

使用開始日  
2024年2月9日

# コア資産形成ファンド

## 愛称：ビギナーズ ラップ

追加型投信／内外／資産複合

- この目論見書により行う「コア資産形成ファンド」の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により、有価証券届出書を2024年2月8日に関東財務局長に提出しており、2024年2月9日にその効力が生じております。
- 「コア資産形成ファンド」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

## アセットマネジメントOne株式会社

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。  
ファンドは、課税上「株式投資信託」として取り扱われます。

### ■委託会社への照会先

【コールセンター】 **0120-104-694**（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

【ホームページアドレス】 <https://www.am-one.co.jp/>

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当事項はありません。

## 目 次

第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
第2【管理及び運営】	61
第3【ファンドの経理状況】	68
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	253
第三部【委託会社等の情報】	255
第1【委託会社等の概況】	255
約款	301

## 第一部【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

コア資産形成ファンド(以下「当ファンド」といいます。)

ただし、愛称として「ビギナーズ ラップ」という名称を用いることがあります。

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」と称することがあります。）です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

また、当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付けまたは信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

### (3) 【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4) 【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

※ 「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除して求めた金額（純資産総額）を、計算日における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価額で表示されることがあります。

基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号※
アセットマネジメントOne株式会社	<a href="https://www.am-one.co.jp/">https://www.am-one.co.jp/</a>	0120-104-694

注：電話番号はコールセンターのものです（以下同じ）。

※ 電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時から午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

### (5) 【申込手数料】

① 申込手数料（受益権1口当たり）は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。なお、申込手数料には、消費税

ならびに地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が課せられます。

- ② 申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。
- ③ 「分配金再投資コース」を選択された場合の収益分配金は、毎計算期末の翌営業日に原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

#### (6) 【申込単位】

- ① 申込単位は各販売会社が定める単位とします。
- ② 「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」による取得申込が可能です。販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。なお、「分配金再投資コース」を選択されたお申込者は、収益分配金の再投資に際し、1口の整数倍をもって取得することができます。
- ③ 申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。  
※当初元本は1口当たり1円です。

#### (7) 【申込期間】

2024年2月9日から2024年8月8日まで

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

#### (8) 【申込取扱場所】

当ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	<a href="https://www.am-one.co.jp/">https://www.am-one.co.jp/</a>	0120-104-694

#### (9) 【払込期日】

取得申込代金は、販売会社が定める期日までに、販売会社にお支払いいただきます。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、アセットマネジメントOne株式会社（「委託者」または「委託会社」といいます。）の指定する口座を経由して、みずほ信託銀行株式会社（「受託者」または「受託会社」といいます。）の指定するファンド口座（受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座）に払い込まれます。

#### (10) 【払込取扱場所】

取得申込代金は、お申込みの販売会社にお支払いください。なお、払込取扱場所については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	<a href="https://www.am-one.co.jp/">https://www.am-one.co.jp/</a>	0120-104-694

#### (11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## (12) 【その他】

### ○ 投資信託振替制度における振替受益権について

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

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

投資信託振替制度（以下「振替制度」といいます。）においては、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われます。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- ① 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、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および外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券（以下、各々を「主要投資対象マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

##### <ファンドの特色>

国内外の公社債・株式へ分散投資を行い、安定した収益の獲得を目指します。

- ◆ 国内債券、外国債券、国内株式および外国株式を主要投資対象とし、各資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析を勘案して配分比率を決定します。

- 資産配分比率は、リスク均等配分を基本としつつ、投資環境分析による各資産の魅力判定に応じた機動的な変更を行うことで、安定した収益の獲得を目指します。

\* ファンドの特色における「リスク」とは、各資産の価格変動やファンドの基準価額の振れ幅の大きさのことをいいます。

- ◆ 各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理し、配分比率を調整することにより、基準価額の変動を抑制することを目指します。

- 各資産のリスク水準の変化に応じて、各資産への配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券（以下、各主要投資対象マザーファンド受益証券を含め「マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて国内短期債券に投資することや、短期金融商品に直接投資することがあります。

- ◆ 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。

- ② 5,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

- ③ 一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

<商品分類>

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)
単位型  追加型	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	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書又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う。
資産複合	目論見書又は投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」及び「その他資産」のうち、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

<属性区分>

・属性区分表

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

※1 当ファンドが投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「資産複合(株式・債券) / 資産配分変更型」です。

※2 「為替ヘッジ」は、対円での為替変動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)	目論見書又は投資信託約款において、主として「株式」、 「債券」及び「不動産投信」以外の資産に投資する旨の記載 があるものをいい、括弧内の記載はその該当資産を表す。
資産複合 (株式・債券) 資産配分変更型	目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象と 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う。な お、括弧内の記載はその該当複数資産を表す。 ※当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券（投資信 託証券）への投資を通じて、株式および債券に投資を行 います。
年1回	目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記 載があるものをいう。
グローバル (日本を含む)	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収 益が、日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるも のをいう。
ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファン ド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資 対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わな い旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がな いものをいう。

(注1) 商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

(注2) 当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

(注3) 当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

(2) 【ファンドの沿革】

2015年4月20日	信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2021年7月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を追加し、「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」を「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更
2021年12月17日	ファンドの主要投資対象から「MHAM TOPIXマザーファンド」を削除
2022年3月1日	ファンドの主要投資対象に「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファン

ド」を追加し、「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」を「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更

2022年6月29日

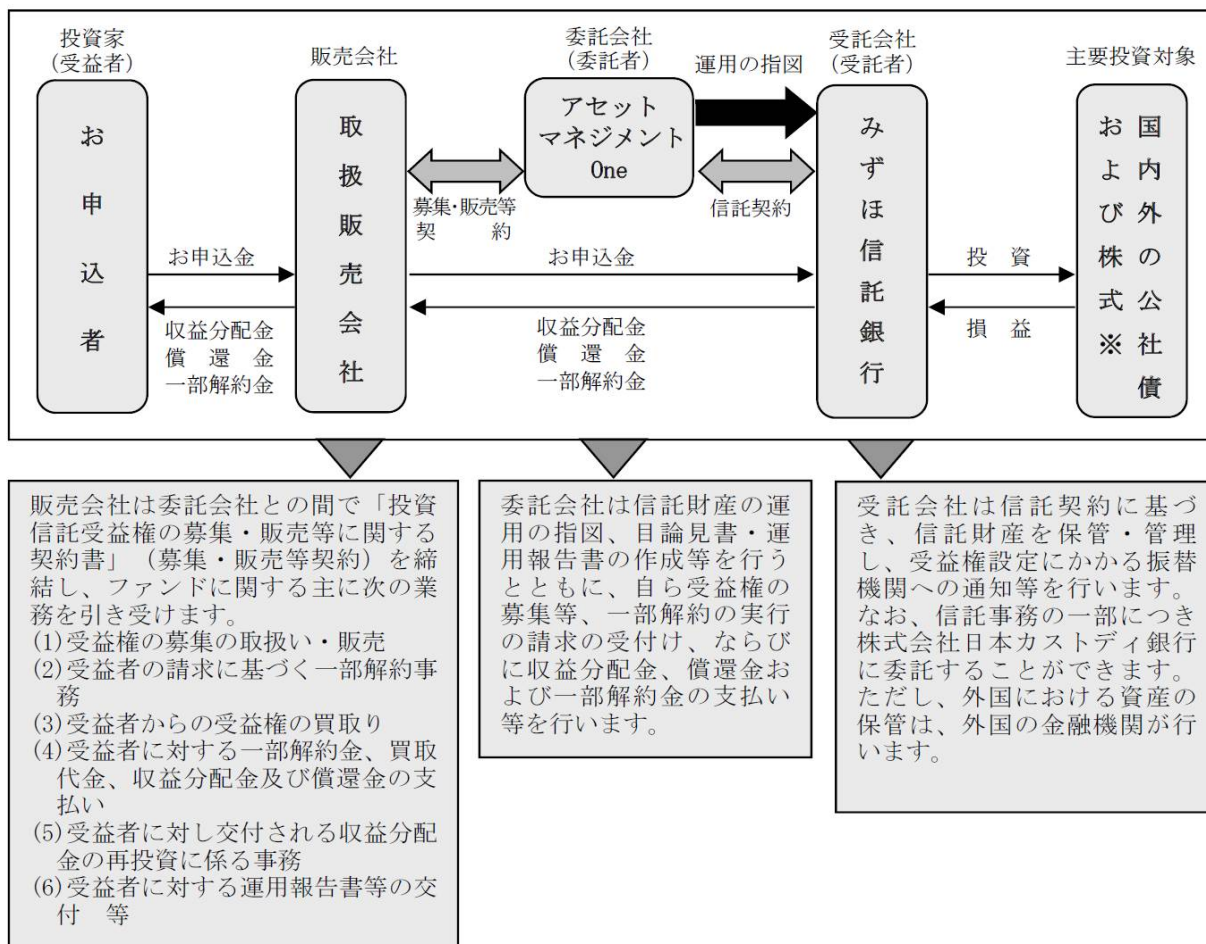
ファンドの主要投資対象から「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」を削除

2023年8月9日

信託期間を2048年5月8日までに変更（当初は2028年5月8日まで）

### (3) 【ファンドの仕組み】

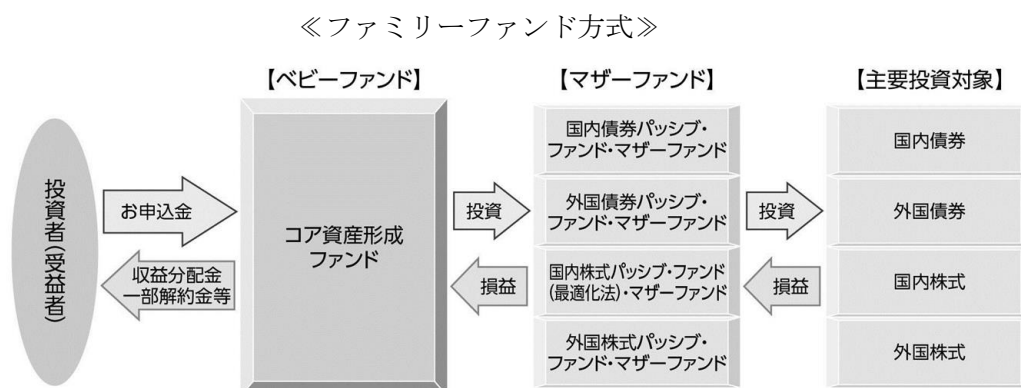
#### ① 当ファンドの運営の仕組み



※ 主要投資対象である国内外の公社債および株式には、主として、各マザーファンドを通じて投資を行います。

## ② ファミリーファンド方式の仕組み

当ファンドは、下図のマザーファンドを通じて各資産への投資を行う「ファミリーファンド方式」で運用を行います。



- ※ ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資することにより、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。
- ※ 資産配分の決定の際、一部のマザーファンド受益証券への投資を行わない場合があります。また、ファンド全体のリスクの状況によっては、上記のマザーファンドを通じた投資のほか、MHAM国内短期債券マザーファンドを通じて国内短期債券に投資する場合や、信託財産の純資産総額の50%を上限に短期金融商品等へ直接投資する場合があります。
- ※ マザーファンドのほかに、株式、公社債等に直接投資する場合があります。

## ③ 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2023年11月30日現在）

委託会社の沿革

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

## 大株主の状況

(2023年11月30日現在)

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

#### ① 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

#### ② 運用方法

##### 1. 主要投資対象

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、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および外国株式パッシブ・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。

##### 2. 投資態度

- a. 主として、各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行います。
- b. 各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資割合については、各マザーファンドが主要投資対象とする資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析等を勘案のうえ配分比率を決定します。ただし、ファンドの価格変動リスクを勘案し、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券への投資を行う場合、および信託財産の純資産総額の50%を上限に預金等の短期金融商品への直接投資を行う場合があります。
- c. 実質組入※外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

※ 「実質組入」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額をいいます。（以下同じ。）

- d. マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。
- e. 市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

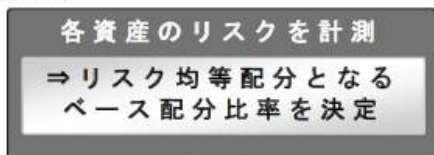
③ ファンドの投資プロセス

1. 当ファンドの投資プロセス

当ファンドは、以下の投資プロセスにより、各資産への投資割合を決定し、当ファンドを管理します。

各資産への配分比率は、特定の資産へのリスク集中回避を意図した「リスク均等配分」をベースに、投資環境分析やリスクの状況を踏まえて機動的に変更します。

STEP1

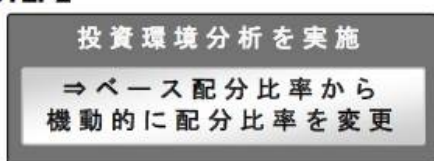


STEP1 各資産のリスクを計測

「国内債券」、「外国債券」、「国内株式」および「外国株式」の各資産について、リスクを計測し、ポートフォリオに対するリスク寄与度が均等（リスク均等配分）となるよう、ベース配分比率を決定します。

☞ 下記「☞ リスク均等配分とは」をご参照ください。

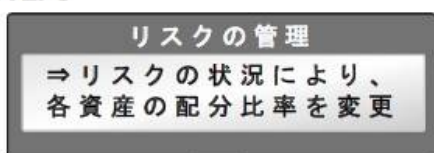
STEP2



STEP2 投資環境分析を実施

マクロ経済の各種指標から世界景気の状態（景気サイクル）を判定する「経済環境分析」と、金融市場の各種指標から金融市場の状態を判定する「市場環境分析」により、投資環境を分析します。この結果をもとに各資産の魅力度を判定し、魅力度に応じて各資産への配分比率をベース配分比率から機動的に変更します。

STEP3



STEP3 リスクの管理

各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理します。資産別のリスク水準の変化に応じて、配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、各資産への配分比率を引き下げます※。

STEP4



STEP4 ポートフォリオの構築

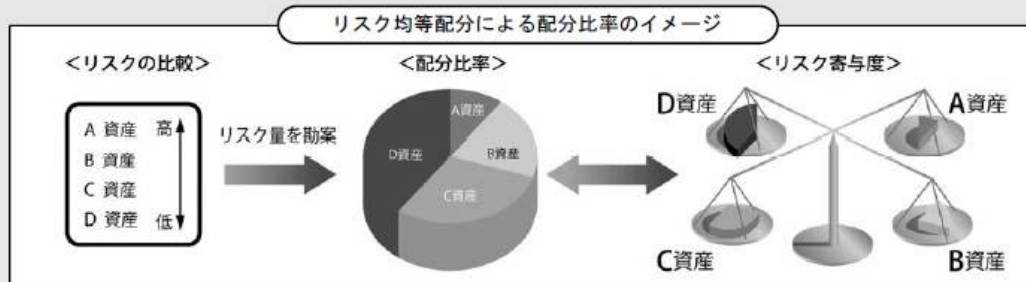
STEP1～3で決定した配分比率に従って、各資産への投資を行います。

※STEP3において各資産への配分比率の引き下げを行った場合、国内短期債券や短期金融商品への投資を行います。

※ 上記のプロセスは、今後変更される場合があります。

☞ リスク均等配分とは

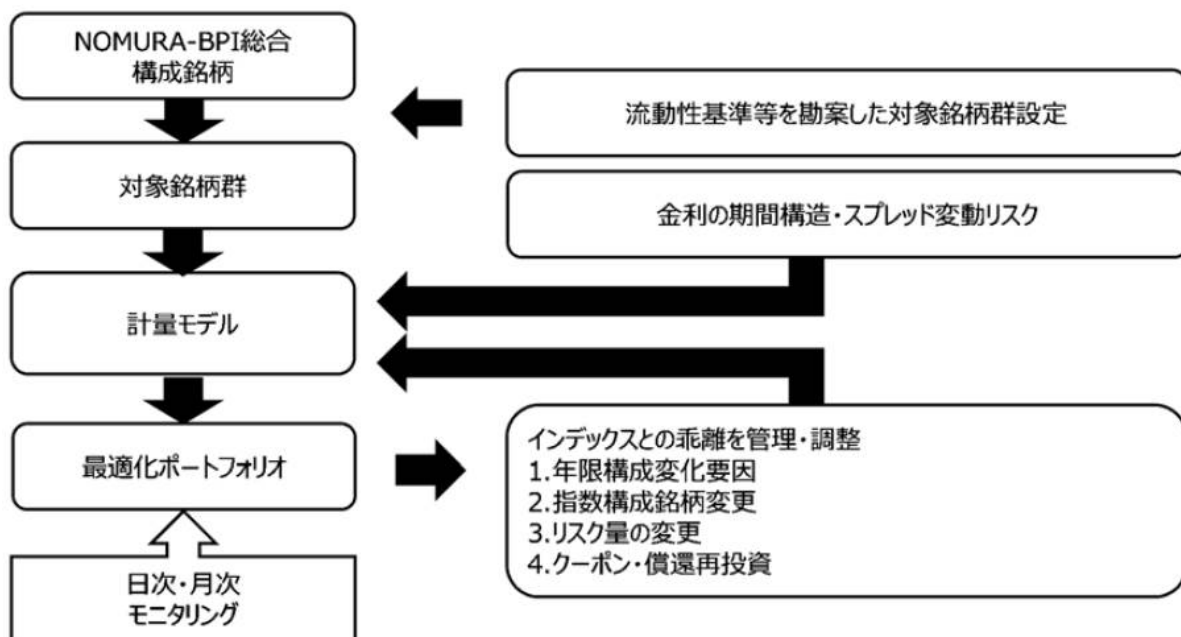
「リスク均等配分」とは、各資産のリスク（価格変動性）の大きさに着目した分散投資の方法で、リスクが相対的に高い資産の配分比率を低くし、リスクが相対的に低い資産の配分比率を高くすることにより、ファンドに対する各資産のリスク寄与度を均等にすることを旨とする投資手法です。これにより、リスクが高い資産の値動きがファンド全体の値動きに与える影響を抑える効果が期待されます。



※上記はイメージ図です。

## 2. 各マザーファンドの投資プロセス

<国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス>



### 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

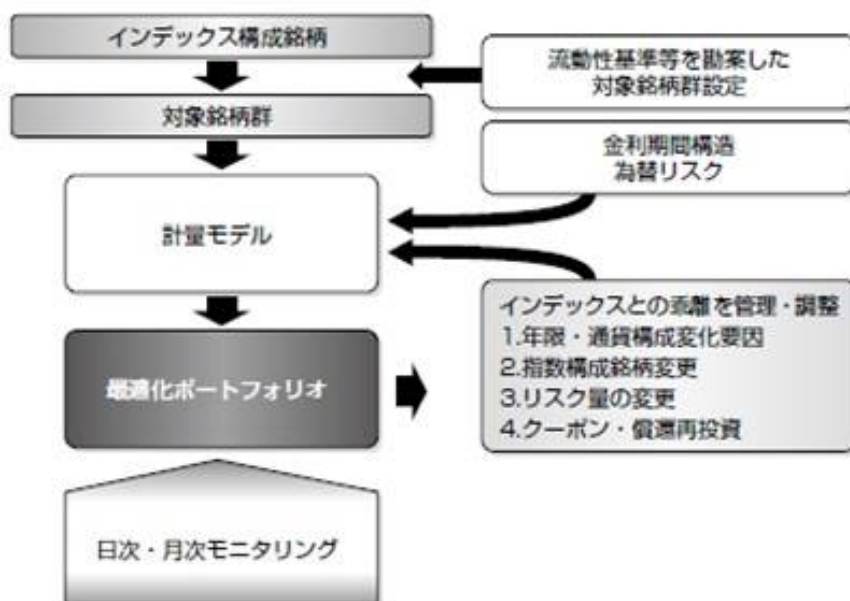
日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

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

＜外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス＞



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。

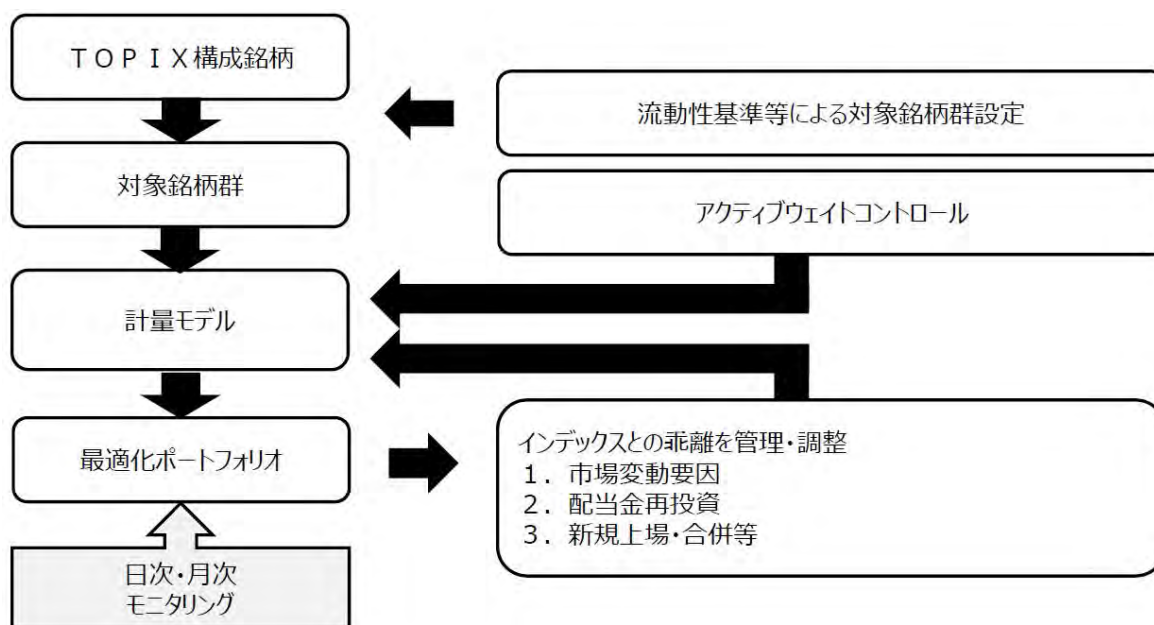
3. インデックスとの乖離を管理

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

＜国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資プロセス＞



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

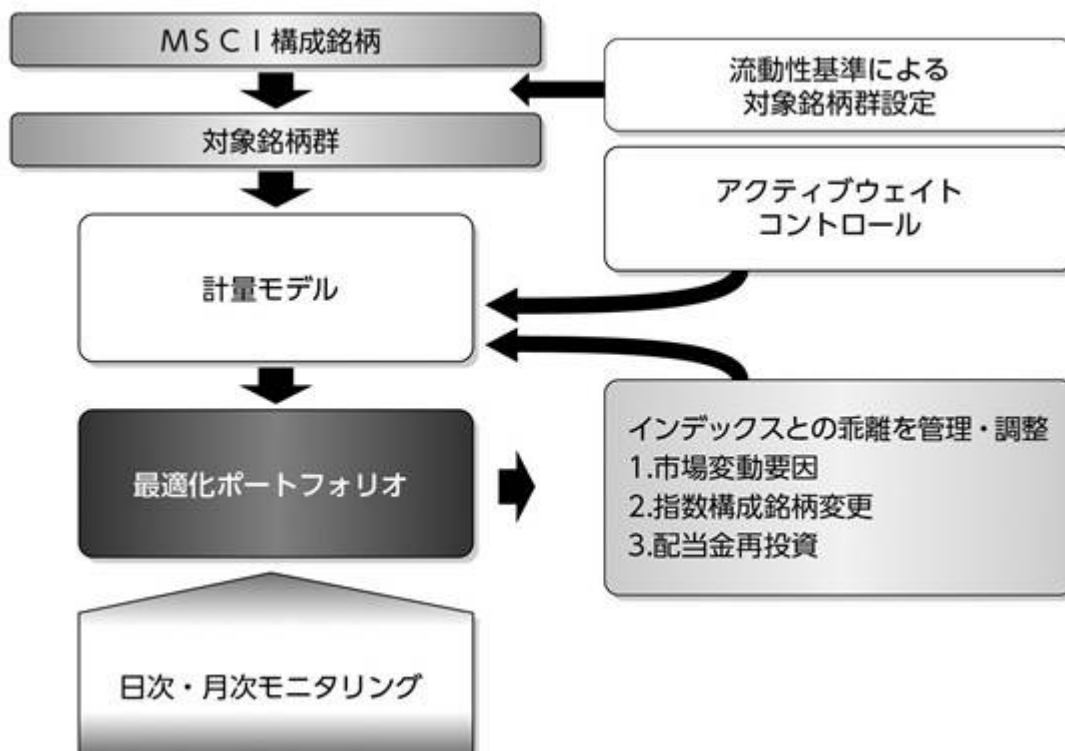
日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。

