 9,177,147,747	22,771.18 8,560,896,141	－ －	0.56
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	155,602	56,099.04 8,729,123,467	51,595.67 8,028,389,941	－ －	0.53
23	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	395,990	19,730.45 7,813,062,281	19,518.83 7,729,262,362	－ －	0.51
24	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	693,546	8,823.06 6,119,204,471	10,170.85 7,053,958,298	－ －	0.46
25	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	68,404	90,868.74 6,215,785,944	101,514.22 6,943,979,279	－ －	0.46
26	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	279,196	23,685.36 6,612,858,933	24,805.67 6,925,644,511	－ －	0.45
27	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	417,435	16,795.29 7,010,942,652	16,342.70 6,822,016,644	－ －	0.45

28	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	275,878	27,314.89 7,535,579,870	24,500.02 6,759,019,110	－ －	0.44
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,113,014	5,208.68 5,797,337,091	6,054.86 6,739,150,848	－ －	0.44
30	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	252,813	27,970.15 7,071,217,867	26,136.39 6,607,620,429	－ －	0.43

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年5月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.72
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.64
合計	97.51

（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

2024年5月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
半導体・半導体製造装置	外国	9.12
ソフトウェア		8.14
銀行		5.49
医薬品		4.93
コンピュータ・周辺機器		4.87
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.86
石油・ガス・消耗燃料		4.27
大規模小売り		3.10
資本市場		3.09
保険		3.00
金融サービス		2.96
ヘルスケア機器・用品		2.11
航空宇宙・防衛		2.04
ホテル・レストラン・レジャー		1.84
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.82
機械		1.81
化学		1.75
生活必需品流通・小売り		1.72
バイオテクノロジー		1.65
電力		1.62
専門小売り		1.50
飲料		1.43
自動車		1.41
金属・鉱業		1.41
食品		1.23
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.12

情報技術サービス	1.11
電気設備	1.09
繊維・アパレル・贅沢品	1.08
娯楽	1.05
家庭用品	0.99
陸上運輸	0.96
専門サービス	0.94
各種電気通信サービス	0.88
総合公益事業	0.68
建設関連製品	0.65
コングロマリット	0.62
通信機器	0.62
商業サービス・用品	0.58
パーソナルケア用品	0.57
メディア	0.57
タバコ	0.50
電子装置・機器・部品	0.49
商社・流通業	0.46
航空貨物・物流サービス	0.40
消費者金融	0.40
建設・土木	0.32
建設資材	0.31
家庭用耐久財	0.30
不動産管理・開発	0.28
エネルギー設備・サービス	0.22
容器・包装	0.22
無線通信サービス	0.20
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
自動車用部品	0.14
運送インフラ	0.09
紙製品・林産品	0.09
水道	0.09
ガス	0.09
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	0.05
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.02
合計	95.72

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	10,400,000,000	99.26 10,323,490,000	98.43 10,237,448,000	0.1 2028/3/20	1.84

2	４５６回　利付国庫債券 （２年） 日本	国債証券	8,300,000,000	99.85 8,288,196,000	99.65 8,271,199,000	0.1 2026/1/1	1.49
3	３７３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,600,000,000	98.72 7,503,103,000	96.13 7,306,336,000	0.6 2033/12/20	1.32
4	１４５回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	7,300,000,000	100.04 7,303,431,000	99.79 7,284,816,000	0.1 2025/9/20	1.31
5	１５６回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	7,200,000,000	99.73 7,180,872,000	98.97 7,125,912,000	0.2 2027/12/20	1.28
6	１６０回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	7,100,000,000	99.55 7,068,195,000	98.63 7,003,014,000	0.2 2028/6/20	1.26
7	３５８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	7,050,000,000	98.14 6,919,430,000	96.79 6,823,906,500	0.1 2030/3/20	1.23
8	３６９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,820,000,000	98.76 6,735,472,000	96.51 6,582,527,600	0.5 2032/12/20	1.19
9	３６７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,900,000,000	96.74 6,675,173,000	94.74 6,537,543,000	0.2 2032/6/20	1.18
10	３６６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,280,000,000	97.02 6,093,089,000	95.07 5,970,647,200	0.2 2032/3/20	1.08
11	３７０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,900,000,000	98.57 5,816,189,000	96.23 5,677,570,000	0.5 2033/3/20	1.02
12	１５３回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,210,000,000	99.41 5,179,677,800	98.64 5,139,508,700	0.005 2027/6/20	0.93
13	３６４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,350,000,000	96.80 5,179,114,000	95.00 5,082,981,500	0.1 2031/9/20	0.92
14	３７２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,000,000,000	100.72 5,036,054,000	98.25 4,912,800,000	0.8 2033/9/20	0.88
15	３５２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,950,000,000	99.00 4,900,648,500	98.02 4,852,336,500	0.1 2028/9/20	0.87
16	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,890,000,000	99.90 4,885,110,000	99.18 4,849,902,000	0.1 2026/12/20	0.87
17	１４６回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,700,000,000	99.99 4,699,530,000	99.68 4,685,148,000	0.1 2025/12/20	0.84
18	１４８回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,610,000,000	99.68 4,595,515,900	99.20 4,573,488,800	0.005 2026/6/20	0.82

19	３７１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,800,000,000	96.82 4,647,695,000	95.10 4,564,848,000	0.4 2033/6/20	0.82
20	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,540,000,000	99.84 4,533,008,400	99.06 4,497,369,400	0.1 2027/3/20	0.81
21	３６８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,750,000,000	96.37 4,577,860,000	94.41 4,484,570,000	0.2 2032/9/20	0.81
22	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,500,000,000	99.73 4,488,030,000	98.93 4,451,985,000	0.1 2027/6/20	0.80
23	３６３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,470,000,000	97.04 4,337,874,000	95.36 4,262,681,400	0.1 2031/6/20	0.77
24	３４３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,090,000,000	99.94 4,087,586,900	99.40 4,065,500,900	0.1 2026/6/20	0.73
25	１５０回　利付国庫債券 （２０年） 日本	国債証券	3,930,000,000	105.53 4,147,653,000	102.87 4,042,791,000	1.4 2034/9/20	0.73
26	３４８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,070,000,000	99.62 4,054,737,500	98.78 4,020,427,400	0.1 2027/9/20	0.72
27	３６５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,230,000,000	96.31 4,073,981,000	94.64 4,003,525,800	0.1 2031/12/20	0.72
28	３６０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,100,000,000	97.82 4,010,661,000	96.26 3,946,824,000	0.1 2030/9/20	0.71
29	３５９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,050,000,000	98.05 3,971,146,500	96.54 3,910,153,500	0.1 2030/6/20	0.70
30	１５４回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	3,900,000,000	99.43 3,878,084,000	98.78 3,852,498,000	0.1 2027/9/20	0.69

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年5月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	85.80
地方債証券	4.92
特殊債券	4.80
社債券	4.00
合計	99.53

（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

2024年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	1,401,255,600	92.01 1,289,379,182	91.84 1,287,020,420	1.5 2027/1/31	0.49
2	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,561,130,400	80.84 1,262,157,000	79.89 1,247,257,810	1.25 2031/8/15	0.47
3	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証券	1,201,154,600	101.31 1,216,927,109	101.74 1,222,074,749	2.69 2026/8/12	0.46
4	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	1,166,589,000	101.94 1,189,291,638	102.22 1,192,493,692	3.03 2026/3/11	0.45
5	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,253,920,000	96.78 1,213,559,450	94.87 1,189,656,600	3.875 2033/8/15	0.45
6	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	1,136,344,100	101.61 1,154,649,402	102.62 1,166,144,269	2.68 2030/5/21	0.44
7	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,369,907,600	83.71 1,146,842,760	82.71 1,133,090,176	1.625 2031/5/15	0.43
8	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,261,757,000	90.24 1,138,661,764	88.83 1,120,819,725	2.875 2032/5/15	0.43
9	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,393,418,600	81.03 1,129,142,406	80.08 1,115,877,911	1.375 2031/11/15	0.42
10	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,362,070,600	81.48 1,109,927,755	80.53 1,096,972,281	1.125 2031/2/15	0.42
11	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,097,180,000	100.86 1,106,648,418	99.57 1,092,465,549	4.5 2033/11/15	0.42
12	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 中国	国債証券	1,080,175,000	100.02 1,080,443,835	100.60 1,086,663,287	2.18 2026/8/15	0.41
13	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,360,503,200	80.42 1,094,221,018	79.64 1,083,513,248	0.875 2030/11/15	0.41
14	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,112,854,000	98.77 1,099,229,245	96.96 1,079,077,144	4.125 2032/11/15	0.41
15	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証券	1,069,373,250	100.31 1,072,728,274	100.88 1,078,836,775	2.3 2026/5/15	0.41
16	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,228,841,600	89.08 1,094,725,064	87.69 1,077,612,473	2.75 2032/8/15	0.41
17	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,136,365,000	94.12 1,069,627,589	92.44 1,050,471,780	3.5 2033/2/15	0.40
18	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	1,097,180,000	93.05 1,021,019,347	91.36 1,002,462,511	3.375 2033/5/15	0.38
19	US T N/B 1.0 07/31/28 アメリカ	国債証券	1,139,499,800	86.83 989,450,768	86.39 984,420,997	1 2028/7/31	0.37
20	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,213,167,600	79.50 964,468,242	78.91 957,407,225	0.625 2030/8/15	0.36
21	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証券	940,440,000	98.40 925,451,737	97.84 920,180,129	3.75 2026/4/15	0.35

22	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証券	998,306,400	92.34 921,912,608	90.73 905,795,342	1.5 2031/5/25	0.34
23	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証券	954,546,600	94.44 901,524,512	94.50 902,121,104	1.625 2026/2/15	0.34
24	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 中国	国債証券	842,536,500	103.05 868,314,462	103.80 874,575,888	3.01 2028/5/13	0.33
25	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証券	940,440,000	92.22 867,298,744	92.40 869,043,702	0.75 2026/4/30	0.33
26	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27 中国	国債証券	851,393,935	101.03 860,185,451	101.49 864,104,990	2.5 2027/7/25	0.33
27	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	896,552,800	92.49 829,276,319	92.68 830,974,863	0.75 2026/3/31	0.32
28	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証券	893,418,000	92.22 823,951,255	92.63 827,598,215	0.375 2026/1/31	0.31
29	FRANCE OAT 0.5 05/25/26 フランス	国債証券	859,086,800	95.00 816,190,850	94.96 815,816,316	0.5 2026/5/25	0.31
30	US T N/B 0.75 05/31/26 アメリカ	国債証券	882,446,200	91.97 811,591,972	92.13 813,005,262	0.75 2026/5/31	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

2024年5月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.72
合計	98.72

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	20,782	577,331.10 11,998,094,958	587,000.00 12,199,034,000	－ －	6.69
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	18,299	545,275.21 9,977,991,222	518,000.00 9,478,882,000	－ －	5.19
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	57,609	163,715.18 9,431,468,246	147,700.00 8,508,849,300	－ －	4.66
4	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	31,034	295,171.58 9,160,354,887	259,200.00 8,044,012,800	－ －	4.41
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	85,390	97,841.35 8,354,673,666	92,500.00 7,898,575,000	－ －	4.33

6	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	59,839	143,003.46 8,557,184,494	130,500.00 7,808,989,500	－ －	4.28
7	ＫＤＸ不動産投資法人 日本	投資証券	50,480	160,570.40 8,105,594,273	151,500.00 7,647,720,000	－ －	4.19
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	26,853	281,614.33 7,562,189,712	248,800.00 6,681,026,400	－ －	3.66
9	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	86,254	59,554.04 5,136,774,418	68,300.00 5,891,148,200	－ －	3.23
10	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	35,495	176,327.74 6,258,753,353	159,400.00 5,657,903,000	－ －	3.10
11	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	17,478	346,459.06 6,055,411,596	323,500.00 5,654,133,000	－ －	3.10
12	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	39,850	148,531.97 5,918,999,015	139,900.00 5,575,015,000	－ －	3.06
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	59,635	75,124.30 4,480,038,208	78,200.00 4,663,457,000	－ －	2.56
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	53,531	80,650.67 4,317,311,194	81,900.00 4,384,188,900	－ －	2.40
15	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	32,448	145,631.81 4,725,461,234	125,400.00 4,068,979,200	－ －	2.23
16	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	12,183	350,897.71 4,274,986,874	328,500.00 4,002,115,500	－ －	2.19
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	6,151	646,583.62 3,977,135,895	635,000.00 3,905,885,000	－ －	2.14
18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	9,346	403,707.60 3,773,051,305	369,000.00 3,448,674,000	－ －	1.89
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	22,772	158,237.17 3,603,376,883	147,700.00 3,363,424,400	－ －	1.84
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	7,410	485,621.96 3,598,458,797	441,000.00 3,267,810,000	－ －	1.79
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	11,371	308,481.63 3,507,744,649	271,600.00 3,088,363,600	－ －	1.69
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,610	472,726.54 3,124,722,432	447,500.00 2,957,975,000	－ －	1.62
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	21,852	150,539.53 3,289,589,945	133,200.00 2,910,686,400	－ －	1.60
24	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,760	333,822.55 2,924,285,578	321,000.00 2,811,960,000	－ －	1.54
25	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	20,948	145,571.48 3,049,431,458	130,900.00 2,742,093,200	－ －	1.50

26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	26,234	110,853.82 2,908,139,271	103,900.00 2,725,712,600	－ －	1.49
27	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	16,667	157,378.41 2,623,026,079	144,400.00 2,406,714,800	－ －	1.32
28	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	34,338	71,616.95 2,459,183,106	70,000.00 2,403,660,000	－ －	1.32
29	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	6,151	408,527.64 2,512,853,572	383,000.00 2,355,833,000	－ －	1.29
30	ＮＴＴ都市開発リート投資法人 日本	投資証券	18,061	130,895.07 2,364,095,914	117,200.00 2,116,749,200	－ －	1.16

（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

2024年5月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.18
合計	97.18

（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

2024年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	367,723	18,219.30 6,699,657,185	16,860.52 6,200,001,657	－ －	7.53
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	37,368	119,734.85 4,474,252,099	119,221.14 4,455,055,791	－ －	5.41
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	220,325	12,993.40 2,862,772,645	16,010.99 3,527,621,592	－ －	4.28
4	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	129,752	17,980.86 2,333,053,536	23,266.48 3,018,873,039	－ －	3.67
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	128,566	18,434.30 2,370,025,494	22,576.82 2,902,612,674	－ －	3.53
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	331,119	8,667.24 2,869,887,885	8,111.29 2,685,803,889	－ －	3.26
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	63,008	43,344.21 2,731,032,568	42,043.93 2,649,104,420	－ －	3.22
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	688,151	2,281.57 1,570,068,876	3,551.94 2,444,272,095	－ －	2.97
9	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	84,148	21,090.32 1,774,708,407	22,206.92 1,868,668,173	－ －	2.27
10	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	412,045	4,740.21 1,953,183,367	4,398.12 1,812,225,168	－ －	2.20

11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	56,503	28,726.88 1,623,155,071	29,777.46 1,682,516,116	— —	2.04
12	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	116,237	9,307.18 1,081,839,567	12,482.77 1,450,960,154	— —	1.76
13	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	137,404	9,810.59 1,348,015,233	10,015.68 1,376,195,319	— —	1.67
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	160,362	6,978.07 1,119,018,399	7,680.25 1,231,621,854	— —	1.50
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	228,952	5,252.85 1,202,651,615	5,333.86 1,221,198,418	— —	1.48
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	62,668	17,299.55 1,084,128,633	18,228.86 1,142,366,323	— —	1.39
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	25,544	35,801.20 914,505,868	40,062.74 1,023,362,732	— —	1.24
18	SEGRO PLC イギリス	投資証券	532,308	1,519.65 808,923,187	1,825.63 971,799,081	— —	1.18
19	MID AMERICA アメリカ	投資証券	46,434	22,161.77 1,029,059,720	20,354.25 945,129,541	— —	1.15
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	49,499	19,536.42 967,033,712	18,474.94 914,491,243	— —	1.11
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	282,328	2,995.69 845,767,983	3,042.32 858,933,080	— —	1.04
22	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	280,532	2,645.91 742,264,939	2,791.53 783,116,130	— —	0.95
23	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	264,877	2,908.03 770,271,316	2,954.54 782,592,075	— —	0.95
24	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	86,950	9,753.52 848,068,628	8,789.97 764,288,691	— —	0.93
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	106,153	7,431.06 788,829,377	6,940.44 736,749,291	— —	0.89
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	74,113	10,467.54 775,781,524	9,811.92 727,191,123	— —	0.88
27	UDR INC アメリカ	投資証券	120,734	6,159.93 743,713,611	5,935.74 716,646,091	— —	0.87
28	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	126,436	5,482.22 693,150,435	5,587.78 706,496,678	— —	0.86
29	LINK REIT 香港	投資証券	1,022,620	849.26 868,473,480	680.69 696,094,877	— —	0.85
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	42,442	16,253.66 689,838,229	15,832.30 671,954,790	— —	0.82

（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

2024年5月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	10.82
投資証券	88.46
合計	99.28

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０６０６月	買建	661	17,983,365,330	18,322,920,000	3.04

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Jun24	買建	706	28,960,939,925	29,064,439,266	1.90
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun24	買建	618	5,241,210,468	5,238,857,317	0.34
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun24	買建	97	1,591,090,311	1,596,314,105	0.10

	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun24	買建	40	1,217,918,510	1,211,297,520	0.08
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Jun24	買建	37	749,394,650	736,481,808	0.05

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０６０６月	買建	2,857	4,858,071,370	4,974,037,000	2.73

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2024年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第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
第35特定期間末 (2024年5月13日)	518	519	1.5937	1.5952
2023年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	－
12月末日	463	－	1.4527	－
2024年1月末日	485	－	1.5041	－
2月末日	497	－	1.5443	－
3月末日	513	－	1.5897	－
4月末日	516	－	1.5899	－
5月末日	520	－	1.5964	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
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
第35特定期間	0.0045

③【収益率の推移】

	収益率（%）
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
第35特定期間	12.5

（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
第35特定期間	17,995,136	19,418,562

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2024年5月31日

基準価額・純資産の推移 《2014年5月30日～2024年5月31日》

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

分配の推移(税引前)

2023年 9月	15円
2023年11月	15円
2024年 1月	15円
2024年 3月	15円
2024年 5月	15円
直近1年間累計	90円
設定来累計	2,055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	28.54
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	24.50
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.76
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.92
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.07
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	5.59

■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	4.63
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.47
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.24
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.94
5	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.77

■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	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.69
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.50
3	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	4.38
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.67
5	META PLATFORMS INC	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	1.66

○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:2024年5月31日

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.84
2	456回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2026/1/1	1.49
3	373回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2033/12/20	1.32
4	145回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	1.31
5	156回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.2	2027/12/20	1.28

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	アメリカ	1.5	2027/1/31	0.49
2	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.47
3	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	中国	2.69	2026/8/12	0.46
4	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	中国	3.03	2026/3/11	0.45
5	US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	アメリカ	3.875	2033/8/15	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	6.69
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.19
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.66
4	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.41
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.33

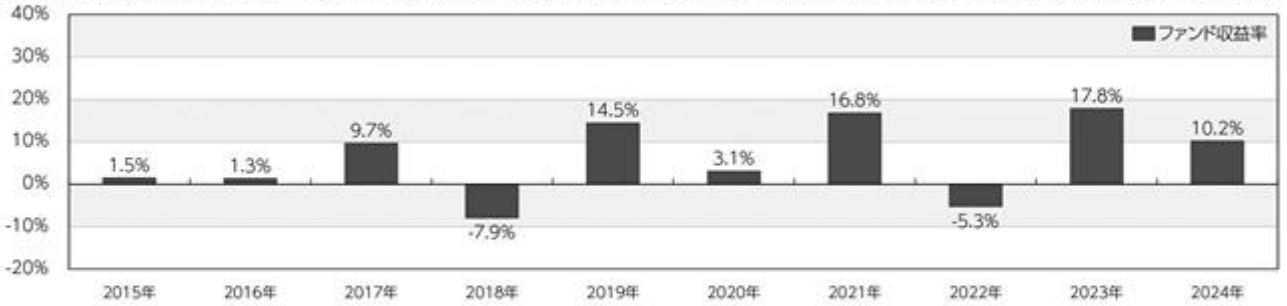
■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	7.53
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.41
3	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	4.28
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.67
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.53

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。
※2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時まで（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）にお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付は行いません。

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

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

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

・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の営業日の午後3時まで（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）に行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

・解約価額

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

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社への問い合わせ

・委託会社への照会

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

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

ロ.信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

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

ニ.公告

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

（URL　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】

①収益分配金請求権

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

②償還金請求権

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

③一部解約請求権

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

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

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

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2023年11月14日から2024年5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＜隔月分配型＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2023年11月13日現在	当期 2024年5月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,393,170	9,413,050
親投資信託受益証券	457,127,663	510,788,786
流動資産合計	465,520,833	520,201,836
資産合計	465,520,833	520,201,836
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	490,530	488,395
未払解約金	－	319,353
未払受託者報酬	34,512	38,654
未払委託者報酬	397,037	444,754
その他未払費用	3,042	3,407
流動負債合計	925,121	1,294,563
負債合計	925,121	1,294,563
純資産の部		
元本等		
元本	327,020,489	325,597,063
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	137,575,223	193,310,210
（分配準備積立金）	135,345,497	180,741,954
元本等合計	464,595,712	518,907,273
純資産合計	464,595,712	518,907,273
負債純資産合計	465,520,833	520,201,836

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2023年5月12日 至　2023年11月13日	当期 自　2023年11月14日 至　2024年5月13日
営業収益		
受取利息	46	806
有価証券売買等損益	35,098,685	58,482,123
営業収益合計	35,098,731	58,482,929
営業費用		
支払利息	1,765	313
受託者報酬	100,470	106,930
委託者報酬	1,155,938	1,230,251
その他費用	8,858	9,423
営業費用合計	1,267,031	1,346,917
営業利益又は営業損失（△）	33,831,700	57,136,012
経常利益又は経常損失（△）	33,831,700	57,136,012
当期純利益又は当期純損失（△）	33,831,700	57,136,012
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（△）	708,280	466,211
期首剰余金又は期首欠損金（△）	105,114,106	137,575,223
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,084,925	9,079,923
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	6,084,925	9,079,923
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,302,832	8,560,293
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,302,832	8,560,293
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	1,444,396	1,454,444
期末剰余金又は期末欠損金（△）	137,575,223	193,310,210

（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11月14日 至　2024年5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、前特定期間末日を2023年11月13日、当特定期間末日を2024年5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 2023年11月13日現在	当期 2024年5月13日現在
１．　期首元本額	327,802,086円	327,020,489円
期中追加設定元本額	14,648,116円	17,995,136円
期中一部解約元本額	15,429,713円	19,418,562円
２．　受益権の総数	327,020,489口	325,597,063口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自　2023年5月12日 至　2023年11月13日	当期 自　2023年11月14日 至　2024年5月13日
１．　分配金の計算過程	（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。	（自2023年11月14日　至2024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（1,327,225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（17,192,544円）、信託約款に規定される収益調整金（30,516,296円）及び分配準備積立金（129,456,129円）より分配対象収益は178,492,194円（1万口当たり5,555.64円）であり、うち481,921円（1万口当たり15円）を分配金額としております。

	（自2023年7月12日　至2023年9月11日） 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4,958.76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。 （自2023年9月12日　至2023年11月13日） 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4,994.12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。	（自2024年1月12日　至2024年3月11日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,171,818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（15,816,802円）、信託約款に規定される収益調整金（33,035,362円）及び分配準備積立金（145,794,179円）より分配対象収益は195,818,161円（1万口当たり6,067.13円）であり、うち484,128円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （自2024年3月12日　至2024年5月13日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,499,234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（17,122,285円）、信託約款に規定される収益調整金（35,453,192円）及び分配準備積立金（161,608,830円）より分配対象収益は216,683,541円（1万口当たり6,654.95円）であり、うち488,395円（1万口当たり15円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自　2023年5月12日 至　2023年11月13日	当期 自　2023年11月14日 至　2024年5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11月13日現在	当期 2024年5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11月13日現在	当期 2024年5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	407,254	19,097,978
合計	407,254	19,097,978

（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11月13日現在	当期 2024年5月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4207円 (14,207円)	1.5937円 (15,937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

2024年5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	26,070,549	125,203,811	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	94,093,897	114,408,769	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	12,646,122	30,260,905	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	16,139,878	147,541,080	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25,663,517	61,738,722	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,876,493	31,635,499	
親投資信託受益証券　合計		190,490,456	510,788,786	
合計			510,788,786	

（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）

	2024年5月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	21,389,103,602
株式	575,974,829,540
派生商品評価勘定	93,083,820
未収入金	3,286,258
未収配当金	5,809,484,223
差入委託証拠金	600,279,154
流動資産合計	603,870,066,597
資産合計	603,870,066,597
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,335,720
前受金	110,278,200
未払解約金	15,572,805,000
流動負債合計	15,709,418,920
負債合計	15,709,418,920
純資産の部	
元本等	
元本	122,470,682,686
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	465,689,964,991
元本等合計	588,160,647,677
純資産合計	588,160,647,677
負債純資産合計	603,870,066,597

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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	117,226,519,868円
同期中追加設定元本額	20,323,075,252円
同期中一部解約元本額	15,078,912,434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	2,421,065,569円
たわらノーロード　国内株式＜ラップ専用＞	5,675,482,879円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	32,272,710,956円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	5,018,251,731円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,315,171円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,134,287円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	19,489,718円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	27,659,832円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	26,378,982円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,444,282円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	2,512,143,693円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,723,103,990円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	46,166,378円
たわらノーロード　バランス（標準型）	352,646,992円
たわらノーロード　バランス（積極型）	630,163,444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）	2,091,246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）	134,361,687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）	399,362,992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）	355,910,569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）	500,568,714円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	364,341円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,273,378円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	26,187,075円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,527,268円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	13,189,262円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,523,383,120円
Ｏｎｅグローバルバランス	60,853,960円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	864,345,151円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,236,298,797円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,810,429,535円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	249,606,811円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	858,857,472円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,007,590,223円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	26,070,549円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	977,266,719円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	12,880,508円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	254,266,639円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	326,233,876円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	554,775,720円
投資のソムリエ	8,513,534,510円
クルーズコントロール	209,017,166円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	885,997,703円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	366,314,329円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,136,270,486円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	483,425,591円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,508,181,985円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	78,251,691円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	40,679,292円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,475,584円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	180,915,771円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	497,022,118円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	207,738,384円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	216,475,737円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	67,054,178円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	43,187,630円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	26,717,256円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	523,025,702円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	6,653,520円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,510,646円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	28,527,891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）	348,992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）	282,142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）	200,478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）	165,167円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	715,577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）	109,695,930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）	173,190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）	33,920,196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）	342,218,534円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	427,966円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	132,825,831円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	1,934,028円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,114,452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）	361,860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）	4,804,509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）	32,552,955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）	65,972,330円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,463,373円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,637,566円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,916,436円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	76,842円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	516,435円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,796,097円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	247,918,593円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	368,353,275円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,143,269,713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）	9,876,684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）	12,727,031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）	128,874,663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）	25,359,495円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,212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）	132,427,088円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,291,519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）	34,114,273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）	91,477,442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）	120,886,118円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,800,962円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,077,232円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	25,746,688円
コア資産形成ファンド	12,404,005円
ＭＨＡＭトピックスファンド	779,501,159円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	44,477,655円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	2,890,466,543円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	2,389,695,132円
計	122,470,682,686円
２．　受益権の総数	122,470,682,686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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	2024年5月13日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	35,182,536,629
合計	35,182,536,629

（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（2024年2月8日から2024年5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	2024年5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	12,714,746,800	－	12,781,650,000	66,903,200
合計	12,714,746,800	－	12,781,650,000	66,903,200

（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）

	2024年5月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.8025円 (48,025円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2024年5月13日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	8,700	3,760.00	32,712,000	
ニッスイ	209,900	945.00	198,355,500	
マルハニチロ	31,100	3,269.00	101,665,900	
雪国まいたけ	17,900	982.00	17,577,800	
カネコ種苗	5,800	1,444.00	8,375,200	
サカタのタネ	23,900	3,680.00	87,952,000	
ホクト	16,800	1,813.00	30,458,400	
ホクリヨウ	1,200	1,024.00	1,228,800	
ショーボンドホールディングス	28,600	6,224.00	178,006,400	
ミライト・ワン	63,400	1,933.50	122,583,900	
タマホーム	13,200	4,470.00	59,004,000	
サンヨーホームズ	900	740.00	666,000	
日本アクア	3,000	931.00	2,793,000	
ファーストコーポレーション	2,000	839.00	1,678,000	
ベステラ	1,700	953.00	1,620,100	
ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ	41,100	161.00	6,617,100	
キャンディル	1,300	594.00	772,200	
住石ホールディングス	26,700	1,225.00	32,707,500	
日鉄鉱業	8,400	4,985.00	41,874,000	
三井松島ホールディングス	12,500	4,685.00	58,562,500	

ＩＮＰＥＸ	705,200	2,393.00	1,687,543,600	
石油資源開発	24,300	6,690.00	162,567,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	9,500	3,375.00	32,062,500	
リョーサン菱洋ホールディングス	29,800	2,745.00	81,801,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,400	942.00	1,318,800	
第一カッター興業	6,000	1,489.00	8,934,000	
明豊ファシリティワークス	2,600	885.00	2,301,000	
安藤・間	121,600	1,153.00	140,204,800	
東急建設	65,700	801.00	52,625,700	
コムシスホールディングス	67,000	3,378.00	226,326,000	
ビーアールホールディングス	30,800	358.00	11,026,400	
高松コンストラクショングループ	15,600	2,793.00	43,570,800	
東建コーポレーション	5,200	11,300.00	58,760,000	
ソネック	900	935.00	841,500	
ヤマウラ	10,700	1,385.00	14,819,500	
オリエンタル白石	77,900	385.00	29,991,500	
大成建設	134,600	5,512.00	741,915,200	
大林組	525,300	1,676.50	880,665,450	
清水建設	416,500	949.30	395,383,450	
飛島建設	15,100	1,397.00	21,094,700	
長谷工コーポレーション	134,800	1,845.00	248,706,000	
松井建設	13,700	849.00	11,631,300	
錢高組	800	4,270.00	3,416,000	
鹿島建設	325,700	2,980.00	970,586,000	
不動テトラ	10,200	2,325.00	23,715,000	
大末建設	2,000	1,781.00	3,562,000	
鉄建建設	10,500	2,834.00	29,757,000	
西松建設	28,000	4,676.00	130,928,000	
三井住友建設	109,400	404.00	44,197,600	
大豊建設	5,000	3,325.00	16,625,000	
佐田建設	3,200	746.00	2,387,200	
ナカノフドー建設	3,600	641.00	2,307,600	
奥村組	23,800	5,000.00	119,000,000	
東鉄工業	18,200	3,115.00	56,693,000	
イチケン	1,300	2,399.00	3,118,700	
富士ピー・エス	2,400	444.00	1,065,600	
淺沼組	10,900	3,680.00	40,112,000	
戸田建設	198,700	1,062.00	211,019,400	
熊谷組	24,200	4,090.00	98,978,000	
北野建設	900	3,615.00	3,253,500	
植木組	1,400	1,722.00	2,410,800	
矢作建設工業	20,000	1,540.00	30,800,000	
ピーエス三菱	18,600	991.00	18,432,600	
日本ハウスホールディングス	31,400	310.00	9,734,000	
大東建託	54,100	16,450.00	889,945,000	
新日本建設	20,700	1,597.00	33,057,900	
東亜道路工業	29,300	1,217.00	35,658,100	
日本道路	17,200	1,840.00	31,648,000	
東亜建設工業	45,400	1,025.00	46,535,000	
日本国土開発	41,700	524.00	21,850,800	

若築建設	5,000	3,350.00	16,750,000	
東洋建設	37,000	1,365.00	50,505,000	
五洋建設	208,200	702.60	146,281,320	
世紀東急工業	18,800	1,668.00	31,358,400	
福田組	5,500	5,820.00	32,010,000	
日本ドライケミカル	1,200	2,634.00	3,160,800	
住友林業	127,000	5,892.00	748,284,000	
日本基礎技術	3,100	519.00	1,608,900	
巴コーポレーション	6,100	722.00	4,404,200	
大和ハウス工業	406,300	4,137.00	1,680,863,100	
ライト工業	29,200	2,080.00	60,736,000	
積水ハウス	445,400	3,610.00	1,607,894,000	
日特建設	14,000	1,126.00	15,764,000	
北陸電気工事	10,100	1,140.00	11,514,000	
ユアテック	32,300	1,515.00	48,934,500	
日本リーテック	11,500	1,330.00	15,295,000	
四電工	6,100	3,645.00	22,234,500	
中電工	22,700	3,095.00	70,256,500	
関電工	92,000	1,851.00	170,292,000	
きんでん	102,100	3,083.00	314,774,300	
東京エネシス	13,700	1,312.00	17,974,400	
トーエネック	4,800	5,190.00	24,912,000	
住友電設	13,900	3,445.00	47,885,500	
日本電設工業	27,600	2,047.00	56,497,200	
エクシオグループ	143,600	1,722.00	247,279,200	
新日本空調	9,500	4,165.00	39,567,500	
九電工	31,700	6,441.00	204,179,700	
三機工業	31,700	2,238.00	70,944,600	
日揮ホールディングス	145,300	1,384.00	201,095,200	
中外炉工業	4,800	3,285.00	15,768,000	
ヤマト	4,200	1,147.00	4,817,400	
太平電業	9,100	4,940.00	44,954,000	
高砂熱学工業	39,400	5,440.00	214,336,000	
三晃金属工業	700	4,660.00	3,262,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	58,500	2,434.00	142,389,000	
朝日工業社	13,700	1,543.00	21,139,100	
明星工業	28,400	1,250.00	35,500,000	
大氣社	16,900	4,820.00	81,458,000	
ダイダン	19,300	3,215.00	62,049,500	
日比谷総合設備	10,600	3,050.00	32,330,000	
ニップン	44,200	2,390.00	105,638,000	
日清製粉グループ本社	136,400	2,057.00	280,574,800	
日東富士製粉	2,400	5,390.00	12,936,000	
昭和産業	14,300	3,435.00	49,120,500	
鳥越製粉	4,400	677.00	2,978,800	
中部飼料	20,500	1,442.00	29,561,000	
フィード・ワン	21,600	957.00	20,671,200	
東洋精糖	900	1,969.00	1,772,100	
日本甜菜製糖	8,600	2,023.00	17,397,800	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	14,600	3,000.00	43,800,000	

塩水港精糖	6,500	277.00	1,800,500	
ウェルネオシュガー	7,400	2,181.00	16,139,400	
ＬＩＦＵＬＬ	37,700	169.00	6,371,300	
ＭＩＸＩ	33,000	2,663.00	87,879,000	
ジェイエイシーリクルートメント	55,600	751.00	41,755,600	
日本M＆Aセンターホールディングス	245,300	763.00	187,163,900	
メンバーズ	5,200	879.00	4,570,800	
中広	800	480.00	384,000	
ＵＴグループ	20,000	3,360.00	67,200,000	
アイティメディア	5,800	1,823.00	10,573,400	
ケアネット	31,400	576.00	18,086,400	
Ｅ・Ｊホールディングス	9,000	1,868.00	16,812,000	
オープンアップグループ	46,300	2,083.00	96,442,900	
コシダカホールディングス	46,100	869.00	40,060,900	
アルトナー	2,200	2,181.00	4,798,200	
パソナグループ	18,700	2,260.00	42,262,000	
ＣＤＳ	1,300	1,800.00	2,340,000	
リンクアンドモチベーション	44,300	485.00	21,485,500	
エス・エム・エス	54,000	2,069.00	111,726,000	
サニーサイドアップグループ	1,800	695.00	1,251,000	
パーソルホールディングス	1,567,200	220.20	345,097,440	
リニカル	3,400	408.00	1,387,200	
クックパッド	42,100	169.00	7,114,900	
エスクリ	2,300	305.00	701,500	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,600	770.00	2,002,000	
森永製菓	62,300	2,520.00	156,996,000	
中村屋	3,600	3,280.00	11,808,000	
江崎グリコ	42,200	4,134.00	174,454,800	
名糖産業	5,800	1,758.00	10,196,400	
井村屋グループ	8,900	2,472.00	22,000,800	
不二家	10,200	2,465.00	25,143,000	
山崎製パン	98,700	3,572.00	352,556,400	
第一屋製パン	900	768.00	691,200	
モロゾフ	4,600	4,180.00	19,228,000	
亀田製菓	8,400	4,085.00	34,314,000	
寿スピリッツ	69,700	1,746.50	121,731,050	
カルビー	67,500	3,233.00	218,227,500	
森永乳業	51,500	3,149.00	162,173,500	
六甲バター	10,900	1,466.00	15,979,400	
ヤクルト本社	210,700	3,129.00	659,280,300	
明治ホールディングス	180,800	3,457.00	625,025,600	
雪印メグミルク	35,700	2,585.00	92,284,500	
プリマハム	19,800	2,345.00	46,431,000	
日本ハム	63,400	5,126.00	324,988,400	
林兼産業	1,700	558.00	948,600	
丸大食品	14,900	1,623.00	24,182,700	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	16,300	3,065.00	49,959,500	
柿安本店	5,700	2,604.00	14,842,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	22,500	4,355.00	97,987,500	
学情	7,800	1,785.00	13,923,000	

スタジオアリス	7,700	2,047.00	15,761,900	
クロスキャット	9,500	1,385.00	13,157,500	
エプコ	1,500	830.00	1,245,000	
システナ	227,100	266.00	60,408,600	
ＮＪＳ	3,400	3,235.00	10,999,000	
デジタルアーツ	9,500	4,100.00	38,950,000	
日鉄ソリューションズ	25,600	4,950.00	126,720,000	
綜合警備保障	257,200	845.30	217,411,160	
キューブシステム	8,000	1,105.00	8,840,000	
いちご	169,800	416.00	70,636,800	
日本駐車場開発	175,400	202.00	35,430,800	
コア	6,600	1,901.00	12,546,600	
カカクコム	99,900	1,900.00	189,810,000	
アイロムグループ	6,200	1,873.00	11,612,600	
セントケア・ホールディング	11,200	867.00	9,710,400	
サイネックス	900	732.00	658,800	
ルネサンス	12,000	996.00	11,952,000	
ディップ	23,500	2,761.00	64,883,500	
ＳＢＳホールディングス	13,300	2,655.00	35,311,500	
デジタルホールディングス	8,000	1,053.00	8,424,000	
新日本科学	14,000	1,485.00	20,790,000	
キャリアデザインセンター	1,000	1,687.00	1,687,000	
エムスリー	304,200	1,629.50	495,693,900	
ツカダ・グローバルホールディング	3,300	478.00	1,577,400	
ブラス	700	697.00	487,900	
ウェルネット	4,400	593.00	2,609,200	
ワールドホールディングス	6,900	2,357.00	16,263,300	
ディー・エヌ・エー	54,700	1,576.50	86,234,550	
博報堂ＤＹホールディングス	196,400	1,501.50	294,894,600	
ぐるなび	28,700	315.00	9,040,500	
タカミヤ	21,000	494.00	10,374,000	
ファンコミュニケーションズ	21,800	410.00	8,938,000	
ライク	5,700	1,707.00	9,729,900	
Ａｏｂａ‐ＢＢＴ	2,100	378.00	793,800	
エスプール	44,300	330.00	14,619,000	
ＷＤＢホールディングス	7,900	2,285.00	18,051,500	
手間いらず	2,600	3,225.00	8,385,000	
ティア	3,700	454.00	1,679,800	
ＣＤＧ	600	1,229.00	737,400	
アドウェイズ	21,300	400.00	8,520,000	
バリューコマース	13,500	1,104.00	14,904,000	
インフォマート	159,900	306.00	48,929,400	
サッポロホールディングス	48,500	5,639.00	273,491,500	
アサヒグループホールディングス	340,700	5,450.00	1,856,815,000	
キリンホールディングス	614,200	2,262.00	1,389,320,400	
宝ホールディングス	99,600	1,089.50	108,514,200	
オエノンホールディングス	44,100	346.00	15,258,600	
養命酒製造	4,800	2,463.00	11,822,400	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	115,500	1,950.50	225,282,750	