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



<外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資プロセス>



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。

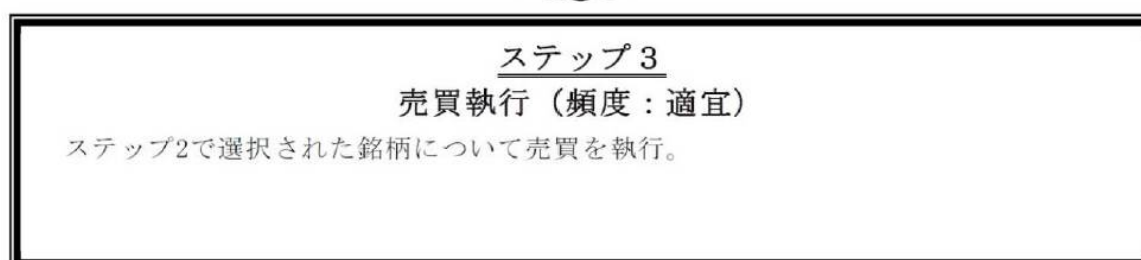
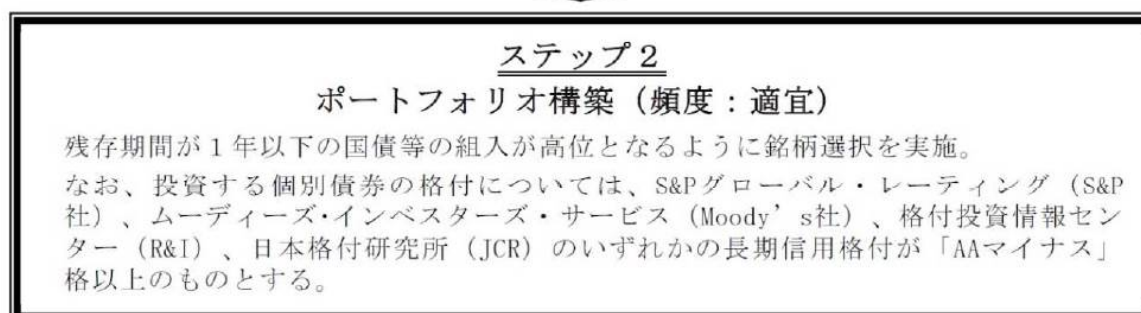
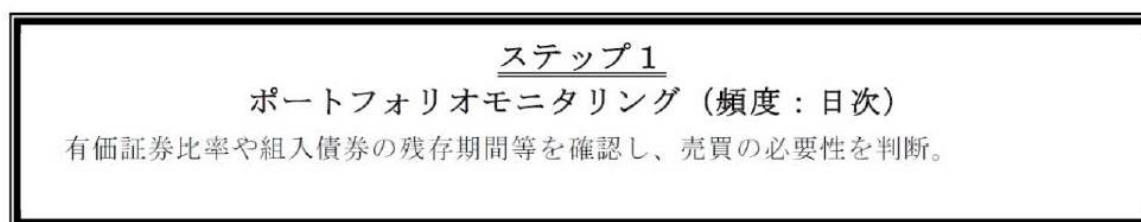
3. インデックスとの乖離を管理

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

<MHAM国内短期債券マザーファンドの投資プロセス>



市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

## (2) 【投資対象】

### ① 投資の対象とする資産の種類

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。）
  - a. 有価証券
  - b. 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25条、第26条および第27条に定めるものに限ります。）
  - c. 金銭債権
  - d. 約束手形（a.に掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - a. 為替手形

### ② 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として下記1. から下記5. 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各受益証券を含む下記6. から下記27. 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. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
2. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
3. 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
4. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
5. MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券
6. 株券または新株引受権証券
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人が発行する債券
10. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
11. 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。）
12. 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。）
13. 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。）
14. 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。）

15. コマーシャル・ペーパー
  16. 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
  17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1. から前記16. の証券または証書の性質を有するもの（外国の者の発行する証券または証書で、前記6. から前記11. の証券または証書の性質を有するプリファードセキュリティーズ（ハイブリッド型のプリファードセキュリティーズを含みます。）およびこれらに類するものを含みます。）
  18. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  19. 投資証券、投資法人債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、プリファードセキュリティーズ（投資証券および投資法人債券のハイブリッド型のものを含みます。）に該当するものを含みます。）
  20. 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。）
  21. 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。）
  22. 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。）
  23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  24. 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。）
  25. 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。）
  26. 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
  27. 外国の者に対する権利で前記26. の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記6. の証券または証書、前記17. および前記22. の証券または証書のうち前記6. 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、前記7. から前記11. までの証券および前記17. ならびに前記22. の証券または証書のうち前記7. から前記11. までの証券の性質を有するものならびに前記19. の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、前記18. の証券および前記19. の証券（投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

### ③ 金融商品の指図範囲

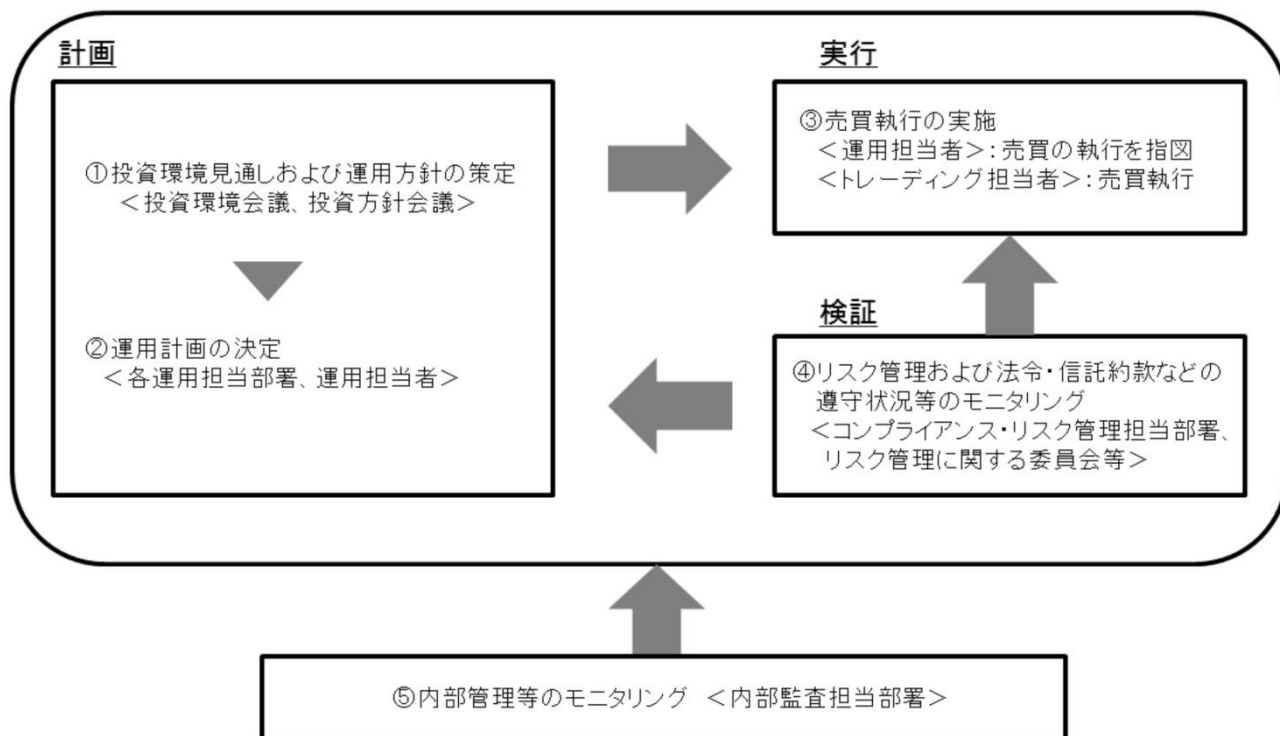
委託会社は、信託金を、②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。また、②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、下記1. から下記4. までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

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前記5. の権利の性質を有するもの
  7. 金銭債権（ただし、流動性のあるプリファードセキュリティーズに該当するものに限り、前記1. から前記6. で該当するものならびに「② 有価証券の指図範囲」の17. および19. に定める証券または証書を除きます。）
  8. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に定めるものをいいます。）
  9. 外国の法律に基づく権利であって前記8. に掲げる権利に類するもの（リミテッド・パートナーシップ（LP）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含みます。）を含みます。）
  10. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
  11. 外国法人の社員権で前記10. に掲げる権利の性質を有するもの（リミテッド・ライアビリティ・カンパニー（LLC）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含みます。）を含みます。）
- なお、前記5.、前記6. および前記8. から前記11. までの権利等を以下「みなし有価証券」といいます。

### (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。

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2023年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

#### (4) 【分配方針】

##### ① 収益分配方針

毎計算期末(原則として5月8日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益(繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
2. 分配金額は、委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
3. 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

※ 将来の収益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。

##### ② 収益分配金の支払い

1. 収益分配金は、原則として毎計算期間終了日から起算して5営業日までに販売会社において支払いが開始されます。
2. 収益分配金の再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資することにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

※ 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、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に対し、お支払いします。

#### (5) 【投資制限】

##### a. 約款で定める投資制限

##### ① 株式、新株引受権証券および新株予約権証券(約款 運用の基本方針 運用方法(3) 投資制限、約款第17条および約款第20条)

1. 株式への実質投資割合<sup>※</sup>には制限を設けません。

※ 「実質投資割合」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の当ファンドの信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。(以下同じ。)

2. 委託会社は、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が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
3. 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
4. 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には制限を設けません。
5. 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、取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび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。なお、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。

② みなし有価証券（約款第17条）

委託会社は、みなし有価証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。

③ 投資信託証券（約款第17条）

委託会社は、投資信託証券（マザーファンド受益証券および取引所金融商品市場（金融商品取引法第2条第17項に規定する金融商品市場をいいます。）または外国金融商品市場に上場等（不動産投資信託証券については、予定を含みます。以下同じ。）され、かつこれらの市場において常時売却可能（市場の急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

④ 転換社債等（約款第21条）

委託会社は、同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 外貨建資産（約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限および約款第31条）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、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。

⑥ 外国為替予約取引（約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限）

外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

⑦ 外国為替予約取引（約款第32条）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑧ 信用リスク集中回避のための投資制限（約款第22条）

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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨ デリバティブ取引（約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限）

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

⑩ デリバティブ取引等（約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限、約款第23条）

委託会社は、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。（ただし、この信託において取引可能なものに限ります。以下同じ。）。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

⑪ 信用取引（約款第24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、株券の引き渡し又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. 信用取引の指図は、次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、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - a. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  - b. 株式分割により取得する株券
  - c. 有償増資により取得する株券
  - d. 売り出しにより取得する株券
  - e. 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
  - f. 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（前記e.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑫ 有価証券先物取引等（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、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

2. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
3. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係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。

⑬ スワップ取引（約款第26条）

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

⑭ 金利先渡取引および為替先渡取引（約款第27条）

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

⑮ 有価証券の貸付（約款第28条）

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を以下の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

⑩ 公社債の空売り（約款第29条）

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1. の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2. の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑪ 公社債の借入れ（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、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
2. 前記1. の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2. の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
4. 前記1. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑫ 資金の借入れ（約款第38条）

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用および運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金等および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を上回らない範囲内とします。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
4. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

## b. 法令で定める投資制限

### ○ 同一の法人の発行する株式の取得割合（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を、運用の指図を行うすべ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の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

## <各マザーファンドの投資方針および主な投資制限>

### I 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」

#### 1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合<sup>※</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。

※ NOMURA-BPI総合とは、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債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。NOMURA-BPI総合は、銘柄種別・残存年数別に分類した各セクターポートフォリオに対して、それぞれの投資収益指数が用意され、一定の組入基準にもとづいて構成されたインデックス・ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算され、機関投資家に広く認知されています。NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 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目指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。

##### (3) 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します。
- 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 有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。
- ⑦ スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。
- ⑧ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。
- ⑨ 外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行いません。
- ⑩ 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。
- ⑪ 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。
- ⑫ 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。

## II 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」

### 1. 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。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

- ① 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果を目指して運用を行います。

※ 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）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。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。

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）は、FTSE世界国債インデックス・データに基づき当社が計算したものです。

- 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。

#### (3) 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せん。

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 有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。
- ⑥ スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。
- ⑦ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。
- ⑧ 外国為替予約取引は約款24条の範囲で行いません。
- ⑨ 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。
- ⑩ 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。
- ⑪ 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。

### Ⅲ「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」

#### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX、配当込み）※に連動する投資成果を目標として運用を行います。

※ 東証株価指数（TOPIX=Tokyo Stock Price Index）とは、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、基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

\*1 東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」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 J P X が有しています。

\*2 J P X 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。

\*3 J P X 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。

\*4 J P X 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、J P X 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、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。
- \*6 J P X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。
- \*7 J P X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、J P X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。

## 2. 運用方法

### (1) 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。

### (2) 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目指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。

### (3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- ③ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- ④ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑤ 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 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。

## IV 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」

### 1. 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。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

海外の株式を主要投資対象とします。

### (2) 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）※に連動する投資成果を目指して運用を行います。

※ MSCI コクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み）とは、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。

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。

### (3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③ 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- ⑤ 有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。
- ⑥ スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。
- ⑦ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。
- 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。
- 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。
- 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。

## V 「MHAM国内短期債券マザーファンド」

### 1. 基本方針

この投資信託は、主としてわが国の短期の国債、地方債、政府保証債、金融債等（以下「国債等」といいます。）に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

この投資信託は、わが国の短期の国債等を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

- ① わが国の短期の国債等を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。
- ② 投資する個別債券の格付については、S&Pグローバル・レーティング（S&P社）、ムーディーズ・インベスターズ・サービス（Moody's社）、格付投資情報センター（R&I）、日本格付研究所（JCR）のいずれかの長期信用格付が「AAマイナス」格以上のものとします。
- ③ 投資する個別債券の残存期間については、原則として1年以下とします。
- ④ 市場動向および資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- ⑤ 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

## (3) 投資制限

- ① 株式（新株引受権証券を含みます。）への投資は行いません。
- ② 同一発行体が発行する有価証券への投資割合は、国債、地方債、特別の法律により法人の発行する債券を除き、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等への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 3【投資リスク】

### (1) 当ファンドにおける主として想定されるリスクと収益性に与える影響度合い

- ・当ファンドは、主として各マザーファンド受益証券への投資を通じて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。したがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
- ・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。
- ・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・登録金融機関およびアセットマネジメントOne株式会社が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- ・投資信託は預貯金とは異なります。

- ・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。

当ファンドにおいて主として想定されるリスクは以下の通りですが、基準価額の変動要因はこれらに限定されるものではありません。

なお、以下のリスクは、主にマザーファンドを通じて当ファンドが行う有価証券等への投資により発生します。

#### ① 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。

資産配分リスクとは、複数資産への投資（資産配分）を行った場合に、投資成果の悪い資産への配分が大きかったため、投資全体の成果も悪くなってしまいうリスクをいいます。

一般に、投資に際して資産配分を行う場合には、そのうちの1資産の価値変動が投資全体の成果に及ぼす影響度合いを小さくする効果が期待されますが、その場合にも、それぞれの資産の価値変動は、当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響を及ぼします。当ファンドは、国内外の公社債および株式に資産配分を行います。配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数の資産の価値が同時に下落した場合等には、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

#### ② 金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスクとは、金利変動により公社債の価格が下落するリスクをいいます。

一般に金利が上昇した場合には、既に発行されて流通している公社債の価格は下落します。金利上昇は、当ファンドが投資する公社債の価格に影響を及ぼし、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。また、金利変動により株式市場と公社債市場の間で資金シフトが起こる場合があります。その場合、金利変動の影響は株式市場にも及びます。

#### ③ 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。

当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることがあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

#### ④ 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスクとは、為替変動により外貨建資産の円換算価格が下落するリスクをいいます。当ファンドでは、外貨建資産への投資にあたり、原則として為替ヘッジを行わないため、投資対

象通貨と円との外国為替相場が円高となった場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### ⑤ 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。

信用リスクとは、公社債等の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）リスクをいいます。

一般に債務不履行が生じた場合、またはその可能性が高まった場合には、当該発行体が発行する公社債および短期金融商品（コマーシャル・ペーパー等）の価格は下落します。また、当該発行体が企業の場合には、一般にその企業の株価が下落する要因となります。当ファンドが投資する公社債等の発行体や株式の発行企業がこうした状況に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

#### ⑥ 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。

流動性リスクとは、有価証券を売却（または購入）しようとする際に、需要（または供給）がないため、有価証券を希望する時期に、希望する価格で売却（または購入）することができなくなるリスクをいいます。

一般に規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあたっては、流動性リスクへの留意が特に必要とされます。また、一般に市場を取り巻く外部環境の急変があった場合には、市場実勢価格での売買ができなくなる可能性が高まります。当ファンドが投資する株式・公社債等の流動性が損なわれた場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

#### ⑦ カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

カントリーリスクとは、投資先となっている国（地域）の政治・経済・社会・国際関係等が不安定な状態、あるいは混乱した状態等に陥った場合に、当該国における資産価値や当該国通貨の価値が下落するリスクをいいます。

当ファンドの投資先となっている国（地域）がこうした状態に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

#### <その他>

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

- ・有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- ・投資対象国において、税制、決済ルールの変更などにより税金や費用が新たに発生した場合や、外国為替取引規制や外国からの投資規制の実施などがあった場合は、当ファンドの基準価額に影響を与える場合があります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、一部解約の実行の請求金額が多額な場合や取引所等における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことがあります。

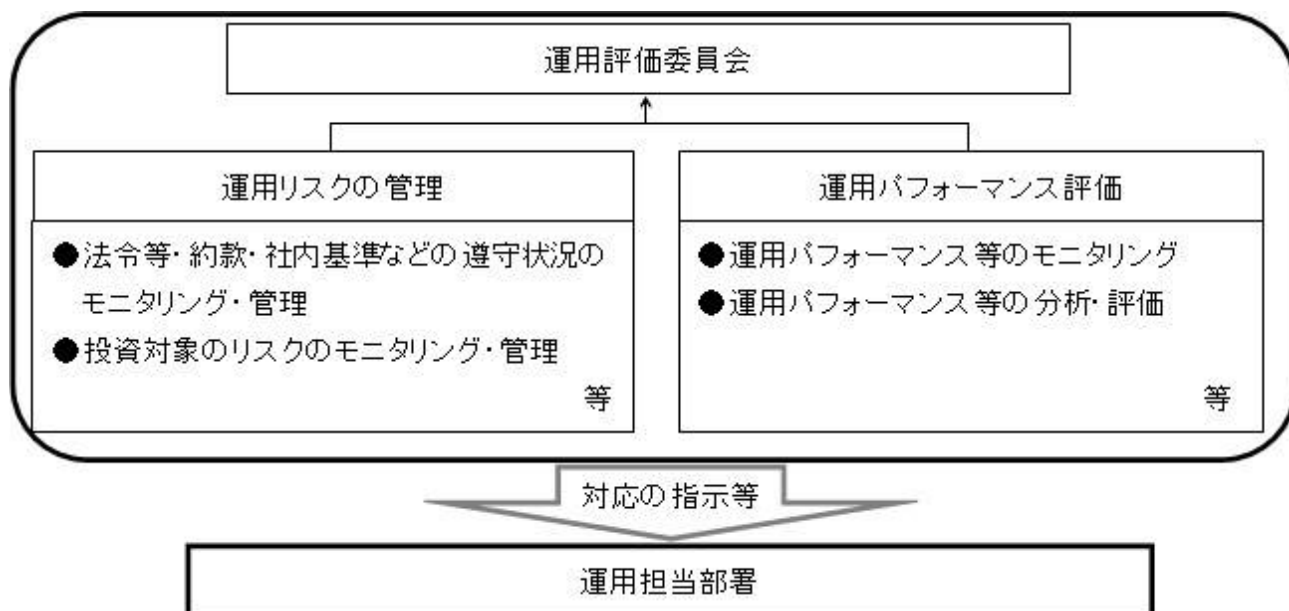
#### <収益分配金に関する留意点>

- ・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。
- ・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。
- ・投資家（受益者）のファンドの取得価額によっては、分配金の一部または全部が、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。ファンド取得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。

#### (2) リスク管理体制

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

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

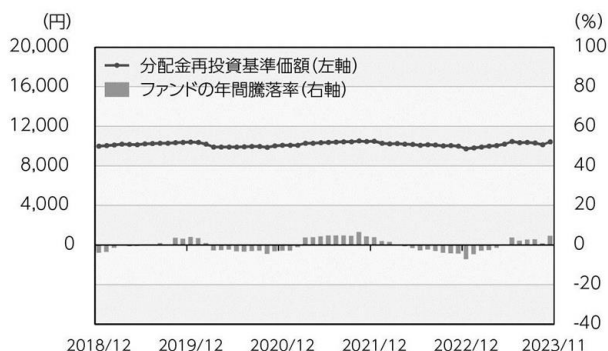


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

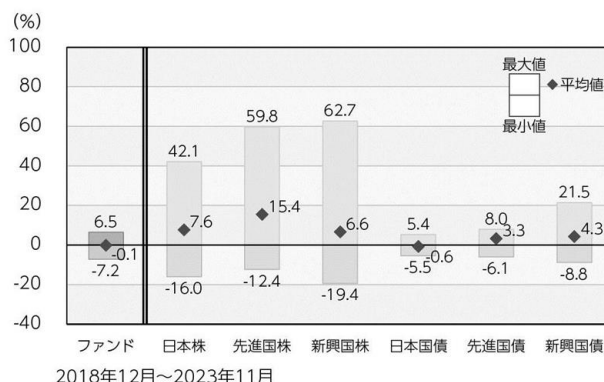
※リスク管理体制は2023年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数 (TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、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準または商標は、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準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・ディバースィファイド (円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」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】

- ① 申込手数料(受益権1口当たり)は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2% (税抜2%) を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。なお、申込手数料には消費税等相当額が課せられます。
- ② 申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。
- ③ 「分配金再投資コース」における収益分配金は、毎計算期末の翌営業日に原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

< 申込手数料を対価とする役務の内容 >

商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価

##### (2) 【換金(解約)手数料】

ありません。

##### (3) 【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.99% (税抜0.9%) の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分(税抜)については、以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
0.53%	0.33%	0.04%

- ② 信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税等相当額を信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

※信託報酬=運用期間中の基準価額×信託報酬率

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

委託会社	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	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	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



#### (4) 【その他の手数料等】

- ① 信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、当該費用に係る消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支弁します。
- ② 当ファンドの組入有価証券の売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用およびこれら手数料ならびに費用にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ③ 上記①、②の手数料等（借入金の利息および財務諸表の監査に要する費用を除きます。）については、当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおいて発生する場合、マザーファンドの信託財産中から支弁されます。これらはマザーファンドの基準価額に反映されるため、結果として当ファンドの受益者が間接的に負担することとなります。

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、2024年1月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

<個別元本について>

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、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別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
1.00%	0.99%	0.01%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2022年5月10日~2023年5月8日

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。

※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	371,207,019	77.95
内 日本	371,207,019	77.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	105,018,327	22.05
純資産総額	476,225,346	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)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	463,206,715,650	84.38
内 日本	463,206,715,650	84.38
地方債証券	29,994,713,181	5.46
内 日本	29,994,713,181	5.46
特殊債券	28,798,875,797	5.25
内 日本	28,798,875,797	5.25
社債券	23,616,291,600	4.30
内 日本	23,223,209,600	4.23
内 フランス	393,082,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,351,948,676	0.61
純資産総額	548,968,544,904	100.00

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	245,812,723,868	98.48
内 アメリカ	117,089,327,422	46.91
内 フランス	20,864,389,805	8.36
内 イタリア	18,624,368,647	7.46
内 中国	17,445,780,199	6.99
内 ドイツ	16,047,112,032	6.43
内 イギリス	12,521,415,696	5.02
内 スペイン	12,288,253,612	4.92
内 カナダ	4,855,361,025	1.95
内 ベルギー	4,359,548,233	1.75
内 オランダ	3,722,780,929	1.49
内 オーストラリア	3,640,803,411	1.46
内 オーストリア	2,870,205,471	1.15
内 メキシコ	2,195,257,065	0.88
内 アイルランド	1,449,341,240	0.58
内 フィンランド	1,307,172,988	0.52
内 ポーランド	1,250,069,951	0.50
内 マレーシア	1,225,212,190	0.49

	内 シンガポール	1,055,566,721	0.42
	内 デンマーク	770,869,493	0.31
	内 イスラエル	755,588,298	0.30
	内 ニュージーランド	572,207,075	0.23
	内 スウェーデン	494,744,870	0.20
	内 ノルウェー	407,347,495	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,802,181,814	1.52
純資産総額		249,614,905,682	100.00

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

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

#### 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年11月30日現在

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

#### その他資産の投資状況

2023年11月30日現在

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

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

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

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

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		1,153,040,458,823	96.54
	内 アメリカ	826,704,621,104	69.22
	内 イギリス	46,692,548,512	3.91
	内 カナダ	39,850,797,142	3.34
	内 スイス	37,348,801,352	3.13
	内 フランス	37,247,766,065	3.12
	内 ドイツ	28,883,347,750	2.42
	内 オランダ	22,581,968,058	1.89
	内 オーストラリア	22,174,302,963	1.86
	内 アイルランド	21,650,247,741	1.81
	内 デンマーク	11,387,327,300	0.95
	内 スウェーデン	10,184,900,509	0.85
	内 スペイン	9,143,536,236	0.77
	内 イタリア	6,530,053,523	0.55
	内 香港	5,606,203,563	0.47
	内 ジョージア	3,857,987,749	0.32
	内 シンガポール	3,673,841,974	0.31
	内 フィンランド	3,657,587,915	0.31

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

その他資産の投資状況

2023年11月30日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資 信託受	143,225,692	1.2637	1.2385	—	37.25

	日本	益証券		181,005,897	177,385,019	—	
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	16,228,932	3.6041	4.1378	—	14.10
	日本			58,490,839	67,152,074	—	
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	29,680,821	2.1063	2.2569	—	14.07
	日本			62,519,298	66,986,644	—	
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,935,446	6.5310	7.5211	—	12.53
	日本			51,826,721	59,683,282	—	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	77.95
合計	77.95

(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)

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	6,900,000,000	100.14 6,909,867,000	100.17 6,911,799,000	0.1 2025/9/20	1.26
2	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,860,000,000	99.34 5,821,850,000	99.59 5,836,267,000	0.1 2028/3/20	1.06
3	449回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証 券	5,600,000,000	99.96 5,598,040,000	100.00 5,600,392,000	0.005 2025/6/1	1.02
4	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,520,000,000	98.48 5,436,539,000	98.63 5,444,652,000	0.1 2029/12/20	0.99
5	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,500,000,000	97.85 5,381,816,000	97.94 5,387,140,000	0.1 2030/9/20	0.98
6	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	5,410,000,000	99.46 5,381,104,000	99.57 5,387,007,500	0.005 2027/6/20	0.98
7	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,450,000,000	96.78 5,275,041,000	96.85 5,278,325,000	0.1 2031/9/20	0.96
8	355回 利付国庫債券	国債証	5,330,000,000	98.60	98.93	0.1	0.96

	(10年)	日本	券		5,255,605,000	5,273,235,500	2029/6/20	
9	365回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,430,000,000	96.39 5,234,201,000	96.60 5,245,597,200	0.1 2031/12/20	0.96
10	146回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	5,200,000,000	100.22 5,211,927,000	100.15 5,207,956,000	0.1 2025/12/20	0.95
11	351回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,190,000,000	99.23 5,150,467,000	99.45 5,161,922,100	0.1 2028/6/20	0.94
12	367回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,300,000,000	96.94 5,138,031,000	96.94 5,137,979,000	0.2 2032/6/20	0.94
13	349回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,150,000,000	99.38 5,118,505,000	99.71 5,135,477,000	0.1 2027/12/20	0.94
14	363回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,170,000,000	97.29 5,030,104,000	97.16 5,023,172,000	0.1 2031/6/20	0.92
15	154回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	5,000,000,000	99.50 4,975,420,000	99.82 4,991,450,000	0.1 2027/9/20	0.91
16	369回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,020,000,000	99.57 4,998,472,000	99.01 4,970,452,600	0.5 2032/12/20	0.91
17	370回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,000,000,000	99.57 4,978,672,000	98.81 4,940,700,000	0.5 2033/3/20	0.90
18	366回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,080,000,000	97.11 4,933,282,000	97.18 4,936,896,400	0.2 2032/3/20	0.90
19	345回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,890,000,000	100.15 4,897,774,000	100.04 4,892,200,500	0.1 2026/12/20	0.89
20	368回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,050,000,000	97.52 4,925,051,000	96.65 4,881,077,500	0.2 2032/9/20	0.89
21	359回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,950,000,000	97.90 4,846,400,000	98.21 4,861,395,000	0.1 2030/6/20	0.89
22	346回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,840,000,000	100.07 4,843,484,000	99.98 4,839,177,200	0.1 2027/3/20	0.88
23	361回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,900,000,000	97.41 4,773,149,000	97.67 4,786,026,000	0.1 2030/12/20	0.87
24	453回 利付国庫債券 (2年)	日本	国債証 券	4,700,000,000	99.84 4,692,668,000	99.96 4,698,261,000	0.005 2025/10/1	0.86
25	347回 利付国庫債券		国債証	4,700,000,000	99.67	99.91	0.1	0.86



	(10年)	日本	券		4,684,776,000	4,695,817,000	2027/6/20	
26	371回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,800,000,000	96.95	97.70	0.4	0.85
					4,653,830,000	4,689,936,000	2033/6/20	
27	362回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,810,000,000	97.20	97.42	0.1	0.85
					4,675,454,000	4,686,046,300	2031/3/20	
28	150回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	4,570,000,000	99.57	99.75	0.005	0.83
					4,550,696,000	4,558,849,200	2026/12/20	
29	144回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	4,530,000,000	100.32	100.17	0.1	0.83
					4,544,681,000	4,537,701,000	2025/6/20	
30	352回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,450,000,000	99.13	99.28	0.1	0.80
					4,411,573,000	4,418,316,000	2028/9/20	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,567,766,200	80.76 1,266,211,665	80.39 1,260,367,663	1.25 2031/8/15	0.50
2	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	1,425,108,300	81.49 1,161,368,477	81.06 1,155,311,910	1.125 2031/2/15	0.46
3	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	1,364,809,600	84.87 1,158,448,233	83.48 1,139,429,417	1.875 2032/2/15	0.46
4	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証 券	1,205,974,000	96.08 1,158,709,084	94.06 1,134,369,293	3.5 2033/2/15	0.45
5	US T N/B 1.5 11/30/24 アメリカ	国債証 券	1,176,560,000	94.46 1,111,402,107	96.41 1,134,332,438	1.5 2024/11/30	0.45
6	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	1,394,223,600	80.44 1,121,535,818	79.93 1,114,425,797	0.875 2030/11/15	0.45
7	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証 券	1,117,732,000	103.19 1,153,448,059	98.77 1,104,022,322	4.125 2032/11/15	0.44

8	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証 券	1,351,573,300	82.03 1,108,795,309	80.62 1,089,679,572	1.375 2031/11/15	0.44
9	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	1,183,913,500	92.10 1,090,391,323	90.04 1,066,007,742	2.875 2032/5/15	0.43
10	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証 券	1,153,028,800	91.93 1,060,046,820	88.86 1,024,664,270	2.75 2032/8/15	0.41
11	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証 券	1,019,719,800	99.64 1,016,108,859	99.65 1,016,230,838	2.26 2025/2/24	0.41
12	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	1,182,442,800	83.43 986,579,577	83.35 985,584,539	1.625 2031/5/15	0.39
13	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証 券	980,579,040	99.91 979,724,543	100.00 980,587,571	2.68 2030/5/21	0.39
14	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証 券	1,033,902,100	91.47 945,795,936	92.54 956,844,082	1.5 2026/8/15	0.38
15	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	1,211,856,800	79.49 963,313,540	78.86 955,733,697	0.625 2030/8/15	0.38
16	US T N/B 3.5 04/30/28 アメリカ	国債証 券	955,955,000	95.27 910,786,126	96.93 926,622,867	3.5 2028/4/30	0.37
17	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証 券	882,420,000	97.86 863,615,629	98.28 867,270,639	3.75 2026/4/15	0.35
18	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証 券	844,616,400	101.65 858,621,520	101.53 857,543,085	3.03 2026/3/11	0.34
19	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証 券	933,527,800	90.33 843,313,700	91.51 854,321,700	1.5 2031/5/25	0.34
20	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証 券	895,656,300	92.44 827,997,434	93.88 840,902,311	1.625 2026/2/15	0.34
21	US T N/B 2.75 04/30/27 アメリカ	国債証 券	882,420,000	94.17 831,050,655	94.97 838,109,420	2.75 2027/4/30	0.34
22	US T N/B 3.75 06/30/30 アメリカ	国債証 券	838,299,000	93.37 782,795,223	96.91 812,413,240	3.75 2030/6/30	0.33
23	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証 券	813,715,800	100.15 815,014,323	99.62 810,696,092	2.3 2026/5/15	0.32
24	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証 券	882,420,000	90.27 796,629,880	91.50 807,500,475	0.75 2026/4/30	0.32
25	US T N/B 4.25 12/31/24 アメリカ	国債証 券	808,885,000	99.03 801,103,526	99.07 801,380,698	4.25 2024/12/31	0.32
26	US T N/B 0.875 06/30/26 アメリカ	国債証 券	854,476,700	89.93 768,511,846	91.43 781,295,441	0.875 2026/6/30	0.31
27	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証 券	844,181,800	90.39 763,131,237	91.60 773,283,712	1.5 2027/1/31	0.31
28	FRANCE OAT 0.5 05/25/26 フランス	国債証 券	817,240,600	92.92 759,457,013	94.50 772,335,680	0.5 2026/5/25	0.31
29	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証 券	841,240,400	90.88 764,522,252	91.80 772,265,255	0.75 2026/3/31	0.31
30	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証 券	838,299,000	89.75 752,376,293	91.40 766,224,934	0.375 2026/1/31	0.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.48
合計	98.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,680,800	2,015.48 15,480,535,736	2,794.50 21,463,995,600	— —	4.44
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	989,500	12,154.75 12,027,131,364	12,820.00 12,685,390,000	— —	2.63
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,627,900	979.49 8,450,986,115	1,255.00 10,828,014,500	— —	2.24
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	139,900	60,676.65 8,488,664,718	63,350.00 8,862,665,000	— —	1.83
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	41,729,400	157.79 6,584,629,394	173.10 7,223,359,140	— —	1.49
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	296,000	16,461.19 4,872,514,392	24,025.00 7,111,400,000	— —	1.47
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	979,500	5,857.14 5,737,074,620	7,258.00 7,109,211,000	— —	1.47
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	679,000	7,408.87 5,030,623,684	10,285.00 6,983,515,000	— —	1.45
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	977,500	5,154.63 5,038,658,896	6,886.00 6,731,065,000	— —	1.39
10	信越化学工業 日本	株式 化学	1,270,600	4,024.86 5,113,993,769	5,212.00 6,622,367,200	— —	1.37
11	任天堂 日本	株式 その他製品	883,100	5,699.18 5,032,949,935	6,912.00 6,103,987,200	— —	1.26
12	三井物産 日本	株式 卸売業	1,115,100	4,258.93 4,749,142,843	5,392.00 6,012,619,200	— —	1.24
13	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,064,600	4,348.38 4,629,288,599	5,505.00 5,860,623,000	— —	1.21
14	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	994,900	4,398.01 4,375,585,195	5,738.00 5,708,736,200	— —	1.18

15	武田薬品工業	日本	株式 医薬品	1,241,600	4,228.63 5,250,277,258	4,165.00 5,171,264,000	— —	1.07
16	本田技研工業	日本	株式 輸送用機器	3,411,100	1,180.54 4,026,943,271	1,509.00 5,147,349,900	— —	1.07
17	KDDI	日本	株式 情報・通信業	1,084,100	4,058.59 4,399,918,314	4,625.00 5,013,962,500	— —	1.04
18	東京海上ホールディングス	日本	株式 保険業	1,361,800	2,819.55 3,839,673,691	3,648.00 4,967,846,400	— —	1.03
19	第一三共	日本	株式 医薬品	1,222,200	4,127.45 5,044,577,070	4,000.00 4,888,800,000	— —	1.01
20	みずほフィナンシャルグループ	日本	株式 銀行業	1,859,600	2,135.68 3,971,521,989	2,512.00 4,671,315,200	— —	0.97
21	HOYA	日本	株式 精密機器	277,900	14,445.37 4,014,369,302	16,665.00 4,631,203,500	— —	0.96
22	ソフトバンクグループ	日本	株式 情報・通信業	692,000	6,207.88 4,295,855,920	6,020.00 4,165,840,000	— —	0.86
23	ソフトバンク	日本	株式 情報・通信業	2,256,900	1,552.89 3,504,739,095	1,798.50 4,059,034,650	— —	0.84
24	オリエンタルランド	日本	株式 サービス業	761,000	4,440.58 3,379,284,552	5,025.00 3,824,025,000	— —	0.79
25	ダイキン工業	日本	株式 機械	168,700	23,053.33 3,889,098,120	22,155.00 3,737,548,500	— —	0.77
26	村田製作所	日本	株式 電気機器	1,272,600	2,596.50 3,304,310,481	2,883.50 3,669,542,100	— —	0.76
27	日本たばこ産業	日本	株式 食料品	836,900	2,780.59 2,327,077,060	3,801.00 3,181,056,900	— —	0.66
28	三菱電機	日本	株式 電気機器	1,572,400	1,572.80 2,473,072,232	2,009.00 3,158,951,600	— —	0.65
29	SMC	日本	株式 機械	42,300	68,754.56 2,908,317,954	74,450.00 3,149,235,000	— —	0.65
30	丸紅	日本	株式 卸売業	1,233,900	1,858.48 2,293,184,180	2,307.00 2,846,607,300	— —	0.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	97.67
合計	97.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2023年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	16.90

輸送用機器	8.47
情報・通信業	7.50
銀行業	7.01
卸売業	6.86
化学	5.84
機械	5.09
サービス業	4.70
医薬品	4.65
小売業	4.18
食料品	3.35
陸運業	2.71
保険業	2.39
精密機器	2.28
その他製品	2.24
建設業	2.03
不動産業	1.91
電気・ガス業	1.35
その他金融業	1.13
鉄鋼	0.96
証券、商品先物取引業	0.77
海運業	0.74
ゴム製品	0.71
非鉄金属	0.67
ガラス・土石製品	0.66
金属製品	0.51
石油・石炭製品	0.47
空運業	0.44
繊維製品	0.41
鉱業	0.36
パルプ・紙	0.17
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.08
合計	97.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,331,541	23,510.37 54,815,405,749	27,850.64 64,934,922,792	— —	5.44
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,047,225	42,186.50 44,178,762,791	55,717.46 58,348,726,997	— —	4.89
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小	1,369,189	15,760.04 21,578,486,353	21,519.28 29,463,964,749	— —	2.47

		売り					
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	366,286	41,700.77 15,274,410,246	70,799.49 25,932,864,924	— —	2.17
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	881,185	15,290.79 13,474,019,844	19,852.97 17,494,147,564	— —	1.46
6	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	328,040	30,913.70 10,140,932,289	48,856.65 16,026,936,778	— —	1.34
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	783,554	15,212.78 11,920,039,939	20,060.34 15,718,365,916	— —	1.32
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	423,117	31,510.77 13,332,744,535	35,905.66 15,192,299,288	— —	1.27
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイダー ／ヘルス ケア・ サービス	137,987	73,178.27 10,097,650,301	78,679.50 10,856,749,353	— —	0.91
10	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	119,666	58,182.16 6,962,426,993	87,044.85 10,416,309,044	— —	0.87
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	191,620	46,745.31 8,957,336,933	52,752.53 10,108,441,389	— —	0.85
12	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	432,533	20,987.62 9,077,841,742	22,695.84 9,816,700,800	— —	0.82
13	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	65,729	100,696.46 6,618,677,659	138,367.86 9,094,781,602	— —	0.76
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	239,625	33,966.36 8,139,190,905	37,389.60 8,959,484,361	— —	0.75
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ	593,892	16,833.49 9,997,277,164	15,051.14 8,938,753,893	— —	0.75

		ス・消耗 燃料					
16	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	356,591	23,631.13 8,426,651,443	22,370.81 7,977,232,254	— —	0.67
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	348,735	20,901.47 7,289,077,388	22,226.68 7,751,224,423	— —	0.65
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	125,305	54,994.39 6,891,072,962	60,272.22 7,552,411,454	— —	0.63
19	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	484,214	11,640.74 5,636,610,726	14,932.40 7,230,479,070	— —	0.61
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	148,947	45,870.05 6,832,206,940	45,741.71 6,813,090,687	— —	0.57
21	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	395,086	18,440.53 7,285,597,789	16,709.35 6,601,631,360	— —	0.55
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	67,635	60,635.22 4,101,063,390	90,799.54 6,141,227,381	— —	0.51
23	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	59,922	99,255.17 5,947,568,806	101,622.09 6,089,398,996	— —	0.51
24	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	269,029	24,796.43 6,670,960,216	21,164.84 5,693,956,735	— —	0.48
25	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	65,588	75,535.57 4,954,227,367	86,456.57 5,670,513,526	— —	0.47
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	375,951	15,887.20 5,972,808,959	14,873.18 5,591,590,315	— —	0.47
27	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	261,732	22,280.49 5,831,518,820	20,369.19 5,331,270,145	— —	0.45
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	607,988	8,709.46 5,295,248,649	8,563.88 5,206,739,982	— —	0.44
29	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	219,021	21,896.48 4,795,791,118	22,954.68 5,027,558,194	— —	0.42
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	203,773	25,693.34 5,235,610,742	24,584.22 5,009,600,506	— —	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	96.54

新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.82
合計	98.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年11月30日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
ソフトウェア	外国	8.89
半導体・半導体製造装置		6.29
コンピュータ・周辺機器		5.70
銀行		5.23
医薬品		4.93
石油・ガス・消耗燃料		4.58
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.26
保険		3.14
資本市場		3.13
金融サービス		3.08
大規模小売り		2.90
ヘルスケア機器・用品		2.16
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.13
ホテル・レストラン・レジャー		2.04
自動車		1.89
化学		1.87
機械		1.77
バイオテクノロジー		1.76
航空宇宙・防衛		1.70
生活必需品流通・小売り		1.66
電力		1.63
飲料		1.57
専門小売り		1.56
金属・鉱業		1.46
食品		1.45
情報技術サービス		1.39
繊維・アパレル・贅沢品		1.23
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.15
家庭用品		1.07
陸上運輸		1.05
娯楽		1.02
専門サービス		1.00
各種電気通信サービス		0.97
コングロマリット		0.90
電気設備		0.86
総合公益事業		0.76
メディア		0.66
通信機器		0.66
パーソナルケア用品		0.61
建設関連製品		0.60
商業サービス・用品		0.57



タバコ	0.56
航空貨物・物流サービス	0.50
電子装置・機器・部品	0.50
商社・流通業	0.42
消費者金融	0.35
不動産管理・開発	0.33
建設・土木	0.32
家庭用耐久財	0.31
建設資材	0.30
エネルギー設備・サービス	0.27
無線通信サービス	0.22
容器・包装	0.22
自動車用部品	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12
運送インフラ	0.10
ガス	0.10
紙製品・林産品	0.10
水道	0.10
販売	0.08
海上運輸	0.05
旅客航空輸送	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.01
合計	96.54

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

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。

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。

## 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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年11月30日現在

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

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Dec23	買建	422	13,540,131,913	14,148,159,737	1.18
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec23	買建	385	2,603,823,842	2,722,921,316	0.23
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec23	買建	57	796,461,552	792,723,817	0.07
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec23	買建	24	610,535,969	629,470,555	0.05
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec23	買建	21	355,570,687	360,891,457	0.03

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

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

### (3) 【運用実績】

#### ① 【純資産の推移】

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第1計算期間末 (2016年 5月 9日)	93	93	0.9889	0.9889
第2計算期間末 (2017年 5月 8日)	219	219	1.0052	1.0052
第3計算期間末 (2018年 5月 8日)	276	276	1.0243	1.0243
第4計算期間末 (2019年 5月 8日)	382	382	1.0152	1.0152
第5計算期間末 (2020年5月8日)	433	433	0.9884	0.9884
第6計算期間末 (2021年5月10日)	485	485	1.0343	1.0343

第7計算期間末 (2022年5月9日)	465	465	1.0171	1.0171
第8計算期間末 (2023年5月8日)	506	506	1.0105	1.0105
2022年11月末日	486	—	1.0000	—
12月末日	477	—	0.9737	—
2023年1月末日	486	—	0.9809	—
2月末日	492	—	0.9925	—
3月末日	499	—	0.9999	—
4月末日	505	—	1.0069	—
5月末日	514	—	1.0198	—
6月末日	507	—	1.0468	—
7月末日	488	—	1.0362	—
8月末日	487	—	1.0395	—
9月末日	478	—	1.0313	—
10月末日	473	—	1.0154	—
11月末日	476	—	1.0454	—

## ②【分配の推移】

	1口当たりの分配金 (円)	
第1計算期間		0.0000
第2計算期間		0.0000
第3計算期間		0.0000
第4計算期間		0.0000
第5計算期間		0.0000
第6計算期間		0.0000
第7計算期間		0.0000
第8計算期間		0.0000
2023年5月9日～2023年11月8日		—

## ③【収益率の推移】

	収益率 (%)	
第1計算期間		△1.11
第2計算期間		1.65
第3計算期間		1.90
第4計算期間		△0.89
第5計算期間		△2.6
第6計算期間		4.6
第7計算期間		△1.7
第8計算期間		△0.6
2023年5月9日～2023年11月8日		2.2

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 計算期間末が2019年8月29日以前の収益率については、小数点第2位で表示しています。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	97,026,713	2,647,305
第2計算期間	146,988,315	23,166,841
第3計算期間	135,796,963	84,429,344

第4計算期間	180,925,539	73,460,775
第5計算期間	184,043,588	122,719,064
第6計算期間	159,040,672	128,083,716
第7計算期間	125,302,215	137,244,618
第8計算期間	106,738,897	62,999,022
2023年5月9日～ 2023年11月8日	46,553,299	85,130,870

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

データの基準日:2023年11月30日

基準価額・純資産の推移 《2015年4月20日～2023年11月30日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、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:2015年4月20日)

分配の推移(税引前)

2019年 5月	0円
2020年 5月	0円
2021年 5月	0円
2022年 5月	0円
2023年 5月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	37.25
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	14.10
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.07
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.53

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.50
2	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.46
3	US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	アメリカ	1.875	2032/2/15	0.46
4	US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	アメリカ	3.5	2033/2/15	0.45
5	US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	アメリカ	1.5	2024/11/30	0.45

○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。

### ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.44
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.63
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.24
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.83
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.49