ライフドリンク　カンパニー	3,000	5,220.00	15,660,000	
サントリー食品インターナショナル	103,800	5,315.00	551,697,000	
ダイドーグループホールディングス	16,700	2,739.00	45,741,300	
伊藤園	49,900	3,797.00	189,470,300	
キーコーヒー	16,500	2,032.00	33,528,000	
ユニカフェ	1,800	916.00	1,648,800	
ジャパンフーズ	800	1,991.00	1,592,800	
日清オイリオグループ	20,800	4,950.00	102,960,000	
不二製油グループ本社	34,300	2,411.00	82,697,300	
かどや製油	600	3,630.00	2,178,000	
Ｊ－オイルミルズ	16,900	1,949.00	32,938,100	
サンエー	12,100	4,715.00	57,051,500	
カワチ薬品	12,400	2,816.00	34,918,400	
エービーシー・マート	69,300	3,166.00	219,403,800	
ハードオフコーポレーション	6,300	1,895.00	11,938,500	
高千穂交易	5,600	3,775.00	21,140,000	
アスクル	38,300	2,290.00	87,707,000	
ゲオホールディングス	17,800	1,858.00	33,072,400	
アダストリア	19,100	3,515.00	67,136,500	
ジーフット	4,300	285.00	1,225,500	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	700	576.00	403,200	
オルバヘルスケアホールディングス	900	2,107.00	1,896,300	
伊藤忠食品	3,600	7,430.00	26,748,000	
くら寿司	18,600	4,800.00	89,280,000	
キャンドゥ	5,600	2,830.00	15,848,000	
エレマテック	14,100	1,901.00	26,804,100	
ＩＫホールディングス	1,900	434.00	824,600	
パルグループホールディングス	31,100	1,817.00	56,508,700	
エディオン	62,800	1,595.00	100,166,000	
あらた	24,200	3,200.00	77,440,000	
サーラコーポレーション	33,300	801.00	26,673,300	
ワッツ	2,300	713.00	1,639,900	
トーメンデバイス	2,300	6,560.00	15,088,000	
ハローズ	7,200	4,425.00	31,860,000	
ＪＰホールディングス	39,400	434.00	17,099,600	
フジオフードグループ本社	17,800	1,427.00	25,400,600	
あみやき亭	3,900	6,170.00	24,063,000	
東京エレクトロン　デバイス	15,800	5,090.00	80,422,000	
ひらまつ	12,600	271.00	3,414,600	
円谷フィールズホールディングス	27,200	1,782.00	48,470,400	
双日	176,400	4,229.00	745,995,600	
アルフレッサ　ホールディングス	159,100	2,367.00	376,589,700	
大黒天物産	4,800	8,050.00	38,640,000	
ハニーズホールディングス	14,000	1,733.00	24,262,000	
ファーマライズホールディングス	1,300	657.00	854,100	
キッコーマン	488,600	1,816.00	887,297,600	
味の素	350,400	6,021.00	2,109,758,400	
ブルドックソース	7,800	2,009.00	15,670,200	
キユーピー	79,300	3,193.00	253,204,900	
ハウス食品グループ本社	50,800	3,010.00	152,908,000	

カゴメ	63,400	3,904.00	247,513,600	
アリアケジャパン	14,700	5,260.00	77,322,000	
ピエトロ	800	1,793.00	1,434,400	
エバラ食品工業	3,500	2,924.00	10,234,000	
やまみ	700	3,345.00	2,341,500	
ニチレイ	67,500	3,890.00	262,575,000	
横浜冷凍	39,800	1,053.00	41,909,400	
東洋水産	74,600	10,880.00	811,648,000	
イートアンドホールディングス	7,000	1,998.00	13,986,000	
大冷	800	1,905.00	1,524,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,700	1,604.00	10,746,800	
日清食品ホールディングス	155,500	4,026.00	626,043,000	
永谷園ホールディングス	7,200	2,327.00	16,754,400	
一正蒲鉾	2,400	760.00	1,824,000	
フジッコ	15,200	1,886.00	28,667,200	
ロック・フィールド	18,000	1,537.00	27,666,000	
日本たばこ産業	896,100	4,375.00	3,920,437,500	
ケンコーマヨネーズ	10,200	2,308.00	23,541,600	
わらべや日洋ホールディングス	9,900	2,409.00	23,849,100	
なとり	9,300	2,085.00	19,390,500	
イフジ産業	1,000	1,367.00	1,367,000	
ファーマフーズ	19,600	873.00	17,110,800	
北の達人コーポレーション	63,300	177.00	11,204,100	
ユーグレナ	91,800	525.00	48,195,000	
紀文食品	12,900	1,144.00	14,757,600	
ピックルスホールディングス	8,700	1,169.00	10,170,300	
スター・マイカ・ホールディングス	17,200	632.00	10,870,400	
ＳＲＥホールディングス	6,300	4,315.00	27,184,500	
ＡＤワークスグループ	12,400	247.00	3,062,800	
片倉工業	13,800	1,946.00	26,854,800	
グンゼ	10,700	5,370.00	57,459,000	
ヒューリック	344,000	1,475.00	507,400,000	
神栄	800	1,908.00	1,526,400	
ラサ商事	7,200	1,906.00	13,723,200	
アルペン	13,100	2,024.00	26,514,400	
ハブ	1,700	806.00	1,370,200	
ラクーンホールディングス	11,300	664.00	7,503,200	
クオールホールディングス	21,800	1,548.00	33,746,400	
アルコニックス	20,900	1,356.00	28,340,400	
神戸物産	122,600	3,410.00	418,066,000	
ソリトンシステムズ	7,800	1,190.00	9,282,000	
ジンズホールディングス	12,100	3,575.00	43,257,500	
ビックカメラ	94,800	1,474.00	139,735,200	
ＤＣＭホールディングス	83,700	1,490.00	124,713,000	
ペッパーフードサービス	39,000	125.00	4,875,000	
ハイパー	1,100	303.00	333,300	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	224,600	1,690.00	379,574,000	
東京一番フーズ	1,500	508.00	762,000	
ＤＤグループ	3,400	1,268.00	4,311,200	
あい　ホールディングス	25,300	2,433.00	61,554,900	

ディーブイエックス	1,500	1,001.00	1,501,500	
きちりホールディングス	1,500	908.00	1,362,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	181,800	1,428.50	259,701,300	
ドトール・日レスホールディングス	28,100	2,093.00	58,813,300	
マツキヨココカラ＆カンパニー	288,200	2,265.50	652,917,100	
ブロンコビリー	9,300	3,775.00	35,107,500	
ＺＯＺＯ	101,000	3,355.00	338,855,000	
トレジャー・ファクトリー	9,800	1,706.00	16,718,800	
物語コーポレーション	26,500	3,720.00	98,580,000	
三越伊勢丹ホールディングス	267,000	2,323.00	620,241,000	
東洋紡	64,800	1,123.00	72,770,400	
ユニチカ	48,500	213.00	10,330,500	
富士紡ホールディングス	6,500	4,065.00	26,422,500	
日清紡ホールディングス	113,700	1,135.00	129,049,500	
倉敷紡績	10,600	4,030.00	42,718,000	
ダイワボウホールディングス	70,100	2,660.50	186,501,050	
シキボウ	8,900	1,048.00	9,327,200	
日東紡績	19,000	6,950.00	132,050,000	
トヨタ紡織	63,100	2,269.50	143,205,450	
マクニカホールディングス	37,500	6,555.00	245,812,500	
Ｈａｍｅｅ	6,400	1,231.00	7,878,400	
マーケットエンタープライズ	500	713.00	356,500	
ラクト・ジャパン	6,100	2,655.00	16,195,500	
ウエルシアホールディングス	82,200	2,301.00	189,142,200	
クリエイトＳＤホールディングス	22,400	3,415.00	76,496,000	
グリムス	6,600	2,188.00	14,440,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,000	1,224.00	29,376,000	
八洲電機	12,900	1,517.00	19,569,300	
メディアスホールディングス	9,300	838.00	7,793,400	
レスター	13,400	2,938.00	39,369,200	
ジオリーブグループ	1,300	1,224.00	1,591,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	6,400	333.00	2,131,200	
大光	2,800	642.00	1,797,600	
ＯＣＨＩホールディングス	1,300	1,521.00	1,977,300	
ＴＯＫＡＩホールディングス	86,000	967.00	83,162,000	
黒谷	1,600	705.00	1,128,000	
ミサワ	1,100	619.00	680,900	
ティーライフ	700	1,406.00	984,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,100	862.00	948,200	
エー・ピーホールディングス	1,300	943.00	1,225,900	
三洋貿易	16,200	1,611.00	26,098,200	
チムニー	1,700	1,308.00	2,223,600	
シュッピン	14,300	1,333.00	19,061,900	
ビューティガレージ	5,000	2,002.00	10,010,000	
オイシックス・ラ・大地	21,400	1,193.00	25,530,200	
ウイン・パートナーズ	10,300	1,163.00	11,978,900	
ネクステージ	36,200	2,894.00	104,762,800	
ジョイフル本田	46,200	2,203.00	101,778,600	
エターナルホスピタリティグループ	5,800	3,850.00	22,330,000	

ホットランド	12,200	2,107.00	25,705,400	
すかいらーくホールディングス	216,600	2,218.50	480,527,100	
ＳＦＰホールディングス	7,600	2,069.00	15,724,400	
綿半ホールディングス	12,300	1,570.00	19,311,000	
日本毛織	38,500	1,359.00	52,321,500	
ダイトウボウ	8,200	101.00	828,200	
トーア紡コーポレーション	1,800	448.00	806,400	
ダイドーリミテッド	6,200	627.00	3,887,400	
ヨシックスホールディングス	3,700	2,878.00	10,648,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,300	893.00	39,559,900	
野村不動産ホールディングス	82,100	4,372.00	358,941,200	
三重交通グループホールディングス	31,600	567.00	17,917,200	
サムティ	23,400	2,675.00	62,595,000	
ディア・ライフ	25,100	893.00	22,414,300	
コーセーアールイー	1,600	783.00	1,252,800	
地主	11,300	2,569.00	29,029,700	
プレサンスコーポレーション	19,500	1,802.00	35,139,000	
フィル・カンパニー	2,300	640.00	1,472,000	
ＴＨＥグローバル社	3,400	555.00	1,887,000	
ハウスコム	800	950.00	760,000	
ＪＰＭＣ	8,500	1,305.00	11,092,500	
サンセイランディック	1,500	1,048.00	1,572,000	
エストラスト	600	764.00	458,400	
フージャースホールディングス	22,600	1,114.00	25,176,400	
オープンハウスグループ	54,100	4,897.00	264,927,700	
東急不動産ホールディングス	443,500	1,146.50	508,472,750	
飯田グループホールディングス	141,300	2,036.00	287,686,800	
イーグランド	700	1,590.00	1,113,000	
ムゲンエステート	3,300	1,223.00	4,035,900	
帝国繊維	17,000	2,360.00	40,120,000	
日本コークス工業	152,200	129.00	19,633,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,100	593.00	4,210,300	
ミタチ産業	1,500	1,155.00	1,732,500	
ＢＥＥＮＯＳ	9,400	2,197.00	20,651,800	
あさひ	14,600	1,391.00	20,308,600	
日本調剤	10,400	1,422.00	14,788,800	
コスモス薬品	13,400	13,755.00	184,317,000	
シップヘルスケアホールディングス	57,000	2,459.50	140,191,500	
トーエル	2,500	790.00	1,975,000	
ソフトクリエイトホールディングス	12,400	1,942.00	24,080,800	
セブン＆アイ・ホールディングス	1,622,300	2,018.50	3,274,612,550	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	107,300	1,092.00	117,171,600	
明治電機工業	5,900	1,643.00	9,693,700	
ツルハホールディングス	33,300	10,070.00	335,331,000	
デリカフーズホールディングス	2,400	571.00	1,370,400	
スターティアホールディングス	1,400	1,450.00	2,030,000	
サンマルクホールディングス	12,800	2,099.00	26,867,200	
フェリシモ	1,200	903.00	1,083,600	

トリドールホールディングス	44,400	3,764.00	167,121,600	
帝人	144,100	1,494.50	215,357,450	
東レ	1,005,100	781.80	785,787,180	
クラレ	218,600	1,723.50	376,757,100	
旭化成	1,014,900	1,063.50	1,079,346,150	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	16,900	305.00	5,154,500	
稲葉製作所	8,600	1,791.00	15,402,600	
宮地エンジニアリンググループ	7,700	3,920.00	30,184,000	
トーカロ	44,600	1,956.00	87,237,600	
アルファ	1,900	1,407.00	2,673,300	
ＳＵＭＣＯ	274,600	2,534.00	695,836,400	
川田テクノロジーズ	11,000	3,010.00	33,110,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	10,400	3,205.00	33,332,000	
ジェイテックコーポレーション	900	2,107.00	1,896,300	
信和	3,400	744.00	2,529,600	
ビーロット	3,400	1,031.00	3,505,400	
ファーストブラザーズ	900	1,277.00	1,149,300	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	8,900	1,267.00	11,276,300	
シーアールイー	6,600	1,402.00	9,253,200	
ケイアイスター不動産	7,100	3,855.00	27,370,500	
アグレ都市デザイン	900	1,480.00	1,332,000	
グッドコムアセット	13,600	836.00	11,369,600	
ジェイ・エス・ビー	7,300	2,825.00	20,622,500	
ロードスターキャピタル	9,600	3,550.00	34,080,000	
テンポイノベーション	1,600	910.00	1,456,000	
グローバル・リンク・マネジメント	1,000	2,588.00	2,588,000	
フェイスネットワーク	1,400	1,620.00	2,268,000	
霞ヶ関キャピタル	6,000	17,970.00	107,820,000	
住江織物	1,100	2,672.00	2,939,200	
日本フエルト	2,800	428.00	1,198,400	
イチカワ	700	1,829.00	1,280,300	
エコナックホールディングス	4,800	128.00	614,400	
日東製網	500	1,438.00	719,000	
芦森工業	1,000	2,377.00	2,377,000	
アツギ	3,600	647.00	2,329,200	
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,002.00	1,102,200	
ＪＭホールディングス	12,000	2,696.00	32,352,000	
コメダホールディングス	38,800	2,600.00	100,880,000	
サツドラホールディングス	2,200	860.00	1,892,000	
アレンザホールディングス	12,000	1,093.00	13,116,000	
串カツ田中ホールディングス	4,300	1,670.00	7,181,000	
バロックジャパンリミテッド	12,300	784.00	9,643,200	
クスリのアオキホールディングス	47,700	2,941.50	140,309,550	
ダイニック	1,600	759.00	1,214,400	
共和レザー	3,000	754.00	2,262,000	
ピーバンドットコム	800	375.00	300,000	
力の源ホールディングス	9,100	1,549.00	14,095,900	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	84,500	3,079.00	260,175,500	
アセンテック	6,100	542.00	3,306,200	

セーレン	29,000	2,515.00	72,935,000	
ソトー	1,600	699.00	1,118,400	
東海染工	500	843.00	421,500	
小松マテーレ	21,800	728.00	15,870,400	
ワコールホールディングス	30,800	3,493.00	107,584,400	
ホギメディカル	19,800	3,900.00	77,220,000	
クラウディアホールディングス	1,300	397.00	516,100	
ＴＳＩホールディングス	48,700	886.00	43,148,200	
マツオカコーポレーション	1,600	1,493.00	2,388,800	
ワールド	21,200	2,107.00	44,668,400	
ＴＩＳ	158,800	3,128.00	496,726,400	
テクミラホールディングス	2,300	385.00	885,500	
グリー	50,200	503.00	25,250,600	
GMOペパボ	1,900	1,405.00	2,669,500	
コーエーテクモホールディングス	94,000	1,413.00	132,822,000	
三菱総合研究所	7,300	4,840.00	35,332,000	
ボルテージ	1,500	259.00	388,500	
電算	600	1,487.00	892,200	
ＡＧＳ	2,100	1,152.00	2,419,200	
ファインデックス	11,900	1,024.00	12,185,600	
ブレインパッド	12,500	1,340.00	16,750,000	
ＫＬａｂ	27,600	254.00	7,010,400	
ポールトゥウィンホールディングス	25,700	492.00	12,644,400	
ネクソン	329,600	2,556.00	842,457,600	
アイスタイル	50,100	499.00	24,999,900	
エムアップホールディングス	18,400	1,060.00	19,504,000	
エイチーム	10,000	666.00	6,660,000	
エニグモ	19,200	331.00	6,355,200	
テクノスジャパン	4,400	609.00	2,679,600	
ｅｎｉｓｈ	5,100	236.00	1,203,600	
コロプラ	51,000	630.00	32,130,000	
オルトプラス	4,800	133.00	638,400	
ブロードリーフ	71,300	532.00	37,931,600	
クロス・マーケティンググループ	2,400	497.00	1,192,800	
デジタルハーツホールディングス	9,400	971.00	9,127,400	
メディアドゥ	6,800	1,403.00	9,540,400	
じげん	43,800	664.00	29,083,200	
ブイキューブ	18,000	233.00	4,194,000	
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	626.00	813,800	
サイバーリンクス	2,000	779.00	1,558,000	
ディー・エル・イー	3,600	163.00	586,800	
フィックスターズ	15,000	1,894.00	28,410,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,100	1,680.00	11,928,000	
オプティム	15,500	904.00	14,012,000	
セレス	6,000	2,087.00	12,522,000	
ＳＨＩＦＴ	10,000	15,395.00	153,950,000	
特種東海製紙	8,200	3,810.00	31,242,000	
ティーガイア	15,700	2,007.00	31,509,900	
セック	2,100	4,555.00	9,565,500	
テクマトリックス	27,400	1,766.00	48,388,400	

プロシップ	7,200	1,411.00	10,159,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,100	2,663.50	104,142,850	
GMOペイメントゲートウェイ	34,300	7,881.00	270,318,300	
ザッパラス	1,200	425.00	510,000	
システムリサーチ	10,300	1,580.00	16,274,000	
インターネットイニシアティブ	71,800	2,279.00	163,632,200	
さくらインターネット	16,800	6,000.00	100,800,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,500	2,805.00	12,622,500	
ＳＲＡホールディングス	7,700	4,025.00	30,992,500	
システムインテグレータ	1,500	366.00	549,000	
朝日ネット	16,100	649.00	10,448,900	
ｅＢＡＳＥ	21,200	663.00	14,055,600	
アバントグループ	19,000	1,282.00	24,358,000	
アドソル日進	6,300	1,616.00	10,180,800	
ＯＤＫソリューションズ	1,100	613.00	674,300	
フリービット	6,500	1,482.00	9,633,000	
コムチュア	21,700	1,866.00	40,492,200	
アステリア	11,800	595.00	7,021,000	
アイル	8,400	2,891.00	24,284,400	
王子ホールディングス	624,600	616.40	385,003,440	
日本製紙	84,600	1,122.00	94,921,200	
三菱製紙	6,700	662.00	4,435,400	
北越コーポレーション	73,800	1,329.00	98,080,200	
中越パルプ工業	2,000	1,740.00	3,480,000	
巴川コーポレーション	1,400	918.00	1,285,200	
大王製紙	66,200	1,142.50	75,633,500	
阿波製紙	1,400	475.00	665,000	
マークラインズ	8,100	3,165.00	25,636,500	
メディカル・データ・ビジョン	17,900	551.00	9,862,900	
ｇｕｍｉ	24,400	375.00	9,150,000	
ショーケース	1,200	305.00	366,000	
モバイルファクトリー	1,100	691.00	760,100	
テラスカイ	6,500	2,029.00	13,188,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,766.00	13,774,800	
ＰＣＩホールディングス	2,100	935.00	1,963,500	
アイビーシー	800	411.00	328,800	
ネオジャパン	5,000	1,516.00	7,580,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,100	1,951.00	6,048,100	
ラクス	71,000	1,731.50	122,936,500	
ランドコンピュータ	2,500	788.00	1,970,000	
ダブルスタンダード	4,500	1,747.00	7,861,500	
オープンドア	8,800	632.00	5,561,600	
マイネット	1,600	332.00	531,200	
アカツキ	7,300	2,145.00	15,658,500	
ベネフィットジャパン	300	1,172.00	351,600	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,700	1,226.00	5,762,200	
カナミックネットワーク	18,800	491.00	9,230,800	

ノムラシステムコーポレーション	5,400	134.00	723,600	
レンゴー	136,500	1,127.50	153,903,750	
トーモク	8,600	2,748.00	23,632,800	
ザ・パック	11,200	3,875.00	43,400,000	
チェンジホールディングス	32,700	1,201.00	39,272,700	
シンクロ・フード	3,200	567.00	1,814,400	
オークネット	5,500	2,594.00	14,267,000	
キャピタル・アセット・プランニング	1,000	797.00	797,000	
セグエグループ	4,500	536.00	2,412,000	
エイトレッド	800	1,510.00	1,208,000	
マクロミル	29,500	739.00	21,800,500	
ビーグリー	1,100	1,107.00	1,217,700	
オロ	5,400	2,706.00	14,612,400	
ユーザーローカル	6,300	2,309.00	14,546,700	
テモナ	1,200	237.00	284,400	
ニーズウェル	2,800	794.00	2,223,200	
マネーフォワード	33,600	5,813.00	195,316,800	
サインポスト	2,000	710.00	1,420,000	
レゾナック・ホールディングス	145,000	3,635.00	527,075,000	
住友化学	1,113,300	331.70	369,281,610	
住友精化	7,000	5,090.00	35,630,000	
日産化学	70,000	5,520.00	386,400,000	
ラサ工業	5,700	2,914.00	16,609,800	
クレハ	32,800	2,852.00	93,545,600	
多木化学	5,800	3,975.00	23,055,000	
テイカ	12,900	1,566.00	20,201,400	
石原産業	24,800	1,692.00	41,961,600	
片倉コープアグリ	1,200	1,127.00	1,352,400	
日本曹達	17,700	5,800.00	102,660,000	
東ソー	200,200	2,167.00	433,833,400	
トクヤマ	48,400	3,145.00	152,218,000	
セントラル硝子	16,000	3,285.00	52,560,000	
東亜合成	72,100	1,627.50	117,342,750	
大阪ソーダ	10,500	9,090.00	95,445,000	
関東電化工業	29,000	1,028.00	29,812,000	
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	10,700	946.00	10,122,200	
デンカ	54,600	2,358.00	128,746,800	
イビデン	78,900	5,216.00	411,542,400	
信越化学工業	1,345,200	5,813.00	7,819,647,600	
日本カーバイド工業	7,100	1,708.00	12,126,800	
プラスアルファ・コンサルティング	18,900	2,029.00	38,348,100	
電算システムホールディングス	6,600	2,725.00	17,985,000	
堺化学工業	11,500	2,020.00	23,230,000	
第一稀元素化学工業	16,400	906.00	14,858,400	
エア・ウォーター	141,500	2,293.50	324,530,250	
日本酸素ホールディングス	145,500	4,713.00	685,741,500	
日本化学工業	5,500	2,460.00	13,530,000	
東邦アセチレン	5,400	382.00	2,062,800	
日本パーカライジング	66,800	1,196.00	79,892,800	
高圧ガス工業	22,000	907.00	19,954,000	

チタン工業	600	1,034.00	620,400	
四国化成ホールディングス	16,900	1,930.00	32,617,000	
戸田工業	3,500	1,942.00	6,797,000	
ステラ　ケミファ	8,100	3,940.00	31,914,000	
保土谷化学工業	4,700	4,655.00	21,878,500	
日本触媒	87,300	1,532.50	133,787,250	
大日精化工業	10,500	2,992.00	31,416,000	
カネカ	37,000	4,146.00	153,402,000	
協和キリン	181,400	2,671.50	484,610,100	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	51,400	1,356.00	69,698,400	
三菱瓦斯化学	109,500	3,091.00	338,464,500	
三井化学	123,700	4,482.00	554,423,400	
東京応化工業	71,600	4,434.00	317,474,400	
大阪有機化学工業	12,600	3,430.00	43,218,000	
三菱ケミカルグループ	1,096,700	901.60	988,784,720	
ＫＨネオケム	22,800	2,261.00	51,550,800	
ビジョナル	17,600	7,870.00	138,512,000	
ダイセル	192,800	1,576.00	303,852,800	
住友ベークライト	42,000	4,621.00	194,082,000	
積水化学工業	301,500	2,251.50	678,827,250	
日本ゼオン	102,800	1,490.50	153,223,400	
アイカ工業	37,900	3,407.00	129,125,300	
ＵＢＥ	71,400	2,907.50	207,595,500	
積水樹脂	22,300	2,561.00	57,110,300	
タキロンシーアイ	38,300	727.00	27,844,100	
旭有機材	10,000	5,080.00	50,800,000	
ニチバン	8,200	1,777.00	14,571,400	
リケンテクノス	28,100	1,000.00	28,100,000	
大倉工業	7,000	3,145.00	22,015,000	
積水化成品工業	21,200	459.00	9,730,800	
群栄化学工業	3,600	3,450.00	12,420,000	
タイガースポリマー	2,300	1,018.00	2,341,400	
ミライアル	1,700	1,531.00	2,602,700	
ダイキアクシス	2,000	719.00	1,438,000	
ダイキョーニシカワ	33,100	721.00	23,865,100	
竹本容器	1,900	841.00	1,597,900	
森六ホールディングス	7,800	2,709.00	21,130,200	
恵和	10,800	1,154.00	12,463,200	
日本化薬	114,600	1,339.00	153,449,400	
カーリットホールディングス	16,200	1,148.00	18,597,600	
ソルクシーズ	4,300	319.00	1,371,700	
ＣＬホールディングス	3,700	1,305.00	4,828,500	
プレステージ・インターナショナル	72,100	690.00	49,749,000	
フェイス	1,200	441.00	529,200	
プロトコーポレーション	16,400	1,313.00	21,533,200	
ハイマックス	4,500	1,391.00	6,259,500	
アミューズ	9,300	1,607.00	14,945,100	
野村総合研究所	325,300	4,059.00	1,320,392,700	
ドリームインキュベータ	5,200	2,513.00	13,067,600	
クイック	10,700	2,278.00	24,374,600	

ＴＡＣ	2,300	183.00	420,900	
ＣＥホールディングス	2,400	564.00	1,353,600	
日本システム技術	12,600	1,623.00	20,449,800	
電通グループ	151,300	4,218.00	638,183,400	
インテージホールディングス	17,000	1,484.00	25,228,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,600	1,072.00	7,075,200	
東邦システムサイエンス	6,300	1,317.00	8,297,100	
ぴあ	5,100	3,020.00	15,402,000	
イオンファンタジー	5,500	2,245.00	12,347,500	
ソースネクスト	68,700	189.00	12,984,300	
シーティーエス	19,600	753.00	14,758,800	
ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ	1,600	623.00	996,800	
インフォコム	19,400	3,655.00	70,907,000	
メディカルシステムネットワーク	17,200	645.00	11,094,000	
日本精化	10,000	2,593.00	25,930,000	
扶桑化学工業	15,900	3,915.00	62,248,500	
トリケミカル研究所	18,200	4,425.00	80,535,000	
シンプレクス・ホールディングス	22,800	2,725.00	62,130,000	
ＨＥＲＯＺ	5,900	1,395.00	8,230,500	
ラクスル	36,300	936.00	33,976,800	
メルカリ	73,300	1,867.50	136,887,750	
ＩＰＳ	4,400	2,587.00	11,382,800	
ＦＩＧ	5,800	372.00	2,157,600	
システムサポート	5,800	2,012.00	11,669,600	
ＡＤＥＫＡ	52,300	3,388.00	177,192,400	
日油	135,900	2,098.50	285,186,150	
ミヨシ油脂	1,900	1,455.00	2,764,500	
新日本理化	6,900	195.00	1,345,500	
ハリマ化成グループ	10,600	900.00	9,540,000	
イーソル	10,900	830.00	9,047,000	
東海ソフト	800	1,440.00	1,152,000	
ウイングアーク１ｓｔ	15,600	2,678.00	41,776,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,000	1,019.00	5,095,000	
サーバーワークス	3,100	3,090.00	9,579,000	
東名	500	2,329.00	1,164,500	
ヴィッツ	500	791.00	395,500	
トビラシステムズ	1,500	800.00	1,200,000	
Ｓａｎｓａｎ	49,300	1,525.00	75,182,500	
Ｌｉｎｋ－Ｕグループ	1,000	630.00	630,000	
ギフティ	13,200	1,234.00	16,288,800	
花王	339,200	6,862.00	2,327,590,400	
第一工業製薬	6,000	3,520.00	21,120,000	
石原ケミカル	6,600	1,792.00	11,827,200	
日華化学	2,100	1,060.00	2,226,000	
ニイタカ	1,000	1,946.00	1,946,000	
三洋化成工業	9,200	4,130.00	37,996,000	
メドレー	20,200	3,665.00	74,033,000	
ベース	5,200	3,425.00	17,810,000	
ＪＭＤＣ	25,600	2,850.00	72,960,000	

武田薬品工業	1,329,400	4,102.00	5,453,198,800	
アステラス製薬	1,317,500	1,510.50	1,990,083,750	
住友ファーマ	111,300	416.00	46,300,800	
塩野義製薬	189,300	7,629.00	1,444,169,700	
わかもと製薬	5,300	236.00	1,250,800	
日本新薬	39,400	3,893.00	153,384,200	
中外製薬	470,200	4,966.00	2,335,013,200	
科研製薬	25,700	3,548.00	91,183,600	
エーザイ	182,700	6,764.00	1,235,782,800	
理研ビタミン	12,800	2,567.00	32,857,600	
ロート製薬	145,500	3,178.00	462,399,000	
小野薬品工業	307,200	2,320.00	712,704,000	
久光製薬	33,400	3,793.00	126,686,200	
有機合成薬品工業	4,200	303.00	1,272,600	
持田製薬	16,800	3,150.00	52,920,000	
参天製薬	265,000	1,648.00	436,720,000	
扶桑薬品工業	5,300	2,284.00	12,105,200	
日本ケミファ	600	1,600.00	960,000	
ツムラ	47,300	4,071.00	192,558,300	
テルモ	834,900	2,663.50	2,223,756,150	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	45,000	2,472.00	111,240,000	
キッセイ薬品工業	24,800	3,130.00	77,624,000	
生化学工業	25,400	737.00	18,719,800	
栄研化学	26,900	2,073.00	55,763,700	
鳥居薬品	8,100	3,955.00	32,035,500	
ＪＣＲファーマ	50,800	648.00	32,918,400	
東和薬品	23,000	2,777.00	63,871,000	
富士製薬工業	11,100	1,544.00	17,138,400	
ゼリア新薬工業	20,900	2,039.00	42,615,100	
ネクセラファーマ	65,800	1,510.00	99,358,000	
第一三共	1,308,500	5,422.00	7,094,687,000	
杏林製薬	32,500	1,753.00	56,972,500	
大幸薬品	31,300	411.00	12,864,300	
ダイト	11,500	2,456.00	28,244,000	
大塚ホールディングス	312,500	6,626.00	2,070,625,000	
ペプチドリーム	72,800	1,953.50	142,214,800	
大日本塗料	16,600	1,137.00	18,874,200	
日本ペイントホールディングス	796,700	1,111.00	885,133,700	
関西ペイント	129,600	2,240.00	290,304,000	
神東塗料	4,600	132.00	607,200	
中国塗料	30,800	2,013.00	62,000,400	
日本特殊塗料	3,600	1,252.00	4,507,200	
藤倉化成	17,300	467.00	8,079,100	
太陽ホールディングス	26,100	3,170.00	82,737,000	
ＤＩＣ	58,500	2,984.50	174,593,250	
サカタインクス	33,300	1,587.00	52,847,100	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	32,600	3,380.00	110,188,000	
アルプス技研	14,600	2,799.00	40,865,400	
サニックス	24,600	335.00	8,241,000	
日本空調サービス	16,500	885.00	14,602,500	

オリエンタルランド	814,700	4,517.00	3,679,999,900	
フォーカスシステムズ	10,000	1,220.00	12,200,000	
ダスキン	33,600	3,296.00	110,745,600	
パーク２４	95,800	1,739.50	166,644,100	
明光ネットワークジャパン	18,700	728.00	13,613,600	
ファルコホールディングス	6,800	2,291.00	15,578,800	
クレスコ	12,300	2,264.00	27,847,200	
フジ・メディア・ホールディングス	144,300	1,840.00	265,512,000	
秀英予備校	1,200	308.00	369,600	
田谷	1,000	388.00	388,000	
ラウンドワン	145,100	719.00	104,326,900	
リゾートトラスト	66,800	2,649.00	176,953,200	
オービック	50,200	21,200.00	1,064,240,000	
ジャストシステム	21,600	2,848.00	61,516,800	
ＴＤＣソフト	28,200	1,143.00	32,232,600	
ＬＩＮＥヤフー	2,138,600	373.00	797,697,800	
ビー・エム・エル	18,900	3,035.00	57,361,500	
トレンドマイクロ	71,000	7,473.00	530,583,000	
ＩＤホールディングス	10,100	1,462.00	14,766,200	
リソー教育	78,700	276.00	21,721,200	
日本オラクル	28,800	11,880.00	342,144,000	
早稲田アカデミー	8,500	1,577.00	13,404,500	
アルファシステムズ	4,000	3,210.00	12,840,000	
フューチャー	32,000	1,547.00	49,504,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,000	1,957.00	15,656,000	
ＳＢテクノロジー	6,300	2,946.00	18,559,800	
トーセ	1,400	692.00	968,800	
ユー・エス・エス	345,500	1,290.00	445,695,000	
オービックビジネスコンサルタント	21,200	6,682.00	141,658,400	
アイティフォー	19,200	1,320.00	25,344,000	
東京個別指導学院	18,400	408.00	7,507,200	
東計電算	4,200	3,810.00	16,002,000	
サイバーエージェント	340,200	1,000.00	340,200,000	
楽天グループ	1,321,000	804.50	1,062,744,500	
エックスネット	700	1,502.00	1,051,400	
クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,717.00	13,220,900	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	30,200	672.00	20,294,400	
テー・オー・ダブリュー	30,300	374.00	11,332,200	
大塚商会	149,000	2,956.50	440,518,500	
サイボウズ	20,700	1,617.00	33,471,900	
山田コンサルティンググループ	6,700	1,925.00	12,897,500	
セントラルスポーツ	5,600	2,470.00	13,832,000	
パラカ	4,600	1,921.00	8,836,600	
電通総研	18,300	5,080.00	92,964,000	
ＡＣＣＥＳＳ	15,600	1,536.00	23,961,600	
デジタルガレージ	24,000	2,674.00	64,176,000	
イーエムシステムズ	25,000	645.00	16,125,000	
ウェザーニューズ	4,600	4,700.00	21,620,000	
ＣＩＪ	37,400	464.00	17,353,600	

ビジネスエンジニアリング	3,200	3,570.00	11,424,000	
日本エンタープライズ	5,000	140.00	700,000	
WOWOW	11,400	1,099.00	12,528,600	
スカラ	13,700	712.00	9,754,400	
インテリジェント　ウェイブ	2,700	1,085.00	2,929,500	
フルキャストホールディングス	14,700	1,455.00	21,388,500	
エン・ジャパン	25,000	2,715.00	67,875,000	
セルソース	5,500	1,437.00	7,903,500	
あすか製薬ホールディングス	15,400	2,476.00	38,130,400	
サワイグループホールディングス	34,300	5,645.00	193,623,500	
富士フイルムホールディングス	836,000	3,394.00	2,837,384,000	
コニカミノルタ	337,800	537.00	181,398,600	
資生堂	313,600	4,656.00	1,460,121,600	
ライオン	191,100	1,329.50	254,067,450	
高砂香料工業	11,300	3,720.00	42,036,000	
マンダム	32,400	1,351.00	43,772,400	
ミルボン	20,400	3,158.00	64,423,200	
ファンケル	65,800	2,001.00	131,665,800	
コーセー	30,600	9,831.00	300,828,600	
コタ	15,200	1,440.00	21,888,000	
シーボン	700	1,422.00	995,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	77,000	1,414.50	108,916,500	
ノエビアホールディングス	13,300	5,270.00	70,091,000	
アジュバンホールディングス	1,200	858.00	1,029,600	
新日本製薬	8,600	1,644.00	14,138,400	
Ｉ－ｎｅ	4,000	1,641.00	6,564,000	
アクシージア	9,900	947.00	9,375,300	
エステー	11,600	1,529.00	17,736,400	
アグロ　カネショウ	6,000	1,175.00	7,050,000	
コニシ	43,400	1,307.00	56,723,800	
長谷川香料	28,700	3,170.00	90,979,000	
小林製薬	43,700	5,568.00	243,321,600	
荒川化学工業	12,900	1,097.00	14,151,300	
メック	12,400	4,550.00	56,420,000	
日本高純度化学	3,400	3,245.00	11,033,000	
タカラバイオ	40,400	1,038.00	41,935,200	
ＪＣＵ	16,600	3,875.00	64,325,000	
新田ゼラチン	3,500	722.00	2,527,000	
ＯＡＴアグリオ	5,500	1,703.00	9,366,500	
デクセリアルズ	37,100	6,049.00	224,417,900	
アース製薬	13,600	4,540.00	61,744,000	
北興化学工業	15,100	1,636.00	24,703,600	
大成ラミック	4,300	2,874.00	12,358,200	
クミアイ化学工業	59,600	813.00	48,454,800	
日本農薬	27,500	788.00	21,670,000	
富士興産	1,500	1,778.00	2,667,000	
ニチレキ	19,600	2,330.00	45,668,000	
ユシロ化学工業	7,800	1,937.00	15,108,600	
ビーピー・カストロール	2,000	996.00	1,992,000	
富士石油	43,800	472.00	20,673,600	

ＭＯＲＥＳＣＯ	1,900	1,293.00	2,456,700	
出光興産	779,800	1,065.50	830,876,900	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,378,100	714.00	1,697,963,400	
コスモエネルギーホールディングス	44,500	8,050.00	358,225,000	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	21,300	2,318.00	49,373,400	
テスホールディングス	31,600	442.00	13,967,200	
インフロニア・ホールディングス	169,400	1,401.00	237,329,400	
横浜ゴム	75,900	4,066.00	308,609,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	86,300	2,880.50	248,587,150	
ブリヂストン	439,700	6,956.00	3,058,553,200	
住友ゴム工業	147,300	1,896.50	279,354,450	
藤倉コンポジット	13,000	1,446.00	18,798,000	
オカモト	7,100	4,665.00	33,121,500	
アキレス	9,500	1,603.00	15,228,500	
フコク	7,900	1,836.00	14,504,400	
ニッタ	15,200	3,935.00	59,812,000	
クリエートメディック	1,600	961.00	1,537,600	
住友理工	23,300	1,271.00	29,614,300	
三ツ星ベルト	17,400	4,630.00	80,562,000	
バンドー化学	22,200	1,755.00	38,961,000	
ＡＧＣ	134,000	5,677.00	760,718,000	
日本板硝子	71,700	458.00	32,838,600	
石塚硝子	900	2,957.00	2,661,300	
有沢製作所	26,300	1,560.00	41,028,000	
日本山村硝子	1,900	1,459.00	2,772,100	
日本電気硝子	61,300	3,613.00	221,476,900	
オハラ	7,100	1,272.00	9,031,200	
住友大阪セメント	25,000	3,982.00	99,550,000	
太平洋セメント	88,800	3,739.00	332,023,200	
リソルホールディングス	500	5,030.00	2,515,000	
日本ヒューム	13,200	933.00	12,315,600	
日本コンクリート工業	29,200	412.00	12,030,400	
三谷セキサン	6,300	5,370.00	33,831,000	
アジアパイルホールディングス	21,400	968.00	20,715,200	
東海カーボン	138,500	982.20	136,034,700	
日本カーボン	8,000	5,460.00	43,680,000	
東洋炭素	10,600	8,120.00	86,072,000	
ノリタケカンパニーリミテド	16,600	4,000.00	66,400,000	
ＴＯＴＯ	99,100	4,200.00	416,220,000	
日本碍子	174,700	2,105.00	367,743,500	
日本特殊陶業	125,800	4,798.00	603,588,400	
ダントーホールディングス	3,400	770.00	2,618,000	
ＭＡＲＵＷＡ	5,500	34,450.00	189,475,000	
品川リフラクトリーズ	18,500	1,862.00	34,447,000	
黒崎播磨	12,300	3,320.00	40,836,000	
ヨータイ	9,300	1,787.00	16,619,100	
東京窯業	5,400	487.00	2,629,800	
ニッカトー	2,400	570.00	1,368,000	
フジミインコーポレーテッド	40,300	3,625.00	146,087,500	
クニミネ工業	1,500	1,089.00	1,633,500	

エーアンドエーマテリアル	1,100	1,439.00	1,582,900	
ニチアス	38,000	4,305.00	163,590,000	
日本製鉄	692,100	3,308.00	2,289,466,800	
神戸製鋼所	310,800	1,888.00	586,790,400	
中山製鋼所	35,400	940.00	33,276,000	
合同製鐵	8,600	5,390.00	46,354,000	
ＪＦＥホールディングス	429,800	2,309.50	992,623,100	
東京製鐵	43,500	1,653.00	71,905,500	
共英製鋼	17,600	2,160.00	38,016,000	
大和工業	29,200	8,590.00	250,828,000	
東京鐵鋼	6,800	5,100.00	34,680,000	
大阪製鐵	7,100	2,638.00	18,729,800	
淀川製鋼所	17,600	5,410.00	95,216,000	
中部鋼鈑	10,200	2,584.00	26,356,800	
丸一鋼管	47,100	3,849.00	181,287,900	
モリ工業	3,600	5,530.00	19,908,000	
大同特殊鋼	97,300	1,618.00	157,431,400	
日本高周波鋼業	2,000	446.00	892,000	
日本冶金工業	11,300	4,570.00	51,641,000	
山陽特殊製鋼	15,300	2,217.00	33,920,100	
愛知製鋼	8,900	3,720.00	33,108,000	
日本金属	1,400	823.00	1,152,200	
ミガロホールディングス	700	2,676.00	1,873,200	
大平洋金属	13,200	1,285.00	16,962,000	
新日本電工	76,900	300.00	23,070,000	
栗本鐵工所	7,100	4,330.00	30,743,000	
虹　技	700	1,215.00	850,500	
日本鋳鉄管	600	1,420.00	852,000	
日本製鋼所	41,600	3,943.00	164,028,800	
三菱製鋼	11,500	1,363.00	15,674,500	
日亜鋼業	5,700	323.00	1,841,100	
日本精線	12,500	1,306.00	16,325,000	
エンビプロ・ホールディングス	13,700	520.00	7,124,000	
大紀アルミニウム工業所	19,700	1,384.00	27,264,800	
日本軽金属ホールディングス	45,300	1,876.00	84,982,800	
三井金属鉱業	45,000	5,007.00	225,315,000	
東邦亜鉛	10,000	1,075.00	10,750,000	
三菱マテリアル	110,400	3,092.00	341,356,800	
住友金属鉱山	179,200	5,001.00	896,179,200	
ＤＯＷＡホールディングス	38,200	5,721.00	218,542,200	
古河機械金属	20,400	1,983.00	40,453,200	
エス・サイエンス	32,600	25.00	815,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,800	2,508.00	67,214,400	
東邦チタニウム	31,900	1,247.00	39,779,300	
ＵＡＣＪ	21,700	4,895.00	106,221,500	
ＣＫサンエツ	2,800	3,870.00	10,836,000	
古河電気工業	51,400	3,449.00	177,278,600	
住友電気工業	578,000	2,379.00	1,375,062,000	
フジクラ	182,200	2,845.00	518,359,000	
ＳＷＣＣ	17,300	4,170.00	72,141,000	

タツタ電線	27,600	716.00	19,761,600	
カナレ電気	900	1,582.00	1,423,800	
平河ヒューテック	9,900	1,323.00	13,097,700	
いよぎんホールディングス	175,500	1,305.50	229,115,250	
しずおかフィナンシャルグループ	327,700	1,544.50	506,132,650	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	124,200	1,524.00	189,280,800	
楽天銀行	68,400	3,365.00	230,166,000	
京都フィナンシャルグループ	186,900	2,846.00	531,917,400	
リョービ	16,400	2,754.00	45,165,600	
アーレスティ	5,600	647.00	3,623,200	
ＡＲＥホールディングス	58,000	1,995.00	115,710,000	
東洋製罐グループホールディングス	88,600	2,424.50	214,810,700	
ホッカンホールディングス	7,500	1,730.00	12,975,000	
コロナ	8,600	945.00	8,127,000	
横河ブリッジホールディングス	24,100	2,838.00	68,395,800	
駒井ハルテック	900	2,063.00	1,856,700	
高田機工	400	3,550.00	1,420,000	
三和ホールディングス	155,200	2,683.50	416,479,200	
文化シヤッター	40,400	1,773.00	71,629,200	
三協立山	19,500	855.00	16,672,500	
アルインコ	11,800	1,095.00	12,921,000	
東洋シヤッター	1,200	735.00	882,000	
ＬＩＸＩＬ	241,300	1,802.00	434,822,600	
日本フイルコン	3,400	553.00	1,880,200	
ノーリツ	24,400	1,770.00	43,188,000	
長府製作所	15,300	2,179.00	33,338,700	
リンナイ	74,000	3,800.00	281,200,000	
ユニプレス	26,900	1,446.00	38,897,400	
ダイニチ工業	2,600	699.00	1,817,400	
日東精工	22,400	622.00	13,932,800	
三洋工業	600	3,125.00	1,875,000	
岡部	27,600	790.00	21,804,000	
ジーテクト	19,700	1,919.00	37,804,300	
東プレ	27,200	2,480.00	67,456,000	
高周波熱錬	22,800	1,098.00	25,034,400	
東京製綱	10,000	1,490.00	14,900,000	
サンコール	15,600	443.00	6,910,800	
モリテックスチール	4,700	241.00	1,132,700	
パイオラックス	19,200	2,103.00	40,377,600	
エイチワン	16,000	701.00	11,216,000	
日本発条	136,700	1,642.00	224,461,400	
中央発條	11,500	1,059.00	12,178,500	
アドバネクス	600	1,038.00	622,800	
三浦工業	63,200	2,604.00	164,572,800	
タクマ	51,100	1,950.00	99,645,000	
テクノプロ・ホールディングス	90,200	2,733.50	246,561,700	
アトラグループ	1,600	164.00	262,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	8,000	1,215.00	9,720,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	9,500	4,075.00	38,712,500	

ファーストロジック	1,600	508.00	812,800	
三機サービス	900	1,292.00	1,162,800	
Ｇｕｎｏｓｙ	12,200	741.00	9,040,200	
デザインワン・ジャパン	1,600	133.00	212,800	
イー・ガーディアン	7,400	1,760.00	13,024,000	
リブセンス	2,400	223.00	535,200	
ジャパンマテリアル	47,200	2,398.00	113,185,600	
ベクトル	18,400	1,297.00	23,864,800	
ウチヤマホールディングス	2,300	340.00	782,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,900	1,608.00	20,743,200	
キャリアリンク	5,600	2,556.00	14,313,600	
ＩＢＪ	11,900	593.00	7,056,700	
アサンテ	7,600	1,665.00	12,654,000	
バリューＨＲ	13,400	1,362.00	18,250,800	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	12,500	2,175.00	27,187,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,100	1,050.00	6,405,000	
ＥＲＩホールディングス	1,500	2,325.00	3,487,500	
アビスト	800	3,290.00	2,632,000	
シグマクシス・ホールディングス	20,200	1,422.00	28,724,400	
ウィルグループ	12,900	1,070.00	13,803,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,400	144.00	921,600	
メドピア	12,300	700.00	8,610,000	
レアジョブ	1,000	690.00	690,000	
リクルートホールディングス	1,108,800	6,871.00	7,618,564,800	
エラン	20,400	939.00	19,155,600	
ツガミ	33,600	1,422.00	47,779,200	
オークマ	13,200	6,963.00	91,911,600	
芝浦機械	15,100	3,650.00	55,115,000	
アマダ	229,200	1,765.00	404,538,000	
アイダエンジニアリング	35,000	911.00	31,885,000	
ＦＵＪＩ	71,200	2,682.00	190,958,400	
牧野フライス製作所	16,700	6,340.00	105,878,000	
オーエスジー	66,600	2,048.00	136,396,800	
ダイジェット工業	500	844.00	422,000	
旭ダイヤモンド工業	34,900	960.00	33,504,000	
ＤＭＧ森精機	93,900	4,654.00	437,010,600	
ソディック	36,800	729.00	26,827,200	
ディスコ	72,900	52,710.00	3,842,559,000	
日東工器	7,300	2,275.00	16,607,500	
日進工具	14,000	928.00	12,992,000	
パンチ工業	5,000	458.00	2,290,000	
冨士ダイス	10,100	679.00	6,857,900	
土木管理総合試験所	2,500	325.00	812,500	
日本郵政	1,809,100	1,518.50	2,747,118,350	
ベルシステム２４ホールディングス	16,500	1,560.00	25,740,000	
鎌倉新書	13,200	578.00	7,629,600	
ＳＭＮ	1,000	300.00	300,000	
一蔵	700	569.00	398,300	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,000	637.00	637,000	

エアトリ	11,300	1,397.00	15,786,100	
アトラエ	11,700	436.00	5,101,200	
ストライク	7,600	4,185.00	31,806,000	
ソラスト	42,400	487.00	20,648,800	
セラク	4,700	1,055.00	4,958,500	
インソース	33,400	871.00	29,091,400	
豊田自動織機	127,700	15,265.00	1,949,340,500	
豊和工業	2,800	807.00	2,259,600	
石川製作所	1,300	1,538.00	1,999,400	
リケンＮＰＲ	16,400	2,983.00	48,921,200	
東洋機械金属	4,100	736.00	3,017,600	
津田駒工業	900	395.00	355,500	
エンシュウ	1,200	676.00	811,200	
島精機製作所	24,000	1,557.00	37,368,000	
オプトラン	24,800	2,068.00	51,286,400	
ＮＣホールディングス	1,200	1,875.00	2,250,000	
イワキ	10,100	2,636.00	26,623,600	
フリュー	14,200	1,220.00	17,324,000	
ヤマシンフィルタ	36,000	415.00	14,940,000	
日阪製作所	16,500	1,069.00	17,638,500	
やまびこ	24,700	2,127.00	52,536,900	
野村マイクロ・サイエンス	20,500	5,470.00	112,135,000	
平田機工	7,200	7,320.00	52,704,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	16,700	539.00	9,001,300	
マルマエ	6,600	1,989.00	13,127,400	
タツモ	9,100	4,470.00	40,677,000	
ナブテスコ	94,900	2,887.00	273,976,300	
三井海洋開発	19,200	3,360.00	64,512,000	
レオン自動機	17,500	1,511.00	26,442,500	
ＳＭＣ	45,300	84,350.00	3,821,055,000	
ホソカワミクロン	10,600	4,715.00	49,979,000	
ユニオンツール	6,600	4,575.00	30,195,000	
瑞光	10,900	1,065.00	11,608,500	
オイレス工業	20,500	2,210.00	45,305,000	
日精エー・エス・ビー機械	5,100	5,340.00	27,234,000	
サトーホールディングス	21,600	2,116.00	45,705,600	
技研製作所	14,200	1,994.00	28,314,800	
日本エアーテック	7,000	1,204.00	8,428,000	
カワタ	1,600	925.00	1,480,000	
日精樹脂工業	11,300	1,141.00	12,893,300	
オカダアイヨン	1,700	2,596.00	4,413,200	
ワイエイシイホールディングス	6,400	2,388.00	15,283,200	
小松製作所	709,000	4,601.00	3,262,109,000	
住友重機械工業	89,500	4,409.00	394,605,500	
日立建機	60,200	4,496.00	270,659,200	
日工	22,500	748.00	16,830,000	
巴工業	5,900	4,155.00	24,514,500	
井関農機	14,200	1,031.00	14,640,200	
ＴＯＷＡ	16,800	13,450.00	225,960,000	
丸山製作所	900	2,512.00	2,260,800	

北川鉄工所	5,900	1,398.00	8,248,200	
シンニッタン	6,700	259.00	1,735,300	
ローツェ	7,900	31,350.00	247,665,000	
タカキタ	1,800	500.00	900,000	
クボタ	790,800	2,354.00	1,861,543,200	
荏原実業	8,000	3,495.00	27,960,000	
東洋エンジニアリング	21,600	907.00	19,591,200	
三菱化工機	5,300	3,820.00	20,246,000	
月島ホールディングス	20,500	1,419.00	29,089,500	
帝国電機製作所	10,400	2,359.00	24,533,600	
東京機械製作所	1,400	439.00	614,600	
新東工業	30,600	1,246.00	38,127,600	
澁谷工業	14,200	3,770.00	53,534,000	
アイチコーポレーション	20,900	1,160.00	24,244,000	
小森コーポレーション	37,200	1,244.00	46,276,800	
鶴見製作所	11,600	3,810.00	44,196,000	
日本ギア工業	1,900	558.00	1,060,200	
酒井重工業	2,700	6,310.00	17,037,000	
荏原製作所	62,100	13,555.00	841,765,500	
石井鐵工所	600	2,790.00	1,674,000	
酉島製作所	13,100	3,050.00	39,955,000	
北越工業	15,200	2,087.00	31,722,400	
ダイキン工業	180,500	24,450.00	4,413,225,000	
オルガノ	18,200	8,680.00	157,976,000	
トーヨーカネツ	5,100	4,225.00	21,547,500	
栗田工業	84,600	6,859.00	580,271,400	
椿本チエイン	20,800	5,480.00	113,984,000	
大同工業	2,300	732.00	1,683,600	
日機装	34,800	1,239.00	43,117,200	
木村化工機	11,600	690.00	8,004,000	
レイズネクスト	21,300	2,078.00	44,261,400	
アネスト岩田	23,300	1,400.00	32,620,000	
ダイフク	255,300	3,320.00	847,596,000	
サムコ	3,600	4,710.00	16,956,000	
加藤製作所	2,600	1,381.00	3,590,600	
油研工業	900	2,216.00	1,994,400	
タダノ	87,000	1,246.00	108,402,000	
フジテック	35,300	3,908.00	137,952,400	
ＣＫＤ	41,800	3,315.00	138,567,000	
平和	44,700	2,057.00	91,947,900	
理想科学工業	12,100	3,005.00	36,360,500	
ＳＡＮＫＹＯ	145,600	1,578.50	229,829,600	
日本金銭機械	18,300	1,229.00	22,490,700	
マースグループホールディングス	7,600	3,185.00	24,206,000	
フクシマガリレイ	9,900	6,100.00	60,390,000	
オーイズミ	2,000	383.00	766,000	
ダイコク電機	7,400	3,395.00	25,123,000	
竹内製作所	27,400	6,400.00	175,360,000	
アマノ	42,900	3,816.00	163,706,400	
ＪＵＫＩ	23,300	542.00	12,628,600	

サンデン	7,600	165.00	1,254,000	
ジャノメ	15,200	678.00	10,305,600	
ブラザー工業	202,100	2,856.50	577,298,650	
マックス	21,300	3,540.00	75,402,000	
モリタホールディングス	26,300	1,781.00	46,840,300	
グローリー	36,300	2,739.50	99,443,850	
新晃工業	15,200	4,115.00	62,548,000	
大和冷機工業	23,100	1,623.00	37,491,300	
セガサミーホールディングス	135,100	2,306.50	311,608,150	
ＴＰＲ	19,200	2,307.00	44,294,400	
ツバキ・ナカシマ	30,400	850.00	25,840,000	
ホシザキ	89,300	5,859.00	523,208,700	
大豊工業	13,200	833.00	10,995,600	
日本精工	279,900	825.30	231,001,470	
ＮＴＮ	327,900	307.30	100,763,670	
ジェイテクト	134,700	1,203.50	162,111,450	
不二越	11,200	3,360.00	37,632,000	
ミネベアミツミ	263,100	3,190.00	839,289,000	
日本トムソン	41,100	646.00	26,550,600	
ＴＨＫ	87,300	3,480.00	303,804,000	
ユーシン精機	12,100	696.00	8,421,600	
前澤給装工業	10,900	1,319.00	14,377,100	
イーグル工業	16,700	1,817.00	30,343,900	
前澤工業	3,200	1,272.00	4,070,400	
日本ピラー工業	14,000	6,670.00	93,380,000	
キッツ	50,600	1,315.00	66,539,000	
日立製作所	726,900	14,295.00	10,391,035,500	
三菱電機	1,683,700	2,750.50	4,631,016,850	
富士電機	92,000	9,613.00	884,396,000	
東洋電機製造	1,800	1,162.00	2,091,600	
安川電機	164,300	6,512.00	1,069,921,600	
シンフォニア　テクノロジー	16,700	3,945.00	65,881,500	
明電舎	28,100	3,740.00	105,094,000	
オリジン	1,200	1,213.00	1,455,600	
山洋電気	6,500	7,370.00	47,905,000	
デンヨー	11,600	2,602.00	30,183,200	
ＰＨＣホールディングス	28,300	1,141.00	32,290,300	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	78,200	4,000.00	312,800,000	
ソシオネクスト	110,000	4,512.00	496,320,000	
ベイカレント・コンサルティング	113,100	3,332.00	376,849,200	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,400	979.00	3,328,600	
アイモバイル	19,600	446.00	8,741,600	
キャリアインデックス	1,700	176.00	299,200	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	6,300	1,170.00	7,371,000	
船場	1,100	1,317.00	1,448,700	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	49,800	2,415.00	120,267,000	
フルテック	800	1,113.00	890,400	
グリーンズ	1,900	2,207.00	4,193,300	

ツナググループ・ホールディングス	1,500	704.00	1,056,000	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	2,200	292.00	642,400	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	700	600.00	420,000	
エル・ティー・エス	1,800	2,378.00	4,280,400	
ミダックホールディングス	9,300	1,445.00	13,438,500	
キュービーネットホールディングス	8,900	1,123.00	9,994,700	
ＲＰＡホールディングス	21,100	256.00	5,401,600	
三櫻工業	22,800	972.00	22,161,600	
マキタ	172,500	4,708.00	812,130,000	
東芝テック	19,400	3,180.00	61,692,000	
芝浦メカトロニクス	8,600	7,350.00	63,210,000	
マブチモーター	74,500	2,401.50	178,911,750	
ニデック	334,000	7,042.00	2,352,028,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,600	356.00	3,417,600	
トレックス・セミコンダクター	7,800	1,834.00	14,305,200	
東光高岳	9,100	2,152.00	19,583,200	
ダブル・スコープ	43,300	511.00	22,126,300	
宮越ホールディングス	6,700	1,375.00	9,212,500	
ダイヘン	14,300	9,050.00	129,415,000	
ヤーマン	29,400	913.00	26,842,200	
ＪＶＣケンウッド	119,300	821.00	97,945,300	
ミマキエンジニアリング	14,300	1,366.00	19,533,800	
Ｉ－ＰＥＸ	10,500	2,047.00	21,493,500	
大崎電気工業	33,000	621.00	20,493,000	
オムロン	115,500	5,760.00	665,280,000	
日東工業	20,400	3,970.00	80,988,000	
ＩＤＥＣ	22,300	2,688.00	59,942,400	
正興電機製作所	1,700	1,569.00	2,667,300	
不二電機工業	1,200	1,113.00	1,335,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	59,000	3,005.00	177,295,000	
サクサホールディングス	1,200	2,695.00	3,234,000	
メルコホールディングス	4,700	3,550.00	16,685,000	
テクノメディカ	3,600	1,735.00	6,246,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,600	749.00	4,194,400	
日本電気	198,600	10,770.00	2,138,922,000	
富士通	1,391,900	2,357.00	3,280,708,300	
沖電気工業	68,300	1,047.00	71,510,100	
岩崎通信機	2,400	671.00	1,610,400	
電気興業	6,100	2,149.00	13,108,900	
サンケン電気	14,000	6,242.00	87,388,000	
ナカヨ	800	1,131.00	904,800	
アイホン	8,100	2,917.00	23,627,700	
ルネサスエレクトロニクス	942,900	2,576.50	2,429,381,850	
セイコーエプソン	194,100	2,512.50	487,676,250	
ワコム	110,600	715.00	79,079,000	
アルバック	33,100	9,959.00	329,642,900	
アクセル	6,800	1,351.00	9,186,800	
ＥＩＺＯ	11,100	5,000.00	55,500,000	
ジャパンディスプレイ	650,600	18.00	11,710,800	

日本信号	34,400	1,012.00	34,812,800	
京三製作所	31,500	520.00	16,380,000	
能美防災	20,500	2,362.00	48,421,000	
ホーチキ	11,300	2,199.00	24,848,700	
星和電機	2,300	590.00	1,357,000	
エレコム	36,200	1,526.00	55,241,200	
パナソニック　ホールディングス	1,786,800	1,313.50	2,346,961,800	
シャープ	255,000	851.40	217,107,000	
アンリツ	106,500	1,204.50	128,279,250	
富士通ゼネラル	42,800	2,162.50	92,555,000	
ソニーグループ	1,059,400	11,920.00	12,628,048,000	
ＴＤＫ	239,500	6,895.00	1,651,352,500	
帝国通信工業	6,600	1,900.00	12,540,000	
タムラ製作所	60,200	692.00	41,658,400	
アルプスアルパイン	135,100	1,492.00	201,569,200	
池上通信機	1,600	765.00	1,224,000	
日本電波工業	18,100	1,283.00	23,222,300	
鈴木	8,100	1,368.00	11,080,800	
メイコー	15,000	6,120.00	91,800,000	
日本トリム	3,400	3,535.00	12,019,000	
ローランド　ディー．ジー．	8,300	5,360.00	44,488,000	
フォスター電機	11,200	1,190.00	13,328,000	
ＳＭＫ	3,900	2,401.00	9,363,900	
ヨコオ	13,300	1,690.00	22,477,000	
ティアック	8,000	100.00	800,000	
ホシデン	34,400	1,926.00	66,254,400	
ヒロセ電機	22,300	18,375.00	409,762,500	
日本航空電子工業	36,200	2,462.00	89,124,400	
ＴＯＡ	17,200	1,141.00	19,625,200	
マクセル	33,300	1,535.00	51,115,500	
古野電気	19,700	2,121.00	41,783,700	
スミダコーポレーション	20,300	1,148.00	23,304,400	
アイコム	5,800	3,310.00	19,198,000	
リオン	6,200	3,030.00	18,786,000	
横河電機	165,500	3,996.00	661,338,000	
新電元工業	5,700	2,982.00	16,997,400	
アズビル	103,000	4,775.00	491,825,000	
東亜ディーケーケー	2,500	850.00	2,125,000	
日本光電工業	64,300	4,351.00	279,769,300	
チノー	6,200	2,839.00	17,601,800	
共和電業	4,700	453.00	2,129,100	
日本電子材料	9,200	3,125.00	28,750,000	
堀場製作所	28,600	16,080.00	459,888,000	
アドバンテスト	429,100	5,127.00	2,199,995,700	
小野測器	2,100	675.00	1,417,500	
エスペック	12,000	3,005.00	36,060,000	
キーエンス	149,800	70,860.00	10,614,828,000	
日置電機	7,000	7,190.00	50,330,000	
シスメックス	387,800	2,622.50	1,017,005,500	
日本マイクロニクス	26,900	7,990.00	214,931,000	

メガチップス	11,900	4,290.00	51,051,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	9,400	4,175.00	39,245,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	14,900	566.00	8,433,400	
澤藤電機	600	1,260.00	756,000	
デンソー	1,235,700	2,554.00	3,155,977,800	
原田工業	2,300	698.00	1,605,400	
コーセル	16,000	1,484.00	23,744,000	
イリソ電子工業	13,700	3,145.00	43,086,500	
オプテックスグループ	27,500	1,772.00	48,730,000	
千代田インテグレ	5,900	2,755.00	16,254,500	
レーザーテック	68,600	40,620.00	2,786,532,000	
スタンレー電気	95,900	2,783.00	266,889,700	
ウシオ電機	66,200	2,103.50	139,251,700	
岡谷電機産業	3,900	261.00	1,017,900	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	4,900	500.00	2,450,000	
エノモト	1,400	1,564.00	2,189,600	
日本セラミック	12,200	2,519.00	30,731,800	
遠藤照明	2,300	1,567.00	3,604,100	
古河電池	11,100	1,109.00	12,309,900	
双信電機	2,000	478.00	956,000	
山一電機	13,400	2,805.00	37,587,000	
図研	12,500	4,210.00	52,625,000	
日本電子	37,500	6,664.00	249,900,000	
カシオ計算機	108,100	1,300.50	140,584,050	
ファナック	730,300	4,619.00	3,373,255,700	
日本シイエムケイ	35,100	624.00	21,902,400	
エンプラス	4,400	7,420.00	32,648,000	
大真空	22,200	833.00	18,492,600	
ローム	276,900	2,065.50	571,936,950	
浜松ホトニクス	120,200	5,414.00	650,762,800	
三井ハイテック	13,200	7,503.00	99,039,600	
新光電気工業	53,000	5,538.00	293,514,000	
京セラ	930,600	1,867.00	1,737,430,200	
協栄産業	500	2,555.00	1,277,500	
太陽誘電	72,900	3,234.00	235,758,600	
村田製作所	1,362,600	2,784.00	3,793,478,400	
双葉電子工業	28,900	477.00	13,785,300	
日東電工	96,500	12,450.00	1,201,425,000	
北陸電気工業	1,900	1,392.00	2,644,800	
東海理化電機製作所	42,200	2,220.00	93,684,000	
ニチコン	39,300	1,235.00	48,535,500	
日本ケミコン	15,900	1,645.00	26,155,500	
ＫＯＡ	22,600	1,563.00	35,323,800	
三井Ｅ＆Ｓ	75,000	1,696.00	127,200,000	
日立造船	133,400	1,149.00	153,276,600	
三菱重工業	2,645,200	1,288.00	3,407,017,600	
川崎重工業	122,200	5,725.00	699,595,000	
ＩＨＩ	112,600	3,869.00	435,649,400	
名村造船所	41,900	1,935.00	81,076,500	
サノヤスホールディングス	7,300	192.00	1,401,600	

スプリックス	1,600	780.00	1,248,000	
マネジメントソリューションズ	6,600	1,942.00	12,817,200	
プロレド・パートナーズ	3,800	461.00	1,751,800	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	1,500	315.00	472,500	
テノ．ホールディングス	700	449.00	314,300	
フロンティア・マネジメント	3,900	1,474.00	5,748,600	
ピアラ	1,000	293.00	293,000	
コプロ・ホールディングス	1,700	1,659.00	2,820,300	
ギークス	700	512.00	358,400	
アンビスホールディングス	32,900	2,182.00	71,787,800	
カーブスホールディングス	42,000	768.00	32,256,000	
フォーラムエンジニアリング	21,000	888.00	18,648,000	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	5,200	1,049.00	5,454,800	
日本車輌製造	4,900	2,374.00	11,632,600	
三菱ロジスネクスト	23,900	1,638.00	39,148,200	
近畿車輌	700	2,332.00	1,632,400	
一家ホールディングス	1,400	696.00	974,400	
フルサト・マルカホールディングス	14,100	2,377.00	33,515,700	
ヤマエグループホールディングス	13,900	2,470.00	34,333,000	
ジャパンクラフトホールディングス	4,300	159.00	683,700	
ＦＰＧ	54,900	2,143.00	117,650,700	
島根銀行	1,500	590.00	885,000	
じもとホールディングス	4,400	400.00	1,760,000	
全国保証	38,600	5,691.00	219,672,600	
めぶきフィナンシャルグループ	683,300	580.40	396,587,320	
ジャパンインベストメントアドバイザー	23,900	1,260.00	30,114,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,900	4,465.00	84,388,500	
九州フィナンシャルグループ	285,500	972.10	277,534,550	
かんぽ生命保険	150,200	3,012.00	452,402,400	
ゆうちょ銀行	1,620,900	1,591.50	2,579,662,350	
あんしん保証	2,400	225.00	540,000	
富山第一銀行	46,800	1,064.00	49,795,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	791,300	862.00	682,100,600	
ジェイリース	9,900	1,215.00	12,028,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	82,600	2,062.00	170,321,200	
イントラスト	1,900	834.00	1,584,600	
日本モーゲージサービス	2,700	436.00	1,177,200	
ＣＡＳＡ	2,000	853.00	1,706,000	
ＳＢＩアルヒ	14,100	862.00	12,154,200	
プレミアグループ	24,900	2,245.00	55,900,500	
日産自動車	2,021,000	557.90	1,127,515,900	
いすゞ自動車	435,400	1,938.50	844,022,900	
トヨタ自動車	8,223,500	3,366.00	27,680,301,000	
日野自動車	225,300	459.80	103,592,940	
三菱自動車工業	584,200	448.80	262,188,960	
エフテック	3,500	714.00	2,499,000	

レシップホールディングス	2,200	578.00	1,271,600	
GMB	1,000	1,171.00	1,171,000	
ファルテック	1,000	586.00	586,000	
武蔵精密工業	36,600	1,580.00	57,828,000	
日産車体	15,200	1,106.00	16,811,200	
新明和工業	43,100	1,328.00	57,236,800	
極東開発工業	24,700	2,612.00	64,516,400	
トピー工業	12,200	2,474.00	30,182,800	
ティラド	3,400	3,675.00	12,495,000	
曙ブレーキ工業	91,400	164.00	14,989,600	
タチエス	27,600	1,977.00	54,565,200	
ＮＯＫ	58,200	2,283.50	132,899,700	
フタバ産業	40,100	954.00	38,255,400	
カヤバ	14,100	5,180.00	73,038,000	
市光工業	27,000	504.00	13,608,000	
大同メタル工業	29,300	589.00	17,257,700	
プレス工業	59,700	786.00	46,924,200	
ミクニ	6,300	432.00	2,721,600	
太平洋工業	34,300	1,557.00	53,405,100	
河西工業	8,000	245.00	1,960,000	
アイシン	115,500	5,599.00	646,684,500	
マツダ	495,400	1,600.00	792,640,000	
今仙電機製作所	3,300	627.00	2,069,100	
本田技研工業	3,548,500	1,756.00	6,231,166,000	
スズキ	1,100,300	1,737.50	1,911,771,250	
ＳＵＢＡＲＵ	464,400	3,199.00	1,485,615,600	
安永	2,200	651.00	1,432,200	
ヤマハ発動機	647,200	1,392.50	901,226,000	
小糸製作所	155,100	2,212.00	343,081,200	
ＴＢＫ	5,500	358.00	1,969,000	
エクセディ	24,500	2,825.00	69,212,500	
ミツバ	28,100	1,080.00	30,348,000	
豊田合成	42,900	3,092.00	132,646,800	
愛三工業	24,800	1,454.00	36,059,200	
盟和産業	700	992.00	694,400	
日本プラスト	4,400	459.00	2,019,600	
ヨロズ	14,000	988.00	13,832,000	
エフ・シー・シー	26,500	2,216.00	58,724,000	
新家工業	1,100	3,815.00	4,196,500	
シマノ	60,400	26,305.00	1,588,822,000	
テイ・エス　テック	53,300	1,743.00	92,901,900	
三十三フィナンシャルグループ	13,200	2,064.00	27,244,800	
第四北越フィナンシャルグループ	23,100	4,660.00	107,646,000	
ひろぎんホールディングス	209,900	1,205.50	253,034,450	
マーキュリアホールディングス	2,600	1,088.00	2,828,800	
おきなわフィナンシャルグループ	12,600	2,641.00	33,276,600	
ダイレクトマーケティングミックス	15,900	238.00	3,784,200	
ポピンズ	2,300	1,340.00	3,082,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	12,000	1,897.00	22,764,000	
コンフィデンス・インターワークス	500	1,801.00	900,500	

十六フィナンシャルグループ	19,100	4,690.00	89,579,000	
北國フィナンシャルホールディングス	15,500	5,000.00	77,500,000	
ネットプロテクションズホールディングス	49,100	206.00	10,114,600	
プロクレアホールディングス	16,900	1,908.00	32,245,200	
ＦＰパートナー	3,900	4,700.00	18,330,000	
あいちフィナンシャルグループ	30,300	2,965.00	89,839,500	
ジャムコ	8,100	1,362.00	11,032,200	
小野建	16,000	1,830.00	29,280,000	
はるやまホールディングス	2,500	600.00	1,500,000	
南陽	2,300	1,123.00	2,582,900	
ノジマ	46,000	1,742.00	80,132,000	
佐鳥電機	9,900	2,266.00	22,433,400	
カッパ・クリエイト	24,800	1,626.00	40,324,800	
エコートレーディング	1,000	1,221.00	1,221,000	
伯東	9,100	5,060.00	46,046,000	
コンドーテック	12,200	1,294.00	15,786,800	
中山福	3,100	356.00	1,103,600	
ライトオン	4,000	380.00	1,520,000	
ナガイレーベン	20,000	2,460.00	49,200,000	
三菱食品	14,600	5,470.00	79,862,000	
良品計画	188,700	2,422.50	457,125,750	
パリミキホールディングス	6,600	408.00	2,692,800	
松田産業	12,100	2,738.00	33,129,800	
第一興商	61,300	1,816.00	111,320,800	
メディパルホールディングス	161,100	2,449.50	394,614,450	
アドヴァングループ	13,500	1,055.00	14,242,500	
ＳＰＫ	7,000	2,113.00	14,791,000	
萩原電気ホールディングス	6,800	4,175.00	28,390,000	
アルビス	5,100	2,614.00	13,331,400	
アズワン	49,100	2,637.50	129,501,250	
スズデン	5,400	1,879.00	10,146,600	
尾家産業	1,300	1,917.00	2,492,100	
シモジマ	10,700	1,230.00	13,161,000	
ドウシシャ	14,600	2,101.00	30,674,600	
小津産業	1,200	1,778.00	2,133,600	
コナカ	6,200	394.00	2,442,800	
高速	9,500	2,150.00	20,425,000	
ハウス　オブ　ローゼ	700	1,592.00	1,114,400	
Ｇ－７ホールディングス	17,300	1,325.00	22,922,500	
たけびし	5,900	2,089.00	12,325,100	
イオン北海道	46,900	960.00	45,024,000	
コジマ	30,700	852.00	26,156,400	
ヒマラヤ	2,000	913.00	1,826,000	
コーナン商事	19,500	4,590.00	89,505,000	
ネットワンシステムズ	58,400	2,965.00	173,156,000	
エコス	5,900	2,381.00	14,047,900	
ワタミ	16,700	924.00	15,430,800	
マルシェ	1,900	257.00	488,300	
リックス	3,600	4,510.00	16,236,000	

システムソフト	53,300	60.00	3,198,000	
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	320,100	3,730.00	1,193,973,000	
丸文	14,100	1,284.00	18,104,400	
西松屋チェーン	31,100	2,218.00	68,979,800	
ゼンショーホールディングス	80,700	6,123.00	494,126,100	
ハピネット	13,400	2,972.00	39,824,800	
幸楽苑ホールディングス	11,800	1,296.00	15,292,800	
ハークスレイ	1,600	892.00	1,427,200	
橋本総業ホールディングス	6,100	1,300.00	7,930,000	
日本ライフライン	42,400	1,220.00	51,728,000	
サイゼリヤ	23,400	5,390.00	126,126,000	
タカショー	13,800	518.00	7,148,400	
ＶＴホールディングス	61,200	512.00	31,334,400	
アルゴグラフィックス	13,700	3,985.00	54,594,500	
魚力	5,500	2,370.00	13,035,000	
ＩＤＯＭ	41,900	1,352.00	56,648,800	
日本エム・ディ・エム	12,000	657.00	7,884,000	
ポプラ	1,400	229.00	320,600	
フジ・コーポレーション	7,500	1,833.00	13,747,500	
ユナイテッドアローズ	18,600	1,822.00	33,889,200	
進和	9,700	2,773.00	26,898,100	
エスケイジャパン	1,300	840.00	1,092,000	
ダイトロン	6,200	3,230.00	20,026,000	
ハイデイ日高	23,500	2,855.00	67,092,500	
シークス	22,500	1,447.00	32,557,500	
ＹＵ－ＷＡ ＣＲＥＡＴＩＯＮ ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,100	143.00	443,300	
コロワイド	68,100	1,984.00	135,110,400	
田中商事	1,600	816.00	1,305,600	
オーハシテクニカ	8,300	1,586.00	13,163,800	
壱番屋	62,600	1,078.00	67,482,800	
白銅	4,500	2,818.00	12,681,000	
トップカルチャー	2,100	156.00	327,600	
ＰＬＡＮＴ	1,200	1,802.00	2,162,400	
スギホールディングス	95,700	2,399.00	229,584,300	
ダイコー通産	600	1,434.00	860,400	
薬王堂ホールディングス	7,700	2,842.00	21,883,400	
島津製作所	198,900	4,487.00	892,464,300	
ＪＭＳ	13,800	532.00	7,341,600	
クボテック	1,400	216.00	302,400	
長野計器	10,900	2,876.00	31,348,400	
ブイ・テクノロジー	7,900	2,762.00	21,819,800	
スター精密	27,800	1,935.00	53,793,000	
東京計器	11,500	3,180.00	36,570,000	
愛知時計電機	6,500	2,141.00	13,916,500	
インターアクション	9,000	1,521.00	13,689,000	
オーバル	4,400	534.00	2,349,600	
東京精密	30,700	11,400.00	349,980,000	
マニー	59,900	1,893.00	113,390,700	

ニコン	216,500	1,667.00	360,905,500	
トプコン	72,800	1,883.50	137,118,800	
オリンパス	884,700	2,510.00	2,220,597,000	
理研計器	21,200	3,815.00	80,878,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	51,200	15,620.00	799,744,000	
キヤノン電子	16,500	2,253.00	37,174,500	
タムロン	9,200	7,950.00	73,140,000	
ＨＯＹＡ	294,900	18,125.00	5,345,062,500	
シード	3,100	595.00	1,844,500	
ノーリツ鋼機	14,100	3,860.00	54,426,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	21,900	2,985.00	65,371,500	
朝日インテック	182,500	2,343.00	427,597,500	
キヤノン	747,000	4,361.00	3,257,667,000	
リコー	375,500	1,286.00	482,893,000	
シチズン時計	137,700	1,017.00	140,040,900	
リズム	1,100	3,380.00	3,718,000	
大研医器	4,400	562.00	2,472,800	
メニコン	51,500	1,550.00	79,825,000	
シンシア	600	496.00	297,600	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	7,400	171.00	1,265,400	
中本パックス	1,700	1,676.00	2,849,200	
パラマウントベッドホールディングス	31,100	2,617.00	81,388,700	
トランザクション	9,900	1,890.00	18,711,000	
粧美堂	1,400	588.00	823,200	
ニホンフラッシュ	14,100	918.00	12,943,800	
前田工繊	13,000	3,380.00	43,940,000	
永大産業	6,100	271.00	1,653,100	
アートネイチャー	13,500	776.00	10,476,000	
フルヤ金属	4,700	12,140.00	57,058,000	
バンダイナムコホールディングス	410,300	3,173.00	1,301,881,900	
アイフィスジャパン	1,500	610.00	915,000	
ＳＨＯＥＩ	42,100	2,000.00	84,200,000	
フランスベッドホールディングス	19,300	1,223.00	23,603,900	
マーベラス	24,300	665.00	16,159,500	
パイロットコーポレーション	21,100	4,260.00	89,886,000	
萩原工業	10,000	1,560.00	15,600,000	
エイベックス	25,500	1,236.00	31,518,000	
フジシールインターナショナル	30,400	2,129.00	64,721,600	
タカラトミー	68,100	2,680.50	182,542,050	
広済堂ホールディングス	43,500	712.00	30,972,000	
エステールホールディングス	1,200	650.00	780,000	
レック	19,300	1,149.00	22,175,700	
タカノ	2,000	988.00	1,976,000	
三光合成	18,900	720.00	13,608,000	
プロネクサス	15,600	1,183.00	18,454,800	
ホクシン	4,000	120.00	480,000	
ウッドワン	1,800	976.00	1,756,800	
きもと	8,400	210.00	1,764,000	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	184,100	3,685.00	678,408,500	
大日本印刷	155,200	4,601.00	714,075,200	

共同印刷	4,200	3,070.00	12,894,000	
ＮＩＳＳＨＡ	25,600	1,786.00	45,721,600	
光村印刷	400	1,597.00	638,800	
藤森工業	11,900	4,035.00	48,016,500	
ヴィア・ホールディングス	8,200	128.00	1,049,600	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,800	2,642.00	23,249,600	
前澤化成工業	9,700	1,741.00	16,887,700	
未来工業	5,300	3,930.00	20,829,000	
アシックス	127,600	8,750.00	1,116,500,000	
ツツミ	3,600	2,161.00	7,779,600	
ウェーブロックホールディングス	2,000	643.00	1,286,000	
ＪＳＰ	10,600	2,227.00	23,606,200	
ニチハ	18,800	3,470.00	65,236,000	
ローランド	11,100	4,295.00	47,674,500	
エフピコ	28,400	2,643.00	75,061,200	
小松ウオール工業	6,100	3,140.00	19,154,000	
ヤマハ	94,400	3,460.00	326,624,000	
河合楽器製作所	4,500	3,715.00	16,717,500	
クリナップ	14,700	734.00	10,789,800	
ピジョン	95,300	1,477.50	140,805,750	
天馬	10,900	2,379.00	25,931,100	
キングジム	13,200	890.00	11,748,000	
象印マホービン	40,600	1,525.00	61,915,000	
リンテック	30,100	3,235.00	97,373,500	
信越ポリマー	32,400	1,634.00	52,941,600	
東リ	11,100	403.00	4,473,300	
イトーキ	28,600	1,912.00	54,683,200	
任天堂	945,600	8,011.00	7,575,201,600	
三菱鉛筆	21,300	2,378.00	50,651,400	
松風	6,700	3,255.00	21,808,500	
タカラスタンダード	30,700	1,893.00	58,115,100	
コクヨ	61,300	2,665.50	163,395,150	
ナカバヤシ	16,200	530.00	8,586,000	
ニフコ	44,900	3,670.00	164,783,000	
立川ブラインド工業	7,000	1,398.00	9,786,000	
グローブライド	13,400	2,049.00	27,456,600	
オカムラ	45,100	2,421.00	109,187,100	
バルカー	12,600	4,625.00	58,275,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	700	2,226.00	1,558,200	
伊藤忠商事	1,065,200	7,131.00	7,595,941,200	
丸紅	1,314,400	3,021.00	3,970,802,400	
スクロール	23,500	989.00	23,241,500	
高島	3,600	1,115.00	4,014,000	
ヨンドシーホールディングス	15,000	1,893.00	28,395,000	
三陽商会	6,300	2,816.00	17,740,800	
長瀬産業	72,700	3,093.00	224,861,100	
ナイガイ	1,800	256.00	460,800	
蝶理	10,000	3,650.00	36,500,000	
豊田通商	138,800	9,671.00	1,342,334,800	
オンワードホールディングス	88,400	606.00	53,570,400	