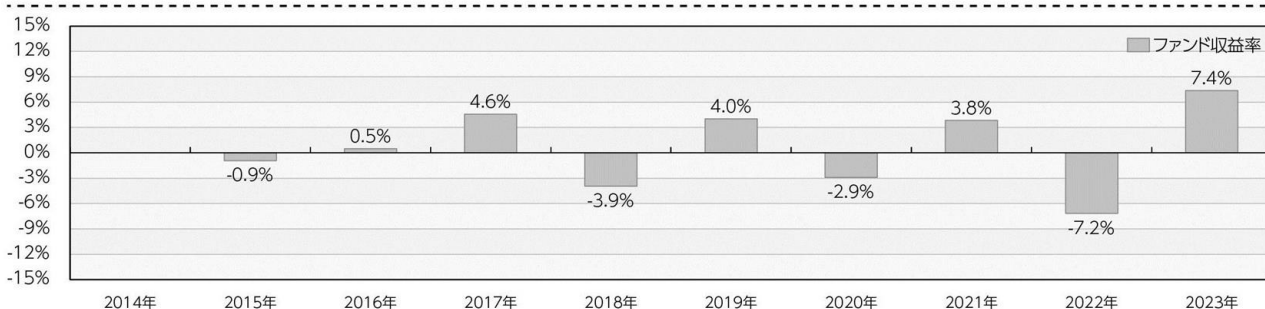
### ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.44
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.89
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.47
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.17
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.46

### 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。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※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】

- (1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該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分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。ただし、取得申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、お申込みの受付はいたしません。
- (2) 取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、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。
- (3) お申込みには、収益の分配がなされた場合に分配金を受領する「分配金受取コース」と、分配金は原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資される「分配金再投資コース」の2つのお申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみのお取扱いと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。
- (4) 申込単位は、各販売会社が定める単位とします。申込単位については、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 取得申込者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (6) 取得申込みにかかる受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、販売会社が別に定める申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。
- (7) 販売会社において金額買付（申込単位が金額にて表示されている場合）によるお申込みをされた場合、申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額はお申込代金の中から差し引かれます。
- (8) 収益分配金の再投資に関する契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
- (9) 信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

### 2【換金（解約）手続等】

- (1) 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が定める単位をもって解約を請求することができます。

※ 解約単位は、販売会社にお問い合わせください。

- (2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。
- (3) 解約請求の受付については、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までに解約のお申込みが行われ、かつ当該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分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。ただし、解約請求受付日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、解約請求の受付はいたしません。
- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号※
アセットマネジメントOne株式会社	0120-104-694

※電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時から午後5時までとさせていただきます。

(以下同じ。)

- (5) 解約代金は、受益者の解約請求を受付けた日から起算して、原則として、6営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (6) 信託財産の資金管理を円滑に行うために、大口の解約請求には制限を設ける場合があります。
- (7) 委託会社は、信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合（一部解約の実行の請求金額が多額な場合を含みます。）、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この日が前記(3)に規定する一部解約の実行の請求を受付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、前記(4)の規定に準じて算出した価額とします。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

- ① 基準価額とは、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従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（「純資産総額」といいます。）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※における取引所の最終相場
公社債等	計算日※における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値

※ 外国で取引されているものについては、計算日の直近の日とします。

- ② 当ファンドの基準価額は、委託会社の毎営業日（土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。）に計算されます。基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。基準価額は1万口単位で表示されたものが発表されます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	<a href="https://www.am-one.co.jp/">https://www.am-one.co.jp/</a>	0120-104-694

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2015年4月20日から2048年5月8日までとします。

ただし、委託会社が、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

原則として毎年5月9日から翌年5月8日までとします。ただし、第1計算期間は2015年4月20日から2016年5月8日までとします。

上記の規定にかかわらず、計算期間終了日に該当する日（以下「当該日」といいます。）が休業日のとき、計算期間終了日は、当該日の翌日以降の最初の営業日とし、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】

① 信託契約の解約

1. 委託会社は、次のいずれかに該当する場合、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（繰上償還）させることがあります。この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。ただし、当該信託契約の解約についての委託会社による提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意

の意思表示をしたときには書面決議は行いません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合にも書面決議は行いません。

- a. 信託終了前に、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき。
  - b. やむを得ない事情が発生したとき。
  - c. 信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることとなるとき。
2. 前記1. により信託契約を解約する場合には、委託会社はあらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
3. 委託会社は、次の事象が起きた場合、信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）させます。
- a. 委託会社が監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき。
  - b. 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。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、この信託は、「②信託約款の変更等」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
  - c. 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において、委託会社が新受託会社を選任できないとき。

## ② 信託約款の変更等

1. 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またはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は「②信託約款の変更等」および「③書面決議」に定める以外の方法によって変更することができないものとし、ます。
2. 委託会社は、前記1.の事項（前記1.の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前記1.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。ただし、当該重大な約款の変更等についての委託会社による提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。
3. この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
4. 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、上記の規定にしたがいます。

## ③ 書面決議

1. 委託会社は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に係る書面決議を行う場合には、あらかじめ、書面決議の日および当該決議の内容に応じて次の事項をそれぞれ定め、当該決議の

日の2週間前までに、この信託契約または信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

a. 信託契約の解約の場合 信託契約の解約の理由など

b. 重大な約款の変更等の場合 重大な約款の変更等の内容およびその理由など

2. 書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下この2.において同じ。）は受益権の口数に応じて議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
3. 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
4. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
5. この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

#### ④ 償還金の支払い

償還金は、原則として償還日（償還日が休業日の場合には当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日までに、販売会社において支払いが開始されます。

※ 償還金は、償還日に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、）に対し、お支払いします。

#### ⑤ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

1. 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
2. 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### ⑥ 関係法人との契約の更改ならびに受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 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。また、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「② 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### ⑦ 信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について、株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

#### ⑧ 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、次のアドレスに掲載します。

<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ます。

#### ⑨ 運用報告書

委託会社は、決算時および信託終了時に期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じて交付いたします。
- ・ 運用報告書（全体版）は、次のアドレスに掲載します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、交付いたします。

<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、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せん。）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。

なお、「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
  
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間（2022年5月10日から2023年5月8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。

# 独立監査人の監査報告書

2023年7月7日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア資産形成ファンドの2022年5月10日から2023年5月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア資産形成ファンドの2023年5月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。



# 1【財務諸表】

## 【コア資産形成ファンド】

### (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 2022年5月9日現在	第8期 2023年5月8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	10,908,584	10,214,441
親投資信託受益証券	435,320,186	494,264,072
未収入金	22,000,000	6,000,000
流動資産合計	468,228,770	510,478,513
<b>資産合計</b>	<b>468,228,770</b>	<b>510,478,513</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	689,968	1,709,001
未払受託者報酬	104,134	106,320
未払委託者報酬	2,239,877	2,286,634
その他未払費用	9,184	9,391
流動負債合計	3,043,163	4,111,346
<b>負債合計</b>	<b>3,043,163</b>	<b>4,111,346</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	457,372,342	501,112,217
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,813,265	5,254,950
(分配準備積立金)	8,216,869	7,212,978
元本等合計	465,185,607	506,367,167
<b>純資産合計</b>	<b>465,185,607</b>	<b>506,367,167</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>468,228,770</b>	<b>510,478,513</b>

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自 2021年5月11日 至 2022年5月9日	第8期 自 2022年5月10日 至 2023年5月8日
営業収益		
受取利息	40	101
有価証券売買等損益	△2,956,316	2,180,673
その他収益	5	3,088
営業収益合計	△2,956,271	2,183,862
営業費用		
支払利息	2,780	4,910
受託者報酬	213,386	212,132
委託者報酬	4,589,764	4,562,390
その他費用	18,823	18,714
営業費用合計	4,824,753	4,798,146
営業利益又は営業損失(△)	△7,781,024	△2,614,284
経常利益又は経常損失(△)	△7,781,024	△2,614,284
当期純利益又は当期純損失(△)	△7,781,024	△2,614,284
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(△)	494,784	△861,852
期首剰余金又は期首欠損金(△)	16,090,686	7,813,265
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,820,232	195,586
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	4,820,232	195,586
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,821,845	1,001,469
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,821,845	1,001,469
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,813,265	5,254,950

### (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第8期	
	自 2022年5月10日	至 2023年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年5月8日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2022年5月9日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第7期	第8期
	2022年5月9日現在	2023年5月8日現在
1. 期首元本額	469,314,745円	457,372,342円
期中追加設定元本額	125,302,215円	106,738,897円
期中一部解約元本額	137,244,618円	62,999,022円
2. 受益権の総数	457,372,342口	501,112,217口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期	第8期
	自 2021年5月11日 至 2022年5月9日	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0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(17,713,898円)及び分配準備積立金(8,216,869円)より分配対象収益は25,930,767円(1万口当たり566.95円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(21,227,005円)及び分配準備積立金(7,212,978円)より分配対象収益は28,439,983円(1万口当たり567.53円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第7期	第8期
	自 2021年5月11日 至 2022年5月9日	自 2022年5月10日 至 2023年5月8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	同左

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>同左</p>
--------------------------	---	-----------

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 2022年5月9日現在	第8期 2023年5月8日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額</p>	<p>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。</p>	<p>同左</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同左</p>
<p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第7期 2022年5月9日現在	第8期 2023年5月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	△5,309,188	5,299,047
合計	△5,309,188	5,299,047

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第7期 2022年5月9日現在	第8期 2023年5月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0171円 (10,171円)	1.0105円 (10,105円)

#### （4）【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### （1）株式

該当事項はありません。

###### （2）株式以外の有価証券

2023年5月8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	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	218,912,898	277,121,837	
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	19,523,044	69,650,411	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,812,638	50,008,695	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	46,449,292	97,483,129	
親投資信託受益証券 合計		292,697,872	494,264,072	
合計			494,264,072	

（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、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券及び「外国株式パッシブ・ファンド」受益証券を保有しております。

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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年5月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,507,298,548
国債証券	502,655,990,950
地方債証券	32,763,180,129
特殊債券	30,359,479,627
社債券	25,654,451,880
未収利息	597,350,161
前払費用	192,410,268
流動資産合計	595,730,161,563
資産合計	595,730,161,563
負債の部	
流動負債	
未払金	107,937,819,000
未払解約金	2,167,667,000
流動負債合計	110,105,486,000
負債合計	110,105,486,000
純資産の部	
元本等	
元本	383,609,412,287
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	102,015,263,276
元本等合計	485,624,675,563
純資産合計	485,624,675,563
負債純資産合計	595,730,161,563

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年5月10日 至 2023年5月8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。時価評価にあつては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年5月8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	516,686,311,075円
同期中追加設定元本額	1,005,695,079,476円
同期中一部解約元本額	1,138,771,978,264円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	25,393,582,694円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	56,639,596円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	97,635,700円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	54,027,230円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	755,367,664円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	202,481,087円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	45,417,547円
たわらノーロード 国内債券	18,011,859,976円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	4,075,274,352円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,320,168,309円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,366,872,408円
たわらノーロード バランス（積極型）	307,076,615円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	137,553,961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）	1,769,944,108円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	1,888,965,761円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	530,248,494円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	27,154,074円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	18,998,749円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	162,619,164円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	5,123,599円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,890,127,480円
O n eグローバルバランス	43,288,269円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	9,876,194,900円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	14,097,590,565円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	6,047,385,035円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,411,861,990円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,483,260,391円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	436,048,600円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	76,877,550円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,843,395,929円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,036,864円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	4,858,815,993円



DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,017,867,730円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	392,082,271円
投資のソムリエ	56,525,903,463円
クルーズコントロール	1,018,247,830円
投資のソムリエ<DC年金>	4,407,129,526円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,739,966,860円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,416,955,017円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	4,632,996,964円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	18,501,476,224円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	384,083,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	189,976,679円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	33,165,824円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,573,874,339円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,632,679,806円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	13,919,729,467円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,563,804,920円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	502,644,601円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	209,630,171円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	125,960,307円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,384,194,839円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	27,538,437円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	132,152,779円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,909,029,792円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,954,033,546円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,518,119,197円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	1,194,334,138円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,886,328,528円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	4,880,494,938円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,872,849,045円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,702,019,985円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	1,920,767,549円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,419,617,024円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,647,924,770円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,502,001,368円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	567,293,469円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	262,012,005円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	5,397,074,453円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII(適格機関投資家限定)	5,408,411,752円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV(適格機関投資家限定)	5,364,968,629円

インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	3,175,355,513円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	23,216,469円
AMOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,052,664,270円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	52,047,750円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	142,702,237円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	98,027,504円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	19,536,442円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	63,038,200円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	27,946,274円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	330,931円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	23,613,464円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	108,439,188円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	2,877,411,302円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,069,118,587円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,084,225,999円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	56,798,155円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	137,987,169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）	1,713,310,605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）	114,179,299円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	530,977円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	1,928,274,570円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	43,339,895円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	285,653,743円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	431,285,903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）	757,091,633円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	195,261,540円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	94,239,882円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	905,339,373円
動的パッケージファンド<DC年金>	332,891,205円
コア資産形成ファンド	218,912,898円
MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	23,261,441,776円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	40,640,412,073円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	11,221,036,228円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	1,409,209,014円
計	383,609,412,287円
2. 受益権の総数	383,609,412,287口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年5月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	5,824,255,250
地方債証券	353,076,965
特殊債券	435,162,938
社債券	251,539,600
合計	6,864,034,753

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月15日から2023年5月8日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年5月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2659円 (12,659円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年5月8日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	438回 利付国庫債券(2年)	1,800,000,000	1,802,268,000	
	439回 利付国庫債券(2年)	1,300,000,000	1,301,677,000	
	440回 利付国庫債券(2年)	1,700,000,000	1,702,125,000	
	441回 利付国庫債券(2年)	1,100,000,000	1,101,452,000	
	442回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,501,995,000	
	443回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,503,500,000	
	444回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,401,848,000	
	445回 利付国庫債券(2年)	3,100,000,000	3,103,751,000	
	446回 利付国庫債券(2年)	3,600,000,000	3,603,888,000	
	447回 利付国庫債券(2年)	1,100,000,000	1,101,144,000	
	140回 利付国庫債券(5年)	2,190,000,000	2,194,993,200	
	141回 利付国庫債券(5年)	3,710,000,000	3,719,386,300	
	142回 利付国庫債券(5年)	2,930,000,000	2,938,291,900	
	143回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,711,026,000	
	144回 利付国庫債券(5年)	4,530,000,000	4,544,858,400	
	145回 利付国庫債券(5年)	4,250,000,000	4,265,087,500	
	146回 利付国庫債券(5年)	5,500,000,000	5,520,845,000	
	147回 利付国庫債券(5年)	3,250,000,000	3,254,160,000	
	148回 利付国庫債券(5年)	3,510,000,000	3,513,825,900	

1 4 9回 利付国庫債券 (5年)	5,010,000,000	5,014,208,400	
1 5 0回 利付国庫債券 (5年)	5,720,000,000	5,722,059,200	
1 5 1回 利付国庫債券 (5年)	4,500,000,000	4,498,245,000	
1 5 2回 利付国庫債券 (5年)	1,030,000,000	1,033,378,400	
1 5 3回 利付国庫債券 (5年)	6,510,000,000	6,501,927,600	
1 5 4回 利付国庫債券 (5年)	5,500,000,000	5,509,570,000	
1 5 5回 利付国庫債券 (5年)	1,800,000,000	1,818,198,000	
1 5 6回 利付国庫債券 (5年)	3,400,000,000	3,417,170,000	
1 5 7回 利付国庫債券 (5年)	1,900,000,000	1,907,809,000	
1回 利付国庫債券 (40年)	110,000,000	139,140,100	
2回 利付国庫債券 (40年)	330,000,000	401,874,000	
3回 利付国庫債券 (40年)	540,000,000	656,364,600	
4回 利付国庫債券 (40年)	720,000,000	876,751,200	
5回 利付国庫債券 (40年)	710,000,000	835,343,400	
6回 利付国庫債券 (40年)	1,240,000,000	1,432,398,400	
7回 利付国庫債券 (40年)	1,210,000,000	1,337,219,400	
8回 利付国庫債券 (40年)	1,290,000,000	1,325,023,500	
9回 利付国庫債券 (40年)	2,150,000,000	1,632,989,500	
10回 利付国庫債券 (40年)	1,970,000,000	1,751,763,400	
11回 利付国庫債券 (40年)	1,580,000,000	1,353,143,600	
12回 利付国庫債券 (40年)	1,440,000,000	1,102,910,400	
13回 利付国庫債券 (40年)	2,190,000,000	1,662,253,800	
14回 利付国庫債券 (40年)	1,920,000,000	1,556,601,600	
15回 利付国庫債券 (40年)	2,440,000,000	2,169,770,000	
334回 利付国庫債券 (10年)	7,320,000,000	7,377,608,400	
335回 利付国庫債券 (10年)	9,410,000,000	9,485,280,000	

0年)			
336回 利付国庫債券 (10年)	1,000,000,000	1,009,300,000	
337回 利付国庫債券 (10年)	2,300,000,000	2,313,938,000	
338回 利付国庫債券 (10年)	6,230,000,000	6,283,391,100	
339回 利付国庫債券 (10年)	6,480,000,000	6,542,402,400	
340回 利付国庫債券 (10年)	3,340,000,000	3,375,604,400	
341回 利付国庫債券 (10年)	6,620,000,000	6,679,778,600	
342回 利付国庫債券 (10年)	3,520,000,000	3,534,115,200	
343回 利付国庫債券 (10年)	4,090,000,000	4,106,564,500	
344回 利付国庫債券 (10年)	5,770,000,000	5,793,310,800	
345回 利付国庫債券 (10年)	5,140,000,000	5,159,480,600	
346回 利付国庫債券 (10年)	4,390,000,000	4,404,399,200	
347回 利付国庫債券 (10年)	5,930,000,000	5,945,833,100	
348回 利付国庫債券 (10年)	4,070,000,000	4,077,081,800	
349回 利付国庫債券 (10年)	4,950,000,000	4,954,504,500	
350回 利付国庫債券 (10年)	5,560,000,000	5,557,275,600	
351回 利付国庫債券 (10年)	4,680,000,000	4,675,226,400	
352回 利付国庫債券 (10年)	4,860,000,000	4,852,224,000	
353回 利付国庫債券 (10年)	4,910,000,000	4,899,050,700	
354回 利付国庫債券 (10年)	5,200,000,000	5,184,868,000	
355回 利付国庫債券 (10年)	4,030,000,000	4,015,330,800	
356回 利付国庫債券 (10年)	4,300,000,000	4,281,037,000	
357回 利付国庫債券 (10年)	4,320,000,000	4,297,363,200	
358回 利付国庫債券 (10年)	5,350,000,000	5,315,546,000	
359回 利付国庫債券 (10年)	3,670,000,000	3,641,667,600	
360回 利付国庫債券 (10年)	5,600,000,000	5,545,232,000	

3 6 1回 利付国庫債券 (10年)	5,920,000,000	5,851,387,200	
3 6 2回 利付国庫債券 (10年)	4,210,000,000	4,153,291,300	
3 6 3回 利付国庫債券 (10年)	5,570,000,000	5,486,060,100	
3 6 4回 利付国庫債券 (10年)	5,250,000,000	5,162,167,500	
3 6 5回 利付国庫債券 (10年)	5,630,000,000	5,528,434,800	
3 6 6回 利付国庫債券 (10年)	4,980,000,000	4,926,365,400	
3 6 7回 利付国庫債券 (10年)	2,500,000,000	2,469,050,000	
3 6 8回 利付国庫債券 (10年)	2,650,000,000	2,612,741,000	
3 6 9回 利付国庫債券 (10年)	2,420,000,000	2,450,346,800	
3 7 0回 利付国庫債券 (10年)	1,500,000,000	1,512,795,000	
1回 利付国庫債券 (30年)	110,000,000	128,302,900	
2回 利付国庫債券 (30年)	100,000,000	114,883,000	
4回 利付国庫債券 (30年)	200,000,000	239,546,000	
6回 利付国庫債券 (30年)	200,000,000	235,242,000	
1 1回 利付国庫債券 (30年)	250,000,000	281,185,000	
1 2回 利付国庫債券 (30年)	230,000,000	268,120,200	
1 3回 利付国庫債券 (30年)	150,000,000	173,557,500	
1 4回 利付国庫債券 (30年)	340,000,000	408,241,400	
1 5回 利付国庫債券 (30年)	260,000,000	315,585,400	
1 6回 利付国庫債券 (30年)	240,000,000	291,940,800	
1 7回 利付国庫債券 (30年)	270,000,000	325,962,900	
1 8回 利付国庫債券 (30年)	400,000,000	479,020,000	
1 9回 利付国庫債券 (30年)	280,000,000	335,846,000	
2 0回 利付国庫債券 (30年)	330,000,000	404,279,700	
2 1回 利付国庫債券 (30年)	310,000,000	372,902,100	
2 2回 利付国庫債券 (30年)	290,000,000	356,433,200	

年)			
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	431,112,500	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	399,108,600	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	758,942,000	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	769,699,000	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	957,872,300	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,059,167,400	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,072,605,600	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	867,132,000	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,183,545,500	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,383,255,000	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,445,628,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,243,772,200	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,609,106,100	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,573,900,800	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	966,688,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,733,325,000	
40回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,512,595,700	
41回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,532,605,300	
42回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	1,365,058,000	
43回 利付国庫債券(30年)	1,350,000,000	1,510,798,500	
44回 利付国庫債券(30年)	1,490,000,000	1,667,742,100	
45回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,404,299,000	
46回 利付国庫債券(30年)	1,770,000,000	1,911,617,700	
47回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,604,116,600	
48回 利付国庫債券(30年)	1,480,000,000	1,566,728,000	



4 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 490, 000, 000	1, 576, 658, 400	
5 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 760, 000, 000	1, 648, 468, 800	
5 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 590, 000, 000	1, 325, 042, 400	
5 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 530, 000, 000	1, 333, 318, 500	
5 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 610, 000, 000	1, 432, 239, 900	
5 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 350, 000, 000	1, 254, 474, 000	
5 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 620, 000, 000	1, 501, 610, 400	
5 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 460, 000, 000	1, 349, 886, 800	
5 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 530, 000, 000	1, 411, 011, 900	
5 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 440, 000, 000	1, 324, 612, 800	
5 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 320, 000, 000	1, 182, 350, 400	
6 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 400, 000, 000	1, 310, 666, 000	
6 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 340, 000, 000	1, 191, 206, 400	
6 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 020, 000, 000	857, 901, 600	
6 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 100, 000, 000	896, 500, 000	
6 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 330, 000, 000	1, 079, 055, 600	
6 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 550, 000, 000	1, 255, 515, 500	
6 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	990, 000, 000	797, 514, 300	
6 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 770, 000, 000	1, 502, 022, 000	
6 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 470, 000, 000	1, 243, 458, 300	
6 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 430, 000, 000	1, 241, 754, 800	
7 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 610, 000, 000	1, 395, 274, 300	
7 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 400, 000, 000	1, 212, 064, 000	
7 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 390, 000, 000	1, 202, 197, 100	
7 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 790, 000, 000	1, 546, 631, 600	
7 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 620, 000, 000	1, 514, 813, 400	

年)			
75回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	1,732,796,800	
76回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	1,670,398,200	
77回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,620,480,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,030,370,000	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,398,000	
71回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,029,200	
72回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	473,754,000	
73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	392,760,400	
74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,408,000	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	187,250,400	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	72,558,500	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,536,800	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	260,347,500	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,175,500	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	94,106,700	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	419,432,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	147,133,000	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	73,932,600	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	179,105,200	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	626,096,200	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	128,029,200	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	127,686,000	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	632,857,600	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,695,300	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	505,156,000	

9 1回 利付国庫債券（20年）	110,000,000	118,597,600	
9 2回 利付国庫債券（20年）	1,160,000,000	1,248,310,800	
9 3回 利付国庫債券（20年）	370,000,000	398,353,100	
9 4回 利付国庫債券（20年）	670,000,000	723,928,300	
9 5回 利付国庫債券（20年）	550,000,000	601,188,500	
9 6回 利付国庫債券（20年）	120,000,000	130,182,000	
9 7回 利付国庫債券（20年）	660,000,000	721,518,600	
9 8回 利付国庫債券（20年）	160,000,000	174,216,000	
9 9回 利付国庫債券（20年）	750,000,000	819,870,000	
1 0 0回 利付国庫債券（20年）	830,000,000	914,128,800	
1 0 1回 利付国庫債券（20年）	230,000,000	255,536,900	
1 0 2回 利付国庫債券（20年）	500,000,000	558,095,000	
1 0 3回 利付国庫債券（20年）	160,000,000	177,777,600	
1 0 4回 利付国庫債券（20年）	110,000,000	121,103,400	
1 0 5回 利付国庫債券（20年）	640,000,000	707,385,600	
1 0 6回 利付国庫債券（20年）	500,000,000	555,310,000	
1 0 7回 利付国庫債券（20年）	600,000,000	665,718,000	
1 0 8回 利付国庫債券（20年）	690,000,000	757,882,200	
1 0 9回 利付国庫債券（20年）	350,000,000	385,707,000	
1 1 0回 利付国庫債券（20年）	440,000,000	490,006,000	
1 1 1回 利付国庫債券（20年）	460,000,000	517,136,600	
1 1 2回 利付国庫債券（20年）	740,000,000	827,438,400	
1 1 3回 利付国庫債券（20年）	1,370,000,000	1,537,509,900	
1 1 4回 利付国庫債券（20年）	410,000,000	461,770,700	
1 1 5回 利付国庫債券（20年）	360,000,000	407,811,600	
1 1 6回 利付国庫債券（20年）	530,000,000	602,578,200	