三共生興	22,000	762.00	16,764,000	
兼松	66,200	2,635.00	174,437,000	
美津濃	14,900	7,570.00	112,793,000	
ツカモトコーポレーション	800	1,187.00	949,600	
ルックホールディングス	4,600	2,883.00	13,261,800	
三井物産	1,186,700	7,876.00	9,346,449,200	
日本紙パルプ商事	7,600	6,020.00	45,752,000	
東京エレクトロン	317,000	34,640.00	10,980,880,000	
カメイ	16,900	2,249.00	38,008,100	
東都水産	300	6,180.00	1,854,000	
ＯＵＧホールディングス	800	2,632.00	2,105,600	
スターゼン	11,000	2,762.00	30,382,000	
セイコーグループ	20,900	4,145.00	86,630,500	
山善	48,100	1,385.00	66,618,500	
椿本興業	9,900	2,297.00	22,740,300	
住友商事	959,000	4,192.00	4,020,128,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	49,100	3,924.00	192,668,400	
内田洋行	6,400	7,040.00	45,056,000	
三菱商事	3,042,500	3,373.00	10,262,352,500	
第一実業	14,900	2,200.00	32,780,000	
キヤノンマーケティングジャパン	36,700	4,468.00	163,975,600	
西華産業	6,200	3,675.00	22,785,000	
佐藤商事	11,100	1,668.00	18,514,800	
東京産業	14,500	656.00	9,512,000	
ユアサ商事	12,400	6,050.00	75,020,000	
神鋼商事	4,000	6,930.00	27,720,000	
トルク	3,900	247.00	963,300	
阪和興業	28,500	6,340.00	180,690,000	
正栄食品工業	10,600	4,215.00	44,679,000	
カナデン	11,900	1,495.00	17,790,500	
ＲＹＯＤＥＮ	12,800	2,527.00	32,345,600	
ニプロ	124,800	1,219.50	152,193,600	
岩谷産業	36,100	8,907.00	321,542,700	
ナイス	1,700	1,782.00	3,029,400	
ニチモウ	1,700	2,054.00	3,491,800	
極東貿易	9,500	1,817.00	17,261,500	
アステナホールディングス	29,800	497.00	14,810,600	
三愛オブリ	37,000	2,116.00	78,292,000	
稲畑産業	31,200	3,275.00	102,180,000	
ＧＳＩクレオス	8,500	2,242.00	19,057,000	
明和産業	18,700	725.00	13,557,500	
クワザワホールディングス	1,900	1,001.00	1,901,900	
キムラタン	33,200	17.00	564,400	
ゴールドウイン	26,600	9,224.00	245,358,400	
ユニ・チャーム	312,900	5,021.00	1,571,070,900	
デサント	25,800	3,810.00	98,298,000	
キング	2,000	662.00	1,324,000	
ワキタ	26,200	1,566.00	41,029,200	
ヤマトインターナショナル	4,000	353.00	1,412,000	
東邦ホールディングス	42,800	3,937.00	168,503,600	

サンゲツ	36,500	3,085.00	112,602,500	
ミツウロコグループホールディングス	20,300	1,308.00	26,552,400	
シナネンホールディングス	4,400	4,845.00	21,318,000	
伊藤忠エネクス	39,300	1,581.00	62,133,300	
サンリオ	128,600	2,796.00	359,565,600	
サンワ　テクノス	8,000	2,193.00	17,544,000	
新光商事	21,200	1,015.00	21,518,000	
トーホー	6,100	3,250.00	19,825,000	
三信電気	6,300	2,223.00	14,004,900	
東陽テクニカ	14,500	1,507.00	21,851,500	
モスフードサービス	23,200	3,405.00	78,996,000	
加賀電子	14,400	5,910.00	85,104,000	
三益半導体工業	13,900	3,720.00	51,708,000	
都築電気	7,900	2,206.00	17,427,400	
ソーダニッカ	15,100	1,076.00	16,247,600	
立花エレテック	10,500	2,891.00	30,355,500	
木曽路	23,900	2,446.00	58,459,400	
ＳＲＳホールディングス	26,100	1,132.00	29,545,200	
千趣会	29,300	322.00	9,434,600	
リテールパートナーズ	23,500	1,723.00	40,490,500	
上新電機	15,700	2,541.00	39,893,700	
日本瓦斯	83,900	2,446.50	205,261,350	
ロイヤルホールディングス	27,900	2,580.00	71,982,000	
東天紅	400	922.00	368,800	
いなげや	15,400	1,262.00	19,434,800	
チヨダ	15,100	897.00	13,544,700	
ライフコーポレーション	16,600	3,945.00	65,487,000	
リンガーハット	20,400	2,283.00	46,573,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	20,000	645.00	12,900,000	
テンアライド	7,300	295.00	2,153,500	
ＡＯＫＩホールディングス	34,000	1,292.00	43,928,000	
オークワ	22,800	951.00	21,682,800	
コメリ	24,400	3,875.00	94,550,000	
青山商事	33,800	1,606.00	54,282,800	
しまむら	37,200	7,541.00	280,525,200	
はせがわ	2,500	343.00	857,500	
高島屋	109,500	2,293.00	251,083,500	
松屋	26,900	954.00	25,662,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	70,100	1,835.00	128,633,500	
近鉄百貨店	6,800	2,187.00	14,871,600	
丸井グループ	105,200	2,384.50	250,849,400	
クレディセゾン	93,400	2,933.00	273,942,200	
アクシアル　リテイリング	43,200	1,015.00	43,848,000	
井筒屋	2,500	512.00	1,280,000	
イオン	537,100	3,303.00	1,774,041,300	
イズミ	28,100	3,474.00	97,619,400	
フォーバル	6,200	1,349.00	8,363,800	
平和堂	26,500	2,416.00	64,024,000	
フジ	24,300	1,956.00	47,530,800	
ヤオコー	18,800	8,553.00	160,796,400	

ゼビオホールディングス	21,500	966.00	20,769,000	
ケーズホールディングス	106,400	1,481.00	157,578,400	
ＰＡＬＴＡＣ	21,400	4,634.00	99,167,600	
三谷産業	27,900	361.00	10,071,900	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	2,500	509.00	1,272,500	
日産東京販売ホールディングス	7,900	538.00	4,250,200	
あおぞら銀行	106,000	2,424.00	256,944,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,982,700	1,600.50	14,376,811,350	
りそなホールディングス	1,705,800	972.90	1,659,572,820	
三井住友トラスト・ホールディングス	530,100	3,283.00	1,740,318,300	
三井住友フィナンシャルグループ	1,048,700	9,104.00	9,547,364,800	
千葉銀行	411,000	1,299.50	534,094,500	
群馬銀行	286,100	1,033.00	295,541,300	
武蔵野銀行	20,600	3,235.00	66,641,000	
千葉興業銀行	31,300	1,056.00	33,052,800	
筑波銀行	64,800	299.00	19,375,200	
七十七銀行	42,900	4,690.00	201,201,000	
秋田銀行	9,900	2,232.00	22,096,800	
山形銀行	16,400	1,184.00	19,417,600	
岩手銀行	9,300	2,569.00	23,891,700	
東邦銀行	116,700	331.00	38,627,700	
東北銀行	2,400	1,229.00	2,949,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	128,400	4,235.00	543,774,000	
スルガ銀行	130,000	966.00	125,580,000	
八十二銀行	316,500	1,096.00	346,884,000	
山梨中央銀行	16,500	1,858.00	30,657,000	
大垣共立銀行	28,100	2,180.00	61,258,000	
福井銀行	13,200	2,018.00	26,637,600	
清水銀行	5,900	1,575.00	9,292,500	
富山銀行	900	1,867.00	1,680,300	
滋賀銀行	24,500	4,005.00	98,122,500	
南都銀行	22,100	3,195.00	70,609,500	
百五銀行	138,600	616.00	85,377,600	
紀陽銀行	52,800	2,030.00	107,184,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	91,300	2,056.00	187,712,800	
山陰合同銀行	92,300	1,488.00	137,342,400	
鳥取銀行	1,700	1,419.00	2,412,300	
百十四銀行	14,400	3,075.00	44,280,000	
四国銀行	21,700	1,126.00	24,434,200	
阿波銀行	20,700	2,723.00	56,366,100	
大分銀行	8,800	3,135.00	27,588,000	
宮崎銀行	8,900	3,325.00	29,592,500	
佐賀銀行	8,700	2,439.00	21,219,300	
琉球銀行	31,300	1,246.00	38,999,800	
セブン銀行	462,200	267.10	123,453,620	
みずほフィナンシャルグループ	1,991,000	3,076.00	6,124,316,000	
高知銀行	1,700	896.00	1,523,200	
山口フィナンシャルグループ	144,600	1,823.00	263,605,800	
芙蓉総合リース	13,500	12,945.00	174,757,500	
みずほリース	123,500	1,104.00	136,344,000	

東京センチュリー	110,200	1,499.00	165,189,800	
ＳＢＩホールディングス	236,700	3,913.00	926,207,100	
日本証券金融	54,200	1,649.00	89,375,800	
アイフル	217,000	407.00	88,319,000	
日本アジア投資	3,600	231.00	831,600	
名古屋銀行	9,400	7,220.00	67,868,000	
北洋銀行	223,500	463.00	103,480,500	
大光銀行	1,600	1,490.00	2,384,000	
愛媛銀行	19,900	1,182.00	23,521,800	
トマト銀行	1,800	1,210.00	2,178,000	
京葉銀行	60,600	786.00	47,631,600	
栃木銀行	73,800	370.00	27,306,000	
北日本銀行	4,800	2,637.00	12,657,600	
東和銀行	27,100	650.00	17,615,000	
福島銀行	5,100	304.00	1,550,400	
大東銀行	2,200	725.00	1,595,000	
リコーリース	13,900	5,160.00	71,724,000	
イオンフィナンシャルサービス	84,600	1,327.50	112,306,500	
アコム	263,300	404.00	106,373,200	
ジャックス	15,700	5,630.00	88,391,000	
オリエントコーポレーション	48,100	1,046.00	50,312,600	
オリックス	884,600	3,334.00	2,949,256,400	
三菱ＨＣキャピタル	657,200	1,023.00	672,315,600	
ジャフコ　グループ	43,900	1,810.00	79,459,000	
九州リースサービス	2,000	1,140.00	2,280,000	
トモニホールディングス	139,600	425.00	59,330,000	
大和証券グループ本社	1,142,600	1,166.00	1,332,271,600	
野村ホールディングス	2,480,400	890.30	2,208,300,120	
岡三証券グループ	129,400	751.00	97,179,400	
丸三証券	49,000	1,029.00	50,421,000	
東洋証券	39,200	368.00	14,425,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	175,000	574.00	100,450,000	
光世証券	1,200	626.00	751,200	
水戸証券	43,500	541.00	23,533,500	
いちよし証券	27,600	818.00	22,576,800	
松井証券	72,500	807.00	58,507,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	665,600	3,159.00	2,102,630,400	
日本取引所グループ	380,300	3,604.00	1,370,601,200	
マネックスグループ	144,500	797.00	115,166,500	
極東証券	20,200	1,520.00	30,704,000	
岩井コスモホールディングス	16,800	2,342.00	39,345,600	
アイザワ証券グループ	21,300	1,746.00	37,189,800	
フィデアホールディングス	15,200	1,555.00	23,636,000	
池田泉州ホールディングス	204,400	406.00	82,986,400	
アニコム　ホールディングス	50,100	567.00	28,406,700	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	990,700	2,867.50	2,840,832,250	
マネーパートナーズグループ	5,100	277.00	1,412,700	
スパークス・グループ	16,400	1,797.00	29,470,800	

小林洋行	2,200	315.00	693,000	
第一生命ホールディングス	693,500	3,606.00	2,500,761,000	
東京海上ホールディングス	1,440,100	5,037.00	7,253,783,700	
アドバンテッジリスクマネジメント	2,600	388.00	1,008,800	
イー・ギャランティ	24,000	1,699.00	40,776,000	
アサックス	2,100	841.00	1,766,100	
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,200	3,805.00	27,396,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	396,000	2,649.00	1,049,004,000	
アドバンスクリエイト	11,300	1,021.00	11,537,300	
三井不動産	2,046,400	1,492.50	3,054,252,000	
三菱地所	964,100	2,812.50	2,711,531,250	
平和不動産	23,900	3,950.00	94,405,000	
東京建物	128,800	2,528.50	325,670,800	
京阪神ビルディング	27,600	1,576.00	43,497,600	
住友不動産	213,300	5,392.00	1,150,113,600	
太平洋興発	2,000	799.00	1,598,000	
テーオーシー	26,300	757.00	19,909,100	
レオパレス２１	147,500	569.00	83,927,500	
スターツコーポレーション	21,200	3,630.00	76,956,000	
フジ住宅	18,600	799.00	14,861,400	
空港施設	20,800	610.00	12,688,000	
明和地所	9,500	1,000.00	9,500,000	
ゴールドクレスト	12,100	2,549.00	30,842,900	
リログループ	77,100	1,637.00	126,212,700	
エスリード	6,900	3,995.00	27,565,500	
日神グループホールディングス	23,700	537.00	12,726,900	
日本エスコン	27,500	1,083.00	29,782,500	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	67,800	498.00	33,764,400	
ＡＶＡＮＴＩＡ	2,700	834.00	2,251,800	
イオンモール	76,400	1,828.00	139,659,200	
毎日コムネット	2,000	808.00	1,616,000	
ファースト住建	2,100	1,064.00	2,234,400	
ランド	818,100	7.00	5,726,700	
カチタス	39,600	1,803.00	71,398,800	
東祥	10,800	688.00	7,430,400	
トーセイ	24,500	2,350.00	57,575,000	
穴吹興産	1,200	2,213.00	2,655,600	
サンフロンティア不動産	21,900	2,171.00	47,544,900	
ＦＪネクストホールディングス	15,500	1,336.00	20,708,000	
インテリックス	1,200	562.00	674,400	
ランドビジネス	1,900	263.00	499,700	
サンネクスタグループ	1,700	1,031.00	1,752,700	
グランディハウス	12,500	572.00	7,150,000	
東武鉄道	164,500	2,941.00	483,794,500	
相鉄ホールディングス	53,600	2,508.50	134,455,600	
東急	419,900	1,844.00	774,295,600	
京浜急行電鉄	185,300	1,223.50	226,714,550	
小田急電鉄	247,700	1,762.50	436,571,250	
京王電鉄	72,000	3,844.00	276,768,000	
京成電鉄	96,600	5,882.00	568,201,200	

富士急行	18,500	3,365.00	62,252,500	
東日本旅客鉄道	825,400	2,881.00	2,377,977,400	
西日本旅客鉄道	355,300	3,129.00	1,111,733,700	
東海旅客鉄道	576,800	3,458.00	1,994,574,400	
西武ホールディングス	181,100	2,099.00	380,128,900	
鴻池運輸	25,500	2,349.00	59,899,500	
西日本鉄道	39,900	2,484.50	99,131,550	
ハマキョウレックス	12,800	3,900.00	49,920,000	
サカイ引越センター	16,600	2,454.00	40,736,400	
近鉄グループホールディングス	149,500	3,900.00	583,050,000	
阪急阪神ホールディングス	199,300	4,057.00	808,560,100	
南海電気鉄道	66,600	2,698.50	179,720,100	
京阪ホールディングス	82,500	3,180.00	262,350,000	
神戸電鉄	4,100	2,746.00	11,258,600	
名古屋鉄道	154,200	2,106.00	324,745,200	
山陽電気鉄道	11,300	2,083.00	23,537,900	
アルプス物流	12,100	5,620.00	68,002,000	
トランコム	4,400	5,510.00	24,244,000	
ヤマトホールディングス	181,700	1,771.00	321,790,700	
山九	38,100	5,773.00	219,951,300	
日新	11,400	4,495.00	51,243,000	
丸運	3,300	282.00	930,600	
丸全昭和運輸	9,300	4,745.00	44,128,500	
センコーグループホールディングス	79,000	1,174.00	92,746,000	
トナミホールディングス	3,300	4,790.00	15,807,000	
ニッコンホールディングス	46,100	3,168.00	146,044,800	
日本石油輸送	600	2,859.00	1,715,400	
福山通運	17,100	3,805.00	65,065,500	
セイノーホールディングス	84,100	2,126.00	178,796,600	
エスライングループ本社	1,600	1,241.00	1,985,600	
神奈川中央交通	4,100	3,010.00	12,341,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	38,300	1,179.00	45,155,700	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	14,400	3,890.00	56,016,000	
日本郵船	428,500	4,636.00	1,986,526,000	
商船三井	324,700	5,019.00	1,629,669,300	
川崎汽船	360,200	2,248.50	809,909,700	
ＮＳユナイテッド海運	8,000	4,790.00	38,320,000	
明海グループ	5,400	790.00	4,266,000	
飯野海運	54,900	1,279.00	70,217,100	
共栄タンカー	1,000	1,136.00	1,136,000	
九州旅客鉄道	105,700	3,323.00	351,241,100	
ＳＧホールディングス	251,000	1,632.50	409,757,500	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	50,700	7,923.00	401,696,100	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	9,300	4,485.00	41,710,500	
日本航空	367,200	2,731.50	1,003,006,800	
ＡＮＡホールディングス	406,900	3,023.00	1,230,058,700	
ビーウィズ	3,200	2,014.00	6,444,800	
パスコ	900	1,965.00	1,768,500	
ＴＲＥホールディングス	29,500	1,231.00	36,314,500	

人・夢・技術グループ	6,300	1,706.00	10,747,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,100	5,810.00	23,821,000	
シルバーライフ	4,300	903.00	3,882,900	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	2,794.00	1,117,600	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,900	5,900.00	40,710,000	
コーア商事ホールディングス	11,100	872.00	9,679,200	
ＫＰＰグループホールディングス	41,000	732.00	30,012,000	
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,348.00	1,213,200	
ブックオフグループホールディングス	10,400	1,696.00	17,638,400	
ギフトホールディングス	6,700	2,744.00	18,384,800	
三菱倉庫	36,700	5,144.00	188,784,800	
三井倉庫ホールディングス	13,900	4,360.00	60,604,000	
住友倉庫	39,900	2,534.00	101,106,600	
澁澤倉庫	6,800	3,175.00	21,590,000	
ヤマタネ	7,000	2,715.00	19,005,000	
東陽倉庫	1,400	1,510.00	2,114,000	
乾汽船	17,500	1,118.00	19,565,000	
日本トランスシティ	30,200	901.00	27,210,200	
ケイヒン	900	2,008.00	1,807,200	
中央倉庫	8,000	1,145.00	9,160,000	
川西倉庫	1,000	1,150.00	1,150,000	
安田倉庫	10,200	1,425.00	14,535,000	
ファイズホールディングス	700	994.00	695,800	
ＮＩＳＳＯホールディングス	13,300	854.00	11,358,200	
大栄環境	28,000	2,569.00	71,932,000	
日本管財ホールディングス	16,100	2,583.00	41,586,300	
東洋埠頭	1,500	1,362.00	2,043,000	
上組	69,000	3,255.00	224,595,000	
サンリツ	1,200	926.00	1,111,200	
キムラユニティー	2,400	1,843.00	4,423,200	
キユーソー流通システム	7,600	1,192.00	9,059,200	
東海運	2,800	286.00	800,800	
エーアイテイー	9,400	1,819.00	17,098,600	
内外トランスライン	6,000	2,496.00	14,976,000	
ショーエイコーポレーション	1,700	586.00	996,200	
日本コンセプト	5,400	1,861.00	10,049,400	
ＴＢＳホールディングス	75,500	4,089.00	308,719,500	
日本テレビホールディングス	133,000	2,120.50	282,026,500	
朝日放送グループホールディングス	14,200	647.00	9,187,400	
テレビ朝日ホールディングス	36,500	2,095.00	76,467,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	116,700	913.00	106,547,100	
テレビ東京ホールディングス	10,800	3,070.00	33,156,000	
日本ＢＳ放送	1,900	902.00	1,713,800	
ビジョン	22,600	1,131.00	25,560,600	
スマートバリュー	1,500	497.00	745,500	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	16,800	4,685.00	78,708,000	
ワイヤレスゲート	2,200	221.00	486,200	
日本通信	147,700	197.00	29,096,900	
クロップス	700	1,015.00	710,500	

日本電信電話	44,678,600	160.20	7,157,511,720	
ＫＤＤＩ	1,160,600	4,469.00	5,186,721,400	
ソフトバンク	2,397,300	1,947.00	4,667,543,100	
光通信	15,100	25,710.00	388,221,000	
エムティーアイ	10,300	732.00	7,539,600	
ＧＭＯインターネットグループ	55,000	2,652.00	145,860,000	
ファイバーゲート	8,000	1,177.00	9,416,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,700	228.00	387,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	79,400	2,940.00	233,436,000	
学研ホールディングス	27,500	993.00	27,307,500	
ゼンリン	25,600	869.00	22,246,400	
昭文社ホールディングス	2,100	383.00	804,300	
インプレスホールディングス	4,900	156.00	764,400	
東京電力ホールディングス	1,350,000	941.70	1,271,295,000	
中部電力	551,900	1,984.00	1,094,969,600	
関西電力	578,300	2,416.50	1,397,461,950	
中国電力	260,100	1,002.00	260,620,200	
北陸電力	153,100	1,002.50	153,482,750	
東北電力	394,300	1,253.00	494,057,900	
四国電力	139,400	1,367.00	190,559,800	
九州電力	345,200	1,580.50	545,588,600	
北海道電力	144,700	1,256.50	181,815,550	
沖縄電力	38,400	1,095.00	42,048,000	
電源開発	122,900	2,516.50	309,277,850	
エフオン	11,100	413.00	4,584,300	
イーレックス	26,700	893.00	23,843,100	
レノバ	39,900	1,110.00	44,289,000	
東京瓦斯	291,600	3,477.00	1,013,893,200	
大阪瓦斯	298,500	3,523.00	1,051,615,500	
東邦瓦斯	64,900	3,970.00	257,653,000	
北海道瓦斯	8,900	3,575.00	31,817,500	
広島ガス	31,800	375.00	11,925,000	
西部ガスホールディングス	15,600	1,934.00	30,170,400	
静岡ガス	30,000	954.00	28,620,000	
メタウォーター	17,900	1,992.00	35,656,800	
Ｍ＆Ａ総研ホールディングス	16,400	4,485.00	73,554,000	
アイネット	9,100	2,367.00	21,539,700	
松竹	7,800	9,426.00	73,522,800	
東宝	83,600	5,047.00	421,929,200	
エイチ・アイ・エス	44,700	1,707.00	76,302,900	
東映	24,800	3,815.00	94,612,000	
ラックランド	7,000	1,840.00	12,880,000	
ＮＴＴデータグループ	392,700	2,334.00	916,561,800	
共立メンテナンス	48,400	3,306.00	160,010,400	
イチネンホールディングス	16,200	1,687.00	27,329,400	
建設技術研究所	7,900	4,805.00	37,959,500	
スペース	10,000	1,025.00	10,250,000	
アインホールディングス	21,900	5,917.00	129,582,300	
燦ホールディングス	14,400	1,181.00	17,006,400	

ピー・シー・エー	8,600	1,965.00	16,899,000	
スバル興業	5,300	2,770.00	14,681,000	
東京テアトル	2,100	1,145.00	2,404,500	
タナベコンサルティンググループ	5,900	1,000.00	5,900,000	
ビジネスブレイン太田昭和	5,900	2,119.00	12,502,100	
ナガワ	4,800	7,500.00	36,000,000	
東京都競馬	12,900	4,430.00	57,147,000	
常磐興産	1,900	1,211.00	2,300,900	
カナモト	23,800	2,713.00	64,569,400	
ＤＴＳ	31,400	4,205.00	132,037,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	68,600	6,268.00	429,984,800	
シーイーシー	19,000	1,795.00	34,105,000	
カプコン	268,600	2,658.50	714,073,100	
ニシオホールディングス	12,800	4,070.00	52,096,000	
アイ・エス・ビー	7,700	1,441.00	11,095,700	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	33,000	64.00	2,112,000	
日本空港ビルデング	52,200	5,229.00	272,953,800	
トランス・コスモス	19,100	3,250.00	62,075,000	
乃村工藝社	67,000	854.00	57,218,000	
ジャステック	9,200	1,942.00	17,866,400	
ＳＣＳＫ	105,100	2,821.50	296,539,650	
藤田観光	6,100	7,000.00	42,700,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	9,200	1,309.00	12,042,800	
トーカイ	13,600	2,139.00	29,090,400	
白洋舎	800	2,460.00	1,968,000	
セコム	156,800	9,886.00	1,550,124,800	
ＮＳＷ	6,600	3,065.00	20,229,000	
セントラル警備保障	8,300	2,760.00	22,908,000	
アイネス	11,700	1,686.00	19,726,200	
丹青社	29,800	884.00	26,343,200	
メイテックグループホールディングス	52,400	3,168.00	166,003,200	
ＴＫＣ	26,800	3,520.00	94,336,000	
富士ソフト	30,200	6,110.00	184,522,000	
応用地質	14,300	2,330.00	33,319,000	
船井総研ホールディングス	30,800	2,366.00	72,872,800	
ＮＳＤ	53,000	2,963.00	157,039,000	
進学会ホールディングス	1,700	239.00	406,300	
丸紅建材リース	400	3,325.00	1,330,000	
オオバ	3,600	1,139.00	4,100,400	
コナミグループ	56,300	10,370.00	583,831,000	
いであ	1,400	2,576.00	3,606,400	
学究社	6,100	2,136.00	13,029,600	
イオンディライト	16,500	3,745.00	61,792,500	
ナック	13,200	533.00	7,035,600	
福井コンピュータホールディングス	9,300	2,465.00	22,924,500	
ダイセキ	31,400	3,050.00	95,770,000	
ステップ	5,600	1,981.00	11,093,600	
泉州電業	9,800	5,750.00	56,350,000	

元気寿司	9,000	3,340.00	30,060,000	
トラスコ中山	33,300	2,568.00	85,514,400	
ヤマダホールディングス	487,600	432.80	211,033,280	
オートバックスセブン	55,200	1,536.00	84,787,200	
モリト	11,400	1,546.00	17,624,400	
アークランズ	47,200	1,897.00	89,538,400	
ニトリホールディングス	57,600	20,985.00	1,208,736,000	
グルメ杵屋	12,900	1,075.00	13,867,500	
愛眼	4,200	182.00	764,400	
ケーユーホールディングス	7,400	1,155.00	8,547,000	
吉野家ホールディングス	58,300	2,863.00	166,912,900	
加藤産業	19,600	4,335.00	84,966,000	
北恵	1,400	854.00	1,195,600	
イノテック	10,000	1,761.00	17,610,000	
イエローハット	25,200	2,062.00	51,962,400	
松屋フーズホールディングス	7,500	5,590.00	41,925,000	
ＪＢＣＣホールディングス	10,000	3,160.00	31,600,000	
ＪＫホールディングス	12,300	1,043.00	12,828,900	
サガミホールディングス	23,700	1,515.00	35,905,500	
日伝	10,400	2,887.00	30,024,800	
関西フードマーケット	10,800	1,922.00	20,757,600	
ミロク情報サービス	13,600	1,679.00	22,834,400	
北沢産業	3,300	360.00	1,188,000	
杉本商事	7,700	2,552.00	19,650,400	
因幡電機産業	41,000	3,875.00	158,875,000	
王将フードサービス	11,800	7,640.00	90,152,000	
ミニストップ	11,600	1,541.00	17,875,600	
アークス	29,100	2,981.00	86,747,100	
バローホールディングス	30,300	2,401.00	72,750,300	
東テク	15,800	3,035.00	47,953,000	
ミスミグループ本社	239,300	2,769.50	662,741,350	
アルテック	2,900	279.00	809,100	
ベルク	7,900	7,330.00	57,907,000	
大　庄	8,500	1,225.00	10,412,500	
タキヒヨー	1,300	1,203.00	1,563,900	
ファーストリテイリング	89,100	40,640.00	3,621,024,000	
ソフトバンクグループ	741,000	8,000.00	5,928,000,000	
蔵王産業	1,000	2,548.00	2,548,000	
スズケン	56,600	4,693.00	265,623,800	
サンドラッグ	53,500	4,233.00	226,465,500	
サックスバー　ホールディングス	13,300	813.00	10,812,900	
ジェコス	9,600	1,014.00	9,734,400	
ヤマザワ	1,200	1,244.00	1,492,800	
やまや	1,100	3,090.00	3,399,000	
ベルーナ	38,100	640.00	24,384,000	
合計	242,151,800		575,974,829,540	

（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）

	2024年5月13日現在
資産の部	
流動資産	
預金	24,274,122,523
コール・ローン	12,419,484,467
株式	1,433,440,554,644
投資信託受益証券	2,353,828,648
投資証券	24,659,075,312
派生商品評価勘定	520,806,996
未収入金	56,499,055
未収配当金	1,785,382,098
差入委託証拠金	11,617,078,016
流動資産合計	1,511,126,831,759
資産合計	1,511,126,831,759
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,604,907
未払解約金	10,663,771,000
流動負債合計	10,739,375,907
負債合計	10,739,375,907
純資産の部	
元本等	
元本	164,131,637,816
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,336,255,818,036
元本等合計	1,500,387,455,852
純資産合計	1,500,387,455,852
負債純資産合計	1,511,126,831,759

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11月14日 至　2024年5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。 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。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年5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	158,641,305,618円
同期中追加設定元本額	18,137,172,532円
同期中一部解約元本額	12,646,840,334円

元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,724,997,494円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,656,016円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	6,988,496円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	17,474,299円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	19,780,695円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	22,673,549円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	12,062,534円
たわらノーロード　先進国株式	61,353,057,507円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,711,373,792円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	926,117,070円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	74,868,776円
たわらノーロード　バランス（標準型）	740,079,934円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,036,878,184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）	31,094,158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）	195,761,409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）	239,391,981円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	425,453,041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）	113,919円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	12,328,358円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,965,235円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	10,887,138円
たわらノーロード　全世界株式	3,538,225,384円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	57,473,424,633円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	3,505,064,157円
Ｏｎｅグローバルバランス	32,769,026円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	124,608,500円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	740,848,709円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	994,786,950円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	67,675,231円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	200,783,416円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	218,371,680円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	16,139,878円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	605,955,973円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	111,796,003円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	138,574,034円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	177,709,758円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	303,120,563円
投資のソムリエ	8,247,796,142円
クルーズコントロール	57,411,493円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	858,248,965円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	199,108,617円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	293,346,951円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	596,658,708円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,862,100,901円
ワールドアセットバランス（基本コース）	84,598,478円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	196,538,829円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	57,909,154円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	29,887,056円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,521,087円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	177,132,826円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	137,593,430円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	466,396,906円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	116,548,979円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	60,214,159円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	31,962,086円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	19,772,786円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	140,911,423円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,918,629円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	23,541,939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）	3,875,857円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	3,904,531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）	27,100,710円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	2,328,570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）	236,047円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	10,054,723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）	6,592,538円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	2,693,857円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	5,493,782円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	6,514,405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）	334,213,766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）	34,323,818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）	975,985,617円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,040,921,215円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	128,596,674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）	780,957円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,867,024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）	6,447,023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）	4,653,893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）	17,495,495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）	35,512,143円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,325,867円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,783,140円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	784,534円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,604円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	278,030円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,911,105円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	88,939,879円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	173,492,678円

ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	615,419,133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）	26,339,905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）	20,311,146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）	138,814,702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）	4,543,939円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	120,792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）	47,517,336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）	3,924,925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）	18,358,762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）	32,828,062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）	65,070,285円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	12,852,907円
コア資産形成ファンド	6,211,288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＞	2,125,162,594円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	130,792,973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＞	988,102,045円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,447,913,716円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	2,029,238,018円
計	164,131,637,816円
２．　受益権の総数	164,131,637,816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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	2024年5月13日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	69,444,609,445
投資信託受益証券	143,276,682
投資証券	△128,134,264
合計	69,459,751,863

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年2月16日から2024年5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	2024年5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				
売建	161,828,280	－	161,825,051	3,229
イギリス・ポンド	97,010,921	－	97,006,398	4,523
オーストラリア・ドル	24,684,240	－	24,685,152	△912
ユーロ	40,133,119	－	40,133,501	△382
買建	2,436,541,832	－	2,439,882,843	3,341,011
アメリカ・ドル	2,016,085,550	－	2,018,892,134	2,806,584
イギリス・ポンド	71,891,163	－	72,033,191	142,028
オーストラリア・ドル	32,613,911	－	32,608,965	△4,946
カナダ・ドル	94,035,157	－	94,162,214	127,057
ユーロ	221,916,051	－	222,186,339	270,288
合計	2,598,370,112	－	2,601,707,894	3,344,240

（注）時価の算定方法

為替予約取引

１．　計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2024年5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	39,925,398,266	－	40,367,256,115	441,857,849
合計	39,925,398,266	－	40,367,256,115	441,857,849

（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）

	2024年5月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	9.1414円 (91,414円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2024年5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	1,432,341	187.480	268,535,290.680	
	ABBOTT LABORATORIES	267,923	104.740	28,062,255.020	
	AES CORP	109,122	19.940	2,175,892.680	

INTL BUSINESS MACHINES CORP	140,501	167.150	23,484,742.150	
ADVANCED MICRO DEVICES	249,270	151.920	37,869,098.400	
ADOBE INC	69,437	482.290	33,488,770.730	
CHUBB LTD	62,823	254.840	16,009,813.320	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	34,261	250.550	8,584,093.550	
ALLSTATE CORP	39,652	172.710	6,848,296.920	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	101,335	202.920	20,562,898.200	
AMGEN INC	82,631	310.150	25,628,004.650	
HESS CORP	41,496	160.400	6,655,958.400	
AMERICAN EXPRESS CO	89,859	242.300	21,772,835.700	
AMERICAN ELECTRIC POWER	83,039	91.610	7,607,202.790	
AFLAC INC	84,730	86.080	7,293,558.400	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	80.110	8,663,896.500	
ANALOG DEVICES	76,233	207.190	15,794,715.270	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	102,432	65.590	6,718,514.880	
VALERO ENERGY CORP	52,332	156.130	8,170,595.160	
ANSYS INC	13,252	328.250	4,349,969.000	
APPLE INC	2,261,698	183.050	414,003,818.900	
APPLIED MATERIALS INC	128,053	209.730	26,856,555.690	
ALBEMARLE CORP	18,991	129.620	2,461,613.420	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	62.980	5,133,121.920	
AMEREN CORP	40,644	74.400	3,023,913.600	
AUTODESK INC	33,059	217.770	7,199,258.430	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	62,963	246.860	15,543,046.180	
AUTOZONE INC	2,716	2,979.320	8,091,833.120	
AVERY DENNISON CORP	11,542	225.610	2,603,990.620	
BALL CORP	46,288	69.160	3,201,278.080	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	201,742	412.050	83,127,791.100	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	116,387	58.440	6,801,656.280	
BAXTER INTERNATIONAL INC	80,219	35.690	2,863,016.110	
BECTON DICKINSON & CO	43,938	235.670	10,354,868.460	
AMETEK INC	36,304	170.800	6,200,723.200	
VERIZON COMM INC	641,522	40.400	25,917,488.800	
WR BERKLEY CORP	31,607	79.740	2,520,342.180	
BEST BUY CO INC	30,568	74.170	2,267,228.560	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	282.000	851,922.000	
YUM! BRANDS INC	42,053	137.620	5,787,333.860	
FIRSTENERGY CORP	83,697	39.940	3,342,858.180	
BOEING CO	88,812	178.510	15,853,830.120	
ROBERT HALF INC	14,456	70.760	1,022,906.560	

BORGWARNER INC	37,010	37.500	1,387,875.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	226,432	73.690	16,685,774.080	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	82.720	1,425,513.760	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	26,064	145.880	3,802,216.320	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,510.250	5,151,462.750	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	315,127	44.940	14,161,807.380	
ONEOK INC	90,252	80.070	7,226,477.640	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	131.350	1,275,277.150	
UNITED RENTALS INC	10,788	698.130	7,531,426.440	
SEMPRA	98,372	77.180	7,592,350.960	
FEDEX CORP	36,746	265.730	9,764,514.580	
VERISIGN INC	14,698	171.230	2,516,738.540	
AMPHENOL CORP	91,520	127.570	11,675,206.400	
BROWN-FORMAN CORP	48,308	49.120	2,372,888.960	
QUANTA SERVICES INC	23,271	271.480	6,317,611.080	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	3.030	308,347.950	
CSX CORP	304,211	34.380	10,458,774.180	
COTERRA ENERGY INC	114,711	28.080	3,221,084.880	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	45.950	1,239,639.100	
CONSTELLATION BRANDS INC	24,629	261.950	6,451,566.550	
CARDINAL HEALTH INC	38,298	99.530	3,811,799.940	
CARLISLE COS INC	7,520	416.630	3,133,057.600	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	14.430	2,141,527.440	
CATERPILLAR INC	77,969	354.790	27,662,621.510	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	14,608	151.570	2,214,134.560	
JPMORGAN CHASE & CO	444,827	198.770	88,418,262.790	
CHURCH & DWIGHT CO INC	38,911	107.310	4,175,539.410	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,876	118.870	2,719,270.120	
CINTAS CORP	14,169	700.270	9,922,125.630	
CISCO SYSTEMS INC	625,028	48.060	30,038,845.680	
CLEVELAND-CLIFFS INC	83,513	17.320	1,446,445.160	
CLOROX COMPANY	18,305	143.350	2,624,021.750	
COCA-COLA CO/THE	634,080	63.260	40,111,900.800	
COPART INC	135,251	54.740	7,403,639.740	
COLGATE-PALMOLIVE CO	121,309	95.100	11,536,485.900	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	38,376	240.460	9,227,892.960	
MOLINA HEALTHCARE INC	8,928	354.600	3,165,868.800	
NRG ENERGY, INC.	34,874	83.650	2,917,210.100	
COMCAST CORP-CL A	619,656	39.310	24,358,677.360	
CONAGRA BRANDS INC	73,639	31.130	2,292,382.070	
CONSOLIDATED EDISON INC	51,736	97.700	5,054,607.200	

CMS ENERGY CORP	44,128	62.930	2,776,975.040	
COOPER COS INC	31,884	94.760	3,021,327.840	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	59.050	1,797,245.800	
CORNING INC	126,561	34.170	4,324,589.370	
HEICO CORP-CL A	11,614	172.150	1,999,350.100	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	217.730	2,055,806.660	
CUMMINS INC	22,263	298.610	6,647,954.430	
DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	46.350	1,103,408.100	
DR HORTON INC	45,784	149.970	6,866,226.480	
DANAHER CORP	108,358	253.380	27,455,750.040	
MOODY'S CORP	25,623	400.350	10,258,168.050	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,997	66.980	5,090,279.060	
TARGET CORP	71,189	163.130	11,613,061.570	
DEERE & CO	41,361	407.890	16,870,738.290	
MORGAN STANLEY	189,813	98.280	18,654,821.640	
REPUBLIC SERVICES INC	33,574	189.240	6,353,543.760	
COSTAR GROUP INC	61,975	89.880	5,570,313.000	
DECKERS OUTDOOR CORP	4,174	861.990	3,597,946.260	
THE WALT DISNEY CO	283,075	105.790	29,946,504.250	
DOLLAR TREE INC	31,756	121.040	3,843,746.240	
DOVER CORP	22,599	185.550	4,193,244.450	
OMNICOM GROUP	30,586	95.820	2,930,750.520	
DTE ENERGY CO	33,700	115.490	3,892,013.000	
DUKE ENERGY CORP	118,123	102.670	12,127,688.410	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,701	148.250	2,624,173.250	
EBAY INC	84,227	51.000	4,295,577.000	
BANK OF AMERICA CORP	1,090,810	38.450	41,941,644.500	
CITIGROUP INC	294,170	63.530	18,688,620.100	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	101.030	1,696,293.700	
EATON CORP PLC	61,113	330.570	20,202,124.410	
CADENCE DESIGN SYS INC	41,715	287.480	11,992,228.200	
ECOLAB INC	39,987	233.520	9,337,764.240	
REVVITY INC	17,972	104.800	1,883,465.600	
ELECTRONIC ARTS INC	38,801	127.140	4,933,159.140	
SALESFORCE INC	148,357	276.670	41,045,931.190	
ERIE INDEMNITY CO	4,050	406.570	1,646,608.500	
EMERSON ELECTRIC CO	87,960	115.550	10,163,778.000	
ATMOS ENERGY CORP	24,532	117.180	2,874,659.760	
ENTERGY CORP	33,557	111.990	3,758,048.430	
EOG RESOURCES INC	90,394	130.100	11,760,259.400	
EQUIFAX INC	18,730	241.590	4,524,980.700	
EQT CORP	59,729	38.930	2,325,249.970	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	35,846	132.000	4,731,672.000	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	118.330	2,652,366.950	
EXXON MOBIL CORP	690,621	117.960	81,465,653.160	
FMC CORP	17,711	67.530	1,196,023.830	
NEXTERA ENERGY INC	317,255	73.790	23,410,246.450	

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,019	439.160	2,643,304.040	
FAIR ISAAC CORP	3,775	1,328.610	5,015,502.750	
ASSURANT INC	8,766	176.500	1,547,199.000	
FASTENAL CO	89,185	67.880	6,053,877.800	
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	38.780	4,087,799.800	
M&T BANK CORP	24,958	153.660	3,835,046.280	
FISERV INC	91,718	154.220	14,144,749.960	
FORD MOTOR CO	608,574	11.990	7,296,802.260	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	23.740	1,127,103.980	
FREEPORT-MCMORAN INC	224,733	51.590	11,593,975.470	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,736.900	2,751,249.600	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	33,344	250.820	8,363,342.080	
GENERAL DYNAMICS CORP	35,855	296.440	10,628,856.200	
GENERAL MILLS INC	88,517	70.700	6,258,151.900	
GENUINE PARTS CO	20,769	155.270	3,224,802.630	
GILEAD SCIENCES INC	190,011	65.960	12,533,125.560	
GARTNER INC	11,988	439.270	5,265,968.760	
MCKESSON CORP	20,854	559.910	11,676,363.140	
NVIDIA CORP	380,370	898.780	341,868,948.600	
GRACO INC	27,006	83.560	2,256,621.360	
GENERAL ELECTRIC CO	167,599	163.380	27,382,324.620	
WW GRAINGER INC	6,777	958.680	6,496,974.360	
HALLIBURTON CO	139,251	37.070	5,162,034.570	
MONSTER BEVERAGE CORP	117,637	55.460	6,524,148.020	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	50,300	454.730	22,872,919.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28,728	219.600	6,308,668.800	
HASBRO INC	16,359	60.090	983,012.310	
HENRY SCHEIN INC	20,863	73.310	1,529,466.530	
HEICO CORP	6,878	215.440	1,481,796.320	
HERSHEY FOODS CORP	24,324	204.780	4,981,068.720	
HP INC	145,950	29.720	4,337,634.000	
F5 INC	8,981	171.620	1,541,319.220	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	84.030	1,523,043.750	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	264.270	2,012,416.050	
JUNIPER NETWORKS INC	50,704	34.640	1,756,386.560	
HOLOGIC INC	38,399	75.140	2,885,300.860	
HOME DEPOT INC	152,731	346.430	52,910,600.330	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29,668	81.030	2,403,998.040	
HORMEL FOODS CORP	49,054	35.630	1,747,794.020	
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	29.700	2,903,947.200	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	494.510	2,431,505.670	
HUBBELL INC	7,820	407.270	3,184,851.400	
HUMANA INC	18,641	335.590	6,255,733.190	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	170.590	2,094,162.840	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	215,385	14.060	3,028,313.100	
BIOGEN INC	21,910	221.500	4,853,065.000	
IDEX CORP	12,292	226.160	2,779,958.720	
ILLINOIS TOOL WORKS	46,463	250.330	11,631,082.790	
INTUIT INC	43,142	632.310	27,279,118.020	
IDEXX LABORATORIES INC	12,500	509.820	6,372,750.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	35,154	331.980	11,670,424.920	
INTEL CORP	650,991	29.850	19,432,081.350	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	97.180	3,983,699.740	
INTERNATIONAL PAPER CO	53,419	38.580	2,060,905.020	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	31.150	1,684,062.450	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	169.240	2,006,678.680	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	117.950	2,310,168.700	
INCYTE CORP	31,654	53.060	1,679,561.240	
JOHNSON & JOHNSON	370,879	149.910	55,598,470.890	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,659	101.890	4,652,195.510	
KLA CORPORATION	20,937	718.270	15,038,418.990	
DEVON ENERGY CORP	96,985	50.120	4,860,888.200	
KELLANOVA	42,451	61.860	2,626,018.860	
KEYCORP	144,072	15.080	2,172,605.760	
KIMBERLY-CLARK CORP	52,932	136.670	7,234,216.440	
BLACKROCK INC/NEW YORK	22,727	796.670	18,105,919.090	
KROGER CO	103,385	55.900	5,779,221.500	
LAM RESEARCH CORP	20,285	915.420	18,569,294.700	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	7,446	393.490	2,929,926.540	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,451	179.400	2,413,109.400	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	69.550	1,409,083.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,313	91.190	2,125,912.470	
LENNAR CORP	37,667	162.930	6,137,084.310	
ELI LILLY & CO	124,326	760.000	94,487,760.000	
BATH & BODY WORKS INC	34,638	47.550	1,647,036.900	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	110,884	147.370	16,340,975.080	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,825	149.760	6,712,992.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	33,842	468.880	15,867,836.960	
LOEWS CORP	30,289	77.980	2,361,936.220	
LOWE'S COS INC	88,486	235.030	20,796,864.580	
DOMINION ENERGY INC	126,501	53.070	6,713,408.070	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	40.570	1,639,068.570	
MCCORMICK & CO INC	40,279	76.150	3,067,245.850	

MCDONALD'S CORPORATION	111,035	275.000	30,534,625.000	
S&P GLOBAL INC	50,122	431.570	21,631,151.540	
EVEREST GROUP LTD	6,670	382.930	2,554,143.100	
MARKEL GROUP INC	2,013	1,652.220	3,325,918.860	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	91,510	86.720	7,935,747.200	
MARSH & MCLENNAN COS	75,606	205.550	15,540,813.300	
MASCO CORP	34,561	72.310	2,499,105.910	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,365	610.430	5,716,676.950	
METLIFE INC	97,405	72.730	7,084,265.650	
MEDTRONIC PLC	205,863	82.840	17,053,690.920	
CVS HEALTH CORP	197,356	55.820	11,016,411.920	
MERCK & CO.INC.	390,800	130.060	50,827,448.000	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	65,250	70.460	4,597,515.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,876	207.670	2,673,958.920	
MICROSOFT CORP	1,087,148	414.740	450,883,761.520	
MICRON TECH INC	168,037	121.240	20,372,805.880	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	81,668	91.500	7,472,622.000	
3M CO	86,733	98.930	8,580,495.690	
ENTEGRIS INC	23,675	131.550	3,114,446.250	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	228.120	1,750,592.880	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	25,570	362.850	9,278,074.500	
ILLUMINA INC	24,379	110.530	2,694,610.870	
XCEL ENERGY INC	88,125	55.460	4,887,412.500	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	136.700	1,997,597.100	
NETAPP INC	32,785	108.500	3,557,172.500	
NEWMONT CORP	182,697	42.490	7,762,795.530	
NVR INC	483	7,655.390	3,697,553.370	
NIKE INC-CL B	187,720	90.940	17,071,256.800	
NORDSON CORP	8,735	278.890	2,436,104.150	
NORFOLK SOUTHERN CORP	35,167	230.290	8,098,608.430	
EVERSOURCE ENERGY	51,861	61.920	3,211,233.120	
NISOURCE INC	64,543	28.680	1,851,093.240	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	86.700	2,849,655.600	
NORTHROP GRUMMAN CORP	22,098	474.800	10,492,130.400	
WELLS FARGO & CO	558,286	61.890	34,552,320.540	
NUCOR CORP	37,496	174.470	6,541,927.120	
CHENIERE ENERGY INC	36,422	157.070	5,720,803.540	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,630	142.560	8,215,732.800	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,774	63.570	6,342,633.180	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	29,708	185.040	5,497,168.320	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,084	1,019.330	9,259,593.720	
ORACLE CORP	254,062	116.670	29,641,413.540	
PACCAR INC	80,726	109.180	8,813,664.680	
PTC INC	18,085	180.000	3,255,300.000	
EXELON CORP	157,197	37.670	5,921,610.990	
PARKER HANNIFIN CORP	19,900	561.130	11,166,487.000	
PAYCHEX INC	49,152	122.550	6,023,577.600	
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,452	271.700	3,111,508.400	
PPL CORPORATION	113,687	29.140	3,312,839.180	
PEPSICO INC	212,674	179.790	38,236,658.460	
PENTAIR PLC	25,545	83.320	2,128,409.400	
PFIZER INC	873,728	28.010	24,473,121.280	
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	39.240	1,582,117.560	
CONOCOPHILLIPS	183,994	121.910	22,430,708.540	
PG&E CORP	306,139	17.830	5,458,458.370	
ALTRIA GROUP INC	271,033	44.900	12,169,381.700	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	61,632	157.580	9,711,970.560	
BROWN & BROWN INC	36,907	87.070	3,213,492.490	
GARMIN LTD	23,281	168.930	3,932,859.330	
PPG INDUSTRIES INC	35,748	135.330	4,837,776.840	
COSTCO WHOLESALE CORP	68,386	787.190	53,832,775.340	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,293	111.600	3,827,098.800	
QUEST DIAGNOSTICS	16,574	138.420	2,294,173.080	
PROCTER & GAMBLE CO	363,111	166.850	60,585,070.350	
PROGRESSIVE CORP	89,808	215.760	19,376,974.080	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	74,243	74.010	5,494,724.430	
PULTE GROUP INC	33,950	117.680	3,995,236.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	40,068	109.230	4,376,627.640	
QUALCOMM INC	172,540	182.080	31,416,083.200	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,141	125.700	3,663,023.700	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	53.510	1,393,667.950	
RELIANCE INC	8,747	293.150	2,564,183.050	
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,559	973.800	16,125,154.200	
REPLIGEN CORP	8,576	166.810	1,430,562.560	
RESMED INC	22,899	213.820	4,896,264.180	
US BANCORP	241,484	41.850	10,106,105.400	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,309	100.050	5,633,715.450	
ROSS STORES INC	50,878	133.480	6,791,195.440	
ROLLINS INC	45,708	46.630	2,131,364.040	
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,344	523.500	8,556,084.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,327	273.590	4,740,493.930	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	37,464	141.040	5,283,922.560	
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	112.840	2,173,072.720	
ACCENTURE PLC-CL A	96,538	306.330	29,572,485.540	

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	208,847	71.200	14,869,906.400	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	256.930	4,166,633.810	
AXON ENTERPRISE INC	11,039	303.430	3,349,563.770	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	34,835	218.500	7,611,447.500	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	89,354	74.640	6,669,382.560	
BOOKING HOLDINGS INC	5,452	3,805.750	20,748,949.000	
SCHLUMBERGER LTD	217,990	48.500	10,572,515.000	
SCHWAB (CHARLES) CORP	230,145	76.110	17,516,335.950	
POOL CORP	6,305	374.210	2,359,394.050	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	121.310	3,895,749.340	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	68.500	991,674.500	
ELEVANCE HEALTH INC	36,139	539.180	19,485,426.020	
CENCORA INC	25,701	224.600	5,772,444.600	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,591	83.960	2,988,220.360	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	37,500	320.860	12,032,250.000	
CENTENE CORP	82,487	77.790	6,416,663.730	
SMITH (A.O.) CORP	19,563	86.380	1,689,851.940	
SNAP-ON INC	8,204	280.910	2,304,585.640	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,392	118.830	6,463,401.360	
EDISON INTERNATIONAL	57,612	74.890	4,314,562.680	
SOUTHERN CO	166,722	78.140	13,027,657.080	
TRUIST FINANCIAL CORP	206,811	39.470	8,162,830.170	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	27.360	538,992.000	
AT&T INC	1,094,228	17.170	18,787,894.760	
CHEVRON CORP	277,081	165.820	45,945,571.420	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,592	89.840	2,029,665.280	
STATE STREET CORP	50,416	76.580	3,860,857.280	
STARBUCKS CORP	175,161	76.110	13,331,503.710	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	135.180	3,100,623.660	
STRYKER CORP	52,791	330.580	17,451,648.780	
NETFLIX INC	67,648	610.870	41,324,133.760	
GEN DIGITAL INC	92,583	23.460	2,171,997.180	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	49.850	1,365,890.000	
SYNOPSYS INC	23,314	556.710	12,979,136.940	
SYSCO CORP	81,369	76.170	6,197,876.730	
INTUITIVE SURGICAL INC	54,381	386.700	21,029,132.700	
TELEFLEX INC	6,985	203.930	1,424,451.050	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	16.250	2,750,312.500	
TERADYNE INC	22,066	122.920	2,712,352.720	
TEXAS INSTRUMENTS INC	140,780	187.050	26,332,899.000	

TEXTRON INC	29,841	88.550	2,642,420.550	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	59,645	593.030	35,371,274.350	
GLOBE LIFE INC	14,973	86.500	1,295,164.500	
TORO CO	14,644	87.420	1,280,178.480	
DAVITA INC	6,813	137.520	936,923.760	
TRACTOR SUPPLY CO	16,808	271.430	4,562,195.440	
BIO-TECHNE CORP	25,934	80.910	2,098,319.940	
TRIMBLE INC	37,504	56.800	2,130,227.200	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,175	484.760	2,993,393.000	
TYSON FOODS INC	41,316	59.650	2,464,499.400	
MARATHON OIL CORP	92,952	26.590	2,471,593.680	
UNION PACIFIC CORP	93,133	247.400	23,041,104.200	
RTX CORP	223,486	106.320	23,761,031.520	
UNITEDHEALTH GROUP INC	142,800	512.810	73,229,268.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,903	178.090	1,763,625.270	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	13.050	1,061,304.300	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	39,411	422.780	16,662,182.580	
VULCAN MATERIALS CO	20,095	272.070	5,467,246.650	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	17.190	1,841,461.560	
WALMART INC	678,540	60.480	41,038,099.200	
WASTE MANAGEMENT INC	62,122	211.490	13,138,181.780	
WATERS CORP	8,786	351.110	3,084,852.460	
WATSCO INC	4,889	479.260	2,343,102.140	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,464	364.190	4,175,074.160	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,604	115.340	1,799,765.360	
VAIL RESORTS INC	6,523	198.520	1,294,945.960	
WESTERN DIGITAL CORP	49,451	71.600	3,540,691.600	
WABTEC CORP	28,400	168.340	4,780,856.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,319	92.200	2,334,411.800	
WYNN RESORTS LTD	15,379	96.390	1,482,381.810	
NASDAQ INC	52,969	60.660	3,213,099.540	
CME GROUP INC	55,935	208.460	11,660,210.100	
WILLIAMS COS INC	188,794	39.640	7,483,794.160	
WILLIAMS-SONOMA INC	9,646	315.940	3,047,557.240	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	196.090	1,676,765.590	
LKQ CORP	43,882	44.210	1,940,023.220	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	51.330	2,080,096.920	
WEC ENERGY GROUP INC	47,882	85.430	4,090,559.260	
CARMAX INC	22,414	71.710	1,607,307.940	
TJX COMPANIES INC	175,938	98.810	17,384,433.780	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	315.800	2,458,503.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.350	522,764.150	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	40.430	951,237.040	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,271	150.470	2,899,707.370	
CBRE GROUP INC	48,577	90.220	4,382,616.940	
REGIONS FINANCIAL CORP	152,588	19.830	3,025,820.040	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	518.650	2,664,305.050	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,519	702.540	5,282,398.260	
WESTLAKE CORP	6,030	158.150	953,644.500	
T-MOBILE US INC	80,697	164.200	13,250,447.400	
LAS VEGAS SANDS CORP	59,474	46.540	2,767,919.960	
MOSAIC CO/THE	48,502	29.430	1,427,413.860	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	206.110	1,262,629.860	
CELANESE CORP	16,273	156.690	2,549,816.370	
DEXCOM INC	58,553	127.050	7,439,158.650	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	166.960	3,264,735.840	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	112.840	2,479,997.520	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	73.950	2,290,157.550	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,536	433.550	6,735,632.800	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	87,385	133.990	11,708,716.150	
LIVE NATION	23,597	97.020	2,289,380.940	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,226	3,239.230	13,688,985.980	
TRANSDIGM GROUP INC	8,496	1,310.490	11,133,923.040	
MASTERCARD INC	128,934	456.980	58,920,259.320	
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	82.810	1,956,220.630	
OWENS CORNING	13,227	176.810	2,338,665.870	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,679	147.480	3,049,738.920	
AERCAP HOLDINGS NV	30,064	91.170	2,740,934.880	
FIRST SOLAR INC	15,579	191.050	2,976,367.950	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	18,398	195.690	3,600,304.620	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,793	798.500	6,222,710.500	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	93.050	1,962,796.700	
DELTA AIR LINES INC	21,592	52.600	1,135,739.200	
INSULET CORP	10,158	165.900	1,685,212.200	
DISCOVER FINANCIAL	39,188	123.400	4,835,799.200	
TE CONNECTIVITY LTD	47,054	146.190	6,878,824.260	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,837	352.960	6,295,747.520	
MERCADOLIBRE INC	6,913	1,693.970	11,710,414.610	
ULTA BEAUTY INC	7,263	401.590	2,916,748.170	
MSCI INC	11,948	485.160	5,796,691.680	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	236,746	99.660	23,594,106.360	
VISA INC	243,751	280.740	68,430,655.740	
KEURIG DR PEPPER INC	160,760	34.030	5,470,662.800	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	31,751	135.500	4,302,260.500	
MARATHON PETROLEUM CORP	58,062	179.560	10,425,612.720	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	75.320	1,614,107.600	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	298,312	19.080	5,691,792.960	
XYLEM INC	36,891	143.000	5,275,413.000	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	40,421	101.370	4,097,476.770	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	252.030	1,633,406.430	
EPAM SYSTEMS INC	9,031	183.400	1,656,285.400	
HCA HEALTHCARE INC	30,702	326.650	10,028,808.300	
VERISK ANALYTICS INC	21,663	248.310	5,379,139.530	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,706	109.630	1,173,698.780	
CORPAY INC	11,338	283.440	3,213,642.720	
NXP SEMICONDUCTOR NV	38,938	261.730	10,191,242.740	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,242	156.060	3,002,906.520	
TARGA RESOURCES CORP	33,263	113.200	3,765,371.600	
LEAR CORP	9,398	131.070	1,231,795.860	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,608	181.060	2,825,984.480	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	62.960	2,159,213.200	
DOLLAR GENERAL CORP	33,444	140.950	4,713,931.800	
FORTINET INC	100,599	58.160	5,850,837.840	
HYATT HOTELS CORP	6,647	152.200	1,011,673.400	
TESLA INC	440,906	168.470	74,279,433.820	
ENPHASE ENERGY INC	21,539	108.350	2,333,750.650	
GENERAL MOTORS CO	208,056	45.210	9,406,211.760	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	39.410	1,546,054.300	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	268.640	3,195,472.800	
APTIV PLC	43,097	82.780	3,567,569.660	
PHILLIPS 66	68,358	145.600	9,952,924.800	
META PLATFORMS INC	341,856	476.200	162,791,827.200	
IQVIA HOLDINGS INC	27,848	234.080	6,518,659.840	
DIAMONDBACK ENERGY INC	26,616	202.190	5,381,489.040	
SERVICENOW INC	31,602	729.790	23,062,823.580	
PALO ALTO NETWORKS INC	48,773	297.470	14,508,504.310	
WORKDAY INC	32,378	246.340	7,975,996.520	
ABBVIE INC	272,283	160.750	43,769,492.250	
ZOETIS INC	70,224	169.040	11,870,664.960	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	25.030	1,356,901.330	
CDW CORP	20,262	222.460	4,507,484.520	
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	80.870	5,103,705.700	
TWILIO INC	25,710	60.100	1,545,171.000	
SNAP INC	152,250	16.010	2,437,522.500	

TRADE DESK INC A	69,828	87.260	6,093,191.280	
OKTA INC	25,106	97.420	2,445,826.520	
BAKER HUGHES CO	152,160	32.340	4,920,854.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	85.160	1,855,210.600	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	11.520	1,865,802.240	
BROADCOM INC	68,510	1,332.800	91,310,128.000	
ARES MANAGEMENT CORP	26,510	142.270	3,771,577.700	
MONGODB INC	10,906	353.470	3,854,943.820	
BURLINGTON STORES INC	10,565	190.400	2,011,576.000	
VEEVA SYSTEMS INC	23,273	203.780	4,742,571.940	
EVERGY INC	33,192	55.420	1,839,500.640	
ALLEGION PLC	13,423	125.990	1,691,163.770	
DAYFORCE INC	22,002	60.700	1,335,521.400	
STERIS PLC	15,540	231.330	3,594,868.200	
DOCUSIGN INC	31,974	58.030	1,855,451.220	
WIX.COM LTD	8,997	122.260	1,099,973.220	
DROPBOX INC	41,801	23.130	966,857.130	
KKR & CO INC	90,373	103.130	9,320,167.490	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	68.900	347,945.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	39,400	61.970	2,441,618.000	
MODERNA INC	50,006	117.310	5,866,203.860	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40,232	208.080	8,371,474.560	
CIGNA GROUP	45,163	348.390	15,734,337.570	
DELL TECHNOLOGIES INC	38,669	132.770	5,134,083.130	
DOW INC	106,037	59.410	6,299,658.170	
OVINTIV INC	39,160	49.940	1,955,650.400	
AMCOR PLC	223,348	10.360	2,313,885.280	
PINTEREST INC	90,936	42.000	3,819,312.000	
FOX CORP-A	36,501	33.410	1,219,498.410	
FOX CORP-B	27,507	30.940	851,066.580	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	35,283	320.760	11,317,375.080	
AVANTOR INC	107,376	24.790	2,661,851.040	
DYNATRACE INC	39,362	46.210	1,818,918.020	
CLOUDFLARE INC	46,487	71.920	3,343,345.040	
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	110.410	1,867,916.380	
CARRIER GLOBAL CORP	124,379	65.500	8,146,824.500	
OTIS WORLDWIDE CORP	62,600	97.100	6,078,460.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	285,830	66.990	19,147,751.700	
CORTEVA INC	108,001	57.480	6,207,897.480	
MATCH GROUP INC	44,764	30.690	1,373,807.160	
FERGUSON PLC	30,868	221.530	6,838,188.040	
BILL HOLDINGS INC	16,243	56.480	917,404.640	
BLACKSTONE INC	108,546	124.040	13,464,045.840	
PAYLOCITY HOLDING CORP	7,385	163.620	1,208,333.700	
CARLYLE GROUP INC	34,847	42.500	1,480,997.500	
DATADOG INC	42,674	118.970	5,076,925.780	

SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	94.010	2,903,968.900	
VERTIV HOLDINGS CO	53,234	95.400	5,078,523.600	
INGERSOLL RAND INC	61,976	91.260	5,655,929.760	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	62,373	83.400	5,201,908.200	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	173.390	1,550,279.990	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	9.990	933,325.740	
DRAFTKINGS INC	63,900	43.270	2,764,953.000	
UNITY SOFTWARE INC	40,967	21.690	888,574.230	
AON PLC	31,309	293.100	9,176,667.900	
WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	8.150	2,864,081.150	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,718	623.720	1,695,270.960	
BENTLEY SYSTEMS INC	33,634	55.480	1,866,014.320	
COINBASE GLOBAL INC	26,305	200.920	5,285,200.600	
UIPATH INC	53,439	19.220	1,027,097.580	
AIRBNB INC	67,475	146.320	9,872,942.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP	48,214	214.930	10,362,635.020	
MONDAY.COM LTD	4,308	181.760	783,022.080	
SOLVENTUM CORP	21,683	63.740	1,382,074.420	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	39,050	29.550	1,153,927.500	
APPLOVIN CORP	25,377	86.430	2,193,334.110	
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	28.090	1,746,439.570	
ROBLOX CORP	66,477	31.450	2,090,701.650	
VIATRIS INC	184,148	11.160	2,055,091.680	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	36.180	1,251,972.720	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	87.120	1,380,503.520	
HF SINCLAIR CORP	25,560	56.670	1,448,485.200	
SNOWFLAKE INC	42,608	157.150	6,695,847.200	
DOORDASH INC	39,376	114.840	4,521,939.840	
ARISTA NETWORKS INC	40,807	314.030	12,814,622.210	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	61,704	112.060	6,914,550.240	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	29.550	469,638.150	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	290,013	20.600	5,974,267.800	
FNF GROUP	38,907	51.530	2,004,877.710	
JACOBS SOLUTIONS INC	18,723	139.240	2,606,990.520	
MARVELL TECHNOLOGY INC	134,511	68.470	9,209,968.170	
APA CORP	49,146	30.380	1,493,055.480	
CONFLUENT INC	27,524	29.420	809,756.080	
LINDE PLC	74,454	434.390	32,342,073.060	
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	16.230	1,193,976.180	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	66.510	796,856.310	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	209.080	777,986.680	
TOAST INC	45,399	26.830	1,218,055.170	

	GE VERNOVA INC	41,899	167.270	7,008,445.730	
	GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.500	978,302.500	
	CATALENT INC	27,357	55.810	1,526,794.170	
	SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	45.730	3,141,696.730	
	VERALTO CORP	37,086	96.500	3,578,799.000	
	SAMSARA INC	27,908	39.840	1,111,854.720	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM	19,871	24.690	490,614.990	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE	28,191	70.010	1,973,651.910	
	BUNGE GLOBAL SA	21,715	106.030	2,302,441.450	
	KENVUE INC	264,038	20.540	5,423,340.520	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	36.060	2,632,848.780	
	CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	233.570	1,588,042.430	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	150.210	4,162,769.730	
	HUBSPOT INC	7,360	597.950	4,400,912.000	
	QORVO INC	14,144	97.690	1,381,727.360	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,444	53.060	978,638.640	
	LIBERTY GLOBAL LTD	36,034	17.230	620,865.820	
	GODADDY INC	19,713	133.920	2,639,964.960	
	ETSY INC	18,558	61.920	1,149,111.360	
	TRANSUNION	31,262	78.000	2,438,436.000	
	ALBERTSONS COS INC	54,086	20.740	1,121,743.640	
	BLOCK INC	84,306	71.310	6,011,860.860	
	DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	78.760	5,374,188.600	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	73.830	2,289,615.960	
	WESTROCK CO	42,166	51.640	2,177,452.240	
	KRAFT HEINZ CO	129,447	36.240	4,691,159.280	
	FORTIVE CORP	55,370	76.880	4,256,845.600	
	WASTE CONNECTIONS INC	38,848	167.380	6,502,378.240	
	ALPHABET INC-CL A	912,175	168.650	153,838,313.750	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	186,711	17.060	3,185,289.660	
	PAYPAL HOLDINGS INC	158,507	62.930	9,974,845.510	
	SEA LTD ADR	58,070	64.910	3,769,323.700	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	39.840	2,244,147.360	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	42.360	947,762.640	
	ALPHABET INC-CL C	792,918	170.290	135,026,006.220	
	ZSCALER INC	14,051	174.620	2,453,585.620	
	ATLASSIAN CORP PLC	23,713	179.750	4,262,411.750	
	ROKU INC	19,331	57.910	1,119,458.210	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,049	275.550	4,146,751.950	
	VISTRA CORP	49,633	93.420	4,636,714.860	
アメリカ・ドル　小計		52,418,783		6,914,413,239.880	

				(1,078,510,177,160)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	22.550	1,382,202.250	
	ASHTEAD GROUP	66,851	59.260	3,961,590.260	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	25.870	1,178,326.760	
	BARCLAYS PLC	2,229,023	2.139	4,767,880.190	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.937	613,155.650	
	BT GROUP PLC	904,198	1.054	953,024.690	
	BUNZL PLC	53,979	31.840	1,718,691.360	
	CRH PLC	108,593	67.800	7,362,605.400	
	AVIVA PLC	429,205	4.903	2,104,392.110	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	48.650	1,000,876.450	
	DIAGEO PLC	346,858	28.500	9,885,453.000	
	SCHRODERS PLC	110,366	3.730	411,665.180	
	DCC PLC	17,471	58.500	1,022,053.500	
	NATIONAL GRID PLC	579,825	11.170	6,476,645.250	
	KINGFISHER PLC	336,026	2.616	879,044.010	
	BAE SYSTEMS PLC	457,388	13.940	6,375,988.720	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	315,055	24.330	7,665,288.150	
	HALMA PLC	62,208	23.280	1,448,202.240	
	NEXT PLC	18,588	92.940	1,727,568.720	
	IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	18.680	2,357,023.720	
	ANGLO AMERICAN PLC	193,117	27.735	5,356,099.990	
	COMPASS GROUP PLC	259,074	23.080	5,979,427.920	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,973,100	6.960	20,692,776.000	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	949,467	2.486	2,360,374.960	
	CENTRICA PLC	793,776	1.375	1,091,442.000	
	UNILEVER PLC	382,437	42.880	16,398,898.560	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,134	10.945	1,260,141.630	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	27.020	1,487,261.860	
	PEARSON PLC	84,159	9.976	839,570.180	
	PERSIMMON PLC	56,989	14.245	811,808.300	
	PRUDENTIAL PLC	418,146	8.018	3,352,694.620	
	RIO TINTO PLC	173,077	56.050	9,700,965.850	
	VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.694	2,486,534.680	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	110,858	45.970	5,096,142.260	
	RELX PLC	289,143	34.590	10,001,456.370	
	RENTOKIL INITIAL PLC	374,845	4.250	1,593,091.250	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,303,232	4.236	5,520,490.750	
	NATWEST GROUP PLC	896,355	3.193	2,862,061.510	
	ST JAMES'S PLACE PLC	89,082	4.848	431,869.530	
	SSE PLC	168,922	18.120	3,060,866.640	
	BP PLC	2,631,576	5.062	13,321,037.710	
	SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	11.980	1,823,308.080	

	SMITHS GROUP PLC	51,695	17.270	892,772.650	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	93.500	1,005,218.500	
	STANDARD CHARTERED PLC	362,528	7.750	2,809,592.000	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,868,076	0.543	5,358,365.260	
	TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.443	822,312.300	
	TESCO PLC	1,122,991	3.117	3,500,362.940	
	3I GROUP PLC	149,486	28.510	4,261,845.860	
	SMITH & NEPHEW PLC	125,930	10.045	1,264,966.850	
	GSK PLC	626,067	17.995	11,266,075.660	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	63,356	91.280	5,783,135.680	
	WPP PLC	176,061	8.456	1,488,771.810	
	ASTRAZENECA PLC	239,773	123.700	29,659,920.100	
	WHITBREAD PLC	31,475	30.690	965,967.750	
	INTERTEK GROUP PLC	23,309	50.000	1,165,450.000	
	BURBERRY GROUP PLC	52,229	11.750	613,690.750	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	78.900	2,120,358.600	
	SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.760	733,627.320	
	ADMIRAL GROUP PLC	40,084	27.500	1,102,310.000	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	52.450	864,848.050	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	19.940	367,992.700	
	ABRDN PLC	285,831	1.583	452,470.470	
	EXPERIAN PLC	140,133	34.530	4,838,792.490	
	MONDI PLC	67,554	15.755	1,064,313.270	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.620	318,440.040	
	OCADO GROUP PLC	69,766	3.483	242,994.970	
	INFORMA PLC	223,961	8.502	1,904,116.420	
	GLENCORE PLC	1,570,188	4.760	7,474,094.880	
	ENTAIN PLC	96,924	7.788	754,844.110	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	27.160	842,910.600	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	5.205	706,984.740	
	M&G PLC	270,401	2.055	555,674.050	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	17.230	483,732.250	
	WISE PLC	96,207	7.985	768,212.890	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.219	465,744.540	
	HALEON PLC	947,490	3.278	3,105,872.220	
	SHELL PLC	1,001,245	29.460	29,496,677.700	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	7.482	1,071,332.610	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	27,104	162.450	4,403,044.800	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	6.012	1,299,337.480	
イギリス・ポンド　小計		42,077,422		315,117,173.570 (61,523,476,968)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	33.920	6,356,743.680	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	29.460	7,043,385.180	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	741.000	2,467,530.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	19.100	3,112,230.400	
	ICL GROUP LTD	103,067	17.600	1,813,979.200	
	NICE LTD	10,202	845.500	8,625,791.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	137.000	4,033,828.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	242.000	1,130,624.000	
イスラエル・シュケル　小計		740,146		34,584,111.460 (1,452,681,393)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	50.110	1,418,413.660	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	540,278	26.660	14,403,811.480	
	FORTESCUE LTD	253,090	26.210	6,633,488.900	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.660	2,195,461.980	
	ASX LTD	31,215	64.200	2,004,003.000	
	BHP GROUP LTD	775,707	42.910	33,285,587.370	
	AMPOL LTD	31,828	36.150	1,150,582.200	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	26.770	2,452,774.480	
	CSL LIMITED	73,693	279.180	20,573,611.740	
	REA GROUP LTD	9,317	187.320	1,745,260.440	
	TRANSURBAN GROUP	476,258	12.810	6,100,864.980	
	COCHLEAR LTD	10,446	320.330	3,346,167.180	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	9.930	2,558,881.560	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	255,604	117.540	30,043,694.160	
	RIO TINTO LIMITED	56,991	130.020	7,409,969.820	
	APA GROUP	222,829	8.780	1,956,438.620	
	ARISTOCRAT LEISU	86,829	39.420	3,422,799.180	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	6.260	2,254,113.320	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	69,336	55.600	3,855,081.600	
	ORICA LTD	63,862	18.300	1,168,674.600	
	BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	22.070	1,690,275.090	
	MACQUARIE GROUP LTD	56,701	193.270	10,958,602.270	
	SUNCORP GROUP LTD	199,628	16.250	3,243,955.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	482,840	33.810	16,324,820.400	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.240	702,992.160	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	219,807	17.610	3,870,801.270	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	14.670	2,385,767.430	
	REECE LTD	31,558	27.400	864,689.200	
	SANTOS LTD	478,809	7.860	3,763,438.740	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	26.760	1,736,643.720	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	32.610	1,285,486.200	

	WESFARMERS LTD	172,824	67.950	11,743,390.800	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	296,262	28.630	8,481,981.060	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	183,840	30.720	5,647,564.800	
	SEEK LTD	58,513	23.440	1,371,544.720	
	MINERAL RESOURCES LTD	28,865	77.120	2,226,068.800	
	BRAMBLES LTD	220,767	14.320	3,161,383.440	
	PILBARA MINERALS LTD	404,496	4.140	1,674,613.440	
	CAR GROUP LTD	58,310	34.900	2,035,019.000	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	28,600	39.940	1,142,284.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.810	849,054.690	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	11.740	1,583,843.400	
	XERO LTD	23,149	125.360	2,901,958.640	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	16.240	729,549.520	
	LOTTERY CORP LTD	366,780	5.080	1,863,242.400	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.200	1,214,928.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	462,432	29.090	13,452,146.880	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.650	1,506,541.150	
	SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.650	2,491,993.700	
	COLES GROUP LTD	197,589	16.240	3,208,845.360	
	WISETECH GLOBAL LTD	27,325	96.720	2,642,874.000	
オーストラリア・ドル　小計		10,481,938		264,735,979.550 (27,236,037,576)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	75,291	93.530	7,041,967.230	
	BARRICK GOLD CORP	267,495	23.140	6,189,834.300	
	BANK OF MONTREAL	109,727	128.160	14,062,612.320	
	BANK OF NOVA SCOTIA	189,801	65.670	12,464,231.670	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,706	116.020	5,998,930.120	
	BCE INC	14,197	46.390	658,598.830	
	BROOKFIELD CORP	211,045	60.460	12,759,780.700	
	SAPUTO INC	34,582	27.250	942,359.500	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	133.090	1,531,599.720	
	CGI INC	31,091	139.900	4,349,630.900	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	70.730	1,489,432.340	
	CAE INC	40,808	28.620	1,167,924.960	
	CAMECO CORP	66,084	69.600	4,599,446.400	
	ROGERS COMM-CL B	53,375	54.060	2,885,452.500	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	143,011	67.550	9,660,393.050	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	164,344	104.590	17,188,738.960	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	144.070	1,283,807.770	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	31.830	519,783.900	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,693	174.210	14,580,157.530	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	45.930	1,384,422.060	
	OPEN TEXT CORP	40,459	41.460	1,677,430.140	

EMPIRE CO LTD	20,608	32.840	676,766.720	
KINROSS GOLD CORP	192,737	10.380	2,000,610.060	
RB GLOBAL INC	26,641	104.530	2,784,783.730	
FORTIS INC	82,632	56.190	4,643,092.080	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	18.240	1,558,079.040	
TELUS CORP	31,890	22.010	701,898.900	
GREAT WEST LIFECO INC	43,551	43.280	1,884,887.280	
IMPERIAL OIL LTD	27,434	95.440	2,618,300.960	
ENBRIDGE INC	326,190	51.670	16,854,237.300	
IGM FINANCIAL INC	12,478	37.630	469,547.140	
MANULIFE FINANCIAL CORP	271,363	35.600	9,660,522.800	
LOBLAW CO LTD	24,803	156.120	3,872,244.360	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	120,276	75.690	9,103,690.440	
MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	64.110	2,710,506.690	
SUN LIFE FINANCIAL INC	90,324	68.510	6,188,097.240	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,133	1,571.020	4,922,005.660	
METRO INC	35,059	74.080	2,597,170.720	
EMERA INC	44,643	48.600	2,169,649.800	
ONEX CORP	10,157	95.330	968,266.810	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	27.860	1,542,691.780	
POWER CORP OF CANADA	89,864	40.120	3,605,343.680	
QUEBECOR INC-B	30,598	30.660	938,134.680	
ROYAL BANK OF CANADA	218,798	141.080	30,868,021.840	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	144,017	113.340	16,322,886.780	
STANTEC INC	18,358	110.590	2,030,211.220	
SUNCOR ENERGY INC	198,439	54.790	10,872,472.810	
LUNDIN MINING CORP	119,660	16.060	1,921,739.600	
TECK RESOURCES LTD-CL B	72,863	70.700	5,151,414.100	
THOMSON REUTERS CORP	24,837	229.480	5,699,594.760	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	124.310	1,628,088.070	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	275,206	77.380	21,295,440.280	
TC ENERGY CORP	157,154	52.780	8,294,588.120	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	107.000	866,914.000	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	190.000	1,869,410.000	
INTACT FINANCIAL CORP	28,756	228.700	6,576,497.200	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	73,865	75.110	5,548,000.150	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,041	3,736.300	11,362,088.300	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,420	174.750	5,141,145.000	
TOURMALINE OIL CORP	49,085	65.090	3,194,942.650	
KEYERA CORP	39,997	35.540	1,421,493.380	
PARKLAND CORP	24,129	40.000	965,160.000	

	ALTAGAS LTD	47,249	30.580	1,444,874.420	
	PEMBINA PIPELINE CORP	82,164	50.350	4,136,957.400	
	DOLLARAMA INC	41,508	118.320	4,911,226.560	
	MEG ENERGY CORP	47,181	31.000	1,462,611.000	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	28.070	6,365,349.690	
	ARC RESOURCES LTD	96,301	25.510	2,456,638.510	
	NORTHLAND POWER INC	34,152	21.680	740,415.360	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	22.540	1,155,017.220	
	TMX GROUP LTD	46,884	36.480	1,710,328.320	
	BRP INC	4,307	96.210	414,376.470	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	19.660	1,942,801.200	
	NUTRIEN LTD	77,339	79.470	6,146,130.330	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	188.250	2,182,005.750	
	WSP GLOBAL INC	20,394	219.030	4,466,897.820	
	IA FINANCIAL CORP INC	16,448	91.360	1,502,689.280	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	44.190	1,576,124.730	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	42.910	690,979.730	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	54.350	2,839,733.150	
	AIR CANADA	41,858	18.800	786,930.400	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,113	100.160	4,518,518.080	
	SHOPIFY INC	184,248	80.580	14,846,703.840	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	206.000	1,078,822.000	
	HYDRO ONE LTD	56,437	40.470	2,284,005.390	
カナダ・ドル　小計		6,180,035		415,597,307.680 (47,386,405,022)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.980	683,764.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	5.290	858,038.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	310,981	35.400	11,008,727.400	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	101,000	5.980	603,980.000	
	SEATRIUM LTD	361,761	1.760	636,699.360	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	27.040	419,120.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.290	1,299,671.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.885	673,655.800	
	KEPPEL LTD	249,600	6.730	1,679,808.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	502,098	14.120	7,089,623.760	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	2.400	3,217,992.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.750	1,647,000.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	30.340	5,812,112.440	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.180	822,030.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.590	1,049,701.100	

シンガポール・ドル　小計		5,216,219		37,501,922.860 (4,317,596,379)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	77.020	1,827,992.680	
	NESTLE SA-REGISTERED	412,946	95.180	39,304,200.280	
	CIE FINANC RICHEMONT	83,477	135.500	11,311,133.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	108,977	225.100	24,530,722.700	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	237.400	1,260,831.400	
	SIKA INHABER	23,397	278.100	6,506,705.700	
	SGS SA-REG	22,978	82.240	1,889,710.720	
	NOVARTIS AG-REG SHS	316,216	92.320	29,193,061.120	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	145.500	848,265.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	711	1,533.000	1,089,963.000	
	CLARIANT AG-REG	22,909	14.200	325,307.800	
	SWISSCOM AG-REG	4,457	501.000	2,232,957.000	
	ABB LTD	247,495	47.160	11,671,864.200	
	ADECCO GROUP AG-REG	26,454	34.460	911,604.840	
	GEBERIT AG	5,105	550.600	2,810,813.000	
	LONZA GROUP AG-REG	11,536	526.200	6,070,243.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	161	10,530.000	1,695,330.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	106,200.000	1,699,200.000	
	GIVAUDAN-REG	1,392	4,053.000	5,641,776.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	22,758	457.400	10,409,509.200	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	246.800	1,187,108.000	
	HOLCIM LTD	77,519	81.600	6,325,550.400	
	TEMENOS GROUP	10,930	54.400	594,592.000	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	83.400	389,728.200	
	SONOVA HOLDING AG	8,100	270.300	2,189,430.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,597	248.900	2,139,793.300	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,475	119.250	1,964,643.750	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	196.000	842,800.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	39.450	365,267.550	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	124.700	611,778.200	
	SCHINDLER NAMEN	4,209	230.500	970,174.500	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	648.800	2,921,546.400	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	96.300	472,158.900	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	768.000	956,160.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,356	85.600	1,143,273.600	
	AVOLTA AG	12,933	37.600	486,280.800	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,433	1,258.500	4,320,430.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	54.080	1,736,725.120	
	SWISS RE LTD	45,502	106.050	4,825,487.100	
	BKW AG	3,194	142.400	454,825.600	
	SIG GROUP AG	50,969	19.190	978,095.110	
	ALCON INC	74,922	73.600	5,514,259.200	
	SANDOZ GROUP AG	57,347	32.550	1,866,644.850	