0年)			
1 1 7回 利付国庫債券 (20年)	470,000,000	531,175,200	
1 1 8回 利付国庫債券 (20年)	555,000,000	625,079,850	
1 1 9回 利付国庫債券 (20年)	470,000,000	522,752,800	
1 2 1回 利付国庫債券 (20年)	640,000,000	717,945,600	
1 2 2回 利付国庫債券 (20年)	570,000,000	635,287,800	
1 2 3回 利付国庫債券 (20年)	350,000,000	398,692,000	
1 2 5回 利付国庫債券 (20年)	600,000,000	689,688,000	
1 2 6回 利付国庫債券 (20年)	510,000,000	578,375,700	
1 2 7回 利付国庫債券 (20年)	540,000,000	608,234,400	
1 2 8回 利付国庫債券 (20年)	370,000,000	417,726,300	
1 3 0回 利付国庫債券 (20年)	910,000,000	1,022,658,000	
1 3 2回 利付国庫債券 (20年)	30,000,000	33,541,800	
1 3 3回 利付国庫債券 (20年)	630,000,000	709,669,800	
1 3 4回 利付国庫債券 (20年)	200,000,000	225,704,000	
1 3 5回 利付国庫債券 (20年)	130,000,000	145,587,000	
1 3 6回 利付国庫債券 (20年)	360,000,000	400,057,200	
1 3 7回 利付国庫債券 (20年)	6,680,000,000	7,493,089,600	
1 3 8回 利付国庫債券 (20年)	4,420,000,000	4,879,768,400	
1 3 9回 利付国庫債券 (20年)	3,500,000,000	3,895,045,000	
1 4 0回 利付国庫債券 (20年)	2,850,000,000	3,198,954,000	
1 4 1回 利付国庫債券 (20年)	1,060,000,000	1,190,910,000	
1 4 2回 利付国庫債券 (20年)	430,000,000	487,099,700	
1 4 3回 利付国庫債券 (20年)	1,230,000,000	1,370,699,700	
1 4 4回 利付国庫債券 (20年)	750,000,000	828,667,500	
1 4 5回 利付国庫債券 (20年)	2,750,000,000	3,093,035,000	

146回 利付国庫債券(20年)	2,740,000,000	3,083,815,200	
147回 利付国庫債券(20年)	2,490,000,000	2,778,715,500	
148回 利付国庫債券(20年)	2,160,000,000	2,388,700,800	
149回 利付国庫債券(20年)	2,840,000,000	3,140,699,200	
150回 利付国庫債券(20年)	3,000,000,000	3,285,090,000	
151回 利付国庫債券(20年)	3,060,000,000	3,280,748,400	
152回 利付国庫債券(20年)	3,040,000,000	3,258,211,200	
153回 利付国庫債券(20年)	2,800,000,000	3,031,616,000	
154回 利付国庫債券(20年)	2,930,000,000	3,135,979,000	
155回 利付国庫債券(20年)	2,380,000,000	2,488,718,400	
156回 利付国庫債券(20年)	2,540,000,000	2,464,612,800	
157回 利付国庫債券(20年)	2,460,000,000	2,319,189,600	
158回 利付国庫債券(20年)	2,880,000,000	2,816,467,200	
159回 利付国庫債券(20年)	2,640,000,000	2,610,405,600	
160回 利付国庫債券(20年)	2,040,000,000	2,040,000,000	
161回 利付国庫債券(20年)	2,040,000,000	2,008,624,800	
162回 利付国庫債券(20年)	2,370,000,000	2,328,406,500	
163回 利付国庫債券(20年)	2,140,000,000	2,097,713,600	
164回 利付国庫債券(20年)	2,440,000,000	2,350,549,600	
165回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,872,370,500	
166回 利付国庫債券(20年)	2,080,000,000	2,051,524,800	
167回 利付国庫債券(20年)	2,350,000,000	2,242,769,500	
168回 利付国庫債券(20年)	2,090,000,000	1,957,159,600	
169回 利付国庫債券(20年)	2,260,000,000	2,074,996,400	
170回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	1,828,800,000	
171回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,041,289,600	

	0年)			
	172回 利付国庫債券 (20年)	1,580,000,000	1,458,987,800	
	173回 利付国庫債券 (20年)	2,520,000,000	2,317,644,000	
	174回 利付国庫債券 (20年)	2,770,000,000	2,537,209,200	
	175回 利付国庫債券 (20年)	2,630,000,000	2,444,006,400	
	176回 利付国庫債券 (20年)	2,600,000,000	2,408,432,000	
	177回 利付国庫債券 (20年)	2,650,000,000	2,404,292,000	
	178回 利付国庫債券 (20年)	2,500,000,000	2,304,225,000	
	179回 利付国庫債券 (20年)	2,450,000,000	2,252,432,000	
	180回 利付国庫債券 (20年)	2,140,000,000	2,072,076,400	
	181回 利付国庫債券 (20年)	2,300,000,000	2,263,085,000	
	182回 利付国庫債券 (20年)	2,080,000,000	2,115,443,200	
	183回 利付国庫債券 (20年)	2,200,000,000	2,350,084,000	
	184回 利付国庫債券 (20年)	800,000,000	809,896,000	
国債証券 合計		498,655,000,000	502,655,990,950	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,731,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	109,639,200	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	196,078,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	393,056,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	294,024,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	228,440,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	115,649,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	103,784,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	104,916,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	214,458,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	322,158,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	110,900,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	111,717,000	
31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	210,668,000		

28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,801,000	
30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	398,932,000	
30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	397,128,000	
令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	97,419,000	
36回2号 宮城県公募公債10年	250,000,000	244,527,500	
208回 神奈川県公募公債	300,000,000	301,749,000	
213回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,851,000	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	198,012,000	
251回 神奈川県公募公債10年	200,000,000	195,748,000	
258回 神奈川県公募公債10年	300,000,000	290,949,000	
3回 神奈川県公募公債30年	100,000,000	122,763,000	
11回 神奈川県公募公債20年	100,000,000	110,494,000	
16回 神奈川県公募公債20年	300,000,000	336,363,000	
19回 神奈川県公募公債20年	100,000,000	110,534,000	
413回 大阪府公募公債10年	100,000,000	99,587,000	
419回 大阪府公募公債10年	100,000,000	100,082,000	
464回 大阪府公募公債10年	200,000,000	193,900,000	
467回 大阪府公募公債10年	200,000,000	194,850,000	
469回 大阪府公募公債10年	200,000,000	193,874,000	
472回 大阪府公募公債10年	200,000,000	193,098,000	
474回 大阪府公募公債10年	300,000,000	289,548,000	
10回 大阪府公募公債20年	200,000,000	218,436,000	
13回 大阪府公募公債20年	100,000,000	104,594,000	
14回 大阪府公募公債20年	100,000,000	96,227,000	
190回 大阪府公募公債5年	300,000,000	298,320,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	352,345,000	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	109,015,129	

令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	392,996,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	195,992,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	201,348,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	195,988,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	97,512,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	120,280,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	209,820,000	
1回 兵庫県公募公債 (12年)	300,000,000	303,609,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	315,147,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	103,989,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	102,032,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	196,202,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	97,896,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	194,854,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	105,005,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	105,319,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	205,824,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	104,951,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	332,214,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	336,057,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	117,128,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	217,114,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	159,916,500	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,972,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	197,580,000	
令和元年度7回 愛知県公募	300,000,000	233,946,000	



公債			
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	99,782,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	195,976,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	89,159,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	90,726,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	402,820,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	196,788,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	186,916,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	239,640,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	112,021,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	108,315,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	325,752,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	104,447,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	100,320,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	198,730,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	196,214,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	97,813,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	104,937,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	158,596,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	109,548,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	112,247,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	325,743,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	202,304,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,985,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	193,342,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	103,980,000	
18回 千葉県公募公債 2	100,000,000	104,194,000	

0年			
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	94,713,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	195,492,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	108,375,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,345,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,920,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	605,748,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,220,000	
150回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,039,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,982,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,926,800	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,712,000	
160回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,945,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,540,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,785,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,252,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,717,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,906,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,640,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,420,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	295,890,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	491,185,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,080,000	
227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	486,400,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	483,730,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	99,283,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	100,703,000	

債			
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	195,316,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	100,704,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	100,451,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	199,480,000	
令和2年 2回 大阪市公募公債	300,000,000	294,483,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	220,862,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	453,375,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	195,780,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	108,325,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	104,836,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	107,989,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	224,898,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	218,994,000	
26年度4回 神戸市公募公債	100,000,000	100,682,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	299,349,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	167,880,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	392,236,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	119,409,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	109,658,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	108,380,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	116,555,000	
26年度4回 札幌市公募公債 10年	100,000,000	100,570,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	288,477,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	198,836,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	222,132,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	116,837,000	

年			
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	109,377,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	335,703,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	108,160,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	119,188,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	193,294,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	89,722,000	
26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	100,635,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	193,074,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	299,643,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	97,090,000	
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	298,335,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	196,574,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	195,316,000	
26年度1回 相模原市公募公債	100,000,000	100,655,000	
26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	100,636,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	197,984,000	
地方債証券 合計	32,439,330,000	32,763,180,129	
特殊債券			
9回 新関西国際空港社債	200,000,000	208,616,000	
12回 新関西国際空港社債	200,000,000	207,190,000	
78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	300,000,000	
125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	446,890,000	
127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,848,000	
131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	81,996,000	
156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	389,468,000	
33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,529,000	
1回 高速道路機構債	300,000,000	391,248,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	189,582,000	
26回 高速道路機構債	200,000,000	244,854,000	
36回 高速道路機構債	300,000,000	385,587,000	

50回 高速道路機構債	300,000,000	275,904,000	
75回 日本高速道路保有・ 債務返済機構	100,000,000	111,407,000	
124回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	108,086,000	
139回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	100,595,000	
155回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	105,467,000	
159回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	104,812,000	
162回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	107,544,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	96,659,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	185,852,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	95,829,000	
97回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	111,642,000	
116回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	112,142,000	
121回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	500,000,000	551,715,000	
153回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	111,205,000	
188回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	107,149,000	
218回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	100,692,000	
220回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	201,446,000	
239回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	300,000,000	315,573,000	
241回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	500,000,000	503,685,000	
250回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	106,408,000	
254回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	100,877,000	
260回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	200,000,000	208,032,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	521,205,000	
268回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	101,710,000	
271回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	300,000,000	299,520,000	
286回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	187,884,000	
300回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	99,979,000	
309回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	800,000,000	800,152,000	

3 1 9回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	194,794,000	
3 3 7回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	96,365,000	
3 9 8回 政保道路債	300,000,000	239,598,000	
4 1 3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	157,320,000	
4 1 8回 高速道路機構債	200,000,000	166,086,000	
4 2 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	168,472,000	
2 8回 日本道路・機構承継債	500,000,000	601,670,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	218,834,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	334,035,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	334,836,000	
1 3回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	112,324,000	
7 9回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,052,000	
1 9回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	221,510,000	
2 3回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	109,314,000	
2 4回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	219,202,000	
F 1 4 7回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,362,000	
F 1 7 4回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	339,291,000	
3 6回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	108,492,000	
6 4回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,082,000	
3 9回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	534,300,000	
4 2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	306,735,000	
7 1回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,651,000	
4 4回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	211,138,000	
2 8 8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,587,000	
8 3回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	399,636,000	
9 1回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,906,000	
5 9回 地方公共団体金融機	100,000,000	97,132,000	

構債券 20年			
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	499,595,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,020,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,817,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,860,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	262,725,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	235,509,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,880,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	220,760,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,852,710	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	105,151,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	104,222,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	206,526,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	164,328,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	106,950,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	100,731,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	221,664,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,473,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	392,003,500	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,781,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,383,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,186,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	280,177,500	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,512,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,977,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,866,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,926,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,151,000	

2 3 3回 住宅金融支援機構 債券	100,000,000	94,950,000	
3 2 1回 住宅金融支援機構 債券	500,000,000	497,405,000	
3 2 5回 住宅金融支援機構 債券	500,000,000	497,405,000	
4 0回貸付債権担保住宅金融 公庫債券	43,516,000	44,056,033	
2 7回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	15,850,000	16,572,760	
2 9回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	99,195,000	104,744,960	
3 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	150,992,000	157,901,393	
3 8回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	21,130,000	22,031,405	
4 9回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	18,152,000	18,890,967	
5 2回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	21,301,000	22,097,657	
5 3回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	22,315,000	23,152,258	
6 0回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	27,405,000	28,389,661	
6 4回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	67,326,000	69,348,473	
7 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	30,540,000	31,523,998	
8 2回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	36,593,000	37,399,509	
8 4回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	37,271,000	38,104,379	
8 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	41,012,000	41,878,173	
9 0回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	42,549,000	43,156,174	
9 3回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	47,964,000	47,849,845	
9 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	54,211,000	54,461,996	
9 9回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	56,203,000	56,833,597	
1 1 4回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	211,134,000	205,665,629	
1 1 7回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	71,644,000	70,206,104	
1 1 8回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	71,232,000	69,883,578	
1 1 9回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	71,404,000	69,986,630	
1 2 6回貸付債権担保住宅金	223,338,000	217,830,484	



融支援機構債券			
1 2 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	223,734,000	218,098,140	
1 3 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,686,000	147,763,400	
1 3 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	227,733,000	221,367,862	
1 3 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	227,163,000	220,836,510	
1 3 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	393,310,000	383,666,038	
1 3 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,595,000	76,597,115	
1 4 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,960,000	78,031,676	
1 5 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,926,000	249,029,902	
1 5 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	346,888,000	333,324,679	
1 6 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	266,910,000	256,535,208	
1 6 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,612,000	263,132,660	
1 7 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	831,969,000	796,968,064	
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	416,300,000	
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,098,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	99,863,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	298,800,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	298,506,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	198,948,000	
369回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	399,360,000	
377回 利附信金中金債(5年)	300,000,000	299,064,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	109,574,000	
72回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,618,000	
77回 東日本高速道路社債	300,000,000	296,793,000	
85回 中日本高速道路債券	300,000,000	299,415,000	
87回 中日本高速道路債券	400,000,000	398,464,000	
71回 鉄道建設運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,691,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,435,000	
90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	194,744,000	
特殊債券 合計	29,897,763,000	30,359,479,627	
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	293,910,000	

2回 BPCE SA円貨社債 (ソーシャルボンド)	100,000,000	99,686,000	
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,624,000	
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債 (2016)	100,000,000	98,627,000	
25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,917,000	
27回 首都高速道路社債	400,000,000	398,644,000	
16回 成田国際空港社債	100,000,000	100,654,000	
37回 成田国際空港社債	100,000,000	88,097,000	
57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,672,000	
67回 東日本高速道路社債	200,000,000	196,934,000	
79回 東日本高速道路社債	300,000,000	298,458,000	
83回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,972,000	
90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,940,000	
91回 中日本高速道路債券	500,000,000	496,910,000	
25回 西日本高速道路社債	200,000,000	201,286,000	
26回 西日本高速道路社債	100,000,000	100,926,000	
33回 西日本高速道路債券	300,000,000	300,309,000	
34回 西日本高速道路債券	200,000,000	200,632,000	
61回 西日本高速道路債券	500,000,000	497,275,000	
62回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,910,000	
24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,988,000	
10回 キリンホールディングス社債	100,000,000	100,724,000	
3回 ダイドーグループHD社債	300,000,000	294,969,000	
9回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	96,618,000	
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,138,000	
14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,620,000	
30回 東レ社債	300,000,000	299,382,000	
42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	199,018,000	
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	188,830,000	
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,282,000	
17回 ダイセル社債	300,000,000	293,751,000	
16回 武田薬品工業社債	500,000,000	477,800,000	
4回 住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,716,000	
4回 ENEOSホールディングス社債	300,000,000	292,584,000	
14回 プリヂストン社債	300,000,000	297,363,000	
35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	298,206,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	100,331,000	

19回	パナソニック社債	100,000,000	96,898,000	
23回	パナソニック社債	200,000,000	192,096,000	
29回	三菱重工業社債	100,000,000	100,629,000	
58回	川崎重工業社債	300,000,000	290,034,000	
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	98,853,000	
26回	トヨタ自動車社債	200,000,000	199,004,000	
26回	豊田通商社債	100,000,000	95,492,000	
73回	三井物産社債	400,000,000	393,324,000	
12回	新生銀行社債	400,000,000	398,792,000	
88回	三菱東京UFJ銀行 社債	100,000,000	107,733,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	105,746,000	
20回	三井住友信託銀行社 債	300,000,000	297,465,000	
10回	三井住友信託銀行社 債	200,000,000	201,006,000	
11回	セブン銀行社債	200,000,000	201,094,000	
28回	芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,234,000	
17回	NTTファイナンス 社債	300,000,000	298,602,000	
18回	NTTファイナンス 社債	400,000,000	393,628,000	
69回	ホンダファイナンス 社債	300,000,000	298,230,000	
81回	トヨタファイナンス 社債	100,000,000	99,627,000	
96回	トヨタファイナンス 社債	100,000,000	99,517,000	
80回	日立キャピタル社債	200,000,000	193,722,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	288,576,000	
23回	三井住友ファイナン ス&リース社債	100,000,000	98,000,000	
27回	三井住友ファイナン ス&リース社債	200,000,000	198,574,000	
29回	三井住友ファイナン ス&リース社債	200,000,000	199,372,000	
31回	三井住友ファイナン ス&リース社債	200,000,000	193,374,000	
56回	三菱UFJリース社 債	300,000,000	297,435,000	
3回	野村ホールディングス 社債	300,000,000	296,094,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	102,894,000	
106回	住友不動産社債	100,000,000	100,314,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	200,048,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	103,655,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	91,653,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	311,565,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	208,806,000	

6 5回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	110,142,000	
7 1回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,079,000	
7 3回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	221,254,000	
1 0 7回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	98,296,000	
1 2 5回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	91,142,000	
1 2 7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	93,797,000	
1 4 7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,701,000	
1 6 0回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	77,203,000	
1 6 3回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,942,000	
1 6 5回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	176,454,000	
1 7 1回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	160,522,000	
2 1回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,833,000	
6 0回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	195,152,000	
7 0回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	81,529,000	
7 1回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	77,492,000	
7 4回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,425,000	
7 5回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	176,034,000	
3 2回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,187,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	127,758,000	
4 7回 東京地下鉄社債	100,000,000	75,999,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	292,491,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	194,718,000	
1 2回 ソフトバンク社債	400,000,000	390,848,000	
3 0回 光通信社債	200,000,000	185,782,000	
5 2 7回 中部電力社債	100,000,000	93,438,000	
5 3 2回 中部電力社債	200,000,000	194,162,000	
4 9 7回 関西電力社債	100,000,000	101,336,000	
5 0 8回 関西電力社債	300,000,000	299,883,000	
5 3 0回 関西電力社債	400,000,000	391,248,000	
5 3 1回 関西電力社債	200,000,000	177,474,000	
5 4 1回 関西電力社債	300,000,000	285,324,000	
3 9 6回 中国電力社債	200,000,000	193,136,000	
4 2 5回 中国電力社債	100,000,000	96,940,000	
3 0 7回 北陸電力社債	100,000,000	102,085,000	
3 1 1回 北陸電力社債	100,000,000	101,531,000	
4 8 8回 東北電力社債	100,000,000	99,589,000	
5 2 1回 東北電力社債	400,000,000	390,032,000	
5 2 5回 東北電力社債	200,000,000	197,166,000	
5 3 6回 東北電力社債	300,000,000	283,878,000	
3 2 0回 四国電力社債	300,000,000	287,454,000	

4 2 8 回 九州電力社債	100,000,000	100,849,000	
4 6 3 回 九州電力社債	100,000,000	91,939,000	
4 6 6 回 九州電力社債	100,000,000	90,746,000	
4 9 1 回 九州電力社債	300,000,000	286,359,000	
4 9 2 回 九州電力社債	100,000,000	85,856,000	
4 9 3 回 九州電力社債	200,000,000	198,188,000	
5 0 7 回 九州電力社債	200,000,000	192,420,000	
3 2 1 回 北海道電力社債	261,000,000	263,630,880	
3 4 0 回 北海道電力社債	300,000,000	300,057,000	
3 5 0 回 北海道電力社債	200,000,000	183,320,000	
1 3 回 電源開発社債	200,000,000	207,254,000	
5 4 回 電源開発社債	100,000,000	99,367,000	
7 5 回 電源開発社債	200,000,000	190,176,000	
4 1 回 東京瓦斯社債	200,000,000	187,036,000	
5 2 回 東京瓦斯社債	100,000,000	89,318,000	
5 5 回 東京瓦斯社債	100,000,000	85,799,000	
5 7 回 東京瓦斯社債	300,000,000	215,550,000	
7 回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,830,000	
8 回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	191,512,000	
社債券 合計	26,281,000,000	25,654,451,880	
合計		591,433,102,586	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年5月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	826,978,459
コール・ローン	677,086,505
国債証券	212,993,290,466
派生商品評価勘定	1,579,828
未収入金	3,280,176,442
未収利息	1,382,153,468
前払費用	263,711,765
流動資産合計	219,424,976,933
資産合計	219,424,976,933
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,764,256
未払金	3,083,316,426
未払解約金	1,376,772,000
流動負債合計	4,463,852,682
負債合計	4,463,852,682
純資産の部	
元本等	
元本	102,423,436,687
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	112,537,687,564
元本等合計	214,961,124,251
純資産合計	214,961,124,251
負債純資産合計	219,424,976,933

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年5月8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	86,476,270,642円
同期中追加設定元本額	64,851,736,641円
同期中一部解約元本額	48,904,570,596円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,380,225,016円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,409,545円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	17,301,994円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	42,669,677円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	32,114,554円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	35,795,142円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	35,198,416円
たわらノーロード 先進国債券	17,643,119,645円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	254,850,887円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,592,956,192円
たわらノーロード バランス（堅実型）	67,835,412円
たわらノーロード バランス（標準型）	348,061,936円
たわらノーロード バランス（積極型）	74,508,317円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	16,652,816円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	991,110,445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）	1,621,239,449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）	749,992,791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）	441,300,005円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	2,025,133円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,772,425円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	185,271,049円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	15,298,353円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	25,025,332円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,695,382,711円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	948,683,406円

One グローバルバランス	28,092,400円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型	746,657,608円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	2,391,956,199円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型	2,676,407,163円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	423,631,209円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	756,445,506円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,213,150円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	895,628,565円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	35,241,998円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	159,329,380円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	154,850,470円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	239,288,486円
クルーズコントロール	929,464,613円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	180,603,325円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	625,489,827円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	635,077,111円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	182,818,638円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	341,519,003円
One グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	9,856,128円
One グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	87,801,857円
D I A M パッシブ資産分散ファンド	1,031,313,518円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	686,297円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	689,934円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	140,709,276円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	297,656円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	690,706円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	910,881円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	403,153,228円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	290,748円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	417,866,540円
D I A M 為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,199,767,596円
D I A M 外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,398,147,865円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,058,944,526円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,279,779,882円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	80,223,864円
D I A M ワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	48,867,091円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,076,736円
D I A M グローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	347,842,192円
D I A M グローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限	239,002,001円



定)	
D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,961,981円
D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	25,669,377円
D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,851,642円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	50,371円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	14,315,645円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	44,100,734円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,542,386,291円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,370,556,334円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,492,746,807円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	57,487,654円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	117,339,632円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,394,674,646円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	256,160,185円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	162,358円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	294,194,539円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	262,693,630円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	370,893,311円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	36,224,845円
動的パッケージファンド<DC年金>	69,486,213円
コア資産形成ファンド	46,449,292円
MHAM外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	2,343,386,054円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	11,292,945,897円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	8,669,520,250円
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	3,441,556,522円
計	102,423,436,687円
2. 受益権の総数	102,423,436,687口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等

を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

### (有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

種類	2023年5月8日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	3,345,202,356	
合計	3,345,202,356	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年2月22日から2023年5月8日まで)に対応する金額であります。

### (デリバティブ取引等に関する注記)

#### 通貨関連

種類	2023年5月8日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	1,086,396,000	—	1,085,365,130	1,030,870
アメリカ・ドル	557,470,000	—	556,620,086	849,914
イギリス・ポンド	54,693,000	—	54,698,610	△5,610
イスラエル・シケル	61,268,000	—	60,773,709	494,291
オーストラリア・ドル	36,667,000	—	37,162,849	△495,849
カナダ・ドル	30,942,000	—	30,943,992	△1,992
ポーランド・ズロチ	31,695,000	—	31,486,766	208,234
ユーロ	313,661,000	—	313,679,118	△18,118
買建	407,296,000	—	404,080,702	△3,215,298

オフショア・人民元	246,563,000	—	244,758,966	△1,804,034
ユーロ	160,733,000	—	159,321,736	△1,411,264
合計	1,493,692,000	—	1,489,445,832	△2,184,428

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年5月8日現在
1口当たり純資産額	2.0987円
(1万口当たり純資産額)	(20,987円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年5月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/15/24	7,500,000.000	7,171,059.970	
		US T N/B 0.25 05/31/25	1,690,000.000	1,569,026.360	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,604,584.370	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,246,044.930	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,512,699.210	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,310,092.180	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,427,413.290	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,671,718.760	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,384,994.130	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,388,449.990	
		US T N/B 0.375 07/15/24	4,000,000.000	3,811,171.870	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,321,453.520	
		US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,895,800.760	
		US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,896,445.320	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,332,782.590	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,769,123.430	

US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,673,281.240	
US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,736,911.510	
US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,681,752.720	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,107,865.030	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,756,901.950	
US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,461,548.830	
US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,697,760.530	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,212,436.310	
US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,972,050.770	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,681,333.980	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,551,132.820	
US T N/B 0.625 08/15/30	6,840,000.000	5,635,518.720	
US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,796,874.990	
US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,437,408.200	
US T N/B 0.625 12/31/27	3,820,000.000	3,359,809.360	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,868,087.500	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,276,700.000	
US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,402,121.100	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,630,000.000	3,330,879.500	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,516,391.570	
US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,477,409.950	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	3,046,622.260	
US T N/B 0.875 09/30/26	6,110,000.000	5,591,604.680	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,280,000.000	6,936,117.150	
US T N/B 1.0 07/31/28	4,770,000.000	4,215,673.810	
US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,384,632.210	
US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,643,339.080	
US T N/B 1.125 02/15/31	8,890,000.000	7,572,474.250	
US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,830,301.540	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,008,154.300	
US T N/B 1.125 02/29/28	6,390,000.000	5,738,020.310	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,196,046.860	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	2,086,340.640	
US T N/B 1.125 08/31/28	5,230,000.000	4,643,872.270	
US T N/B 1.125 10/31/26	3,390,000.000	3,122,176.740	
US T N/B 1.25 03/31/28	5,010,000.000	4,518,785.120	
US T N/B 1.25 04/30/28	5,100,000.000	4,591,792.950	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,880,000.000	2,794,943.770	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,721,714.430	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,328,420.710	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,660,000.000	7,338,673.470	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,756,096.870	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,480,000.000	3,996,825.010	
US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,418,308.600	
US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,587,765.230	
US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	716,367.180	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	2,880,243.530	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,025,041.010	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,225,385.170	
US T N/B 1.375 11/15/31	7,990,000.000	6,804,920.700	

US T N/B 1.375 11/15/40	3,520,000.000	2,418,762.500	
US T N/B 1.375 12/31/28	6,600,000.000	5,909,964.850	
US T N/B 1.5 01/31/27	4,940,000.000	4,592,849.200	
US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,351,292.940	
US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,304,983.980	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,491,119.710	
US T N/B 1.5 09/30/24	4,310,000.000	4,147,533.210	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,651,648.430	
US T N/B 1.5 11/30/24	9,000,000.000	8,638,593.750	
US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,607,578.120	
US T N/B 1.625 02/15/26	3,890,000.000	3,681,292.380	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,462,630.640	
US T N/B 1.625 05/15/31	8,240,000.000	7,241,060.890	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,567,557.810	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,455,334.950	
US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,603,792.950	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	3,020,362.500	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,695,566.980	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	4,105,634.760	
US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,839,531.240	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,298,282.030	
US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,925,208.400	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,110,000.000	3,692,873.230	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,860,094.720	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,914,675.390	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,982,946.670	
US T N/B 1.875 02/15/32	7,280,000.000	6,441,093.700	
US T N/B 1.875 02/15/41	4,700,000.000	3,507,283.190	
US T N/B 1.875 02/15/51	6,280,000.000	4,229,923.440	
US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,400,309.750	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,672,734.350	
US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,784,641.390	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,895,898.440	
US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	793,654.290	
US T N/B 1.875 11/15/51	4,670,000.000	3,128,717.570	
US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,968,878.900	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,601,675.000	
US T N/B 2.0 04/30/24	4,720,000.000	4,597,978.040	
US T N/B 2.0 05/31/24	800,000.000	778,102.700	
US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	281,724.800	
US T N/B 2.0 08/15/25	4,050,000.000	3,890,926.770	
US T N/B 2.0 08/15/51	6,110,000.000	4,232,129.670	
US T N/B 2.0 11/15/26	3,830,000.000	3,635,133.770	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,200,034.170	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,812,444.320	
US T N/B 2.125 05/31/26	1,550,000.000	1,483,368.160	
US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	369,379.290	
US T N/B 2.125 09/30/24	590,000.000	572,680.270	
US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,724,861.720	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,612,926.940	

US T N/B 2. 25 02/15/52	4,300,000.000	3,158,148.410	
US T N/B 2. 25 03/31/26	1,300,000.000	1,251,250.000	
US T N/B 2. 25 04/30/24	3,300,000.000	3,222,035.940	
US T N/B 2. 25 05/15/41	4,420,000.000	3,502,159.370	
US T N/B 2. 25 08/15/27	4,240,000.000	4,037,357.790	
US T N/B 2. 25 08/15/46	2,570,000.000	1,925,893.750	
US T N/B 2. 25 08/15/49	3,040,000.000	2,259,812.500	
US T N/B 2. 25 10/31/24	2,350,000.000	2,282,850.580	
US T N/B 2. 25 11/15/24	3,080,000.000	2,990,427.330	
US T N/B 2. 25 11/15/25	3,620,000.000	3,490,259.770	
US T N/B 2. 25 11/15/27	3,270,000.000	3,105,541.980	
US T N/B 2. 25 12/31/24	3,000,000.000	2,910,410.160	
US T N/B 2. 375 02/15/42	3,610,000.000	2,893,076.560	
US T N/B 2. 375 03/31/29	3,000,000.000	2,829,316.410	
US T N/B 2. 375 04/30/26	1,260,000.000	1,215,973.810	
US T N/B 2. 375 05/15/27	4,430,000.000	4,246,829.860	
US T N/B 2. 375 05/15/29	3,470,000.000	3,269,865.030	
US T N/B 2. 375 05/15/51	5,560,000.000	4,209,962.500	
US T N/B 2. 375 08/15/24	4,610,000.000	4,494,029.680	
US T N/B 2. 375 11/15/49	3,290,000.000	2,511,966.380	
US T N/B 2. 5 01/31/25	500,000.000	486,875.000	
US T N/B 2. 5 02/15/45	2,310,000.000	1,838,164.440	
US T N/B 2. 5 02/15/46	1,770,000.000	1,397,954.290	
US T N/B 2. 5 02/28/26	2,280,000.000	2,209,106.240	
US T N/B 2. 5 03/31/27	1,500,000.000	1,445,449.210	
US T N/B 2. 5 04/30/24	4,010,000.000	3,924,660.620	
US T N/B 2. 5 05/15/24	5,100,000.000	4,989,282.000	
US T N/B 2. 5 05/15/46	2,230,000.000	1,759,870.700	
US T N/B 2. 5 05/31/24	4,180,000.000	4,087,630.480	
US T N/B 2. 625 01/31/26	2,460,000.000	2,392,253.900	
US T N/B 2. 625 02/15/29	4,330,000.000	4,144,790.990	
US T N/B 2. 625 03/31/25	1,790,000.000	1,746,438.660	
US T N/B 2. 625 04/15/25	3,000,000.000	2,925,703.140	
US T N/B 2. 625 05/31/27	3,410,000.000	3,298,242.560	
US T N/B 2. 625 07/31/29	2,570,000.000	2,452,442.570	
US T N/B 2. 625 12/31/25	1,000,000.000	972,773.440	
US T N/B 2. 75 02/15/28	6,340,000.000	6,148,190.210	
US T N/B 2. 75 02/28/25	1,960,000.000	1,916,665.600	
US T N/B 2. 75 04/30/27	3,500,000.000	3,402,382.830	
US T N/B 2. 75 05/15/25	4,000,000.000	3,909,843.760	
US T N/B 2. 75 05/31/29	3,300,000.000	3,175,089.850	
US T N/B 2. 75 06/30/25	1,040,000.000	1,016,031.240	
US T N/B 2. 75 07/31/27	3,820,000.000	3,710,921.080	
US T N/B 2. 75 08/15/32	7,840,000.000	7,419,212.450	
US T N/B 2. 75 08/15/42	1,540,000.000	1,310,383.590	
US T N/B 2. 75 08/15/47	2,230,000.000	1,837,659.370	
US T N/B 2. 75 08/31/25	1,830,000.000	1,787,824.200	
US T N/B 2. 75 11/15/42	1,556,000.000	1,320,047.190	
US T N/B 2. 75 11/15/47	2,250,000.000	1,854,492.170	
US T N/B 2. 875 04/30/25	2,000,000.000	1,959,062.500	

US T N/B 2.875 04/30/29	3,000,000.000	2,906,601.560	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,860,000.000	4,732,614.810	
US T N/B 2.875 05/15/32	8,950,000.000	8,571,023.430	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,976,735.130	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,300,000.000	2,795,460.950	
US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,804,431.640	
US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,537,925.370	
US T N/B 2.875 06/15/25	3,420,000.000	3,350,798.420	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,155,312.500	
US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,408,167.770	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,500,973.820	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	913,232.800	
US T N/B 2.875 11/30/25	1,360,000.000	1,331,418.750	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,960,000.000	2,556,237.490	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,288,937.500	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,310,000.000	2,869,356.250	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	959,259.360	
US T N/B 3.0 05/15/45	2,290,000.000	1,987,111.730	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,398,515.620	
US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,142,812.500	
US T N/B 3.0 07/31/24	3,820,000.000	3,752,254.660	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,810,000.000	3,294,310.540	
US T N/B 3.0 08/15/52	3,740,000.000	3,237,437.500	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,718,212.870	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,270,000.000	1,246,981.250	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,358,357.810	
US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	745,210.150	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,234,571.860	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,740,000.000	1,564,844.520	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,502,560.160	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,983,603.120	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,861,896.090	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,940,000.000	3,886,979.290	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	3,053,509.770	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,309,851.560	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	928,558.580	
US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	3,463,018.720	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,500,000.000	3,467,255.850	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,000,000.000	2,966,132.820	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,328,112.500	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,735,903.110	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,200,000.000	2,964,374.970	
US T N/B 3.5 01/31/28	2,380,000.000	2,387,669.930	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,500,000.000	2,510,546.870	
US T N/B 3.5 02/15/33	4,000,000.000	4,021,562.480	
US T N/B 3.5 02/15/39	500,000.000	495,029.280	
US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,980,253.910	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,574,414.450	
US T N/B 3.625 02/15/53	3,200,000.000	3,127,499.990	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,425,785.150	

US T N/B 3.75 08/15/41	820,000.000	817,533.580	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,441,065.620	
US T N/B 3.875 01/15/26	5,800,000.000	5,824,921.900	
US T N/B 3.875 02/15/43	1,800,000.000	1,809,140.610	
US T N/B 3.875 03/31/25	1,050,000.000	1,047,969.730	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,321,846.870	
US T N/B 3.875 09/30/29	3,250,000.000	3,329,726.560	
US T N/B 3.875 11/30/27	3,000,000.000	3,056,191.410	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,300,000.000	2,358,757.820	
US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,685,710.920	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,000,000.000	2,052,421.880	
US T N/B 4.0 02/15/26	2,500,000.000	2,521,191.400	
US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	3,103,593.750	
US T N/B 4.0 02/29/28	3,200,000.000	3,284,249.980	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,500,000.000	2,580,957.020	
US T N/B 4.0 11/15/42	3,320,000.000	3,401,962.500	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,860,000.000	5,085,534.360	
US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,168,785.910	
US T N/B 4.125 01/31/25	1,800,000.000	1,800,386.710	
US T N/B 4.125 09/30/27	4,420,000.000	4,538,010.550	
US T N/B 4.125 10/31/27	2,340,000.000	2,404,212.890	
US T N/B 4.125 11/15/32	8,300,000.000	8,759,093.750	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	1,025,591.780	
US T N/B 4.25 09/30/24	2,200,000.000	2,197,292.960	
US T N/B 4.25 10/15/25	2,800,000.000	2,829,914.050	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,300,000.000	1,395,011.710	
US T N/B 4.25 12/31/24	5,500,000.000	5,506,445.340	
US T N/B 4.375 02/15/38	800,000.000	877,671.870	
US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	993,428.510	
US T N/B 4.375 05/15/41	930,000.000	1,011,375.000	
US T N/B 4.375 10/31/24	2,070,000.000	2,072,951.360	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,092,929.690	
US T N/B 4.5 02/15/36	400,000.000	445,976.560	
US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	666,304.670	
US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,088,757.010	
US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,632,684.160	
US T N/B 4.5 11/30/24	4,200,000.000	4,217,308.570	
US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	1,001,667.170	
US T N/B 4.625 03/15/26	5,330,000.000	5,471,994.500	
US T N/B 4.75 02/15/41	830,000.000	945,454.290	
US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	648,493.650	
US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	926,632.810	
US T N/B 5.375 02/15/31	860,000.000	976,805.450	
US T N/B 6.0 02/15/26	400,000.000	424,375.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	200,000.000	222,335.930	
US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	893,144.340	
アメリカ・ドル 小計	847,830,000.000 (114,575,746,200)	776,663,421.330 (104,958,294,759)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,150,000.000	1,045,076.300



UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,040,000.000	882,492.000	
UK TREASURY 0.25 01/31/25	2,400,000.000	2,244,945.600	
UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,698,368.000	
UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,330,000.000	2,074,767.140	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	962,116.400	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,780,000.000	1,486,620.400	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	610,454.800	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	994,139.020	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,850,000.000	1,265,007.800	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	890,000.000	382,195.000	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,670,000.000	862,388.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,300,000.000	980,329.480	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,260,000.000	1,065,153.600	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,970,000.000	2,373,624.000	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,860,000.000	1,226,315.850	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	298,893.990	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	998,470.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,730,000.000	903,942.300	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,600,000.000	1,012,437.740	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,100,000.000	1,027,323.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	594,149.190	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,110,000.000	608,399.880	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	931,120.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	870,000.000	489,897.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	424,296.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	391,482.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	650,027.070	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	1,050,562.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,310,000.000	1,256,300.480	

	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	871,125.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	810,000.000	795,147.350	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,040,000.000	1,777,284.720	
	UK TREASURY 3.25 01/31/33	700,000.000	670,390.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,450,000.000	1,307,083.930	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	930,000.000	834,777.300	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	400,000.000	386,929.600	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	903,724.930	
	UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,400,000.000	1,298,080.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	889,409.310	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	1,890,000.000	1,901,718.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,500,000.000	1,552,665.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,420,000.000	1,482,906.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,080,572.480	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	910,000.000	932,467.900	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,088,426.240	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,080,000.000	1,087,622.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	1,026,852.690	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,238,151.060	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,273,568.400	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,565,000.000	1,642,543.870	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,395,000.000	1,498,467.150	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,080,000.000	1,170,072.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,785,000.000	1,815,580.620	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	760,376.000	
	イギリス・ポンド 小計	72,184,000.000 (12,320,365,120)	60,077,235.790 (10,253,982,605)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	320,000.000	302,479.360	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	830,000.000	755,823.730	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,763,345.430	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0	2,860,000.000	2,400,918.520	

	03/31/30			
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,720,000.000	1,281,355.280	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,896,772.000	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	560,000.000	432,076.960	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,560,000.000	1,459,447.080	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,360,000.000	2,188,609.720	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,910,000.000	1,815,938.230	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,010,000.000	1,205,185.530	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,313,276.320	
	イスラエル・シュケル 小計	18,240,000.000 (676,911,936)	16,815,228.160 (624,036,658)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,990,000.000	1,902,006.110	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,364,090.130	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,815,000.000	1,672,230.200	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,470,000.000	2,053,780.380	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,421,281.670	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,790,695.920	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,710,000.000	1,498,104.430	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,460,000.000	914,398.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,614,754.860	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,430,000.000	1,372,156.500	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,734,045.040	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,020,000.000	881,910.710	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	605,500.870	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,430,000.000	1,411,767.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	950,000.000	935,471.940	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,361,010.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	940,000.000	814,733.250	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	2,270,000.000	2,201,354.300	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,700,000.000	1,705,465.820	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,500,000.000	1,513,294.650	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	774,805.300	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	800,000.000	807,421.360	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	845,654.040	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,400,000.000	1,449,658.280	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,200,000.000	1,243,563.230	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,460,000.000	1,605,288.820	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,590,000.000	1,694,304.790	
	オーストラリア・ドル 小計	39,755,000.000 (3,623,270,700)	37,188,748.100 (3,389,382,502)	
オフショア・人	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.000	9,964,000.000	

民元

1.99 09/15/24			
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.18 06/25/24	4,200,000.000	4,201,642.200	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.18 08/25/25	20,000,000.000	19,916,214.800	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,467,077.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.26 02/24/25	49,500,000.000	49,464,405.040	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,706,190.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.44 10/15/27	26,000,000.000	25,876,017.180	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,342,250.950	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,034,740.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,355,913.500	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.6 09/01/32	7,300,000.000	7,209,624.680	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.62 09/25/29	17,500,000.000	17,388,316.570	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,570,014.080	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,774,230.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.69 08/15/32	13,000,000.000	12,931,214.140	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.75 02/17/32	20,000,000.000	20,004,770.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.75 06/15/29	20,000,000.000	20,049,932.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.76 05/15/32	3,000,000.000	3,002,393.400	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.79 12/15/29	26,000,000.000	26,077,896.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,068,015.200	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 11/15/32	33,300,000.000	33,451,471.710	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.85 06/04/27	18,500,000.000	18,725,977.500	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,144,007.760	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.91 10/14/28	22,100,000.000	22,395,035.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.02 05/27/31	9,000,000.000	9,181,350.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.03 03/11/26	35,000,000.000	35,612,500.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	7,500,000.000	7,525,156.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,222,664.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	450,000.000	461,678.490	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,618,031.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	20,320,000.000	21,023,866.510	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	5,100,000.000	5,314,950.210	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	16,450,000.000	17,639,843.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,241,500.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,321,716.320	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	3,000,000.000	3,363,522.900	
	オフショア・人民元 小計	555,220,000.000 (10,833,119,508)	559,648,129.290 (10,919,518,510)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,291,483.860	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,153,497.500	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,510,869.600	
	CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	774,772.290	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	507,966.800	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,181,679.120	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	669,823.000	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,210,000.000	1,127,657.080	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,850,000.000	1,659,248.350	
	CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,055,080.400	
	CANADA 1.5 05/01/24	940,000.000	914,535.400	
	CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	664,338.500	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,225,057.510	
	CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	425,879.960	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,620,000.000	2,346,212.620	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,616,587.720	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,430,000.000	1,369,651.140	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,940,000.000	1,801,730.380	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,260,000.000	2,595,041.500	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,284,534.240	
	CANADA 2.25 06/01/29	230,000.000	222,390.450	
	CANADA 2.5 06/01/24	970,000.000	953,453.740	
	CANADA 2.5 12/01/32	2,020,000.000	1,950,922.060	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,280,000.000	1,261,117.440	
	CANADA 2.75 08/01/24	590,000.000	580,465.010	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,250,000.000	1,232,931.250	
	CANADA 2.75 12/01/48	860,000.000	808,882.460	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	360,483.240	

	CANADA 3.0 04/01/26	200,000.000	197,779.400	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,760,000.000	1,737,355.840	
	CANADA 3.0 11/01/24	860,000.000	848,114.800	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,130,000.000	1,153,918.710	
	CANADA 3.5 12/01/45	900,000.000	955,364.400	
	CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,158,457.200	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	638,282.010	
	CANADA 5.0 06/01/37	380,000.000	462,931.200	
	CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	857,409.140	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	758,997.380	
カナダ・ドル 小計		46,210,000.000 (4,665,361,600)	43,314,902.700 (4,373,072,577)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	380,000.000	357,960.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	483,633.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	540,000.000	497,880.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	458,556.250	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	474,623.850	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	940,000.000	919,414.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	571,120.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	769,068.300	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	187,231.700	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	340,000.000	339,250.300	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	460,000.000	491,293.100	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	693,897.600	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	590,000.000	597,257.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	201,440.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	627,626.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	157,425.460	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	370,000.000	368,335.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	330,000.000	352,110.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	821,600.000	
シンガポール・ドル 小計		9,425,000.000 (960,596,000)	9,369,721.560 (954,962,021)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	5,420,000.000	4,571,618.240	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,135,429.360	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,010,000.000	2,733,841.180	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,910,000.000	7,510,874.050	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	2,000,000.000	1,895,400.000	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,050,000.000	4,036,601.690	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,882,629.690	
SWEDEN 3.5 03/30/39	3,370,000.000	3,830,914.900		
スウェーデン・クローナ 小計		35,070,000.000 (466,080,300)	33,597,309.110 (446,508,238)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,200,000.000	2,109,382.000	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,180,000.000	3,391,794.800	
	DENMARK 0.25 11/15/52	3,760,000.000	1,971,584.180	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,350,000.000	5,829,561.860	

	DENMARK 0.5 11/15/29	6,290,000.000	5,556,712.410	
	DENMARK 1.75 11/15/25	4,840,000.000	4,738,229.320	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,930,000.000	11,066,059.560	
デンマーク・クローネ 小計		36,550,000.000 (730,634,500)	34,663,324.130 (692,919,849)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	450,000.000	373,691.560	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/24	650,000.000	619,985.830	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	519,223.310	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	580,000.000	478,558.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	267,707.740	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	440,000.000	371,861.620	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	820,000.000	791,815.780	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	810,000.000	677,973.280	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	440,000.000	326,752.430	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	350,000.000	330,868.040	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	350,000.000	333,443.870	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	130,858.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	600,000.000	609,145.970	
ニュージーランド・ドル 小計		6,600,000.000 (561,792,000)	5,831,885.430 (496,410,088)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,286,181.500	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,826,286.110	
	NORWAY 1.5 02/19/26	6,710,000.000	6,405,198.250	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,283,084.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,130,000.000	1,096,784.780	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,620,000.000	2,420,880.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,970,433.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,630,000.000	2,421,309.500	
NORWAY 3.0 08/15/33	2,900,000.000	2,853,600.000		
ノルウェー・クローネ 小計		27,420,000.000 (350,701,800)	25,563,757.140 (326,960,454)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,564,066.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	4,470,000.000	4,068,817.500	
	POLAND 07/25/24	1,710,000.000	1,601,842.500	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,370,000.000	3,216,713.300	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,920,000.000	2,848,664.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,150,000.000	2,050,562.500	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,528,298.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,076,918.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,020,929.460	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,509,895.800	
	POLAND 3.75 05/25/27	3,650,000.000	3,380,173.750	