	UBS GROUP AG	503,306	26.950	13,564,096.700	
	VAT GROUP AG	4,131	470.200	1,942,396.200	
スイス・フラン	小計	2,311,496		219,994,437.320 (37,845,643,052)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	422,695	202.500	85,595,737.500	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	241,869	175.700	42,496,383.300	
	ERICSSON LM-B SHS	465,668	58.200	27,101,877.600	
	GETINGE AB-B SHS	38,925	211.900	8,248,207.500	
	LUNDBERGS B	14,872	569.000	8,462,168.000	
	SKF AB-B SHS	46,594	237.700	11,075,393.800	
	SANDVIK AB	169,218	233.100	39,444,715.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	250,203	153.150	38,318,589.450	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	192.300	8,449,085.100	
	SWEDBANK AB	132,581	219.400	29,088,271.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,795	165.300	15,339,013.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	98.300	21,512,561.800	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	292.800	7,085,174.400	
	VOLVO AB-B SHS	237,569	282.600	67,136,999.400	
	HOLMEN AB-B SHS	17,320	445.400	7,714,328.000	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	104.550	7,073,225.700	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	364.800	5,578,521.600	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	364.600	7,775,095.000	
	SAAB AB-B	47,156	226.300	10,671,402.800	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	108.550	8,259,026.750	
	INVESTOR AB-B SHS	271,548	282.350	76,671,577.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	170.550	17,851,297.950	
	ASSA ABLOY AB-B	153,368	315.400	48,372,267.200	
	TELIA CO AB	344,810	25.830	8,906,442.300	
	BOLIDEN AB	36,260	369.300	13,390,818.000	
	ALFA LAVAL AB	44,407	486.800	21,617,327.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	72.000	5,251,824.000	
	INDUTRADE AB	39,178	272.800	10,687,758.400	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	89.660	4,282,968.540	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	57.200	12,173,990.400	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	288.000	10,477,728.000	
	HEXAGON AB-B SHS	307,116	122.050	37,483,507.800	
	SAGAX AB	28,022	284.400	7,969,456.800	
	EPIROC AB-A	103,115	218.000	22,479,070.000	
	EPIROC AB-B	61,487	197.200	12,125,236.400	
	ESSITY AB-B	99,980	279.100	27,904,418.000	
	EQT AB	55,194	325.600	17,971,166.400	
	VOLVO CAR AB	143,747	35.060	5,039,769.820	
	BEIJER REF AB	50,493	168.450	8,505,545.850	
	LIFCO AB	39,631	277.200	10,985,713.200	

	EVOLUTION AB	28,266	1,240.000	35,049,840.000	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	291.100	8,045,421.800	
スウェーデン・クローナ　小計		4,953,655		879,668,924.660 (12,649,639,137)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	15,167	956.200	14,502,685.400	
	A P MOLLER A/S	663	10,435.000	6,918,405.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	10,160.000	5,516,880.000	
	DANSKE BANK A/S	102,303	190.750	19,514,297.250	
	GENMAB A/S	9,783	2,003.000	19,595,349.000	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	54,795	418.400	22,926,228.000	
	ROCKWOOL AS	873	2,576.000	2,248,848.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	502,851	883.200	444,118,003.200	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	191.050	29,521,237.050	
	COLOPLAST-B	21,291	845.200	17,995,153.200	
	DSV A/S	28,190	1,018.500	28,711,515.000	
	DEMANT A/S	17,700	320.400	5,671,080.000	
	TRYG A/S	58,222	142.800	8,314,101.600	
	PANDORA A/S	12,473	1,131.500	14,113,199.500	
	ORSTED A/S	26,911	431.100	11,601,332.100	
デンマーク・クローネ　小計		1,006,286		651,268,314.300 (14,666,562,438)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	229,726	7.790	1,789,565.540	
	EBOS GROUP LTD	25,631	34.850	893,240.350	
	FISHER & PAYKEL	78,460	28.850	2,263,571.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	4.380	1,369,726.740	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.400	402,137.600	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	6.170	1,476,530.360	
ニュージーランド・ドル　小計		948,682		8,194,771.590 (768,751,523)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	197.150	14,415,213.700	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	66.600	14,730,721.200	
	TELENOR ASA	119,576	126.300	15,102,448.800	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	831.500	9,300,327.500	
	ORKLA ASA	116,068	82.550	9,581,413.400	
	EQUINOR ASA	129,895	312.750	40,624,661.250	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	320.800	9,436,011.200	
	AKER BP ASA	40,933	275.900	11,293,414.700	
	SALMAR ASA	12,897	677.500	8,737,717.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	186.800	4,804,682.800	
	DNB BANK ASA	143,909	203.700	29,314,263.300	
ノルウェー・クローネ　小計		923,898		167,340,875.350 (2,403,014,970)	
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	25,025	80.000	2,002,000.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	24,704	89.150	2,202,361.600	
	UMICORE	33,545	21.800	731,281.000	

AIR LIQUIDE	81,240	186.640	15,162,633.600	
AIRBUS SE	90,775	159.840	14,509,476.000	
AXA SA	279,056	33.720	9,409,768.320	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	107,926	29.270	3,158,994.020	
ADIDAS AG	24,550	224.400	5,509,020.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	24.400	3,528,557.200	
DASSAULT AVIATION SA	3,120	206.800	645,216.000	
DANONE	96,532	59.500	5,743,654.000	
SAFRAN SA	52,883	212.500	11,237,637.500	
INTESA SANPAOLO	2,225,194	3.600	8,010,698.400	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	49,783	101.600	5,057,952.800	
ACCOR SA	31,427	41.450	1,302,649.150	
BOUYGUES	29,123	35.910	1,045,806.930	
BNP PARIBAS	160,893	71.200	11,455,581.600	
THALES SA	15,023	167.100	2,510,343.300	
CAPGEMINI SA	25,063	205.400	5,147,940.200	
LOTUS BAKERIES NV	77	9,870.000	759,990.000	
UNICREDIT SPA	235,573	36.025	8,486,517.320	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	133.350	1,653,940.050	
D'IETEREN TRDG	2,736	216.800	593,164.800	
COMMERZBANK AG	158,792	14.005	2,223,881.960	
EIFFAGE	12,706	105.000	1,334,130.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	28.670	1,686,197.380	
PUBLICIS GROUPE	33,467	108.100	3,617,782.700	
IBERDROLA SA	939,014	12.210	11,465,360.940	
ENI SPA	332,847	15.180	5,052,617.460	
JERONIMO MARTINS	45,606	20.380	929,450.280	
KESKO OYJ-B	35,252	16.455	580,071.660	
KBC GROUPE	35,962	71.380	2,566,967.560	
HANNOVER RUECK SE	9,638	237.300	2,287,097.400	
WARTSILA OYJ	77,148	18.685	1,441,510.380	
L'OREAL	36,699	453.450	16,641,161.550	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	42,615	788.400	33,597,666.000	
GEA GROUP AG	25,513	38.360	978,678.680	
BOLLORE	114,808	6.155	706,643.240	
MEDIOBANCA SPA	86,792	14.450	1,254,144.400	
MICHELIN(CGDE)-B	98,359	37.120	3,651,086.080	
CONTINENTAL AG	17,635	60.880	1,073,618.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	151,735	39.580	6,005,671.300	
OMV AG	23,354	46.840	1,093,901.360	
VERBUND AG	10,663	71.150	758,672.450	
PERNOD-RICARD	30,948	149.350	4,622,083.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	23,311	49.320	1,149,698.520	
RENAULT SA	27,902	48.300	1,347,666.600	
REPSOL SA	195,049	14.840	2,894,527.160	

REMY COINTREAU	2,866	96.450	276,425.700	
MERCK KGAA	20,216	155.500	3,143,588.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	69,501	80.740	5,611,510.740	
RWE AG	98,751	34.500	3,406,909.500	
SEB SA	2,596	115.900	300,876.400	
SOCIETE GENERALE-A	116,635	25.920	3,023,179.200	
VINCI S.A.	76,313	115.600	8,821,782.800	
SODEXO	12,910	82.400	1,063,784.000	
SOFINA	2,281	222.800	508,206.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	83,164	234.000	19,460,376.000	
VIVENDI SE	98,944	9.954	984,888.570	
SAP SE	161,215	176.060	28,383,512.900	
TELEFONICA S.A	755,720	4.110	3,106,009.200	
TOTALENERGIES SE	332,113	68.680	22,809,520.840	
E.ON SE	339,366	13.195	4,477,934.370	
VOEST-ALPINE AG	18,032	25.480	459,455.360	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	73.100	1,307,466.600	
SIEMENS AG-REG	116,150	188.400	21,882,660.000	
UPM-KYMMENE OYJ	77,973	34.460	2,686,949.580	
ING GROEP NV-CVA	510,410	16.058	8,196,163.780	
PUMA AG	17,210	50.820	874,612.200	
BAYER AG	147,329	28.955	4,265,911.190	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	13.115	1,258,777.700	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	82.280	1,990,435.480	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	123,737	68.190	8,437,626.030	
BASF SE	135,442	48.805	6,610,246.810	
BEIERSDORF AG	15,743	147.250	2,318,156.750	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	102.950	2,222,278.700	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	40.400	1,358,732.800	
ASM INTERNATIONAL NV	7,273	621.800	4,522,351.400	
ORANGE	286,957	10.575	3,034,570.270	
SAMPO OYJ-A SHS	70,999	39.430	2,799,490.570	
RANDSTAD NV	15,584	49.120	765,486.080	
ALLIANZ SE	61,413	265.500	16,305,151.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	3.846	1,943,926.080	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	29.690	4,354,543.230	
HERMES INTL	4,880	2,296.000	11,204,480.000	
ENDESA S.A.	50,946	17.990	916,518.540	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	6.668	724,458.190	
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	45.700	2,585,431.800	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	20,996	455.400	9,561,578.400	
ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	23.880	1,937,360.520	
DASSAULT SYSTEMES SA	101,597	38.160	3,876,941.520	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	39.000	1,358,604.000	
RHEINMETALL STAMM	6,662	535.800	3,569,499.600	
HEINEKEN NV	43,759	93.760	4,102,843.840	
AKZO NOBEL	26,032	63.080	1,642,098.560	
ASML HOLDING NV	62,104	864.500	53,688,908.000	
AEGON LTD	232,433	6.136	1,426,208.880	
VOLKSWAGEN AG	5,460	134.900	736,554.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	30,425	116.950	3,558,203.750	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	914,652	9.710	8,881,270.920	
KERING	11,443	332.450	3,804,225.350	
ACCIONA S.A.	5,005	121.200	606,606.000	
FORTUM OYJ	73,699	13.405	987,935.090	
AGEAS	24,086	45.860	1,104,583.960	
UCB SA	20,020	123.000	2,462,460.000	
NEMETSCHEK SE	10,222	85.350	872,447.700	
CARREFOUR SA	90,642	16.490	1,494,686.580	
NOKIA OYJ	827,068	3.479	2,877,369.570	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	121,772	24.880	3,029,687.360	
WOLTERS KLUWER-CVA	38,724	146.950	5,690,491.800	
SANOFI	174,457	94.330	16,456,528.810	
STMICROELECTRONICS NV	104,058	37.655	3,918,303.990	
ELISA OYJ	20,242	42.140	852,997.880	
BANCO SANTANDER SA	2,484,377	4.734	11,761,040.710	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	16.450	1,078,939.050	
QIAGEN N.V.	34,544	40.870	1,411,813.280	
DEUTSCHE BANK AG-REG	282,637	15.878	4,487,710.280	
BMW VORZUG	7,821	96.600	755,508.600	
ENEL SPA	1,241,600	6.755	8,387,008.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	501,748	21.970	11,023,403.560	
SARTORIUS AG	3,651	278.800	1,017,898.800	
LEONARDO SPA	64,915	22.760	1,477,465.400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	197,936	38.000	7,521,568.000	
RATIONAL AG	860	796.000	684,560.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	7,150	94.550	676,032.500	
BECHTLE AG	14,521	45.640	662,738.440	
KONINKLIJKE KPN NV	496,095	3.408	1,690,691.760	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	57.660	1,328,371.080	
TELEPERFORMANCE	9,581	102.600	983,010.600	
DEUTSCHE BOERSE AG	28,751	187.450	5,389,374.950	
EURAZEO	5,673	85.600	485,608.800	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	70.650	912,656.700	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	77.600	1,372,744.000	
INDITEX	168,449	42.880	7,223,093.120	
ESSILORLUXOTTICA	45,265	205.900	9,320,063.500	
SNAM SPA	317,518	4.426	1,405,334.660	

CREDIT AGRICOLE SA	166,921	15.450	2,578,929.450	
ENAGAS	38,270	14.490	554,532.300	
TENARIS SA	76,002	15.960	1,212,991.920	
TELECOM ITALIA SPA	1,970,516	0.226	445,336.610	
TERNA SPA	207,655	7.872	1,634,660.160	
BIOMERIEUX	4,870	99.300	483,591.000	
GRIFOLS SA	31,982	9.416	301,142.510	
NESTE OYJ	66,248	22.450	1,487,267.600	
RECORDATI SPA	18,197	50.800	924,407.600	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	9.822	824,458.680	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	233.400	2,028,712.800	
KONE OYJ	49,300	49.310	2,430,983.000	
ELIA GROUP	4,078	99.650	406,372.700	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,801	205.700	987,565.700	
ENGIE	277,054	15.840	4,388,535.360	
ALSTOM	47,494	17.110	812,622.340	
IPSEN SA	5,964	119.900	715,083.600	
ARKEMA SA	10,489	98.000	1,027,922.000	
LEGRAND SA	41,105	103.350	4,248,201.750	
AMPLIFON SPA	20,249	34.470	697,983.030	
ADP	6,104	125.400	765,441.600	
ORION OYJ	13,559	37.680	510,903.120	
METSO CORPORATION	102,831	11.325	1,164,561.070	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	19.940	1,586,924.900	
SYMRISE AG	19,547	101.950	1,992,816.650	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39,869	43.750	1,744,268.750	
REXEL SA	33,916	27.980	948,969.680	
PRYSMIAN SPA	38,343	56.000	2,147,208.000	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	98.540	239,353.660	
CAIXABANK	569,844	4.928	2,808,191.230	
BUREAU VERITAS SA	39,729	28.140	1,117,974.060	
GETLINK	63,968	16.590	1,061,229.120	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	14.610	579,841.680	
AMADEUS IT GROUP SA	68,848	62.260	4,286,476.480	
BRENNTAG SE	21,559	77.740	1,675,996.660	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	20.310	869,999.160	
EDENRED	35,618	47.140	1,679,032.520	
TALANX AG	10,349	69.750	721,842.750	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	82.200	979,413.000	
VONOVIA SE	107,478	27.620	2,968,542.360	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	9.850	1,616,936.600	
KNORR-BREMSE AG	10,342	74.700	772,547.400	
OCI NV	12,329	24.700	304,526.300	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	52.580	2,364,101.960	
FERRARI NV	19,594	374.500	7,337,953.000	
ASR NEDERLAND NV	27,365	48.680	1,332,128.200	

	AIB GROUP PLC	226,914	4.986	1,131,393.200	
	NORDEA BANK ABP	492,403	11.340	5,583,850.020	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	34.080	589,345.440	
	MONCLER SPA	33,422	63.440	2,120,291.680	
	NEXI SPA	83,576	6.224	520,177.020	
	PROSUS NV	220,842	33.960	7,499,794.320	
	DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	81.540	1,497,971.340	
	JDE PEET'S BV	14,385	20.960	301,509.600	
	EXOR NV	14,142	102.400	1,448,140.800	
	SIEMENS ENERGY AG	74,892	24.280	1,818,377.760	
	EURONEXT NV	14,077	87.050	1,225,402.850	
	IMCD NV	9,332	147.300	1,374,603.600	
	WORLDLINE SA	36,232	11.630	421,378.160	
	NN GROUP NV	43,478	45.740	1,988,683.720	
	FINECOBANK SPA	96,393	15.150	1,460,353.950	
	ARGENX SE	9,078	347.900	3,158,236.200	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	125,611	28.010	3,518,364.110	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	83,468	41.490	3,463,087.320	
	DSM-FIRMENICH AG	28,846	103.100	2,974,022.600	
	SYENSQO SA	11,217	94.040	1,054,846.680	
	ZALANDO SE	31,321	25.240	790,542.040	
	STELLANTIS NV	341,919	20.280	6,934,117.320	
	FERROVIAL SE	73,817	34.580	2,552,591.860	
	AENA SME SA	11,603	175.900	2,040,967.700	
	CELLNEX TELECOM SAU	74,060	33.480	2,479,528.800	
	BANCO BPM SPA	202,727	6.228	1,262,583.750	
	ABN AMRO BANK NV	75,982	16.230	1,233,187.860	
	SCOUT24 SE	10,048	71.150	714,915.200	
	COVESTRO AG	27,558	48.210	1,328,571.180	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	136,318	59.480	8,108,194.640	
	POSTE ITALIANE SPA	88,762	12.305	1,092,216.410	
	AMUNDI SA	11,288	71.000	801,448.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.370	434,285.230	
	ADYEN NV	3,378	1,246.600	4,211,014.800	
	DELIVERY HERO SE	22,564	25.240	569,515.360	
ユーロ　小計		27,900,802		816,256,879.520 (137,098,505,484)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	8.120	2,086,840.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	65.500	15,837,638.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	47.000	4,385,758.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	183,491	285.800	52,441,727.800	
	MTR CORP	207,441	27.850	5,777,231.850	
	HANG SENG BANK LTD	122,096	109.100	13,320,673.600	

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	24.800	7,389,705.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	46.700	9,938,694.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	24.950	5,039,900.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	6.280	9,648,629.680	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	37.300	12,566,519.200	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	25.150	17,114,449.250	
	SINO LAND CO	659,200	8.580	5,655,936.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	77.000	15,751,505.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	69.350	3,676,937.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	112.000	24,097,472.000	
	AIA GROUP LTD	1,778,516	64.200	114,180,727.200	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	9.000	7,174,224.000	
	SANDS CHINA LTD	335,800	20.050	6,732,790.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	19.260	2,696,400.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	15.040	3,032,064.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	25.350	6,493,022.250	
	ESR GROUP LTD	465,200	10.000	4,652,000.000	
	WH GROUP LTD	1,001,000	5.740	5,745,740.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	41.150	15,202,661.750	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	34.650	9,223,656.750	
香港・ドル　小計		11,114,703		379,862,902.930 (7,582,063,542)	
合計		166,274,065		1,433,440,554,644 (1,433,440,554,644)	

（２）株式以外の有価証券

2024年5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	1,169,241.570	
		GOODMAN GROUP	255,895.000	8,610,866.750	
		GPT GROUP	349,447.000	1,495,633.160	
		MIRVAC GROUP	700,332.000	1,463,693.880	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,616,689.180	
		STOCKLAND	369,843.000	1,690,182.510	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,047,638.400	
	オーストラリア・ドル　小計		3,210,605.000	18,093,945.450	

				(1,861,505,108)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,535,100.450	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,588,802.800	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	649,517.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	502,820.000	
	シンガポール・ドル　小計		2,277,909.000	4,276,240.250 (492,323,540)	
投資信託受益証券　合計			5,488,514	2,353,828,648 (2,353,828,648)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,823.000	3,261,408.570	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,839,389.650	
		AMERICAN TOWER CORP	71,260.000	13,146,757.400	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,601,853.610	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,518.000	4,236,679.020	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,473.000	1,505,089.500	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,796,990.640	
		CROWN CASTLE INC	67,799.000	6,746,678.490	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	45,607.000	6,451,566.220	
		EQUINIX INC	14,804.000	11,216,694.720	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,713,539.100	
		EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	3,614,147.200	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,561,792.350	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	34,180.000	5,013,180.600	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	41,252.000	1,826,226.040	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,133.000	1,762,100.150	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	2,025,011.100	
		INVITATION HOMES INC	96,467.000	3,355,122.260	
		IRON MOUNTAIN INC	43,616.000	3,479,248.320	
		KIMCO REALTY	95,524.000	1,813,045.520	
		MID AMERICA	17,537.000	2,375,737.390	
		PROLOGIS INC	142,980.000	15,368,920.200	
		PUBLIC STORAGE	24,573.000	6,780,673.620	
		REALTY INCOME CORP	129,955.000	7,148,824.550	
		REGENCY CENTERS CORP	27,176.000	1,618,874.320	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	16,539.000	3,266,617.890	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	48,901.000	7,223,655.720	
		SUN COMMUNITIES INC	18,509.000	2,174,807.500	
		UDR INC	50,449.000	1,969,528.960	
		VENTAS INC	60,757.000	2,889,602.920	
		VICI PROPERTIES INC	152,711.000	4,504,974.500	

		WELLTOWER INC	86,083.000	8,507,582.890	
		WEYERHAEUSER CO	114,764.000	3,554,241.080	
		WP CAREY INC	32,996.000	1,926,636.440	
	アメリカ・ドル　小計		1,947,147.000	148,277,198.440 (23,128,277,412)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	811,191.320	
		SEGRO PLC	165,081.000	1,453,042.960	
	イギリス・ポンド　小計		286,426.000	2,264,234.280 (442,069,101)	
	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	401,822.540	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	255,449.040	
	カナダ・ドル　小計		23,146.000	657,271.580 (74,942,106)	
	ユーロ	COVIVIO	5,066.000	245,093.080	
		GECINA SA	8,697.000	869,700.000	
		KLEPIERRE	36,407.000	926,194.080	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,477.000	1,467,443.340	
		WAREHOUSES DE PAUW	31,043.000	802,151.120	
	ユーロ　小計		99,690.000	4,310,581.620 (724,005,289)	
	香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	14,518,106.400	
	香港・ドル　小計		410,116.000	14,518,106.400 (289,781,404)	
投資証券　合計			2,766,525	24,659,075,312 (24,659,075,312)	
合計				27,012,903,960 (27,012,903,960)	

（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	590銘柄	71.88	－	－	－	75.43
	投資証券	34銘柄	－	－	－	1.54	
イギリス・ポンド	株式	81銘柄	4.10	－	－	－	4.24
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.03	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.10	－	－	－	0.10
オーストラリア・ドル	株式	51銘柄	1.82	－	－	－	1.99
	投資信託受益証券	7銘柄	－	－	0.12	－	

カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.16	－	－	－	3.25
	新株予約権証券	1銘柄	－	0.00	－	－	
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.00	
シンガポール・ドル	株式	15銘柄	0.29	－	－	－	0.33
	投資信託受益証券	4銘柄	－	－	0.03	－	
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.52	－	－	－	2.59
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	0.84	－	－	－	0.87
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	0.98	－	－	－	1.00
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	11銘柄	0.16	－	－	－	0.16
ユーロ	株式	217銘柄	9.14	－	－	－	9.44
	投資証券	5銘柄	－	－	－	0.05	
香港・ドル	株式	26銘柄	0.51	－	－	－	0.54
	投資証券	1銘柄	－	－	－	0.02	

（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）

	2024年5月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,481,946,926
国債証券	477,319,919,850
地方債証券	27,509,456,560
特殊債券	27,406,115,481
社債券	23,262,855,200
未収利息	831,437,404
前払費用	153,706,338
流動資産合計	559,965,437,759
資産合計	559,965,437,759
負債の部	
流動負債	
未払金	775,339,000
未払解約金	2,198,261,000
流動負債合計	2,973,600,000
負債合計	2,973,600,000
純資産の部	
元本等	
元本	458,096,918,070
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	98,894,919,689
元本等合計	556,991,837,759
純資産合計	556,991,837,759
負債純資産合計	559,965,437,759

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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	438,127,800,594円
同期中追加設定元本額	283,745,188,246円
同期中一部解約元本額	263,776,070,770円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	30,481,732,335円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	55,031,877円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	89,311,924円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	50,509,274円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	656,540,044円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	289,773,929円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	34,881,706円
たわらノーロード　国内債券	19,344,129,692円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	6,465,237,353円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,614,745,368円
たわらノーロード　バランス（標準型）	3,281,517,916円
たわらノーロード　バランス（積極型）	466,531,064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）	192,315,757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）	2,532,556,243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）	2,926,499,965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）	923,179,863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）	40,571,112円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	21,403,172円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	200,566,669円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	8,191,712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＞	12,802,922,006円
Ｏｎｅグローバルバランス	159,401,890円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	11,583,143,639円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	16,902,174,052円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	7,965,731,496円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,577,874,366円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,863,080,547円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	559,993,500円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	94,093,897円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	3,527,854,747円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	6,436,914円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	5,707,899,769円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	2,492,819,028円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	537,588,742円
投資のソムリエ	95,757,600,404円
クルーズコントロール	825,979,138円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	9,964,738,979円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	8,253,140,114円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	2,445,755,175円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	10,860,905,503円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	33,890,651,392円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	475,476,695円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	244,099,044円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	100,514,439円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,927,747,214円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	4,883,681,650円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	10,821,855,081円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	6,383,173,579円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	711,668,086円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	262,633,080円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	162,399,338円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	2,515,067,519円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	40,370,385円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	168,231,874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）	1,184,343,057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）	1,188,576,778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）	1,176,399,440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）	715,921,514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）	1,173,541,074円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	3,023,004,718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）	2,057,513,627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）	825,404,410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）	2,105,491,367円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	1,304,385,768円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	10,636,699,468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）	2,014,556,875円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	1,492,873,884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）	603,246,299円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	274,365,755円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	3,475,095,413円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	3,486,432,712円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	3,459,020,369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）	1,965,182,850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）	54,027,572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）	795,265,248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）	154,950,103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）	104,255,954円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,729,996円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	57,159,392円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,831,970円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	405,463円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,062,823円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	58,099,618円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,614,582,631円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,184,560,399円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,519,559,789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）	58,586,164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）	125,854,967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）	1,529,418,170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）	100,248,274円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	596,505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）	1,396,294,441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）	28,824,887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）	269,771,727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）	482,218,520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）	796,677,225円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	205,408,605円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	55,923,953円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	387,569,601円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	265,939,792円
コア資産形成ファンド	127,149,287円
たわらノーロード　国内債券＜ラップ専用＞	20,222,504,654円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	29,891,968,567円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	21,091,078,095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］	149,102,012円
計	458,096,918,070円
２．　受益権の総数	458,096,918,070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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	2024年5月13日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△8,210,765,550
地方債証券	△283,942,397
特殊債券	△366,712,026
社債券	△177,267,600
合計	△9,038,687,573

（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（2024年2月15日から2024年5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）

	2024年5月13日現在
1口当たり純資産額	1.2159円

（1万口当たり純資産額）	(12,159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

2024年5月13日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４５０回　利付国庫債券（２年）	8,800,000,000	8,786,008,000	
	４５１回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	998,050,000	
	４５５回　利付国庫債券（２年）	2,900,000,000	2,888,777,000	
	４５６回　利付国庫債券（２年）	9,300,000,000	9,274,239,000	
	４５７回　利付国庫債券（２年）	3,200,000,000	3,189,568,000	
	４５８回　利付国庫債券（２年）	3,300,000,000	3,294,093,000	
	４５９回　利付国庫債券（２年）	1,800,000,000	1,796,292,000	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	7,300,000,000	7,290,583,000	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	4,700,000,000	4,688,344,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	1,050,000,000	1,044,298,500	
	１４８回　利付国庫債券（５年）	4,610,000,000	4,578,237,100	
	１４９回　利付国庫債券（５年）	1,680,000,000	1,666,845,600	
	１５０回　利付国庫債券（５年）	3,570,000,000	3,538,227,000	
	１５１回　利付国庫債券（５年）	1,600,000,000	1,583,744,000	
	１５２回　利付国庫債券（５年）	1,790,000,000	1,776,610,800	
	１５３回　利付国庫債券（５年）	5,210,000,000	5,150,085,000	
	１５４回　利付国庫債券（５年）	3,300,000,000	3,267,759,000	
	１５５回　利付国庫債券（５年）	2,700,000,000	2,688,957,000	
	１５６回　利付国庫債券（５年）	7,200,000,000	7,144,992,000	
	１５７回　利付国庫債券（５年）	100,000,000	99,110,000	

１５８回　利付国庫債券（５年）	3,600,000,000	3,554,316,000	
１５９回　利付国庫債券（５年）	3,200,000,000	3,154,240,000	
１６０回　利付国庫債券（５年）	7,100,000,000	7,027,083,000	
１６３回　利付国庫債券（５年）	3,000,000,000	2,989,110,000	
１６４回　利付国庫債券（５年）	1,500,000,000	1,478,745,000	
１６５回　利付国庫債券（５年）	2,900,000,000	2,871,957,000	
１６６回　利付国庫債券（５年）	1,500,000,000	1,492,575,000	
１６７回　利付国庫債券（５年）	1,400,000,000	1,390,732,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	121,621,500	
２回　利付国庫債券（４０年）	330,000,000	351,156,300	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	573,048,000	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	761,104,800	
５回　利付国庫債券（４０年）	710,000,000	717,696,400	
６回　利付国庫債券（４０年）	940,000,000	924,490,000	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,030,000,000	964,131,500	
８回　利付国庫債券（４０年）	990,000,000	854,657,100	
９回　利付国庫債券（４０年）	2,090,000,000	1,302,529,800	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,730,000,000	1,266,135,100	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,440,000,000	1,007,798,400	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,420,000,000	875,586,200	
１３回　利付国庫債券（４０年）	1,790,000,000	1,086,476,300	
１４回　利付国庫債券（４０年）	2,200,000,000	1,424,082,000	
１５回　利付国庫債券（４０年）	2,740,000,000	1,954,003,600	
１６回　利付国庫債券（４０年）	2,400,000,000	1,873,008,000	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	3,980,000,000	3,990,905,200	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	3,300,000,000	3,309,108,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	3,620,000,000	3,622,570,200	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	3,520,000,000	3,507,046,400	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,090,000,000	4,069,918,100	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	3,570,000,000	3,549,972,300	

３４５回　利付国庫債券（１０年）	4,890,000,000	4,858,459,500	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	4,540,000,000	4,506,040,800	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	4,500,000,000	4,461,345,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	4,070,000,000	4,030,236,100	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	2,350,000,000	2,323,703,500	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	10,400,000,000	10,268,024,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	3,400,000,000	3,351,380,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	4,950,000,000	4,868,721,000	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	3,690,000,000	3,621,144,600	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	2,460,000,000	2,409,988,200	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	3,730,000,000	3,648,499,500	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	3,400,000,000	3,320,406,000	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	2,700,000,000	2,632,527,000	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	7,750,000,000	7,541,602,500	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	4,050,000,000	3,933,117,000	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	4,100,000,000	3,970,891,000	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	4,000,000,000	3,863,160,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	4,210,000,000	4,054,145,800	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	4,470,000,000	4,291,423,500	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	5,350,000,000	5,120,110,500	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	3,730,000,000	3,558,158,900	
３６６回　利付国庫債券（１０年）	6,280,000,000	6,019,442,800	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	6,900,000,000	6,592,536,000	
３６８回　利付国庫債券（１０年）	4,750,000,000	4,523,282,500	
３６９回　利付国庫債券（１０年）	6,820,000,000	6,644,589,600	

３７０回　利付国庫債券（１０年）	5,900,000,000	5,732,381,000	
３７１回　利付国庫債券（１０年）	3,800,000,000	3,649,368,000	
３７２回　利付国庫債券（１０年）	5,000,000,000	4,963,250,000	
３７３回　利付国庫債券（１０年）	7,600,000,000	7,385,376,000	
３７４回　利付国庫債券（１０年）	2,450,000,000	2,420,159,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	123,062,500	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	110,412,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	229,008,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	224,530,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	268,517,500	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	255,019,400	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	165,021,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	386,838,400	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	298,519,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	275,714,400	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	307,710,900	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	451,776,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	316,528,800	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	380,275,500	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	350,619,300	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	334,488,900	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	403,623,500	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	373,210,200	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	707,947,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	714,816,600	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	886,762,800	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	977,974,800	

３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	987,685,600	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	796,305,600	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,083,936,200	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,264,948,200	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,316,520,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	1,128,306,400	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,453,145,300	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,416,875,200	
３８回　利付国庫債券（３０年）	850,000,000	868,955,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,210,000,000	1,254,842,600	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,030,000,000	1,048,807,800	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	1,059,215,600	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	996,300,000	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,610,000,000	1,601,595,800	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,130,000,000	1,122,361,200	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,150,000,000	1,101,458,500	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,670,000,000	1,596,453,200	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,340,000,000	1,301,997,600	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,140,321,800	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,212,510,000	
５０回　利付国庫債券（３０年）	2,250,000,000	1,850,715,000	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,520,000,000	1,107,821,600	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,066,534,000	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	947,488,600	
５４回　利付国庫債券（３０年）	2,290,000,000	1,856,113,700	

５５回　利付国庫債券（３０年）	1,080,000,000	872,456,400	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,040,000,000	837,335,200	
５７回　利付国庫債券（３０年）	2,030,000,000	1,627,654,000	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,660,000,000	1,325,493,400	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	869,780,800	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,130,000,000	918,158,900	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,560,000,000	1,201,808,400	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,020,000,000	742,600,800	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	845,904,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	490,931,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	628,497,000	
６６回　利付国庫債券（３０年）	1,090,000,000	757,332,000	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,270,000,000	929,233,600	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,540,000,000	1,122,398,200	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,015,104,000	
７０回　利付国庫債券（３０年）	2,100,000,000	1,561,707,000	
７１回　利付国庫債券（３０年）	2,480,000,000	1,837,481,600	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,290,000,000	952,239,300	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,290,000,000	948,717,600	
７４回　利付国庫債券（３０年）	1,390,000,000	1,107,691,000	
７５回　利付国庫債券（３０年）	1,520,000,000	1,305,102,400	
７６回　利付国庫債券（３０年）	1,320,000,000	1,158,867,600	
７７回　利付国庫債券（３０年）	2,200,000,000	2,023,318,000	
７８回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,049,088,000	
７９回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	995,928,000	

８０回　利付国庫債券（３０年）	2,000,000,000	1,920,680,000	
８１回　利付国庫債券（３０年）	1,900,000,000	1,737,683,000	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	254,810,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,017,000	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	91,929,600	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	409,744,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	143,599,400	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	72,061,500	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	174,734,500	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	609,582,100	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	124,424,400	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	124,203,600	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	614,254,900	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,390,200	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	490,463,800	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	115,046,800	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,212,513,200	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	387,168,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	702,977,400	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	582,543,500	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	126,364,800	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	699,652,800	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	169,083,200	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	795,135,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	885,958,600	

１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	247,250,000	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	539,480,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	171,988,800	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	117,355,700	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	684,499,200	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	536,900,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	643,188,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	733,456,200	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	372,757,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	472,771,200	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	498,525,000	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	798,297,200	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,482,353,700	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	2,010,000,000	2,181,111,300	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	1,360,000,000	1,483,175,200	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	579,719,300	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	511,425,800	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	601,969,650	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	504,234,800	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	530,365,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	691,552,000	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	612,419,400	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,450,000,000	1,587,619,500	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	662,064,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	991,854,500	

１２７回　利付国庫債券（２０年）	1,140,000,000	1,235,053,200	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	726,601,600	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	981,371,300	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,178,573,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,165,400	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	1,230,000,000	1,327,662,000	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	432,092,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	139,464,000	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	383,392,800	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	480,000,000	515,020,800	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,120,706,200	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	980,000,000	1,043,611,800	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,019,739,500	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,138,153,800	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	465,169,700	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,230,000,000	1,310,232,900	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	792,405,000	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,250,000,000	2,416,657,500	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	2,240,000,000	2,403,923,200	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	1,290,000,000	1,371,631,200	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	1,730,000,000	1,822,260,900	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,290,000,000	2,409,400,600	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	3,330,000,000	3,466,330,200	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	2,060,000,000	2,099,490,200	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	2,240,000,000	2,278,259,200	

１５３回　利付国庫債券（２０年）	3,640,000,000	3,734,166,800	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	2,420,000,000	2,453,081,400	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,256,538,800	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,099,469,600	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	3,780,000,000	3,380,567,400	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,140,000,000	1,977,766,600	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	1,840,000,000	1,715,376,800	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	1,820,000,000	1,711,054,800	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	1,760,000,000	1,626,627,200	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	1,930,000,000	1,775,252,600	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,930,000,000	2,683,616,300	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	3,450,000,000	3,102,378,000	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	2,150,000,000	1,923,239,500	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	1,540,000,000	1,411,148,200	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	1,750,000,000	1,550,570,000	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	3,090,000,000	2,683,726,800	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	2,220,000,000	1,887,333,000	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,351,952,000	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,740,000,000	1,462,122,000	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,380,000,000	1,172,848,200	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,460,000,000	2,079,388,800	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	2,000,000,000	1,681,280,000	
１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,020,000,000	1,718,373,600	
１７６回　利付国庫債券（２０年）	3,200,000,000	2,707,680,000	
１７７回　利付国庫債券（２０年）	2,100,000,000	1,735,986,000	

	１７８回　利付国庫債券（２０年）	3,400,000,000	2,847,534,000	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	2,200,000,000	1,833,612,000	
	１８０回　利付国庫債券（２０年）	2,320,000,000	2,031,276,000	
	１８１回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	1,686,098,000	
	１８２回　利付国庫債券（２０年）	2,750,000,000	2,517,405,000	
	１８３回　利付国庫債券（２０年）	2,700,000,000	2,592,837,000	
	１８４回　利付国庫債券（２０年）	1,980,000,000	1,801,404,000	
	１８５回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	1,541,798,000	
	１８６回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	1,840,625,000	
	１８７回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	1,586,015,000	
	１８８回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	685,538,000	
国債証券　合計		499,315,000,000	477,319,919,850	
地方債証券	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,092,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	108,563,400	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	193,726,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	387,820,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	289,488,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	221,810,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	104,331,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	102,535,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	208,372,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	313,266,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	107,610,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	108,426,000	
	３１回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	202,730,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,145,000	
	３０年度８回　北海道公募公債	400,000,000	394,536,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	392,536,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	96,026,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	240,977,500	
	２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	195,836,000	

２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	192,752,000	
２５８回　神奈川県公募公債　１０年	300,000,000	286,605,000	
３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	115,270,000	
１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	107,359,000	
１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	326,409,000	
１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	107,335,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	98,979,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,213,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	191,392,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	192,054,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	191,130,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	190,038,000	
４７４回　大阪府公募公債　１０年	300,000,000	284,859,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	213,290,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	100,177,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	91,697,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	296,547,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	108,014,760	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	387,696,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	193,032,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	193,664,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	96,104,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	110,949,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	205,364,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	309,126,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	101,948,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	100,657,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	193,830,000	

令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	96,508,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	191,982,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	102,876,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	103,189,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	201,730,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	102,555,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	322,470,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	326,127,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	105,919,000	
２６年度４回　愛知県公募公債　２０年	200,000,000	209,188,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	142,612,500	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	100,216,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	195,216,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	204,648,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	98,651,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	192,950,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	78,998,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	83,640,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	194,210,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	165,114,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	208,845,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	108,680,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	105,611,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	313,869,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	100,294,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	99,406,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	196,416,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	194,056,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	96,399,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	102,890,000	
令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	138,960,000	

２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	106,552,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	108,838,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	317,844,000	
２７年度４回　千葉県公募公債	200,000,000	200,830,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	99,434,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	190,122,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	101,642,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	99,875,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	90,334,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	192,496,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	104,412,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,780,000	
１５０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,921,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,199,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,234,400	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,466,000	
１６０回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,805,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	496,385,000	
１６９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	496,210,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	396,504,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,856,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,982,000	
１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	494,805,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,249,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	292,464,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	485,480,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,818,000	

２２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	477,855,000	
２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	475,630,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	98,188,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	192,570,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	197,750,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	290,460,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	214,588,000	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	193,266,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	104,323,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	100,462,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	104,828,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	218,152,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	213,128,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	295,965,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	145,040,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	387,480,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	113,656,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	106,642,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	104,430,000	
２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	106,180,000	
２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	272,301,000	
第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	196,722,000	
６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	215,636,000	
５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	105,787,000	
６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	106,462,000	
１１回　北九州市公募公債　２０年	300,000,000	325,860,000	
１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	104,368,000	
２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	109,528,000	
３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	180,498,000	
２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	83,359,000	
２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	182,262,000	
２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	296,772,000	

	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	90,636,000	
	令和３年度３回　仙台市公募公債　５年	300,000,000	296,385,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	194,092,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	192,570,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	195,546,000	
地方債証券　合計		27,939,330,000	27,509,456,560	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	204,700,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	203,052,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	297,489,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	412,950,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,595,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	72,939,000	
	１５６回　日本政策投資銀行債券	400,000,000	381,080,000	
	３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,104,000	
	１回　高速道路機構債	300,000,000	354,201,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	170,653,500	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	228,818,000	
	３６回　高速道路機構債	300,000,000	345,573,000	
	５０回　高速道路機構債	300,000,000	255,480,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,765,000	
	１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,229,000	
	１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,626,000	
	１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	94,497,000	
	１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	93,509,000	
	１６９回　高速道路機構債	100,000,000	87,176,000	
	１７２回　高速道路機構債	200,000,000	176,870,000	
	２１０回　高速道路機構債	100,000,000	89,485,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,115,000	
	１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,108,000	
	１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	535,090,000	
	１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,316,000	
	１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,047,000	

２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	301,434,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,458,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,251,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	183,860,000	
第２６２回　政保道路債	500,000,000	496,685,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	89,817,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	298,008,000	
２８６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	179,092,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,179,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	793,072,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	183,452,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	90,473,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	207,135,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	126,076,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	142,184,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	143,884,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	578,555,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	212,948,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	323,982,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	324,591,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	108,807,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,566,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	214,128,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	105,810,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	212,028,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,438,000	
Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,020,000	

３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	104,133,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,440,000	
４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	293,982,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	201,216,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	291,939,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	397,084,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,154,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	91,472,000	
９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	495,275,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,107,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,867,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,590,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	243,741,000	
１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	208,773,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	496,980,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	214,204,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,352,130	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	102,699,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	102,136,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	202,026,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	146,288,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	103,903,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	215,308,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,285,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	379,487,500	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,566,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,833,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,104,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	254,005,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,874,000	