	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,443,240.000	
	POLAND 7.5 07/25/28	1,500,000.000	1,611,154.500	
ポーランド・ズロチ 小計		35,290,000.000 (1,149,137,683)	30,921,275.310 (1,006,880,212)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,100,000.000	1,015,703.680	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	649,357.570	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,383,950.800	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,021,443.800	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,449,305.030	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,807,378.140	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,660,420.470	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	1,350,000.000	1,364,741.590	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	709,046.800	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,014,535.800	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,758,996.350	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,686,537.410	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	920,000.000	935,587.370	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,750,000.000	2,791,959.500	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	911,155.860	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,900,000.000	1,869,802.120	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,030,000.000	1,043,139.500	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	689,166.810	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	600,000.000	614,629.080	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,080,923.020	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,262,599.320	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,091,249.830	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	950,000.000	1,020,496.460	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,600,000.000	1,750,563.340	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	327,094.170		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,100,000.000	1,186,939.050		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,264,811.230		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,781,057.120		
マレーシア・リンギット 小計		38,080,000.000 (1,159,136,160)	39,142,591.220 (1,191,480,905)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	15,580,000.000	13,800,218.700	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	11,680,000.000	10,655,839.200	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	6,790,000.000	6,226,260.250	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	9,290,000.000	8,252,353.450	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	6,012,245.620	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	21,702,000.000	21,468,110.140	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	32,282,000.000	29,301,294.130	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	28,146,000.000	26,713,087.140	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	31,148,000.000	29,348,424.300	
	MEXICAN BONDS 7.75	21,007,000.000	18,413,160.670	



	11/13/42			
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	6,835,000.000	6,327,672.120	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,070,000.000	21,295,939.100	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	21,661,000.000	19,402,732.440	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	19,911,044.300	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,935,920.120	
メキシコ・ペソ 小計		269,477,000.000 (2,049,911,539)	252,064,301.680 (1,917,453,143)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	930,000.000	773,089.470	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	810,000.000	651,406.860	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	1,090,000.000	1,034,473.220	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	570,000.000	493,578.960	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	450,000.000	260,460.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	380,000.000	261,516.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,420,000.000	1,256,075.200	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,070,000.000	986,505.760	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	410,000.000	181,510.030	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	765,482.910	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	333,839.700	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,190,000.000	1,119,401.030	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	128,555.450	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	900,000.000	762,481.800	
	AUSTRIA 07/15/24	520,000.000	503,406.280	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	940,000.000	908,652.880	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	740,000.000	538,990.840	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	111,910.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	930,000.000	915,254.850	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	290,000.000	223,565.930	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	260,000.000	255,512.140	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	282,870.900	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	770,000.000	727,680.800	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	500,000.000	497,850.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	540,000.000	538,719.120	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	310,000.000	355,037.420	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,510,000.000	1,674,137.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	710,000.000	754,554.980	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	415,000.000	473,202.330	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	517,664.500	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	740,574.300	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	666,240.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	1,200,000.000	956,400.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	450,000.000	279,688.950	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	750,000.000	726,243.750	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	670,000.000	271,735.920	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,980,000.000	1,906,090.560	

BELGIUM 0.8 06/22/27	1,260,000.000	1,173,277.980	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,440,000.000	1,317,024.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,500,000.000	1,356,291.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,810,000.000	1,725,347.650	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,270,000.000	1,105,573.100	
BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	696,201.880	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,490,000.000	926,567.210	
BELGIUM 1.45 06/22/37	380,000.000	304,714.400	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	649,483.200	
BELGIUM 1.7 06/22/50	980,000.000	686,061.100	
BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	512,166.980	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	330,750.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	300,322.230	
BELGIUM 2.6 06/22/24	840,000.000	837,152.400	
BELGIUM 2.75 04/22/39	220,000.000	205,107.100	
BELGIUM 3.0 06/22/33	500,000.000	500,422.350	
BELGIUM 3.0 06/22/34	680,000.000	676,288.560	
BELGIUM 3.3 06/22/54	270,000.000	259,436.520	
BELGIUM 3.75 06/22/45	740,000.000	781,445.920	
BELGIUM 4.0 03/28/32	630,000.000	684,234.810	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,280,000.000	1,435,242.240	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,125,970.630	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,220,000.000	1,444,556.860	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,570,000.000	1,780,411.400	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	2,110,000.000	1,969,537.300	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,514,437.810	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	2,160,000.000	1,978,068.600	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,860,000.000	1,719,625.800	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,850,000.000	2,685,640.500	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,272,996.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,880,000.000	1,806,435.600	
BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,529,671.700	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,800,000.000	1,797,498.000	
BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	1,250,000.000	1,215,050.000	
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	900,000.000	872,388.000	
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	1,350,000.000	1,339,321.500	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,120,000.000	1,830,408.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,840,000.000	1,553,916.800	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,900,000.000	2,392,009.170	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,660,000.000	1,250,063.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,780,000.000	1,302,390.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,430,000.000	2,076,094.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	590,000.000	504,715.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,190,000.000	1,828,474.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	669,049.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,656,296.620	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	710,000.000	375,483.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,540,000.000	770,954.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,466,974.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,060,000.000	1,826,437.200	

DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,967,784.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,080,000.000	1,862,922.880	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,770,000.000	1,598,823.300	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,832,094.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,660,000.000	2,526,521.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,240,000.000	2,068,304.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,310,000.000	2,150,014.020	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,590,000.000	2,403,515.670	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,990,000.000	1,737,560.540	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,460,000.000	1,191,082.600	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,820,000.000	1,780,759.300	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,340,720.800	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,670,000.000	2,099,031.180	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,520,000.000	1,500,165.520	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,430,000.000	1,364,792.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	850,000.000	730,813.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,400,000.000	1,389,514.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	950,000.000	950,798.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,070,000.000	2,082,420.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,170,000.000	2,199,846.180	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,481,899.300	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,130,000.000	2,513,065.590	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,700,000.000	2,095,454.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,325,446.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,820,000.000	2,247,008.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	1,852,105.500	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,820,000.000	3,460,422.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,504,797.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	972,901.800	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	991,108.500	
FINLAND 0.0 09/15/24	410,000.000	395,164.970	
FINLAND 0.0 09/15/26	430,000.000	394,847.500	
FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	171,752.800	
FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	192,581.480	
FINLAND 0.125 04/15/52	660,000.000	301,956.600	
FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	240,557.400	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	179,578.730	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	434,502.660	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	233,358.000	

FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	366,476.800	
FINLAND 0.5 09/15/28	550,000.000	492,481.000	
FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	261,996.300	
FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	171,029.800	
FINLAND 0.875 09/15/25	910,000.000	875,347.200	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	397,657.920	
FINLAND 1.375 04/15/27	110,000.000	105,253.280	
FINLAND 1.375 04/15/47	480,000.000	348,471.360	
FINLAND 1.5 09/15/32	50,000.000	44,444.120	
FINLAND 2.625 07/04/42	430,000.000	401,335.240	
FINLAND 2.75 04/15/38	170,000.000	161,890.150	
FINLAND 2.75 07/04/28	490,000.000	493,712.520	
FINLAND 4.0 07/04/25	510,000.000	524,997.060	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	2,190,000.000	2,085,964.050	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	4,030,000.000	3,749,241.990	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	3,650,000.000	3,314,713.720	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	5,890,000.000	4,596,556.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,890,000.000	2,439,318.950	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,780,000.000	3,915,226.300	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,596,010.490	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,920,000.000	2,690,584.360	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,730,000.000	3,568,523.900	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,460,000.000	3,249,355.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,390,000.000	2,996,180.310	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,150,000.000	1,388,227.050	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	300,556.070	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,590,000.000	932,970.660	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,280,000.000	3,010,548.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,110,000.000	4,671,229.850	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,770,000.000	2,001,327.120	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,350,000.000	1,214,679.750	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,500,000.000	4,080,260.960	
FRANCE OAT 03/25/25	3,970,000.000	3,774,018.240	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,560,000.000	3,345,833.960	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,630,938.410	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,860,000.000	2,404,030.200	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	4,180,000.000	3,364,064.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	500,000.000	385,550.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,480,000.000	4,105,265.920	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,470,000.000	1,682,079.880	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	659,644.920	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,370,000.000	1,953,685.800	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,380,000.000	2,342,527.950	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,250,000.000	1,756,340.060	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,600,000.000	1,492,112.930	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,481,120.620	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,550,000.000	4,512,089.400	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	250,000.000	220,989.000	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	520,000.000	517,543.520	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,890,000.000	3,918,412.560	

FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,040,000.000	2,026,601.280	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,000,000.000	3,074,250.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,712,988.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,170,000.000	1,326,573.490	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,131,443.080	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,089,196.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,530,000.000	2,965,663.470	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,500,000.000	4,047,050.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,117,964.670	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,340,318.960	
IRISH 0.0 10/18/31	870,000.000	693,703.200	
IRISH 0.2 05/15/27	520,000.000	473,962.840	
IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	461,443.400	
IRISH 0.35 10/18/32	400,000.000	321,338.000	
IRISH 0.4 05/15/35	370,000.000	276,045.530	
IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	160,620.540	
IRISH 0.9 05/15/28	610,000.000	564,031.010	
IRISH 1.0 05/15/26	900,000.000	859,956.300	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	672,487.110	
IRISH 1.3 05/15/33	390,000.000	339,500.260	
IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	327,817.440	
IRISH 1.5 05/15/50	570,000.000	391,205.820	
IRISH 1.7 05/15/37	490,000.000	414,449.630	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	676,195.800	
IRISH 2.4 05/15/30	860,000.000	851,774.960	
IRISH 3.0 10/18/43	410,000.000	396,870.570	
IRISH 5.4 03/13/25	920,000.000	964,761.850	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,520,000.000	1,380,768.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,050,000.000	1,840,695.000	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,460,000.000	1,401,410.200	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,291,714.400	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,255,600.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,800,000.000	1,713,333.600	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,500,000.000	1,249,950.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,491,451.160	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	941,490.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,520,000.000	1,166,007.200	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,310,000.000	1,195,244.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,610,000.000	1,281,893.970	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,980,000.000	1,295,514.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	2,380,000.000	1,827,126.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,104,030.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,510,656.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,328,930.800	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,007,270.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,298,392.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,830,000.000	1,700,683.050	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,575,123.300	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	804,832.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,880,000.000	1,815,702.120	

ITALY BTPS 1.45 11/15/24	680,000.000	662,237.040	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	478,548.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,760,000.000	1,698,973.760	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,550,000.000	1,471,725.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,790,000.000	1,481,049.580	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,485,761.560	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,320,000.000	749,103.960	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,179,060.480	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	777,055.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	975,664.800	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,205,404.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	3,040,000.000	2,840,679.360	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,606,868.380	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.000	1,417,942.500	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,290,000.000	1,241,194.140	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	201,600.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	316,965.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,517,973.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,074,128.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,830,000.000	1,565,575.980	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	782,000.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,520,811.950	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,618,672.530	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	2,040,000.000	1,787,244.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,220,000.000	1,178,276.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,590,000.000	1,182,642.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	476,910.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,139,160.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,740,000.000	1,668,680.880	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,520,000.000	1,270,416.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,546,557.950	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,160,000.000	972,066.080	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	521,880.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	969,928.140	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,020,000.000	927,665.520	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	550,000.000	545,655.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,001,972.860	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	2,410,000.000	2,418,676.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,870,000.000	1,839,365.660	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,629,721.280	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,000,000.000	1,010,726.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,250,000.000	1,115,237.500	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,800,000.000	1,804,140.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,170,000.000	2,087,540.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	660,000.000	638,682.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	750,000.000	765,150.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,200,000.000	1,178,400.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,510,000.000	2,586,806.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	370,000.000	359,677.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,772,791.440	

ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,138,145.160	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	560,000.000	576,921.290	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,762,588.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,090,000.000	2,208,921.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,250,000.000	1,323,250.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,140,000.000	2,331,958.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,460,000.000	1,649,070.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,836,376.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,510,000.000	1,700,260.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	394,345.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	1,260,000.000	1,177,677.640	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,080,000.000	986,418.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,110,000.000	965,530.720	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	366,941.300	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,000,000.000	475,495.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	585,575.900	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,400,000.000	1,138,774.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,490,000.000	1,418,076.210	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,060,000.000	926,349.260	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,110,000.000	775,058.850	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,420,000.000	1,333,522.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	700,000.000	581,341.460	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,081,955.200	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,357,851.160	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	561,196.020	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,140,000.000	1,130,330.730	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,100,298.600	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	450,000.000	445,729.500	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,510,000.000	1,518,872.760	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,420,000.000	1,612,417.100	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,720,000.000	1,952,716.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	840,000.000	950,628.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	2,050,000.000	1,951,272.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,518,205.400	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,610,000.000	1,446,746.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	2,280,000.000	1,996,824.000	
SPAIN 0.0 05/31/24	1,110,000.000	1,074,590.880	
SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	820,048.950	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,380,000.000	1,082,610.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,080,000.000	1,043,937.720	
SPAIN 0.5 04/30/30	3,000,000.000	2,523,075.000	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,315,053.680	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,314,675.450	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,487,585.000	

	SPAIN 0.8 07/30/27	1,750,000.000	1,607,287.500	
	SPAIN 0.8 07/30/29	1,100,000.000	958,430.000	
	SPAIN 0.85 07/30/37	900,000.000	619,560.000	
	SPAIN 1.0 07/30/42	840,000.000	519,288.000	
	SPAIN 1.0 10/31/50	1,590,000.000	825,733.110	
	SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	845,257.140	
	SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,542,100.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	1,930,000.000	1,833,372.620	
	SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	2,017,735.440	
	SPAIN 1.4 07/30/28	1,670,000.000	1,550,678.500	
	SPAIN 1.45 04/30/29	1,900,000.000	1,742,343.700	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,747,252.640	
	SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	192,040.610	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,210,000.000	2,096,185.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,591,746.240	
	SPAIN 1.85 07/30/35	2,840,000.000	2,372,439.440	
	SPAIN 1.9 10/31/52	870,000.000	559,031.550	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,330,000.000	1,296,558.480	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,639,535.070	
	SPAIN 2.15 10/31/25	2,010,000.000	1,979,699.250	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,970,000.000	1,792,700.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,614,423.500	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,210,000.000	976,974.570	
	SPAIN 2.75 10/31/24	2,190,000.000	2,184,102.330	
	SPAIN 2.8 05/31/26	800,000.000	796,960.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,730,000.000	1,478,523.740	
	SPAIN 3.15 04/30/33	670,000.000	657,404.000	
	SPAIN 3.45 07/30/43	250,000.000	234,186.500	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	994,407.680	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,480,519.450	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,600,000.000	1,699,265.600	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,967,371.940	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,630,000.000	1,818,700.210	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,510,000.000	1,717,625.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,560,000.000	1,732,380.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,433,989.610	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,815,000.000	2,174,954.430	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,778,874.420	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,460,000.000	1,689,246.280	
	ユーロ 小計	523,957,000.000 (78,027,676,440)	479,730,244.060 (71,441,427,945)	
国債証券	合計	232,150,441,486 (232,150,441,486)	212,993,290,466 (212,993,290,466)	
合計			212,993,290,466 (212,993,290,466)	

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における ( ) 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における ( ) 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳



通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 262銘柄	48.83	49.28
イギリス・ポンド	国債証券 55銘柄	4.77	4.81
イスラエル・シェケル	国債証券 12銘柄	0.29	0.29
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.58	1.59
オフショア・人民元	国債証券 36銘柄	5.08	5.13
カナダ・ドル	国債証券 38銘柄	2.03	2.05
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.44	0.45
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.32	0.33
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	0.23	0.23
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.15	0.15
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.47	0.47
マレーシア・リンギット	国債証券 28銘柄	0.55	0.56
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.89	0.90
ユーロ	国債証券 359銘柄	33.23	33.54

(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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年5月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,550,220,165
株式	414,358,183,660
派生商品評価勘定	288,641,170
未収入金	35,613,600
未収配当金	4,441,213,521
差入委託証拠金	501,390,000
流動資産合計	428,175,262,116
資産合計	428,175,262,116
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,287,240
前受金	348,230,000
未払解約金	671,860,000
流動負債合計	1,030,377,240
負債合計	1,030,377,240
純資産の部	
元本等	
元本	119,728,617,791
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	307,416,267,085
元本等合計	427,144,884,876
純資産合計	427,144,884,876
負債純資産合計	428,175,262,116

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年5月8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	111,720,693,843円
同期中追加設定元本額	100,062,771,519円
同期中一部解約元本額	92,054,847,571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	2,614,273,110円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,273,370,838円
One DC 国内株式インデックスファンド	25,878,773,847円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,591,746,339円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	1,919,058円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,695,470円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	29,741,680円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	25,579,473円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	26,252,146円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	25,005,856円
たわらノーロード TOPIX	1,781,851,705円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,523,554,059円
たわらノーロード バランス（堅実型）	53,649,267円
たわらノーロード バランス（標準型）	361,683,532円
たわらノーロード バランス（積極型）	572,591,945円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	3,035,598円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	171,701,960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）	441,114,466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）	341,117,311円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	452,915,732円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	398,634円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,725,479円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	34,027,017円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,329,331円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,705,563円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,372,673,232円
O n eグローバルバランス	16,475,638円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	1,053,157,383円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,594,440,898円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,962,696,159円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	334,921,035円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,061,732,379円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,123,763,139円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	29,168,729円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,079,733,764円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	317,491,152円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	351,661,679円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	568,099,899円
投資のソムリエ	9,196,036,090円
クルーズコントロール	373,501,158円
投資のソムリエ<DC年金>	716,784,816円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	365,541,371円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	930,512,178円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	733,910,233円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,930,898,203円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	37,067,302円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	18,335,254円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	5,254,799円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	87,191,445円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	504,802,857円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,484,643,474円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	267,005,329円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	28,542,349円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	20,229,926円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	12,154,806円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	404,573,192円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	2,657,065円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,941,415円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	44,761,167円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	55,891,882円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	57,225,511円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	43,870,370円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	35,136,605円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	55,226,539円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	139,105,012円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	223,027,233円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	50,019,791円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き） 2022-05（適格機関投資家限定）	229,715,121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）	474,241,632円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	244,415,180円
AMOn e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）	32,017,881円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	28,461,954円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	197,723,450円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	93,198,630円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,778,231円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	8,245,298円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	42,380,134円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	87,744,623円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,990,117円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	15,036,664円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,991,913円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	89,050円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	5,613,917円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	25,856,414円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	385,380,476円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	492,992,976円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,461,704,478円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	13,517,066円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	19,668,055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）	203,138,623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）	40,600,568円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	63,348円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	258,026,357円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	15,485,866円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	50,813,938円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	115,313,099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）	161,998,587円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	21,245,784円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	14,496,340円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1306）（適格機関投資家限定）	847,598,664円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1309）（適格機関投資家限定）	44,458,208円
動的パッケージファンド<DC年金>	28,995,654円
コア資産形成ファンド	19,523,044円
MHAMトピックスファンド	768,959,272円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	45,806,675円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	3,577,944,747円

MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定] 計	1,467,959,145円 119,728,617,791円
2. 受益権の総数	119,728,617,791口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年5月8日現在
----	-------------

	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	17,140,610,351
合計	17,140,610,351

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間 (2023年2月8日から2023年5月8日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年5月8日現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引 先物取引 買建	11,712,545,000	—	11,991,090,000	278,545,000
合計	11,712,545,000	—	11,991,090,000	278,545,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年5月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.5676円 (35,676円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年5月8日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	7,400	3,575.00	26,455,000	
ニッスイ	196,100	596.00	116,875,600	
マルハニチロ	29,100	2,588.00	75,310,800	
雪国まいたけ	16,700	1,031.00	17,217,700	
カネコ種苗	6,000	1,602.00	9,612,000	
サカタのタネ	22,300	4,055.00	90,426,500	
ホクト	17,500	1,860.00	32,550,000	
ホクリヨウ	2,200	788.00	1,733,600	
ショーボンドホールディングス	26,700	5,820.00	155,394,000	
ミライト・ワン	64,900	1,696.00	110,070,400	
タマホーム	12,300	3,800.00	46,740,000	

サンヨーホームズ	1,900	721.00	1,369,900
日本アクア	6,400	892.00	5,708,800
ファーストコーポレーション	3,900	941.00	3,669,900
ベステラ	3,300	910.00	3,003,000
Robot Home	33,400	234.00	7,815,600
キャンディル	2,800	580.00	1,624,000
住石ホールディングス	23,700	341.00	8,081,700
日鉄鉱業	7,900	3,840.00	30,336,000
三井松島ホールディングス	8,900	3,160.00	28,124,000
INPEX	725,300	1,454.00	1,054,586,200
石油資源開発	22,700	4,505.00	102,263,500
K&Oエナジーグループ	8,900	2,366.00	21,057,400
ダイセキ環境ソリューション	3,100	963.00	2,985,300
第一カッター興業	5,000	1,272.00	6,360,000
明豊ファシリティワークス	5,600	788.00	4,412,800
安藤・間	113,600	911.00	103,489,600
東急建設	55,800	731.00	40,789,800
コムシスホールディングス	66,400	2,603.00	172,839,200
ビーアールホールディングス	31,200	376.00	11,731,200
高松コンストラクショングループ	12,800	2,226.00	28,492,800
東建コーポレーション	5,600	7,930.00	44,408,000
ソネック	1,700	994.00	1,689,800
ヤマウラ	10,000	1,221.00	12,210,000
オリエンタル白石	70,400	337.00	23,724,800
大成建設	128,400	4,710.00	604,764,000
大林組	490,500	1,146.00	562,113,000
清水建設	412,400	823.00	339,405,200
飛島建設	15,100	1,162.00	17,546,200
長谷工コーポレーション	141,600	1,660.00	235,056,000
松井建設	12,800	719.00	9,203,200
銭高組	1,400	3,485.00	4,879,000
鹿島建設	304,100	1,832.00	557,111,200
不動テトラ	9,500	1,810.00	17,195,000
大末建設	3,900	1,241.00	4,839,900
鉄建建設	9,800	1,979.00	19,394,200
西松建設	23,300	3,575.00	83,297,500
三井住友建設	110,600	393.00	43,465,800
大豊建設	5,700	3,955.00	22,543,500
佐田建設	6,800	498.00	3,386,400
ナカノブドー建設	7,600	408.00	3,100,800
奥村組	22,200	3,375.00	74,925,000
東鉄工業	18,900	2,740.00	51,786,000
イチケン	2,400	1,965.00	4,716,000
富士ピー・エス	4,900	445.00	2,180,500
浅沼組	11,000	3,150.00	34,650,000
戸田建設	168,800	819.00	138,247,200
熊谷組	23,000	2,821.00	64,883,000
北野建設	2,000	3,290.00	6,580,000
植木組	3,100	1,358.00	4,209,800
矢作建設工業	18,700	848.00	15,857,600