１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,183,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,279,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,421,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,571,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	88,802,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,420,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,420,000	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,203,000	14,622,130	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,430,000	92,895,412	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,248,000	138,611,060	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,987,000	19,540,660	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,288,000	16,785,109	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,115,000	19,612,372	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,179,000	20,698,811	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,391,000	24,924,675	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,494,000	61,096,520	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,156,000	27,532,653	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,269,000	33,298,276	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,793,000	33,816,655	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,364,000	37,279,557	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,874,000	38,477,873	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,215,000	42,873,959	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,730,000	48,504,155	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,561,000	50,559,685	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,957,000	184,299,518	

１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,667,000	63,069,648	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,216,000	62,747,605	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,682,000	63,108,511	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	207,975,000	195,394,592	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	207,453,000	194,806,665	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,884,000	133,044,626	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	211,887,000	198,133,414	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	210,315,000	196,741,269	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	366,725,000	343,907,370	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,932,000	68,332,908	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,336,000	69,677,513	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	244,305,000	224,281,762	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	325,528,000	299,671,310	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	250,050,000	230,451,081	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	256,449,000	236,369,043	
１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	783,441,000	720,044,954	
６回　沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	407,704,000	
２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,358,000	
い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,665,000	
い第８５１号　利付商工債	300,000,000	297,240,000	
い第８５４号　利付商工債	300,000,000	296,505,000	
い第８５５号　利付商工債	200,000,000	197,582,000	
３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	398,560,000	
３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	297,294,000	
１５回　国際協力機構債	100,000,000	106,124,000	
７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	197,348,000	
７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	294,963,000	
８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	298,644,000	
８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	396,920,000	
７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,325,000	

	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	191,352,000	
特殊債券　合計		28,016,099,000	27,406,115,481	
社債券	２５回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１７）	300,000,000	295,296,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	99,059,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	397,672,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	82,527,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	99,157,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	193,914,000	
	７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	297,099,000	
	８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,066,000	
	９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	197,970,000	
	９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	494,485,000	
	３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	298,044,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	198,906,000	
	６１回　西日本高速道路債券	500,000,000	495,060,000	
	６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	494,480,000	
	２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	197,928,000	
	３回　ダイドーグループＨＤ社債	300,000,000	289,329,000	
	９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	91,677,000	
	１２回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	100,000,000	100,454,000	
	１４回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,030,000	
	３０回　東レ社債	300,000,000	297,060,000	
	４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	198,012,000	
	２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	178,874,000	
	４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	98,884,000	
	１７回　ダイセル社債	300,000,000	288,648,000	
	１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	471,040,000	
	４回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債	300,000,000	288,639,000	
	１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	293,007,000	
	３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	296,523,000	
	１７回　パナソニック社債	100,000,000	99,479,000	
	１９回　パナソニック社債	100,000,000	96,485,000	
	２３回　パナソニック社債	200,000,000	191,102,000	
	５８回　川崎重工業社債	300,000,000	282,117,000	
	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	98,151,000	
	２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	198,170,000	
	２６回　豊田通商社債	100,000,000	89,731,000	

７３回　三井物産社債	400,000,000	388,420,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	398,400,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	104,718,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,325,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	296,445,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,129,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	295,371,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	386,768,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	296,733,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,619,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,010,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	192,434,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	286,329,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	97,335,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	197,848,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,424,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	191,636,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	296,037,000	
３回　野村ホールディングス社債	300,000,000	295,650,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	99,528,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	198,324,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	101,851,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	86,688,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	305,640,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	204,616,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	107,162,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,296,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	215,156,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	89,631,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	82,210,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	88,834,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,577,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	64,311,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,201,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	164,266,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	142,672,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,863,000	

	６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	192,900,000	
	７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	73,083,000	
	７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	64,869,000	
	７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,183,000	
	７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	163,778,000	
	３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,491,000	
	４回　東京地下鉄社債	120,000,000	124,549,200	
	４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	63,092,000	
	７回　ニッコンＨＤ社債	300,000,000	288,399,000	
	６回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	192,614,000	
	１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	387,700,000	
	３０回　光通信社債	200,000,000	186,500,000	
	５２７回　中部電力社債	100,000,000	89,568,000	
	５３２回　中部電力社債	200,000,000	193,456,000	
	４９７回　関西電力社債	100,000,000	100,634,000	
	５０８回　関西電力社債	300,000,000	297,741,000	
	５３０回　関西電力社債	400,000,000	389,868,000	
	５３１回　関西電力社債	200,000,000	168,010,000	
	５４１回　関西電力社債	300,000,000	284,310,000	
	３９６回　中国電力社債	200,000,000	191,432,000	
	４２５回　中国電力社債	100,000,000	96,422,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	100,888,000	
	３１１回　北陸電力社債	100,000,000	100,400,000	
	４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,132,000	
	５２１回　東北電力社債	400,000,000	387,584,000	
	５２５回　東北電力社債	200,000,000	196,530,000	
	５３６回　東北電力社債	300,000,000	282,549,000	
	３２０回　四国電力社債	300,000,000	286,110,000	
	４６３回　九州電力社債	100,000,000	87,610,000	
	４６６回　九州電力社債	100,000,000	86,403,000	
	４９１回　九州電力社債	300,000,000	285,171,000	
	４９２回　九州電力社債	100,000,000	80,696,000	
	４９３回　九州電力社債	200,000,000	197,850,000	
	５０７回　九州電力社債	200,000,000	191,700,000	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	297,957,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	174,988,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	203,598,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	98,752,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	189,064,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	179,204,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	83,956,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	80,545,000	
	５７回　東京瓦斯社債	300,000,000	181,539,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	197,312,000	
	８回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	178,186,000	
社債券　合計		24,320,000,000	23,262,855,200	
合計			555,498,347,091	

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）

	2024年5月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,127,997,573
国債証券	253,976,453,865
派生商品評価勘定	1,807,054
未収入金	1,062,295,902
未収利息	2,122,431,545
前払費用	294,982,593
流動資産合計	260,585,968,532
資産合計	260,585,968,532
負債の部	
流動負債	
前受金	475,061,048
未払金	926,173,105
未払解約金	1,572,605,000
流動負債合計	2,973,839,153
負債合計	2,973,839,153
純資産の部	
元本等	
元本	107,083,069,380
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	150,529,059,999
元本等合計	257,612,129,379
純資産合計	257,612,129,379
負債純資産合計	260,585,968,532

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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	111,298,961,852円
同期中追加設定元本額	19,407,673,850円
同期中一部解約元本額	23,623,566,322円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,229,147,582円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,774,331円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	10,463,837円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	31,539,332円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	21,166,121円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	33,941,440円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	21,795,399円
たわらノーロード　先進国債券	21,201,386,271円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,448,191,888円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	69,916,908円
たわらノーロード　バランス（標準型）	405,126,589円
たわらノーロード　バランス（積極型）	96,640,730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）	16,893,802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）	1,046,087,495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）	1,897,110,894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）	985,133,979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）	769,237,312円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,219,288円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	11,967,664円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	191,083,496円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	25,962,691円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	41,617,538円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,932,984,234円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	1,621,337,280円
Ｏｎｅグローバルバランス	87,481,757円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	733,844,523円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,430,100,443円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,952,485,292円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	380,722,186円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	852,018,246円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	819,061,299円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	25,663,517円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	961,381,549円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	17,942,671円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	154,157,168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）	272,620,908円
クルーズコントロール	643,465,004円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	226,647,379円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	920,773,340円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	706,047,234円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	176,764,787円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	527,777,107円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	5,068,630円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	90,036,902円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	920,086,057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）	281,840,540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）	283,185,298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）	394,630,212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）	170,324,445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）	544,565円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	721,195,741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）	327,442,921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）	195,415,036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）	949,162,544円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	466,201,708円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	5,428,164,234円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	1,375,357,405円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,510,207,940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）	222,926,346円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,560,014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）	468,065,095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）	314,439,489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）	212,797,796円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,590,056円

ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,426,714円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,878,570円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,717円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,561,580円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,746,222円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,166,466,564円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,206,745,924円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,304,499,992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）	49,800,015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）	89,851,031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）	1,034,692,882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）	186,390,717円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	152,152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）	177,920,599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）	245,881,085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）	324,940,666円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,849,698円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	52,571,556円
コア資産形成ファンド	25,616,459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＞	3,622,606,946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＞	11,886,169,211円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	5,972,362,832円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	5,105,093,798円
計	107,083,069,380円
２．　受益権の総数	107,083,069,380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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	2024年5月13日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,448,629,274
合計	△1,448,629,274

（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（2024年2月22日から2024年5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	2024年5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	1,023,101,000	－	1,024,908,054	1,807,054
アメリカ・ドル	508,270,000	－	509,434,513	1,164,513
イギリス・ポンド	72,460,000	－	72,603,151	143,151
オフショア・人民元	96,143,000	－	96,220,693	77,693
ユーロ	346,228,000	－	346,649,697	421,697
合計	1,023,101,000	－	1,024,908,054	1,807,054

（注）時価の算定方法

為替予約取引

１．　計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によって

おります。
・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
２．　計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
３．　換算において円未満の端数は切捨てております。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4057円 (24,057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

2024年5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	1,606,198.220	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,315,839.830	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,586,175.780	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,375,371.270	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,484,884.390	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,733,281.240	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,274,281.250	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,302,332.010	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,308,225.970	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,836,127.160	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,714,765.640	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,780,129.460	
		US T N/B 0.5 04/30/27	4,270,000.000	3,781,785.530	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,630,606.640	
		US T N/B 0.5 06/30/27	780,000.000	686,674.210	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,676,782.790	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,181,340.620	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,855,124.990	
		US T N/B 0.625 05/15/30	6,050,000.000	4,824,875.000	
		US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,656,041.010	
		US T N/B 0.625 08/15/30	7,740,000.000	6,116,111.670	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,394,980.450	
		US T N/B 0.625 12/31/27	4,020,000.000	3,489,234.350	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,680,000.000	4,069,589.040	

US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,299,378.870	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,541,445.310	
US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,183,998.430	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,519,001.950	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,510,000.000	4,154,044.720	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,510,000.000	4,119,426.960	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,680,000.000	6,930,437.500	
US T N/B 1.0 07/31/28	7,270,000.000	6,285,568.130	
US T N/B 1.125 02/15/31	8,690,000.000	7,018,532.800	
US T N/B 1.125 02/28/27	3,600,000.000	3,266,789.070	
US T N/B 1.125 02/29/28	4,690,000.000	4,127,566.370	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	1,989,281.250	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,060,000.000	2,422,281.610	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,730,000.000	4,101,519.730	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,114,137.870	
US T N/B 1.25 03/31/28	4,610,000.000	4,067,604.680	
US T N/B 1.25 04/30/28	4,700,000.000	4,136,917.950	
US T N/B 1.25 05/15/50	5,380,000.000	2,610,981.250	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,635,680.060	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,249,945.490	
US T N/B 1.25 08/15/31	9,960,000.000	7,980,839.030	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,331,530.090	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,309,679.660	
US T N/B 1.25 12/31/26	4,290,000.000	3,925,182.420	
US T N/B 1.375 08/15/50	6,370,000.000	3,189,230.030	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,800,000.000	2,593,609.360	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,111,038.850	
US T N/B 1.375 11/15/31	8,890,000.000	7,137,697.580	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	2,676,374.980	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	3,996,699.220	
US T N/B 1.5 01/31/27	4,740,000.000	4,355,337.890	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,830,000.000	4,100,594.530	
US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,380,175.800	
US T N/B 1.625 02/15/26	6,090,000.000	5,753,503.670	
US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,855,155.060	
US T N/B 1.625 05/15/31	8,740,000.000	7,252,151.490	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,434,062.500	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,441,681.630	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,236,498.810	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,280,000.000	2,830,471.870	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,675,664.060	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	3,971,337.880	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,310,000.000	3,453,366.780	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,450,000.000	2,130,830.060	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,956,612.890	
US T N/B 1.875 02/15/32	5,980,000.000	4,960,012.850	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,100,000.000	3,429,550.780	
US T N/B 1.875 02/15/51	5,780,000.000	3,307,921.100	
US T N/B 1.875 02/28/27	5,210,000.000	4,827,288.850	

		US T N/B 1.875 02/28/29	4,700,000.000	4,165,283.190	
		US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,710,124.970	
		US T N/B 1.875 07/31/26	3,200,000.000	3,005,124.990	
		US T N/B 1.875 11/15/51	5,370,000.000	3,052,823.990	
		US T N/B 2.0 02/15/50	4,020,000.000	2,396,767.950	
		US T N/B 2.0 08/15/25	3,550,000.000	3,419,371.070	
		US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,418,821.860	
		US T N/B 2.0 11/15/41	3,350,000.000	2,266,026.360	
		US T N/B 2.125 05/15/25	2,950,000.000	2,863,713.820	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,850,000.000	2,700,486.300	
		US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,542,642.560	
		US T N/B 2.25 02/15/52	5,000,000.000	3,123,144.530	
		US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,145,570.290	
		US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,148,127.690	
		US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,936,574.990	
		US T N/B 2.25 08/15/46	1,570,000.000	1,030,189.850	
		US T N/B 2.25 08/15/49	4,140,000.000	2,631,972.620	
		US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	4,917,199.960	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,020,981.840	
		US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,588,905.860	
		US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,623,750.000	
		US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,964,725.000	
		US T N/B 2.375 05/15/27	4,830,000.000	4,522,276.140	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,770,000.000	3,409,493.750	
		US T N/B 2.375 05/15/51	5,760,000.000	3,721,724.950	
		US T N/B 2.375 11/15/49	3,890,000.000	2,540,428.310	
		US T N/B 2.5 02/15/45	700,000.000	491,886.710	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,370,000.000	951,133.190	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,185,638.260	
		US T N/B 2.5 03/31/27	4,000,000.000	3,767,812.470	
		US T N/B 2.5 05/15/46	1,730,000.000	1,197,889.850	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,366,837.110	
		US T N/B 2.625 02/15/29	5,330,000.000	4,897,041.570	
		US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,627,195.480	
		US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,801,434.950	
		US T N/B 2.625 12/31/25	3,000,000.000	2,890,839.840	
		US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,251,639.080	
		US T N/B 2.75 05/15/25	2,200,000.000	2,148,656.660	
		US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,037,224.590	
		US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,013,390.610	
		US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,604,975.790	
		US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	6,896,903.100	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	938,185.930	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,600,547.650	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,777,101.560	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,056,000.000	796,702.490	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,611,914.050	
		US T N/B 2.875 04/30/29	3,300,000.000	3,059,009.770	
		US T N/B 2.875 05/15/28	3,560,000.000	3,339,864.040	

US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,172,046.870	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,753,817.970	
US T N/B 2.875 05/15/49	4,800,000.000	3,490,874.970	
US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,247,376.150	
US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,533,955.580	
US T N/B 2.875 06/15/25	2,420,000.000	2,362,950.380	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,143,625.000	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,704,228.920	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,470,000.000	1,099,973.430	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	799,200.000	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,360,000.000	3,254,737.510	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,160,000.000	1,632,065.620	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	1,987,396.470	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,610,000.000	2,693,539.430	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	852,862.500	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	988,865.620	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,221,771.090	
US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,124,562.490	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,510,000.000	2,624,410.530	
US T N/B 3.0 08/15/52	4,740,000.000	3,502,230.460	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,702,866.200	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,206,244.910	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,960,000.000	1,509,276.540	
US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	656,690.620	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,098,731.240	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,540,000.000	1,229,834.370	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,169,150.780	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,959,221.070	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,647,262.880	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,040,000.000	2,900,053.110	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,906,574.400	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,180,000.000	3,938,507.010	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	827,116.400	
US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	3,083,567.190	
US T N/B 3.25 06/30/27	4,200,000.000	4,030,031.240	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,500,000.000	3,295,878.900	
US T N/B 3.375 05/15/33	7,000,000.000	6,416,210.910	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,730,000.000	1,421,776.170	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,433,124.220	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,450,000.000	2,762,021.450	
US T N/B 3.5 01/31/28	3,680,000.000	3,542,287.470	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,700,000.000	2,561,730.460	
US T N/B 3.5 02/15/33	7,250,000.000	6,723,666.950	
US T N/B 3.5 02/15/39	800,000.000	710,640.620	
US T N/B 3.5 04/30/28	3,100,000.000	2,979,269.530	
US T N/B 3.5 04/30/30	3,000,000.000	2,841,855.480	
US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,940,117.180	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,393,395.300	
US T N/B 3.625 02/15/53	3,800,000.000	3,176,265.630	

		US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,381,054.650	
		US T N/B 3.625 03/31/30	2,500,000.000	2,385,644.520	
		US T N/B 3.625 05/15/26	3,900,000.000	3,808,974.620	
		US T N/B 3.625 05/15/53	3,510,000.000	2,934,757.610	
		US T N/B 3.625 05/31/28	2,500,000.000	2,412,939.450	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,260,697.250	
		US T N/B 3.75 04/15/26	6,000,000.000	5,876,835.960	
		US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,359,179.670	
		US T N/B 3.75 06/30/30	3,200,000.000	3,069,562.490	
		US T N/B 3.75 08/15/41	1,220,000.000	1,084,656.240	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,273,336.710	
		US T N/B 3.875 01/15/26	4,300,000.000	4,226,345.680	
		US T N/B 3.875 02/15/43	3,500,000.000	3,122,724.600	
		US T N/B 3.875 05/15/43	800,000.000	712,734.370	
		US T N/B 3.875 08/15/33	8,000,000.000	7,616,718.720	
		US T N/B 3.875 09/30/29	2,950,000.000	2,858,849.590	
		US T N/B 3.875 11/30/27	3,300,000.000	3,220,078.120	
		US T N/B 3.875 11/30/29	2,800,000.000	2,711,078.120	
		US T N/B 3.875 12/31/27	3,600,000.000	3,512,109.380	
		US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,710,093.730	
		US T N/B 4.0 01/15/27	4,000,000.000	3,928,281.240	
		US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	3,937,656.240	
		US T N/B 4.0 02/15/34	2,500,000.000	2,400,195.300	
		US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	2,920,664.070	
		US T N/B 4.0 02/29/28	3,200,000.000	3,133,750.010	
		US T N/B 4.0 06/30/28	2,000,000.000	1,957,226.560	
		US T N/B 4.0 07/31/30	2,500,000.000	2,430,664.050	
		US T N/B 4.0 10/31/29	2,700,000.000	2,631,339.830	
		US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	2,837,615.620	
		US T N/B 4.0 11/15/52	4,760,000.000	4,265,127.350	
		US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,077,333.970	
		US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,633,539.080	
		US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,457,958.970	
		US T N/B 4.125 08/15/53	2,600,000.000	2,380,320.300	
		US T N/B 4.125 08/31/30	1,300,000.000	1,272,298.820	
		US T N/B 4.125 09/30/27	3,220,000.000	3,169,687.500	
		US T N/B 4.125 10/31/27	3,340,000.000	3,286,377.320	
		US T N/B 4.125 11/15/32	7,100,000.000	6,908,632.840	
		US T N/B 4.25 02/28/29	4,930,000.000	4,872,419.120	
		US T N/B 4.25 02/28/31	2,000,000.000	1,970,625.000	
		US T N/B 4.25 03/15/27	3,850,000.000	3,805,785.130	
		US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	916,082.020	
		US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,957,109.350	
		US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	953,750.000	
		US T N/B 4.375 05/15/40	1,210,000.000	1,176,015.990	
		US T N/B 4.375 05/15/41	1,430,000.000	1,380,787.880	
		US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	3,963,125.000	
		US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	1,907,031.240	
		US T N/B 4.375 08/31/28	3,500,000.000	3,474,501.940	

		US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,169,695.300	
		US T N/B 4.375 12/15/26	4,800,000.000	4,758,656.250	
		US T N/B 4.5 02/15/36	500,000.000	505,605.460	
		US T N/B 4.5 04/15/27	800,000.000	796,125.000	
		US T N/B 4.5 05/15/38	500,000.000	499,033.190	
		US T N/B 4.5 07/15/26	4,100,000.000	4,072,533.190	
		US T N/B 4.5 08/15/39	1,480,000.000	1,465,489.030	
		US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,543,713.090	
		US T N/B 4.5 11/15/33	7,000,000.000	6,992,890.660	
		US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	891,355.850	
		US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,612,771.690	
		US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,487,421.870	
		US T N/B 4.625 09/30/30	3,000,000.000	3,018,398.430	
		US T N/B 4.625 10/15/26	3,400,000.000	3,388,976.540	
		US T N/B 4.625 11/15/26	3,900,000.000	3,888,574.200	
		US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,243,693.350	
		US T N/B 4.75 11/15/43	2,620,000.000	2,622,660.920	
		US T N/B 4.75 11/15/53	2,500,000.000	2,541,992.190	
		US T N/B 4.875 10/31/28	3,000,000.000	3,038,496.080	
		US T N/B 4.875 10/31/30	1,500,000.000	1,530,000.000	
		US T N/B 5.0 05/15/37	855,000.000	901,123.230	
		US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,389,181.640	
		US T N/B 5.375 02/15/31	1,860,000.000	1,964,625.000	
		US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,450,718.740	
		US T N/B 6.125 11/15/27	1,200,000.000	1,258,593.740	
		US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	827,369.280	
	アメリカ・ドル　小計		872,000,000.000 (136,014,560,000)	765,837,302.190 (119,455,302,392)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,630,694.450	
		UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,158,337.270	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,716,830.960	
		UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,430,000.000	2,212,053.300	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,390,000.000	1,107,665.980	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,880,000.000	1,596,496.000	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	558,360.000	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	1,016,596.180	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,650,000.000	1,123,976.700	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,640,000.000	654,196.000	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,050,000.000	517,545.000	

UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,700,000.000	1,280,338.000	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,030,000.000	874,975.410	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,870,000.000	2,294,191.900	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,670,000.000	1,076,377.790	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	266,830.680	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	1,006,115.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,730,000.000	836,282.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,750,000.000	1,066,345.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,000,000.000	942,595.200	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,200,000.000	671,640.000	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,410,000.000	711,457.800	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	931,384.490	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	656,911.050	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	377,633.400	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	530,000.000	308,057.200	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,910,000.000	1,002,803.480	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,890,000.000	1,398,330.860	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,073,092.500	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	784,955.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,660,000.000	1,372,217.080	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,500,000.000	2,345,175.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,550,000.000	1,321,344.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	880,000.000	713,680.000	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,500,000.000	1,475,332.200	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,650,000.000	1,543,740.000	
UK TREASURY 3.75 03/07/27	700,000.000	689,154.130	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	837,412.230	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,545,864.480	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	810,238.500	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	900,000.000	895,788.790	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	820,000.000	735,376.000	

		UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,440,000.000	2,426,823.020	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,300,000.000	1,298,255.910	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,570,000.000	1,593,713.280	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,036,235.630	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,210,000.000	1,215,384.500	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,190,000.000	1,155,474.760	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,213,824.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,147,000.000	1,081,558.120	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,112,000.000	1,044,279.200	
		UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,900,000.000	1,923,542.330	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	950,000.000	974,424.880	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,745,000.000	1,733,657.500	
		UK TREASURY 4.625 01/31/34	1,050,000.000	1,088,062.500	
		UK TREASURY 4.75 10/22/43	500,000.000	510,062.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,495,000.000	1,559,311.150	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	580,000.000	601,474.960	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	980,000.000	1,059,968.000	
	イギリス・ポンド　小計		81,669,000.000 (15,945,055,560)	66,654,442.750 (13,013,613,403)	
	イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,430,000.000	1,338,020.970	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,824,726.960	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	3,110,000.000	2,570,934.370	
		ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,600,000.000	1,261,433.600	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,490,000.000	1,711,391.940	
		ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,936,280.000	
		ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,170,000.000	774,152.730	
		ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,660,000.000	1,558,829.640	
		ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	3,160,000.000	2,900,639.840	

	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,508,810.570	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,410,000.000	1,516,297.080	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,274,469.340	
イスラエル・シュケル　小計		22,950,000.000 (963,998,685)	20,175,987.040 (847,478,212)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,377,303.350	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,115,000.000	1,028,213.450	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,470,000.000	1,963,438.960	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,370,000.000	1,123,821.480	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,200,000.000	1,756,013.320	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,010,000.000	1,681,848.000	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	2,020,000.000	1,111,095.390	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,519,303.350	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,080,000.000	1,011,683.060	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,660,000.000	1,520,528.940	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	751,760.400	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	558,580.760	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,130,000.000	1,085,405.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,600,000.000	1,519,189.800	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,310,926.600	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	832,972.910	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,670,000.000	1,501,004.870	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,400,000.000	1,352,463.630	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	706,639.150	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,500,000.000	1,393,736.910	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	775,017.340	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,340,000.000	1,278,423.720	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,606,746.710	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,686,114.940	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,540,000.000	1,573,181.760	
オーストラリア・ドル　小計		36,425,000.000 (3,747,404,000)	32,025,413.800 (3,294,774,572)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27	9,000,000.000	9,019,710.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	50,000,000.000	50,241,105.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	20,081,946.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	6,490,000.000	6,519,437.990	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,998,082.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	49,500,000.000	49,857,132.600	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.33 12/15/25	4,000,000.000	4,028,740.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	3,000,000.000	3,015,690.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	3,000,000.000	3,035,826.300	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26	32,000,000.000	32,336,966.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	31,000,000.000	31,337,180.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,237,837.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,452,233.320	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	39,410,000.000	39,959,552.740	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	23,000,000.000	23,367,694.100	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	5,000,000.000	5,086,359.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	11,000,000.000	11,202,305.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	22,300,000.000	22,763,877.910	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	11,000,000.000	11,219,698.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	15,000,000.000	15,317,365.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	18,000,000.000	18,396,946.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	19,500,000.000	19,999,605.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	52,600,000.000	53,903,548.980	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	55,600,000.000	56,518,167.280	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	20,000,000.000	20,542,858.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	15,500,000.000	16,008,838.650	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	22,000,000.000	22,624,753.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,292,554.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	22,000,000.000	22,675,967.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,321,345.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,317,525.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	19,300,000.000	20,004,272.440	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	26,500,000.000	27,174,743.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	11,200,000.000	11,697,143.360	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	15,100,000.000	15,757,321.120	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	32,100,000.000	33,185,955.840	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	3,000,000.000	3,289,500.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	39,000,000.000	40,431,186.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	23,500,000.000	24,694,361.650	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	54,000,000.000	55,188,378.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	11,500,000.000	12,661,892.150	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,424,270.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	10,800,000.000	12,068,576.640	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	18,998,179.020	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30	9,000,000.000	9,617,677.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,359,236.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	11,000,000.000	11,658,751.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	8,820,000.000	10,047,603.760	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	19,100,000.000	21,792,924.280	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	10,450,000.000	12,281,789.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,287,151.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,600,000.000	9,186,889.880	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	18,000,000.000	21,998,788.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	14,300,000.000	17,518,782.710	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	11,300,000.000	14,250,833.410	
オフショア・人民元　小計		1,073,320,000.000 (23,131,548,648)	1,115,257,062.330 (24,035,351,053)	

カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,810,000.000	1,684,894.190	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,194,788.080	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,122,258.390	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	504,281.890	
	CANADA 1.0 09/01/26	2,670,000.000	2,486,926.310	
	CANADA 1.25 03/01/27	2,110,000.000	1,955,777.990	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,940,000.000	1,684,698.230	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,610,164.930	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,136,088.780	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,240,000.000	1,917,419.090	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,466,584.110	
	CANADA 2.0 06/01/28	930,000.000	869,195.180	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,590,000.000	1,402,989.010	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,460,000.000	2,511,722.270	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,288,987.920	
	CANADA 2.25 06/01/29	530,000.000	496,121.600	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,387,276.820	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,330,000.000	1,234,180.740	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,012,190.230	
	CANADA 2.75 12/01/48	500,000.000	432,690.950	
	CANADA 2.75 12/01/55	800,000.000	682,710.240	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	328,779.020	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,350,000.000	1,318,696.280	
	CANADA 3.0 06/01/34	800,000.000	753,919.560	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,660,000.000	1,626,266.870	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,400,000.000	1,369,677.820	
	CANADA 3.25 12/01/33	1,620,000.000	1,562,419.750	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,030,000.000	1,017,184.610	
	CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	394,871.560	
	CANADA 3.5 12/01/45	900,000.000	885,103.390	
	CANADA 4.0 03/01/29	1,700,000.000	1,717,320.040	
	CANADA 4.0 05/01/26	500,000.000	497,331.570	
	CANADA 4.0 06/01/41	590,000.000	616,550.130	
	CANADA 5.0 06/01/37	330,000.000	375,139.350	
	CANADA 5.75 06/01/29	640,000.000	700,853.480	
	CANADA 5.75 06/01/33	810,000.000	936,573.610	
カナダ・ドル　小計		49,730,000.000 (5,670,214,600)	45,182,633.990 (5,151,723,928)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	280,000.000	268,156.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	483,990.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	840,000.000	753,900.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	630,000.000	478,170.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	382,693.800	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	690,000.000	672,667.200	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	770,000.000	693,000.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	770,406.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	240,000.000	214,180.800	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	240,000.000	234,240.000	

	SINGAPORE 2.75 03/01/46	460,000.000	422,397.300	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	614,130.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	520,000.000	510,900.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	197,360.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	606,670.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	118,062.500	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	820,000.000	827,380.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	803,200.000	
シンガポール・ドル　小計		9,695,000.000 (1,116,185,350)	9,051,503.600 (1,042,099,609)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,221,217.320	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,169,242.400	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,960,000.000	3,638,382.990	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	6,710,000.000	6,432,826.920	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,300,000.000	3,133,285.340	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,430,000.000	3,404,761.430	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,877,633.210	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,340,000.000	3,765,081.800	
スウェーデン・クローナ　小計		34,970,000.000 (502,868,600)	33,642,431.410 (483,778,164)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,242,444.140	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,560,000.000	2,408,258.490	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,850,000.000	4,513,525.420	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,140,000.000	4,627,396.010	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,640,000.000	3,574,631.170	
	DENMARK 2.25 11/15/33	2,740,000.000	2,673,409.780	
	DENMARK 4.5 11/15/39	6,550,000.000	8,039,194.900	
デンマーク・クローネ　小計		32,560,000.000 (733,251,200)	30,078,859.910 (677,375,925)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	650,000.000	547,305.020	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	380,000.000	349,018.170	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	715,704.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	251,199.320	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	890,000.000	732,649.630	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	1,140,000.000	907,255.360	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	810,000.000	538,270.930	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	697,971.930	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	450,000.000	411,126.480	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	125,008.100	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	796,335.490	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	500,000.000	497,418.820	
ニュージーランド・ドル　小計		7,780,000.000 (729,841,800)	6,569,263.250 (616,262,585)	

ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,950,000.000	2,498,827.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,610,000.000	4,032,075.640	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,510,000.000	3,368,529.450	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,700,000.000	4,457,879.500	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,656,178.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,946,628.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,530,000.000	2,258,075.600	
	NORWAY 3.0 08/15/33	3,500,000.000	3,310,046.600	
	NORWAY 3.5 10/06/42	2,160,000.000	2,157,051.600	
	NORWAY 3.625 04/13/34	1,230,000.000	1,218,220.970	
ノルウェー・クローネ　小計		30,180,000.000 (433,384,800)	27,903,512.360 (400,694,437)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,280,000.000	2,021,961.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,720,000.000	3,659,850.240	
	POLAND 1.75 04/25/32	6,050,000.000	4,595,089.950	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,290,000.000	3,103,335.270	
	POLAND 2.5 07/25/27	5,060,000.000	4,646,117.300	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,141,904.900	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,752,652.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,554,177.300	
	POLAND 3.75 05/25/27	2,620,000.000	2,504,835.280	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,190,000.000	3,228,361.660	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,400,000.000	3,653,663.800	
ポーランド・ズロチ　小計		37,660,000.000 (1,469,945,120)	33,861,948.700 (1,321,699,582)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,853,153.400	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	647,702.480	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,368,760.400	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,001,955.600	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,441,905.020	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,270,000.000	2,254,634.130	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,650,554.170	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	704,273.220	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,008,435.700	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,745,269.320	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,674,209.260	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,220,000.000	1,229,860.650	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,650,000.000	1,661,705.590	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,650,519.830	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	685,067.750	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,400,000.000	1,432,518.780	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,067,631.700	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,450,000.000	1,494,695.520	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,243,831.440	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,590,000.000	1,645,646.020	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,450,000.000	1,530,475.290	

	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,160,000.000	1,240,195.070	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	322,019.760	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,900,000.000	2,031,449.980	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,192,913.130	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,759,494.560	
マレーシア・リンギット　小計		36,900,000.000 (1,213,441,740)	37,538,877.770 (1,234,450,980)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	9,500,000.000	9,077,630.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	25,080,000.000	22,392,427.200	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,290,000.000	16,815,285.900	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	16,790,000.000	14,104,607.400	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	11,010,000.000	10,281,468.300	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	4,805,000.000	4,939,972.450	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	31,672,000.000	29,255,558.450	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	25,146,000.000	23,560,796.160	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,148,000.000	27,238,416.520	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	24,707,000.000	20,540,658.590	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	10,035,000.000	8,796,480.300	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	17,461,000.000	14,750,179.750	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,619,000.000	19,627,019.910	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,230,153.080	
メキシコ・ペソ　小計		261,905,000.000 (2,435,611,738)	235,610,654.010 (2,191,084,838)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,280,000.000	1,087,989.760	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,360,000.000	1,122,102.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	620,000.000	547,294.460	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	370,000.000	221,334.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	740,000.000	524,068.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,362,239.200	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,190,000.000	1,110,056.990	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	360,000.000	159,800.760	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	935,000.000	865,508.930	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	338,034.600	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,330,000.000	1,262,064.930	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	138,322.310	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	600,000.000	516,666.600	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	310,000.000	301,320.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	680,000.000	496,777.400	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	112,366.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	460,000.000	355,328.840	

AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	450,383.240	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	290,354.220	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	670,000.000	635,828.660	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,150,000.000	1,144,713.450	
AUSTRIA 2.9 02/20/34	450,000.000	446,220.000	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	547,307.750	
AUSTRIA 3.15 10/20/53	420,000.000	415,313.220	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	350,000.000	395,776.850	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,120,766.700	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,010,000.000	1,041,449.380	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	675,714.640	
BELGIUM 0.0 10/22/27	1,030,000.000	934,216.940	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	841,423.440	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,100,000.000	933,020.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,050,000.000	856,485.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	780,000.000	499,232.760	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	360,792.480	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,380,000.000	1,341,660.840	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,360,000.000	1,275,783.360	
BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	865,552.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,740,000.000	1,583,530.500	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,340,000.000	1,284,640.580	
BELGIUM 1.0 06/22/31	940,000.000	827,932.260	
BELGIUM 1.25 04/22/33	860,000.000	748,522.500	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,540,000.000	963,713.520	
BELGIUM 1.45 06/22/37	560,000.000	457,900.800	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	655,819.240	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,020,000.000	716,571.420	
BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	518,290.160	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	335,160.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	298,362.480	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	300,825.280	
BELGIUM 2.85 10/22/34	200,000.000	196,316.040	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,200,000.000	1,202,473.200	
BELGIUM 3.0 06/22/34	680,000.000	679,056.160	
BELGIUM 3.3 06/22/54	420,000.000	404,358.360	
BELGIUM 3.45 06/22/43	240,000.000	241,780.320	
BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	673,160.960	
BELGIUM 4.0 03/28/32	740,000.000	795,976.560	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,180,000.000	1,318,956.800	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,097,057.720	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,370,000.000	1,610,197.990	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,753,150.400	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,310,000.000	3,131,094.500	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	2,060,000.000	1,903,821.100	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	2,760,000.000	2,579,910.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,650,000.000	2,537,507.500	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,293,030.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	3,080,000.000	2,944,233.600	

BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,050,000.000	1,003,243.500	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,700,000.000	1,672,137.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	2,000,000.000	1,980,940.000	
BUNDESSCHAT 2.5 03/19/26	800,000.000	792,200.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,020,000.000	1,754,491.200	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,340,000.000	1,986,940.800	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,050,000.000	1,698,707.900	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,460,000.000	1,105,512.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,680,000.000	1,235,539.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,530,000.000	1,314,943.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	890,000.000	764,785.900	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,890,000.000	2,424,854.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,400,000.000	1,175,834.240	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,588,840.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	940,000.000	477,115.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,190,000.000	1,055,842.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,477,747.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,060,000.000	946,812.140	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,420,000.000	2,261,732.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,630,000.000	1,466,277.910	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,270,000.000	2,061,114.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,860,000.000	3,696,915.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,120,000.000	1,960,660.800	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,610,000.000	2,436,174.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,290,000.000	2,149,016.150	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,690,000.000	2,363,939.720	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,660,000.000	1,341,894.200	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,620,000.000	1,963,589.910	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,180,000.000	2,056,394.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	2,400,000.000	1,988,496.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,800,000.000	1,760,310.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	2,950,000.000	2,907,815.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	700,000.000	690,396.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	600,000.000	596,088.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,220,000.000	2,150,891.400	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	2,169,529.600	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	500,000.000	484,535.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,900,000.000	1,915,295.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,080,000.000	1,164,229.200	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,030,000.000	2,328,541.950	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,580,000.000	1,886,504.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,276,677.400	

DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,720,000.000	2,054,419.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	2,041,818.100	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,720,000.000	2,026,882.400	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,140,000.000	1,253,783.400	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	840,000.000	1,001,179.200	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	650,000.000	721,643.000	
FINLAND 0.0 09/15/26	100,000.000	93,225.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	110,000.000	91,918.310	
FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	198,269.120	
FINLAND 0.125 04/15/52	640,000.000	293,039.360	
FINLAND 0.125 09/15/31	700,000.000	573,652.800	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	183,601.030	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	438,231.880	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	237,557.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	370,068.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	588,107.000	
FINLAND 0.5 09/15/29	770,000.000	681,396.100	
FINLAND 0.75 04/15/31	700,000.000	608,111.060	
FINLAND 0.875 09/15/25	810,000.000	785,973.780	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	404,234.960	
FINLAND 1.375 04/15/27	210,000.000	200,949.370	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	200,597.040	
FINLAND 1.5 09/15/32	600,000.000	537,351.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	400,000.000	370,797.020	
FINLAND 2.75 04/15/38	370,000.000	353,341.120	
FINLAND 2.75 07/04/28	320,000.000	318,713.600	
FINLAND 2.95 04/15/55	20,000.000	19,320.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	220,000.000	221,733.930	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	3,530,000.000	3,340,816.710	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,500,000.000	4,147,537.500	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,790,000.000	2,217,492.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	4,310,000.000	3,692,527.850	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,880,000.000	3,229,036.880	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	4,470,000.000	3,609,766.380	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,120,000.000	2,913,721.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	4,460,000.000	4,237,178.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	4,290,000.000	3,823,565.460	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,950,000.000	1,283,059.050	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	298,401.500	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,490,000.000	879,614.050	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,780,000.000	3,493,956.060	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,690,000.000	4,316,113.200	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	4,150,000.000	2,193,486.650	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	3,660,000.000	1,889,705.580	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,200,000.000	3,828,783.000	

FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,560,000.000	3,362,768.880	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,650,407.480	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,560,000.000	3,021,056.020	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,680,000.000	2,992,208.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,400,000.000	1,089,760.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,880,000.000	5,379,876.600	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,020,000.000	1,366,047.220	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	940,000.000	617,401.400	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,450,000.000	2,024,591.800	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,510,996.500	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	3,550,000.000	3,303,470.250	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,650,000.000	3,582,007.350	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,050,000.000	923,882.400	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,320,000.000	4,266,293.760	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,300,000.000	3,282,156.900	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,240,000.000	4,217,019.200	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,000,000.000	3,008,712.000	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	900,000.000	824,022.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,340,000.000	2,302,695.720	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,850,000.000	3,879,244.600	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,687,905.180	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,627,111.600	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,540,000.000	1,678,267.360	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,490,000.000	2,881,004.700	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,689,395.510	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,800,000.000	3,134,076.400	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,610,000.000	3,147,853.140	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	170,000.000	176,439.600	
IRISH 0.0 10/18/31	670,000.000	547,098.550	
IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	388,547.360	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	298,391.460	
IRISH 0.35 10/18/32	350,000.000	286,640.070	
IRISH 0.4 05/15/35	420,000.000	321,566.700	
IRISH 0.55 04/22/41	300,000.000	200,693.720	
IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	660,816.880	
IRISH 1.0 05/15/26	890,000.000	856,035.820	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	674,306.110	
IRISH 1.3 05/15/33	290,000.000	255,361.820	
IRISH 1.35 03/18/31	540,000.000	493,892.100	
IRISH 1.5 05/15/50	550,000.000	391,453.700	
IRISH 1.7 05/15/37	780,000.000	670,882.680	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	699,877.080	
IRISH 2.4 05/15/30	690,000.000	676,386.990	
IRISH 3.0 10/18/43	280,000.000	276,524.360	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,897,184.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,850,000.000	1,718,650.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,301,298.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,900,000.000	1,660,600.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,532,789.230	

ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	980,760.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,920,000.000	1,565,115.730	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,603,809.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,110,000.000	1,776,422.920	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,480,000.000	1,037,628.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,580,000.000	1,291,492.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,161,945.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,556,688.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,409,811.700	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,300,000.000	1,221,415.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,160,000.000	1,127,636.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,980,000.000	1,882,037.520	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,647,110.500	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,320,000.000	1,015,740.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	510,000.000	321,555.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,380,000.000	1,332,666.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,290,000.000	1,993,980.860	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,340,000.000	2,088,918.000	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,170,000.000	712,408.320	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	827,540.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	610,000.000	582,631.740	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,625,564.960	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,636,586.600	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,840,000.000	1,792,660.480	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	219,528.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	960,000.000	636,672.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,540,074.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,138,320.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,080,000.000	975,435.480	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,480,000.000	1,070,780.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,530,082.500	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,229,182.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,520,000.000	1,487,472.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,270,000.000	993,902.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	500,000.000	366,050.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,168,440.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,898,881.700	
ITALY BTPS 2.95 02/15/27	1,300,000.000	1,286,870.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	220,000.000	194,150.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,210,000.000	2,171,435.500	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,060,000.000	934,858.520	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	549,300.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,190,648.820	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,720,000.000	1,643,947.620	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,150,000.000	1,153,565.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,440,000.000	1,275,184.800	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,310,000.000	1,311,310.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,181,383.820	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,000,000.000	1,012,100.000	

ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,511,221.500	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.000	1,032,993.500	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	1,600,000.000	1,618,880.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,736,720.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,340,000.000	2,360,124.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,160,000.000	1,177,052.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	900,000.000	927,090.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	500,000.000	516,100.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	260,000.000	260,104.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	720,000.000	745,632.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	300,000.000	314,340.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,500,000.000	1,581,000.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	800,000.000	821,600.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,150,301.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	770,000.000	791,637.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,180,000.000	2,302,816.840	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,460,000.000	1,561,305.020	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,360,000.000	2,598,596.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,890,000.000	2,075,220.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,650,000.000	1,810,710.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,886,576.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,660,000.000	3,066,714.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,260,000.000	2,610,526.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,219,844.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,250,000.000	1,364,875.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	1,500,000.000	1,426,213.500	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,280,000.000	1,187,360.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,240,000.000	1,092,884.650	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,240,000.000	837,673.050	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,330,000.000	627,146.870	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,200,000.000	1,018,334.990	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,900,000.000	1,570,576.340	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,060,000.000	935,871.880	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,310,000.000	920,707.120	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,560,000.000	1,480,674.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	900,000.000	754,794.760	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	938,809.400	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,365,788.960	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	549,917.280	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	150,000.000	148,209.900	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,310,000.000	1,286,053.050	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	350,000.000	342,317.500	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	100,000.000	97,200.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,290,000.000	1,267,683.000	

NETHERLANDS 3.25 01/15/44	140,000.000	147,156.520	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,490,000.000	1,661,336.590	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,320,000.000	1,478,664.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,090,000.000	1,192,460.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,554,113.200	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,010,000.000	1,849,803.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,880,000.000	1,685,984.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	839,454.730	
SPAIN 0.1 04/30/31	2,030,000.000	1,650,796.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,556,359.560	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,360,032.320	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,130,000.000	994,757.080	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,537,422.150	
SPAIN 0.8 07/30/27	2,300,000.000	2,147,740.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,522,010.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,600,000.000	1,152,976.000	
SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	349,002.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,790,000.000	967,060.030	
SPAIN 1.2 10/31/40	720,000.000	502,192.800	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,150,000.000	1,929,947.500	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,130,000.000	2,040,623.070	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	2,042,086.310	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,470,000.000	1,381,359.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,500,000.000	1,395,226.500	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,765,208.820	
SPAIN 1.45 10/31/71	660,000.000	321,256.320	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,660,000.000	1,587,126.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	430,000.000	422,453.500	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,640,000.000	1,409,507.840	
SPAIN 1.9 10/31/52	1,370,000.000	913,242.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,494,787.050	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,663,977.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,782,426.120	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,370,000.000	1,271,771.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,641,234.320	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,560,000.000	1,290,129.360	
SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,785,690.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,131,234.000	
SPAIN 3.15 04/30/33	1,570,000.000	1,561,239.710	
SPAIN 3.25 04/30/34	1,270,000.000	1,263,609.360	
SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	708,074.920	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	1,013,664.960	
SPAIN 3.5 05/31/29	1,300,000.000	1,329,291.340	
SPAIN 3.55 10/31/33	1,820,000.000	1,861,132.000	
SPAIN 3.9 07/30/39	340,000.000	350,208.160	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,660,000.000	1,784,848.600	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,923,747.150	

		SPAIN 4.7 07/30/41	1,880,000.000	2,124,595.520	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,215,791.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	1,660,000.000	1,809,649.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,448,987.100	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,635,000.000	1,941,251.850	
		SPAIN 5.9 07/30/26	2,330,000.000	2,463,609.880	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,218,063.400	
	ユーロ　小計		519,710,000.000 (87,290,491,600)	477,558,729.370 (80,210,764,185)	
国債証券　合計			281,397,803,441 (281,397,803,441)	253,976,453,865 (253,976,453,865)	
合計				253,976,453,865 (253,976,453,865)	

（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	246銘柄	46.37	47.03
イギリス・ポンド	国債証券	59銘柄	5.05	5.12
イスラエル・シュケル	国債証券	12銘柄	0.33	0.33
オーストラリア・ドル	国債証券	25銘柄	1.28	1.30
オフショア・人民元	国債証券	55銘柄	9.33	9.46
カナダ・ドル	国債証券	36銘柄	2.00	2.03
シンガポール・ドル	国債証券	18銘柄	0.40	0.41
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	7銘柄	0.26	0.27
ニュージーランド・ドル	国債証券	12銘柄	0.24	0.24
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	11銘柄	0.51	0.52
マレーシア・リンギット	国債証券	26銘柄	0.48	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.85	0.86
ユーロ	国債証券	349銘柄	31.14	31.58

（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）

	2024年5月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,540,632,417
投資証券	182,182,653,700
派生商品評価勘定	323,098,130
未収入金	510,356,226
未収配当金	2,077,286,622
差入委託証拠金	301,326,786
流動資産合計	190,935,353,881
資産合計	190,935,353,881
負債の部	
流動負債	
前受金	289,128,400
未払金	226,112,084
未払解約金	2,486,290,000
流動負債合計	3,001,530,484
負債合計	3,001,530,484
純資産の部	
元本等	
元本	78,538,338,925
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	109,395,484,472
元本等合計	187,933,823,397
純資産合計	187,933,823,397
負債純資産合計	190,935,353,881

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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	80,768,851,376円
同期中追加設定元本額	17,897,892,818円
同期中一部解約元本額	20,128,405,269円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	278,732円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	1,174,959円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	2,956,489円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	3,322,748円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	3,810,133円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	2,051,835円
たわらノーロード　国内リート	5,876,030,276円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,450,298,224円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	46,127,266円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,009,887,624円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,255,588,462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）	352,356,134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）	954,963,450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）	677,778,891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）	802,706,074円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	3,880,978円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	79,791,967円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	13,099,313円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	25,003,534円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,646,122円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	473,314,451円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	4,539,059円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	152,407,293円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	236,914,240円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	502,127,767円
投資のソムリエ	4,857,481,143円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	505,744,567円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	225,908,401円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	579,927,974円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,808,154,580円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	28,357,257円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	14,460,546円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,368,832円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	68,482,158円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,237,853,142円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	130,512,711円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	31,840,620円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	15,520,395円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	9,552,282円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	2,378,143円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	54,073,658円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	79,869,234円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（隔月決算型）	12,131,978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）	60,574,598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）	213,663,893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）	60,547,266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）	89,471,283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）	36,568,104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）	187,394,813円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	81,150,070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）	213,274,938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）	59,720,153円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	154,315,978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）	26,270,997円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０７（適格機関投資家限定）	43,694,307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）	30,480,697円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	81,099,581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）	41,810,501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）	30,344,037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）	43,911,261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）	185,127,183円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	99,897,573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）２４－０４（適格機関投資家限定）	111,255,376円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,151,616,472円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	75,584,754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）	73,507,082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）	366,249,789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）	100,253,102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）	2,739,353円
日米資産配分戦略ファンド（ＴＩＰＳ活用型）（為替ヘッジ比率調整型）（適格機関投資家限定）	11,394,748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）	435,458,895円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,155,751,857円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	32,093,388,314円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,617,744,144円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ専用＞	4,993,368,003円
計	78,538,338,925円
２．　受益権の総数	78,538,338,925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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	2024年5月13日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△3,634,793,801
合計	△3,634,793,801

（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2024年5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	2024年5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 先物取引 買建	4,857,757,100	－	5,181,169,500	323,412,400
合計	4,857,757,100	－	5,181,169,500	323,412,400

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3929円 (23,929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

2024年5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	7,537	1,146,377,700	
	ＧＬＰ投資法人	58,810	7,892,302,000	
	ＫＤＸ不動産投資法人	50,385	8,006,176,500	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	17,751	2,174,497,500	
	Ｏｎｅリート投資法人	3,054	838,628,400	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	8,736	1,092,000,000	
	いちごオフィスリート投資法人	14,346	1,216,540,800	
	いちごホテルリート投資法人	2,900	335,530,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	9,185	3,669,407,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	17,178	5,892,054,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	7,672	956,698,400	
	イオンリート投資法人	21,477	2,933,758,200	
	インヴィンシブル投資法人	84,771	6,052,649,400	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,559	447,722,200	
	オリックス不動産投資法人	34,885	5,895,565,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	12,928	1,366,489,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	8,609	2,961,496,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,771	527,672,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,609	510,419,000	
	ザイマックス・リート投資法人	2,840	351,024,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	58,610	4,952,545,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	15,216	1,921,780,800	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	17,984	9,621,440,000	
	スターアジア不動産投資法人	26,983	1,686,437,500	
	スターツプロシード投資法人	3,035	639,778,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	9,326	961,510,600	

	トーセイ・リート投資法人	3,687	524,291,400	
	ヒューリックリート投資法人	16,381	2,501,378,700	
	フロンティア不動産投資法人	6,496	2,975,168,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	4,317	570,275,700	
	マリモ地方創生リート投資法人	2,699	361,396,100	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	39,165	5,933,497,500	
	ラサールロジポート投資法人	22,381	3,495,912,200	
	阪急阪神リート投資法人	8,348	1,164,546,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7,282	3,309,669,000	
	三菱地所物流リート投資法人	6,046	2,427,469,000	
	産業ファンド投資法人	31,890	4,206,291,000	
	森トラストリート投資法人	33,748	2,453,479,600	
	森ヒルズリート投資法人	20,588	2,820,556,000	
	星野リゾート・リート投資法人	3,230	1,834,640,000	
	積水ハウス・リート投資法人	52,611	4,303,579,800	
	大和ハウスリート投資法人	26,391	7,017,366,900	
	大和証券オフィス投資法人	3,627	2,114,541,000	
	大和証券リビング投資法人	25,783	2,751,046,100	
	投資法人みらい	24,027	1,107,644,700	
	東海道リート投資法人	2,991	386,736,300	
	東急リアル・エステート投資法人	11,739	1,911,109,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	6,046	4,044,774,000	
	日本ビルファンド投資法人	20,425	12,255,000,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	11,974	4,125,043,000	
	日本プロロジスリート投資法人	30,500	8,094,700,000	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	2,677	210,679,900	
	日本リート投資法人	5,687	2,027,415,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	11,175	3,136,822,500	
	日本都市ファンド投資法人	83,922	7,897,060,200	
	福岡リート投資法人	9,055	1,505,846,500	
	平和不動産リート投資法人	13,081	1,860,118,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	56,618	8,804,099,000	
投資証券　合計		1,112,744	182,182,653,700	
合計			182,182,653,700	

（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）

	2024年5月13日現在
資産の部	
流動資産	
預金	22,547,103
コール・ローン	1,884,811,001
投資信託受益証券	8,902,300,660
投資証券	73,253,204,261
派生商品評価勘定	560
未収入金	265,066,711
未収配当金	146,588,479
流動資産合計	84,474,518,775
資産合計	84,474,518,775
負債の部	
流動負債	
未払金	212,118,746
未払解約金	1,853,911,000
流動負債合計	2,066,029,746
負債合計	2,066,029,746
純資産の部	
元本等	
元本	41,358,084,142
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	41,050,404,887
元本等合計	82,408,489,029
純資産合計	82,408,489,029
負債純資産合計	84,474,518,775

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11月14日 至　2024年5月13日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年5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	47,736,993,571円
同期中追加設定元本額	5,970,499,706円
同期中一部解約元本額	12,349,409,135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＞	3,803,575,222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＞	7,545,012円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,923,091円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	16,559,083円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	41,411,366円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	46,723,091円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	53,721,186円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	28,580,841円
たわらノーロード　先進国リート	15,170,148,686円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	125,732,976円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	258,782,152円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	4,247,402,739円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	28,370,511円
たわらノーロード　バランス（標準型）	632,404,453円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,432,996,579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）	1,255,966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）	627,901,270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）	659,929,357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）	1,172,522,177円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	523,509円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	40,466,036円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	12,526,945円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	32,611,534円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	2,052,242,735円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	15,876,493円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	596,420,560円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	79,425,412円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	191,491,933円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	313,572,673円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	610,166,495円
投資のソムリエ	3,968,235,327円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	413,259,951円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	273,370,120円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	474,013,891円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,476,822,170円
ワールドアセットバランス（基本コース）	256,904,681円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	583,771,637円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	27,827,125円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	14,186,127円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,292,296円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	84,241,913円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	173,958,232円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	162,241,983円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	31,219,629円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	15,230,892円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	9,370,663円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	2,333,972円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	70,541,422円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	283,925,765円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	375,202,692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）	867,926円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	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）	501,108円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	5,202円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	62,054,960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）	2,401,063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）	2,239,608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）	41,806,195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）	109,136,946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）	131,035,294円
計	41,358,084,142円
２．　受益権の総数	41,358,084,142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11月14日 至　2024年5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	2024年5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	2024年5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	751,499,769
投資証券	2,993,340,028
合計	3,744,839,797

（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2024年5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	2024年5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	31,190,740	－	31,191,300	560
アメリカ・ドル	31,190,740	－	31,191,300	560
合計	31,190,740	－	31,191,300	560

（注）時価の算定方法

為替予約取引

１．　計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9926円 (19,926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

2024年5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	299,800.000	184,377.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	291,800.000	40,560.200	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	57,891.000	
		PRIME US REIT	349,360.000	38,778.960	
	アメリカ・ドル　小計		1,852,660.000	321,607.160 (50,164,285)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	168,642.000	196,467.930	
		ABACUS STORAGE KING	224,215.000	256,726.170	
		ARENA REIT	138,778.000	520,417.500	
		BWP TRUST	214,031.000	774,792.220	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	339,660.000	585,913.500	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	213,140.000	686,310.800	
		CENTURIA OFFICE REIT	185,985.000	220,392.220	
		CHARTER HALL GROUP	186,916.000	2,274,767.720	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	265,944.000	936,122.880	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	204,746.000	683,851.640	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	137,586.000	348,092.580	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	618,825.000	244,435.870	
		DEXUS	425,987.000	3,037,287.310	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	93,159.000	274,819.050	
		GDI PROPERTY GROUP	222,442.000	139,026.250	
		GOODMAN GROUP	688,414.000	23,165,131.100	
		GPT GROUP	758,983.000	3,248,447.240	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	119,794.000	286,307.660	
		HEALTHCO REIT	202,023.000	239,397.250	
		HMC CAPITAL LTD	93,821.000	656,747.000	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	696,286.000	873,838.930	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	285,903.810	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	154,661.000	748,559.240	
		MIRVAC GROUP	1,563,561.000	3,267,842.490	
		NATIONAL STORAGE REIT	509,415.000	1,115,618.850	

	REGION RE LTD	466,538.000	1,021,718.220	
	RURAL FUNDS GROUP	148,357.000	302,648.280	
	SCENTRE GROUP	2,063,068.000	6,539,925.560	
	STOCKLAND	945,255.000	4,319,815.350	
	VICINITY CENTRES	1,532,381.000	2,942,171.520	
	WAYPOINT REIT LTD	266,477.000	642,209.570	
オーストラリア・ドル　小計		13,934,947.000	60,835,705.710 (6,258,777,404)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	273,095.000	355,023.500	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	997,316.000	907,557.560	
	CAPITALAND CHINA TRUST	495,380.000	339,335.300	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,007,909.000	3,915,422.550	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,411,860.000	3,670,836.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	291,800.000	285,964.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	15,736.000	
	ESR LOGOS REIT	2,395,840.000	694,793.600	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	393,300.000	241,879.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	445,100.000	965,867.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,178,864.000	1,202,441.280	
	KEPPEL DC REIT	537,300.000	945,648.000	
	KEPPEL REIT	910,000.000	791,700.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	731,400.000	405,927.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	816,920.000	1,805,393.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,317,620.000	1,805,139.400	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	906,600.000	1,124,184.000	
	PARAGON REIT	487,100.000	411,599.500	
	PARKWAY LIFE REIT	149,300.000	538,973.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	242,300.000	167,187.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	530,300.000	251,892.500	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	898,090.000	978,918.100	
シンガポール・ドル　小計		17,529,794.000	21,821,417.990 (2,512,299,853)	
ユーロ	CROMWELL REIT EUR	129,840.000	196,058.400	
ユーロ　小計		129,840.000	196,058.400 (32,929,969)	
香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	591,000.000	2,411,280.000	
香港・ドル　小計		591,000.000	2,411,280.000	

				(48,129,149)	
投資信託受益証券　合計			34,038,241	8,902,300,660 (8,902,300,660)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	39,977.000	680,808.310	
		AGREE REALTY CORP	39,774.000	2,392,406.100	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	30,339.000	508,785.030	
		ALEXANDER'S INC.	860.000	191,917.600	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	62,668.000	7,619,802.120	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,384.000	68,872.640	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	20,536.000	450,765.200	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	126,436.000	4,560,546.520	
		AMERICOLD REALTY TRUST	105,668.000	2,550,825.520	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	57,261.000	2,210,274.600	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	53,077.000	427,269.850	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	83,951.000	1,245,832.840	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	28,991.000	332,816.680	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	15,737.040	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	56,484.000	11,121,134.760	
		BOSTON PROPERTIES INC	57,346.000	3,526,779.000	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	65,100.210	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	73,547.000	346,406.370	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	119,251.000	2,652,142.240	
		BROADSTONE NET LEASE INC	75,796.000	1,155,131.040	
		BRT APARTMENTS CORP	5,643.000	101,969.010	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	42,442.000	4,526,014.880	
		CARETRUST REIT INC	51,501.000	1,271,559.690	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	10,705.000	237,115.750	
		CENTERSPACE	6,258.000	439,499.340	
		CHATHAM LODGING TRUST	19,711.000	177,990.330	
		CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	82,364.180	
		CLIPPER REALTY INC	5,086.000	20,394.860	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	99,470.000	384,948.900	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9,794.000	234,958.060	
		COPT DEFENCE PROPERTIES	45,540.000	1,112,542.200	
		COUSINS PROPERTIES INC	61,058.000	1,442,189.960	
		CTO REALTY GROUTH INC	7,420.000	128,366.000	

CUBESMART	89,334.000	3,813,668.460	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	85,756.000	729,783.560	
DIGITAL REALTY TRUST INC	128,659.000	18,200,102.140	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	89,231.000	202,554.370	
DOUGLAS EMMETT INC	65,520.000	923,832.000	
EAST GROUP	18,935.000	3,114,618.150	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	40,105.000	479,655.800	
ELME COMMUNITIES	36,639.000	575,232.300	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	51,841.000	496,636.780	
EPR PROPERTIES	29,715.000	1,234,658.250	
EQUINIX INC	37,442.000	28,369,054.560	
EQUITY COMMONWEALTH	43,229.000	828,699.930	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	74,113.000	4,653,555.270	
EQUITY RESIDENTIAL	137,404.000	9,178,587.200	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	61,721.000	1,675,725.150	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,544.000	6,614,618.800	
EXTRA SPACE STORAGE INC	84,137.000	12,340,373.790	
FARMLAND PARTNERS INC	16,653.000	186,347.070	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	29,413.000	2,991,890.360	
FIRST INDUSTRIAL RT	52,457.000	2,503,248.040	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	35,542.000	872,911.520	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,375.000	88,576.250	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	106,153.000	4,699,393.310	
GETTY REALTY CORP	20,450.000	571,577.500	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,124.000	223,230.240	
GLADSTONE LAND CORP	13,328.000	178,461.920	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,662.000	237,025.180	
GLOBAL NET LEASE INC	77,690.000	579,567.400	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	150,991.000	2,320,731.670	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	282,878.000	5,530,264.900	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	42,731.000	1,148,609.280	
HOST HOTELS & RESORTS INC	280,532.000	5,144,956.880	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	52,743.000	286,394.490	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	88,684.000	1,494,325.400	

INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	106,448.760	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	11,349.000	1,185,176.070	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	26,385.000	660,416.550	
INVITATION HOMES INC	228,952.000	7,962,950.560	
IRON MOUNTAIN INC	116,237.000	9,272,225.490	
JBG SMITH PROPERTIES	34,530.000	500,685.000	
KILROY REALTY CORP	42,178.000	1,434,895.560	
KIMCO REALTY	264,877.000	5,027,365.460	
KITE REALTY GROUP TRUST	86,855.000	1,831,771.950	
LTC PROPERTIES INC	17,259.000	587,841.540	
LXP INDUSTRIAL TRUST	118,308.000	1,037,561.160	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	242,153.000	1,157,491.340	
MID AMERICA	46,434.000	6,290,413.980	
NATIONAL HEALTH INVS INC	17,553.000	1,146,210.900	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	31,273.000	1,149,595.480	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	5,763.000	138,139.110	
NETSTREIT CORP	28,697.000	506,789.020	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	15,267.000	91,296.660	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	9,758.000	350,117.040	
NNN REIT INC	72,438.000	3,061,229.880	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	51,824.160	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	97,362.000	2,988,039.780	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,830.000	139,861.700	
ORION OFFICE REIT INC	20,368.000	75,768.960	
PARAMOUNT GROUP INC	63,997.000	305,905.660	
PARK HOTELS & RESORTS INC	82,901.000	1,305,690.750	
PEAKSTONE REALTY TRUST	13,637.000	202,782.190	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	48,508.000	709,672.040	
PHILLIPS EDISON & CO INC	48,255.000	1,587,106.950	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	52,948.000	366,929.640	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,197.000	317,161.390	
POSTAL REALTY TRUST INC	7,238.000	99,594.880	
PROLOGIS INC	368,230.000	39,581,042.700	
PUBLIC STORAGE	63,041.000	17,395,533.540	
REALTY INCOME CORP	331,307.000	18,225,198.070	
REGENCY CENTERS CORP	65,271.000	3,888,193.470	

		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	49,154.000	611,475.760	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	83,727.000	3,776,924.970	
		RLJ LODGING TRUST	62,698.000	647,670.340	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	23,680.000	2,508,659.200	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	91,291.000	1,326,458.230	
		SAFEHOLD INC	18,989.000	370,095.610	
		SAUL CENTERS INC	4,875.000	179,838.750	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	69,695.000	399,352.350	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	129,841.000	19,180,112.520	
		SITE CENTERS CORP	72,757.000	1,012,777.440	
		SL GREEN	25,549.000	1,334,935.250	
		STAG INDUSTRIAL INC	72,016.000	2,550,806.720	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	41,424.000	251,029.440	
		SUN COMMUNITIES INC	49,499.000	5,816,132.500	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	82,956.000	851,128.560	
		TANGER INC	42,464.000	1,181,348.480	
		TERRENO REALTY CORP	37,035.000	2,039,517.450	
		THE MACERICH COMPANY	85,228.000	1,302,283.840	
		UDR INC	120,971.000	4,722,707.840	
		UMH PROPERTIES INC	24,455.000	394,214.600	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,814.000	180,621.280	
		URBAN EDGE PROPERTIES	47,399.000	813,366.840	
		VENTAS INC	160,681.000	7,641,988.360	
		VERIS RESIDENTIAL INC	33,561.000	522,880.380	
		VICI PROPERTIES INC	411,986.000	12,153,587.000	
		VORNADO REALTY TRUST	64,265.000	1,556,498.300	
		WELLTOWER INC	220,513.000	21,793,299.790	
		WHITESTONE REIT	18,939.000	235,979.940	
		WP CAREY INC	86,950.000	5,077,010.500	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	42,523.000	632,317.010	
	アメリカ・ドル　小計		8,921,377.000	406,576,081.390 (63,417,737,175)	
	イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	134,607.000	68,918.780	
		AEW UK REIT PLC	50,684.000	43,841.660	
		ASSURA PLC	1,209,341.000	511,551.240	
		BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	269,934.000	212,977.920	
		BIG YELLOW GROUP PLC	77,303.000	878,162.080	
		BRITISH LAND CO PLC	371,714.000	1,515,106.260	
		CLS HOLDINGS PLC	45,585.000	41,664.690	

	CUSTODIAN REIT PLC	191,703.000	143,585.540	
	DERWENT LONDON PLC	44,297.000	975,419.940	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	244,328.000	229,668.320	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	101,041.000	411,236.870	
	HAMMERSON PLC	1,605,036.000	460,645.330	
	HELICAL PLC	48,089.000	111,566.480	
	HOME REIT PLC	286,621.000	0.000	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	169,602.000	144,840.100	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	298,145.000	1,993,099.320	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	147,597.000	56,677.240	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	806,758.000	1,636,105.220	
	NEWRIVER REIT PLC	113,885.000	85,072.090	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	200,922.000	137,430.640	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	535,453.000	512,963.970	
	PRS REIT PLC/THE	210,972.000	168,566.620	
	REGIONAL REIT LTD	236,558.000	59,376.050	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	87,913.000	708,578.780	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	203,492.000	91,164.410	
	SEGRO PLC	532,308.000	4,685,375.010	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	771,234.000	1,082,812.530	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	496,398.000	365,348.920	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	262,409.000	213,338.510	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	156,953.000	95,898.280	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	752,501.000	1,197,981.590	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	354,973.000	249,900.990	
	UNITE GROUP PLC	157,048.000	1,512,372.240	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	190,244.000	224,868.400	
	WAREHOUSE REIT PLC	182,285.000	152,754.830	
	WORKSPACE GROUP PLC	55,710.000	299,719.800	
イギリス・ポンド　小計		11,834,683.000	21,278,590.650 (4,154,432,039)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	293,689.000	511,018.860	
	REIT 1 LTD	80,666.000	1,255,162.960	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	84,461.000	640,045.450	
イスラエル・シュケル　小計		458,816.000	2,406,227.270	

			(101,071,892)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	25,873.000	438,029.890	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,895.000	140,128.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,403.000	687,265.270	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,104.000	125,125.760	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	49,353.600	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	32,344.000	1,490,088.080	
	CHOICE PROPERTIES REIT	64,451.000	841,085.550	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	19,881.000	257,260.140	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,105.000	307,480.550	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	53,218.000	695,027.080	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	2,585.000	47,615.700	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	41,415.000	631,164.600	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,103.000	862,096.690	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	53,933.000	493,486.950	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	27,652.000	335,695.280	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,694.000	409,906.200	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,386.000	113,375.100	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,485.000	104,603.050	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	107,834.300	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	51,343.000	261,849.300	
	PRIMARIS REIT	20,442.000	279,442.140	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,891.000	51,037.560	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	57,580.000	1,019,741.800	
	SLATE GROCERY REIT	12,169.000	132,155.340	
	SMARTCENTRES REIT	28,245.000	644,268.450	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	3,727.000	35,592.850	
カナダ・ドル　小計		645,802.000	10,560,709.230 (1,204,132,066)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	317,876.000	356,021.120	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	431,888.000	954,472.480	

	KIWI PROPERTY GROUP LTD	641,837.000	523,097.150	
	PRECINCT PROPERTIES	629,766.000	730,528.560	
ニュージーランド・ドル　小計		2,021,367.000	2,564,119.310 (240,540,032)	
ユーロ	AEDIFICA	18,765.000	1,179,380.250	
	ALTAREA	1,900.000	183,920.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	15,092.000	217,022.960	
	CARMILA SA	22,407.000	367,474.800	
	COFINIMMO SA	14,794.000	979,362.800	
	COVIVIO	20,012.000	968,180.560	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	16,946.000	372,812.000	
	GECINA SA	20,345.000	2,034,500.000	
	HAMBORNER REIT AG	28,721.000	188,122.550	
	ICADE	12,549.000	334,305.360	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	36,875.670	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	118,112.000	684,459.040	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	175,735.000	177,492.350	
	KLEPIERRE	77,287.000	1,966,181.280	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	19,464.000	138,972.960	
	MERCIALYS	37,380.000	395,480.400	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	131,844.000	1,409,412.360	
	MONTEA SCA	7,158.000	604,851.000	
	NSI NV	7,519.000	151,131.900	
	RETAIL ESTATES	5,102.000	345,915.600	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	12,584.000	498,955.600	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	40,312.000	3,201,579.040	
	VASTNED RETAIL	7,354.000	165,465.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	68,648.000	1,773,864.320	
	WERELDHAVE NV	13,999.000	193,746.160	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,850.000	372,650.000	
ユーロ　小計		927,434.000	18,942,113.960 (3,181,517,461)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	23,341.000	82,043,615.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	69,168.000	328,202,160.000	
	JR REIT XXVII	65,671.000	272,206,295.000	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	22,542.000	109,892,250.000	
	LOTTE REIT CO LTD	48,275.000	162,686,750.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,011.000	42,879,270.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	27,173.000	173,363,740.000	
	SK REITS CO LTD	48,785.000	208,555,875.000	

	韓国・ウォン　小計		316,966.000	1,379,829,955.000 (157,024,649)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	735,070.000	1,301,073.900	
		LINK REIT	1,022,620.000	36,200,748.000	
		PROSPERITY REIT	538,000.000	715,540.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	445,000.000	801,000.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	908,000.000	898,920.000	
	香港・ドル　小計		3,648,690.000	39,917,281.900 (796,748,947)	
投資証券　合計			28,775,135	73,253,204,261 (73,253,204,261)	
合計				82,155,504,921 (82,155,504,921)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券	5銘柄	0.06	－	77.25
	投資証券	133銘柄	－	76.96	
イギリス・ポンド	投資証券	37銘柄	－	5.04	5.06
イスラエル・シュケル	投資証券	3銘柄	－	0.12	0.12
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	31銘柄	7.59	－	7.62
カナダ・ドル	投資証券	26銘柄	－	1.46	1.47
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	22銘柄	3.05	－	3.06
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	－	3.91
	投資証券	26銘柄	－	3.86	
韓国・ウォン	投資証券	8銘柄	－	0.19	0.19
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.06	－	1.03
	投資証券	5銘柄	－	0.97	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	520,374,336円
Ⅱ　負債総額	142,686円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	520,231,650円
Ⅳ　発行済数量	325,887,502口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5964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

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	603,687,242,016円
Ⅱ　負債総額	261,875,935円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	603,425,366,081円
Ⅳ　発行済数量	123,429,925,402口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.8888円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,526,193,555,832円
Ⅱ　負債総額	377,217,578円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,525,816,338,254円
Ⅳ　発行済数量	165,855,594,233口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	9.1997円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	568,141,895,187円
Ⅱ　負債総額	12,832,539,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	555,309,356,187円
Ⅳ　発行済数量	461,478,978,368口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2033円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	264,593,047,724円
Ⅱ　負債総額	1,367,429,249円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	263,225,618,475円
Ⅳ　発行済数量	108,938,863,905口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4163円

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	183,261,384,501円
Ⅱ　負債総額	779,223,944円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	182,482,160,557円
Ⅳ　発行済数量	79,409,420,346口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2980円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	**82,365,048,688円**
Ⅱ　負債総額	**36,452,470円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**82,328,596,218円**
Ⅳ　発行済数量	**41,418,458,350口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.9877円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6)受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【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（2024年5月31日現在）

資本金の額　　20億円

発行する株式総数※　　100,000株
（普通株式 上限100,000株、Ａ種種類株式 上限30,000株）

発行済株式総数　　40,000株
（普通株式24,490株、Ａ種種類株式15,510株）

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

（2）会社の機構（2024年5月31日現在）

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

②　投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年5月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,547,723,749,150
追加型株式投資信託	777	16,661,185,577,328
単位型公社債投資信託	21	34,553,955,694
単位型株式投資信託	198	1,066,255,275,490
合計	1,022	19,309,718,557,662

３【委託会社等の経理状況】

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

2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第39期事業年度（自2023年4月1日至2024年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第38期 （2023年3月31日現在）		第39期 （2024年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		33,770		41,183
金銭の信託		29,184		28,143
未収委託者報酬		16,279		19,018
未収運用受託報酬		3,307		3,577
未収投資助言報酬		283		315
未収収益		15		6
前払費用		1,129		1,510
その他		2,377		2,088
流動資産計		86,346		95,843
固定資産				
有形固定資産		1,127		1,093
建物	※1	1,001	※1	918
器具備品	※1	118	※1	130
リース資産	※1	7	※1	5
建設仮勘定		-		39
無形固定資産		5,021		4,495
ソフトウエア		3,367		2,951
ソフトウエア仮勘定		1,651		1,543
電話加入権		2		0
投資その他の資産		9,768		8,935
投資有価証券		182		184
関係会社株式		5,810		4,447
長期差入保証金		775		768
繰延税金資産		2,895		3,406
その他		104		128
固定資産計		15,918		14,524
資産合計		102,265		110,368

（単位：百万円）

	第38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,481	1,982
リース債務	1	1
未払金	7,246	8,970
未払収益分配金	0	1
未払償還金	-	0
未払手数料	7,005	8,246
その他未払金	240	721
未払費用	7,716	8,616
未払法人税等	1,958	3,676
未払消費税等	277	1,497
賞与引当金	1,730	1,927
役員賞与引当金	48	52
流動負債計	20,460	26,725
固定負債		
リース債務	6	4
退職給付引当金	2,654	2,719
時効後支払損引当金	108	73
固定負債計	2,769	2,796
負債合計	23,230	29,521
（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	57,481	59,294
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	57,358	59,170
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	25,678	27,490
株主資本計	79,034	80,846
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	79,034	80,846
負債・純資産合計	102,265	110,368

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第38期 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）		第39期 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	95,739		102,113	
運用受託報酬	16,150		17,155	
投資助言報酬	2,048		2,211	
その他営業収益	23		26	
営業収益計		113,962		121,507
営業費用				
支払手数料	41,073		44,366	
広告宣伝費	216		329	
公告費	0		0	
調査費	33,177		35,468	
調査費	12,294		13,277	
委託調査費	20,882		22,190	
委託計算費	548		558	
営業雑経費	733		823	
通信費	36		36	
印刷費	504		598	
協会費	69		65	
諸会費	29		44	
支払販売手数料	92		78	
営業費用計		75,749		81,545
一般管理費				
給料	10,484		10,763	
役員報酬	168		164	
給料・手当	9,199		9,425	
賞与	1,115		1,173	
交際費	17		34	
寄付金	11		15	
旅費交通費	128		162	
租税公課	330		489	
不動産賃借料	1,006		1,030	
退職給付費用	437		412	
固定資産減価償却費	1,388		1,567	
福利厚生費	47		46	
修繕費	1		1	
賞与引当金繰入額	1,730		1,927	
役員賞与引当金繰入額	48		52	
機器リース料	0		0	
事務委託費	4,074		3,379	
事務用消耗品費	37		46	
器具備品費	1		3	
諸経費	334		240	
一般管理費計		20,078		20,172
営業利益		18,135		19,788

（単位：百万円）

	第38期 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）		第39期 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	10		4	
受取配当金	※1　2,400		※1　899	
時効成立分配金・償還金	0		0	
雑収入	10		18	
時効後支払損引当金戻入額	24		35	
営業外収益計		2,446		959
営業外費用				
為替差損	3		19	
金銭の信託運用損	1,003		1,008	
早期割増退職金	24		6	
雑損失	47		0	
営業外費用計		1,079		1,034
経常利益		19,502		19,712
特別利益				
投資有価証券売却益	4		―	
特別利益計		4		―
特別損失				
固定資産除却損	12		6	
投資有価証券売却損	9		―	
関係会社株式評価損	584		1,362	
減損損失	―		※2　231	
特別損失計		606		1,601
税引前当期純利益		18,900		18,111
法人税、住民税及び事業税		4,881		5,769
法人税等調整額		197		△510
法人税等合計		5,078		5,258
当期純利益		13,821		12,852

（３）【株主資本等変動計算書】

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

第39期（自　2023年4月1日　至　2024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	25,678	57,481	79,034
当期変動額									
剰余金の配当							△11,040	△11,040	△11,040
当期純利益							12,852	12,852	12,852
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,812	1,812	1,812
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846

	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	79,034
当期変動額			
剰余金の配当			△11,040
当期純利益			12,852
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	1,812
当期末残高	△0	△0	80,846

重要な会計方針

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

6. 収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。 （1）委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年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

（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38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
建物	523	630
器具備品	934	769
リース資産	1	3

（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38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）
受取配当金	2,393	895

※2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウエア仮勘定	231

当社は、キャッシュ・フローを生み出す最小単位として、主として事業別に資産をグルーピングしております。当社の資産運用業に係るソフトウエア開発計画の大幅な延期に伴い、当該計画に係るソフトウエア仮勘定について、回収可能額まで減額し、当該減少額231百万円を減損損失として特別損失に計上いたしました。なお、当該資産の回収可能額は使用価値により測定しており、使用価値については、将来キャッシュ・フローが見込まれないため、備忘価額の1円として評価しております。

（株主資本等変動計算書関係）

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

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（予定）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					

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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
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

2024年6月17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（予定）日
2024年6月17日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第38期（2023年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
（1）金銭の信託	29,184	29,184	―
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	―
資産計	29,186	29,186	―

第39期（2024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	28,143	28,143	―
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	―
資産計	28,145	28,145	―

（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38期（2023年3月31日現在）

	1年以内 （百万円）	1年超5年以内 （百万円）	5年超10年以内 （百万円）	10年超 （百万円）
（1）現金・預金	33,770	―	―	―
（2）金銭の信託	29,184	―	―	―
（3）未収委託者報酬	16,279	―	―	―
（4）未収運用受託報酬	3,307	―	―	―
（5）投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	―	1	―	―
合計	82,540	1	―	―

第39期（2024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	41,183	―	―	―
（2）金銭の信託	28,143	―	―	―
（3）未収委託者報酬	19,018	―	―	―
（4）未収運用受託報酬	3,577	―	―	―
（5）投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	―	1	―	―
合計	91,923	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38期（2023年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
（1）金銭の信託	－	29,184	－	29,184
（2）投資有価証券				
その他有価証券	－	1	－	1
資産計	－	29,186	－	29,186

第39期（2024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	－	28,143	－	28,143
（2）投資有価証券				
その他有価証券	－	1	－	1
資産計	－	28,145	－	28,145

（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（預金・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38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	180	182
関係会社株式		
非上場株式	5,810	4,447

（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38期の貸借対照表計上額5,810百万円、第39期の貸借対照表計上額4,447百万円）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。

第39期（2024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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

該当はありません。

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、有価証券について1,362百万円（関係会社株式1,362百万円）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38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	△191	△246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

（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38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
非積立型制度の退職給付債務	2,698	2,760
未積立退職給付債務	2,698	2,760
未認識数理計算上の差異	△44	△40
未認識過去勤務費用	0	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719
退職給付引当金	2,654	2,719
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	22	13
過去勤務費用の費用処理額	34	△0
その他	△4	△4
確定給付制度に係る退職給付費用	334	307

（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24百万円、当事業年度において6百万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38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～3.56%	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103百万円、当事業年度104百万円であります。

（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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
繰延税金資産	（百万円）	（百万円）
未払事業税	121	195
未払事業所税	9	9
賞与引当金	529	590
未払法定福利費	94	98
運用受託報酬	390	351
資産除去債務	15	17
減価償却超過額（一括償却資産）	21	12
減価償却超過額	198	91
繰延資産償却超過額（税法上）	297	331
退職給付引当金	812	832
時効後支払損引当金	33	22
ゴルフ会員権評価損	7	6
関係会社株式評価損	345	761
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	―	70
その他	13	8
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	2,895	3,406
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	―	―
繰延税金資産の純額	2,895	3,406

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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	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 %	△1.44 %
その他	△0.06 %	△0.14 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.87 %	29.04 %

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

	第38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	68,921百万円	60,761百万円
資産合計	68,921百万円	60,761百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	3,643百万円	1,957百万円
負債合計	3,643百万円	1,957百万円
純資産	65,278百万円	58,804百万円

（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	51,451百万円	47,640百万円
顧客関連資産	20,947百万円	17,109百万円

（2）損益計算書項目

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,039百万円	△7,649百万円
経常利益	△8,039百万円	△7,649百万円
税引前当期純利益	△8,039百万円	△7,649百万円
当期純利益	△6,744百万円	△6,474百万円
1株当たり当期純利益	△168,617円97銭	△161,850円28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	4,228百万円	3,837百万円

（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38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
委託者報酬	95,739百万円	102,113百万円
運用受託報酬	14,651百万円	15,156百万円
投資助言報酬	2,048百万円	2,211百万円
成功報酬（注）	1,499百万円	1,999百万円
その他営業収益	23百万円	26百万円
合計	113,962百万円	121,507百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の運用受託報酬、当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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（持分法損益等）

当社は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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

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。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	8,140	未払手数料	1,870
	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	16,655	未払手数料	3,137

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38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1株当たり純資産額	1,975,862円96銭	2,021,173円74銭
1株当たり当期純利益金額	345,535円19銭	321,310円79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38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
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	13,821百万円	12,852百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2023年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

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

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
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	9,557.5万円（2024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11月28日	臨時報告書
2024年1月25日	臨時報告書
2024年2月13日	有価証券報告書
2024年2月13日	有価証券届出書
2024年3月26日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

２０２４年5月２３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

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２０２４年3月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去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）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２４年7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
業 務 執 行 社 員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の２０２３年１１月１４日から２０２４年5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２０２４年5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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。