ピーエス三菱	17,400	690.00	12,006,000
日本ハウスホールディングス	27,200	390.00	10,608,000
大東建託	50,500	12,980.00	655,490,000
新日本建設	19,300	1,078.00	20,805,400
東亜道路工業	5,500	4,465.00	24,557,500
日本道路	2,800	8,160.00	22,848,000
東亜建設工業	11,800	2,999.00	35,388,200
日本国土開発	41,100	624.00	25,646,400
若築建設	6,100	4,320.00	26,352,000
東洋建設	44,400	977.00	43,378,800
五洋建設	194,500	673.00	130,898,500
世紀東急工業	17,700	945.00	16,726,500
福田組	5,200	4,800.00	24,960,000
日本ドライケミカル	2,600	1,883.00	4,895,800
住友林業	105,200	2,913.00	306,447,600
日本基礎技術	6,500	545.00	3,542,500
巴コーポレーション	12,000	448.00	5,376,000
大和ハウス工業	383,300	3,461.00	1,326,601,300
ライト工業	25,400	2,029.00	51,536,600
積水ハウス	429,700	2,796.50	1,201,656,050
日特建設	13,100	1,016.00	13,309,600
北陸電気工事	9,500	869.00	8,255,500
ユアテック	30,300	830.00	25,149,000
日本リーテック	12,100	1,341.00	16,226,100
四電工	5,800	1,961.00	11,373,800
中電工	21,300	2,271.00	48,372,300
関電工	75,300	1,075.00	80,947,500
きんでん	96,600	1,849.00	178,613,400
東京エネシス	13,700	940.00	12,878,000
トーエネック	4,500	3,655.00	16,447,500
住友電設	13,100	2,875.00	37,662,500
日本電設工業	22,600	2,006.00	45,335,600
エクシオグループ	63,200	2,530.00	159,896,000
新日本空調	7,600	1,952.00	14,835,200
日本工営	8,700	3,845.00	33,451,500
九電工	33,400	3,555.00	118,737,000
三機工業	30,500	1,513.00	46,146,500
日揮ホールディングス	135,700	1,697.00	230,282,900
中外炉工業	4,500	1,816.00	8,172,000
ヤマト	8,900	960.00	8,544,000
太平電業	8,500	4,250.00	36,125,000
高砂熱学工業	33,100	2,369.00	78,413,900
三晃金属工業	1,300	4,025.00	5,232,500
NEC ネットズエスアイ	46,900	1,819.00	85,311,100
朝日工業社	5,700	2,441.00	13,913,700
明星工業	23,600	914.00	21,570,400
大気社	15,800	3,770.00	59,566,000
ダイダン	9,000	2,511.00	22,599,000
日比谷総合設備	11,800	2,268.00	26,762,400
ニッポン	37,100	1,809.00	67,113,900

日清製粉グループ本社	127,400	1,660.00	211,484,000
日東富士製粉	2,300	4,570.00	10,511,000
昭和産業	12,000	2,683.00	32,196,000
鳥越製粉	8,500	635.00	5,397,500
中部飼料	19,100	1,080.00	20,628,000
フィード・ワン	20,100	759.00	15,255,900
東洋精糖	2,000	924.00	1,848,000
日本甜菜製糖	8,000	1,716.00	13,728,000
DM三井製糖ホールディングス	13,700	2,324.00	31,838,800
塩水港精糖	12,900	201.00	2,592,900
ウェルネオシュガー	7,100	1,740.00	12,354,000
L I F U L L	49,100	222.00	10,900,200
M I X I	32,700	2,880.00	94,176,000
ジェイエイシーリクルートメント	13,000	2,511.00	32,643,000
日本M&Aセンターホールディングス	246,700	1,006.00	248,180,200
メンバーズ	4,200	1,271.00	5,338,200
中広	1,000	400.00	400,000
UTグループ	21,100	2,586.00	54,564,600
アイティメディア	5,500	1,307.00	7,188,500
E・Jホールディングス	8,400	1,622.00	13,624,800
オープンアップグループ	43,100	1,921.00	82,795,100
コシダカホールディングス	43,100	1,106.00	47,668,600
アルトナー	2,700	1,365.00	3,685,500
パソナグループ	17,500	1,854.00	32,445,000
C D S	2,800	1,851.00	5,182,800
リンクアンドモチベーション	41,400	480.00	19,872,000
エス・エム・エス	54,700	3,020.00	165,194,000
サニーサイドアップグループ	3,300	687.00	2,267,100
パーソルホールディングス	161,000	2,755.00	443,555,000
リニカル	6,400	700.00	4,480,000
クックパッド	39,300	190.00	7,467,000
エスクリ	4,500	425.00	1,912,500
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,500	657.00	3,613,500
森永製菓	25,200	4,100.00	103,320,000
中村屋	3,400	3,185.00	10,829,000
江崎グリコ	39,400	3,525.00	138,885,000
名糖産業	5,400	1,718.00	9,277,200
井村屋グループ	7,500	2,318.00	17,385,000
不二家	9,400	2,568.00	24,139,200
山崎製パン	92,200	1,985.00	183,017,000
第一屋製パン	2,100	401.00	842,100
モロゾフ	4,400	3,715.00	16,346,000
亀田製菓	8,800	4,500.00	39,600,000
寿スピリッツ	14,700	10,150.00	149,205,000
カルビー	63,000	3,010.00	189,630,000
森永乳業	25,000	5,190.00	129,750,000
六甲バター	10,100	1,425.00	14,392,500
ヤクルト本社	98,400	10,250.00	1,008,600,000
明治ホールディングス	170,700	3,355.00	572,698,500
雪印メグミルク	33,300	2,045.00	68,098,500

プリマハム	18,500	2,366.00	43,771,000
日本ハム	53,800	3,960.00	213,048,000
林兼産業	3,300	467.00	1,541,100
丸大食品	13,900	1,538.00	21,378,200
S Foods	15,200	3,090.00	46,968,000
柿安本店	5,400	2,270.00	12,258,000
伊藤ハム米久ホールディングス	105,200	756.00	79,531,200
学情	6,500	1,554.00	10,101,000
スタジオアリス	7,200	2,156.00	15,523,200
クロスキャット	8,000	1,237.00	9,896,000
シミックホールディングス	6,900	2,029.00	14,000,100
エプロ	2,400	748.00	1,795,200
システナ	235,800	287.00	67,674,600
N J S	2,700	2,324.00	6,274,800
デジタルアーツ	8,900	5,270.00	46,903,000
日鉄ソリューションズ	23,900	3,910.00	93,449,000
総合警備保障	53,400	3,815.00	203,721,000
キューブシステム	8,300	1,162.00	9,644,600
いちご	158,600	254.00	40,284,400
日本駐車場開発	145,800	243.00	35,429,400
コア	6,200	1,724.00	10,688,800
カカコム	105,500	1,857.00	195,913,500
アイロムグループ	5,200	1,847.00	9,604,400
セントケア・ホールディング	9,200	778.00	7,157,600
サイネックス	1,900	574.00	1,090,600
ルネサンス	10,100	955.00	9,645,500
ディップ	25,200	3,310.00	83,412,000
S B Sホールディングス	12,500	3,220.00	40,250,000
デジタルホールディングス	11,200	1,180.00	13,216,000
新日本科学	15,200	2,540.00	38,608,000
キャリアデザインセンター	2,300	1,634.00	3,758,200
ベネフィット・ワン	66,600	1,832.00	122,011,200
エムスリー	284,100	2,998.50	851,873,850
ツカダ・グローバルホールディング	7,200	470.00	3,384,000
プラス	1,300	1,150.00	1,495,000
アウトソーシング	85,600	1,395.00	119,412,000
ウェルネット	8,500	708.00	6,018,000
ワールドホールディングス	6,500	2,761.00	17,946,500
ディー・エヌ・エー	57,500	1,891.00	108,732,500
博報堂DYホールディングス	183,400	1,584.00	290,505,600
ぐるなび	26,400	361.00	9,530,400
タカミヤ	19,600	439.00	8,604,400
ジャパンベストレスキューシステム	7,200	740.00	5,328,000
ファンコミュニケーションズ	28,300	421.00	11,914,300
ライク	5,400	1,850.00	9,990,000
ビジネス・ブレークスルー	4,200	434.00	1,822,800
エスプール	41,300	585.00	24,160,500
WDBホールディングス	7,400	2,009.00	14,866,600
手間いらず	2,400	4,480.00	10,752,000
ティア	6,600	464.00	3,062,400

CDG	1,200	1,355.00	1,626,000
アドウェイズ	19,800	660.00	13,068,000
バリューコマース	10,800	1,334.00	14,407,200
インフォマート	149,300	300.00	44,790,000
サッポロホールディングス	45,300	3,760.00	170,328,000
アサヒグループホールディングス	318,200	5,237.00	1,666,413,400
キリンホールディングス	621,500	2,170.50	1,348,965,750
宝ホールディングス	94,000	1,058.00	99,452,000
オエノンホールディングス	41,200	290.00	11,948,000
養命酒製造	4,500	1,907.00	8,581,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	107,900	1,488.00	160,555,200
サントリー食品インターナショナル	97,000	5,030.00	487,910,000
ダイドーグループホールディングス	7,800	5,100.00	39,780,000
伊藤園	46,700	4,100.00	191,470,000
キーコーヒー	15,400	2,098.00	32,309,200
ユニカフェ	3,600	912.00	3,283,200
ジャパンフーズ	1,700	1,079.00	1,834,300
日清オイリオグループ	19,400	3,405.00	66,057,000
不二製油グループ本社	32,100	2,100.00	67,410,000
かどや製油	1,200	3,580.00	4,296,000
J-オイルミルズ	14,000	1,616.00	22,624,000
ローソン	36,700	6,210.00	227,907,000
サンエー	11,300	4,635.00	52,375,500
カワチ薬品	11,600	2,220.00	25,752,000
エービーシー・マート	21,600	7,830.00	169,128,000
ハードオフコーポレーション	4,600	1,391.00	6,398,600
高千穂交易	4,100	2,348.00	9,626,800
アスクル	30,600	1,763.00	53,947,800
ゲオホールディングス	14,500	1,689.00	24,490,500
アダストリア	17,900	2,560.00	45,824,000
ジーフット	7,000	276.00	1,932,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	486.00	729,000
オルバヘルスケアホールディングス	1,700	1,784.00	3,032,800
伊藤忠食品	3,300	5,420.00	17,886,000
くら寿司	17,300	3,185.00	55,100,500
キャンドゥ	5,300	2,422.00	12,836,600
エレマテック	13,300	1,857.00	24,698,100
I Kホールディングス	3,600	409.00	1,472,400
パルグループホールディングス	14,500	3,075.00	44,587,500
エディオン	58,600	1,341.00	78,582,600
あらた	11,300	4,380.00	49,494,000
サーラコーポレーション	31,100	771.00	23,978,100
ワッツ	5,600	709.00	3,970,400
トーマンデバイス	2,100	5,470.00	11,487,000
ハローズ	6,700	3,205.00	21,473,500
J Pホールディングス	41,300	316.00	13,050,800
フジオフードグループ本社	16,400	1,451.00	23,796,400
あみやき亭	3,600	3,670.00	13,212,000
東京エレクトロン デバイス	5,500	7,980.00	43,890,000

ひらまつ	24,700	316.00	7,805,200
円谷フィールズホールディングス	25,400	1,856.00	47,142,400
双日	157,100	2,825.00	443,807,500
アルフレッサ ホールディングス	148,500	2,027.00	301,009,500
大黒天物産	4,500	5,300.00	23,850,000
ハニーズホールディングス	11,700	1,568.00	18,345,600
ファーマライズホールディングス	2,600	634.00	1,648,400
キッコーマン	91,300	7,840.00	715,792,000
味の素	332,500	4,861.00	1,616,282,500
ブルドックソース	7,300	2,091.00	15,264,300
キューピー	74,000	2,284.00	169,016,000
ハウス食品グループ本社	42,200	3,000.00	126,600,000
カゴメ	64,200	3,435.00	220,527,000
焼津水産化学工業	4,200	861.00	3,616,200
アリアケジャパン	12,000	5,480.00	65,760,000
ピエトロ	1,600	1,831.00	2,929,600
エバラ食品工業	3,700	3,035.00	11,229,500
やまみ	1,000	1,416.00	1,416,000
ニチレイ	63,100	2,794.00	176,301,400
横浜冷凍	40,300	1,108.00	44,652,400
東洋水産	69,600	6,110.00	425,256,000
イートアンドホールディングス	5,800	2,255.00	13,079,000
大冷	1,300	1,950.00	2,535,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,700	952.00	8,282,400
日清食品ホールディングス	48,400	13,140.00	635,976,000
永谷園ホールディングス	6,800	2,180.00	14,824,000
一正蒲鉾	4,600	783.00	3,601,800
フジッコ	14,100	1,926.00	27,156,600
ロック・フィールド	15,400	1,520.00	23,408,000
日本たばこ産業	906,600	2,979.50	2,701,214,700
ケンコーマヨネーズ	9,500	1,252.00	11,894,000
わらべや日洋ホールディングス	10,100	2,304.00	23,270,400
なとり	8,700	1,964.00	17,086,800
イフジ産業	1,900	1,006.00	1,911,400
ファーマフーズ	19,800	1,746.00	34,570,800
北の達人コーポレーション	59,000	292.00	17,228,000
ユーグレナ	89,000	884.00	78,676,000
紀文食品	10,700	1,086.00	11,620,200
ピクルスホールディングス	8,100	1,168.00	9,460,800
スター・マイカ・ホールディングス	12,400	648.00	8,035,200
SREホールディングス	6,800	3,210.00	21,828,000
ADワークスグループ	26,900	181.00	4,868,900
片倉工業	12,900	1,802.00	23,245,800
グンゼ	10,000	4,685.00	46,850,000
ヒューリック	321,300	1,159.00	372,386,700
神栄	1,500	1,181.00	1,771,500
ラサ商事	5,300	1,463.00	7,753,900
アルペン	12,200	2,080.00	25,376,000
ハブ	3,800	793.00	3,013,400
ラクーンホールディングス	11,600	730.00	8,468,000

クオールホールディングス	20,400	1,247.00	25,438,800
アルコニックス	19,500	1,404.00	27,378,000
神戸物産	114,500	3,855.00	441,397,500
ソリトンシステムズ	7,200	1,090.00	7,848,000
ジンズホールディングス	8,800	3,085.00	27,148,000
ビックカメラ	78,700	1,115.00	87,750,500
DCMホールディングス	90,300	1,365.00	123,259,500
ペッパーフードサービス	33,900	165.00	5,593,500
ハイパー	2,200	453.00	996,600
Monotaro	209,800	1,973.00	413,935,400
東京一番フーズ	2,700	496.00	1,339,200
DDホールディングス	7,400	1,216.00	8,998,400
あいホールディングス	23,700	2,423.00	57,425,100
ディービーエックス	3,200	1,009.00	3,228,800
きちりホールディングス	2,700	895.00	2,416,500
アークランドサービスホールディングス	12,100	2,844.00	34,412,400
J.フロントリテイリング	184,000	1,414.00	260,176,000
ドトール・日レスホールディングス	26,200	2,111.00	55,308,200
マツキヨココカラ&カンパニー	89,700	7,250.00	650,325,000
ブロンコビリー	7,900	2,806.00	22,167,400
ZOZO	97,800	2,862.00	279,903,600
トレジャー・ファクトリー	7,100	1,711.00	12,148,100
物語コーポレーション	24,700	2,896.00	71,531,200
三越伊勢丹ホールディングス	249,100	1,475.00	367,422,500
東洋紡	60,500	1,064.00	64,372,000
ユニチカ	42,200	214.00	9,030,800
富士紡ホールディングス	5,500	3,180.00	17,490,000
日清紡ホールディングス	115,000	1,047.00	120,405,000
倉敷紡績	10,500	2,510.00	26,355,000
ダイワボウホールディングス	60,500	2,590.00	156,695,000
シキボウ	6,000	1,023.00	6,138,000
日東紡績	15,800	1,893.00	29,909,400
トヨタ紡織	58,900	2,105.00	123,984,500
マクニカホールディングス	35,000	3,810.00	133,350,000
Hamee	5,100	979.00	4,992,900
マーケットエンタープライズ	1,200	1,345.00	1,614,000
ラクト・ジャパン	5,700	2,070.00	11,799,000
ウエルシアホールディングス	76,800	2,839.00	218,035,200
クリエイトSDホールディングス	24,500	3,330.00	81,585,000
グリムス	6,200	2,110.00	13,082,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,600	960.00	20,736,000
八洲電機	12,000	1,290.00	15,480,000
メディアスホールディングス	9,500	855.00	8,122,500
レスターホールディングス	14,200	2,170.00	30,814,000
ジューテックホールディングス	2,700	1,201.00	3,242,700
丸善CHIホールディングス	13,600	361.00	4,909,600
大光	4,800	634.00	3,043,200
OCHIホールディングス	2,600	1,228.00	3,192,800

TOKAIホールディングス	73,100	883.00	64,547,300
黒谷	3,300	602.00	1,986,600
ミサワ	2,100	620.00	1,302,000
ティーライフ	1,600	1,347.00	2,155,200
Cominix	2,300	769.00	1,768,700
エー・ピーホールディングス	2,400	783.00	1,879,200
三洋貿易	16,700	1,315.00	21,960,500
チムニー	3,600	1,387.00	4,993,200
シュッピン	11,000	870.00	9,570,000
ビューティガレージ	2,300	3,765.00	8,659,500
オイシックス・ラ・大地	19,900	2,599.00	51,720,100
ウイン・パートナーズ	10,800	1,028.00	11,102,400
ネクステージ	33,800	2,428.00	82,066,400
ジョイフル本田	44,000	1,810.00	79,640,000
鳥貴族ホールディングス	5,500	2,387.00	13,128,500
ホットランド	11,300	1,582.00	17,876,600
すかいらーくホールディングス	202,300	1,850.00	374,255,000
SFPホールディングス	8,100	2,050.00	16,605,000
綿半ホールディングス	11,500	1,416.00	16,284,000
日本毛織	37,000	1,019.00	37,703,000
ダイトウボウ	17,600	83.00	1,460,800
トーア紡コーポレーション	4,300	355.00	1,526,500
ダイドーリミテッド	15,700	282.00	4,427,400
ヨシックスホールディングス	2,300	2,353.00	5,411,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	48,200	1,157.00	55,767,400
三栄建築設計	6,700	1,491.00	9,989,700
野村不動産ホールディングス	86,100	3,325.00	286,282,500
三重交通グループホールディングス	29,500	602.00	17,759,000
サムティ	21,900	2,214.00	48,486,600
ディア・ライフ	23,500	727.00	17,084,500
コーセーアールイー	3,400	763.00	2,594,200
地主	10,500	1,971.00	20,695,500
プレサンスコーポレーション	21,700	1,995.00	43,291,500
フィル・カンパニー	2,400	872.00	2,092,800
THEグローバル社	6,200	230.00	1,426,000
ハウスコム	1,700	1,052.00	1,788,400
JPMC	7,000	1,128.00	7,896,000
サンセイランディック	3,100	881.00	2,731,100
エストラスト	1,400	632.00	884,800
フージャースホールディングス	21,200	855.00	18,126,000
オープンハウスグループ	50,500	5,650.00	285,325,000
東急不動産ホールディングス	414,100	677.00	280,345,700
飯田グループホールディングス	120,700	2,390.00	288,473,000
イーランド	1,600	1,488.00	2,380,800
ムゲンエステート	7,200	636.00	4,579,200
帝国繊維	15,800	1,745.00	27,571,000
日本コークス工業	126,700	91.00	11,529,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	953.00	6,385,100
ミタチ産業	2,900	1,365.00	3,958,500

BEENOS	6,300	2,116.00	13,330,800
あさひ	12,300	1,311.00	16,125,300
日本調剤	10,100	1,122.00	11,332,200
コスモス薬品	14,600	13,570.00	198,122,000
シップヘルスケアホールディングス	53,200	2,417.00	128,584,400
トーエル	5,100	753.00	3,840,300
ソフトクリエイトホールディングス	11,500	1,664.00	19,136,000
セブン&アイ・ホールディングス	510,000	6,219.00	3,171,690,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	111,300	1,011.00	112,524,300
明治電機工業	5,500	1,214.00	6,677,000
ツルハホールディングス	31,100	9,110.00	283,321,000
デリカフーズホールディングス	4,500	620.00	2,790,000
スターティアホールディングス	2,200	1,467.00	3,227,400
サンマルクホールディングス	11,900	1,879.00	22,360,100
フェリシモ	2,600	1,009.00	2,623,400
トリドールホールディングス	36,800	2,926.00	107,676,800
帝人	134,600	1,517.00	204,188,200
東レ	938,700	760.90	714,256,830
クラレ	222,800	1,268.00	282,510,400
旭化成	874,900	958.10	838,241,690
TOKYO BASE	15,200	437.00	6,642,400
稲葉製作所	7,500	1,467.00	11,002,500
宮地エンジニアリンググループ	4,000	3,960.00	15,840,000
トーカロ	39,700	1,304.00	51,768,800
アルファ	4,100	1,027.00	4,210,700
SUMCO	274,700	1,907.00	523,852,900
川田テクノロジーズ	3,400	4,220.00	14,348,000
RS Technologies	9,600	3,065.00	29,424,000
ジェイテックコーポレーション	1,500	2,481.00	3,721,500
信和	6,200	716.00	4,439,200
ビーロッド	7,300	609.00	4,445,700
ファーストブラザーズ	2,200	902.00	1,984,400
And Doホールディングス	8,200	976.00	8,003,200
シーアールイー	7,700	1,271.00	9,786,700
プロパティエージェント	1,300	1,134.00	1,474,200
ケイアイスター不動産	6,600	4,235.00	27,951,000
アグレ都市デザイン	1,900	1,533.00	2,912,700
グッドコムアセット	12,800	790.00	10,112,000
ジェイ・エス・ビー	3,400	4,280.00	14,552,000
ロードスターキャピタル	7,800	1,398.00	10,904,400
テンポイノベーション	3,200	1,211.00	3,875,200
グローバル・リンク・マネジメント	2,000	1,182.00	2,364,000
フェイスネットワーク	2,900	823.00	2,386,700
住江織物	2,200	2,290.00	5,038,000
日本フェルト	6,100	420.00	2,562,000
イチカワ	1,400	1,356.00	1,898,400
エコナックホールディングス	19,300	114.00	2,200,200
日東製網	1,100	1,415.00	1,556,500
芦森工業	2,000	1,487.00	2,974,000



アツギ	6,300	429.00	2,702,700
ウイルプラスホールディングス	1,800	1,071.00	1,927,800
JMホールディングス	11,200	1,986.00	22,243,200
コメダホールディングス	36,200	2,617.00	94,735,400
サツドラホールディングス	5,200	853.00	4,435,600
アレンザホールディングス	11,100	997.00	11,066,700
串カツ田中ホールディングス	3,900	1,712.00	6,676,800
バロックジャパンリミテッド	9,600	872.00	8,371,200
クスリのアオキホールディングス	13,200	6,560.00	86,592,000
ダイニック	2,800	720.00	2,016,000
共和レザー	6,300	558.00	3,515,400
ピーバンドットコム	1,600	499.00	798,400
力の源ホールディングス	6,600	1,438.00	9,490,800
FOOD & LIFE COMPANIES	78,900	3,325.00	262,342,500
アセンテック	5,000	577.00	2,885,000
セーレン	27,000	2,288.00	61,776,000
ソトー	3,500	812.00	2,842,000
東海染工	1,100	1,211.00	1,332,100
小松マテーレ	20,300	700.00	14,210,000
ワコールホールディングス	27,000	2,670.00	72,090,000
ホギメディカル	18,800	3,415.00	64,202,000
クラウドディアホールディングス	2,500	476.00	1,190,000
T S I ホールディングス	47,200	661.00	31,199,200
マツオカコーポレーション	3,000	1,434.00	4,302,000
ワールド	18,000	1,571.00	28,278,000
T I S	153,400	3,880.00	595,192,000
J N S ホールディングス	5,000	421.00	2,105,000
グリー	37,600	704.00	26,470,400
GMOベパボ	2,000	1,830.00	3,660,000
コーエーテクモホールディングス	87,900	2,423.00	212,981,700
三菱総合研究所	6,900	5,020.00	34,638,000
ボルテージ	3,100	313.00	970,300
電算	900	1,791.00	1,611,900
AGS	4,600	719.00	3,307,400
ファインデックス	11,100	636.00	7,059,600
ブレインパッド	10,500	707.00	7,423,500
K L a b	27,900	397.00	11,076,300
ポールトゥウィンホールディングス	24,000	913.00	21,912,000
ネクソン	363,300	3,015.00	1,095,349,500
アイスタイル	40,800	535.00	21,828,000
エムアップホールディングス	17,200	1,205.00	20,726,000
エイチーム	8,300	690.00	5,727,000
エニグモ	17,800	427.00	7,600,600
テクノスジャパン	9,000	564.00	5,076,000
e n i s h	8,200	549.00	4,501,800
コロプラ	54,400	636.00	34,598,400
オルトプラス	8,200	201.00	1,648,200
ブロードリーフ	81,900	426.00	34,889,400
クロス・マーケティンググループ	6,600	699.00	4,613,400

デジタルハーツホールディングス	8,800	1,477.00	12,997,600
システム情報	11,100	783.00	8,691,300
メディアドゥ	5,700	1,385.00	7,894,500
じげん	40,900	524.00	21,431,600
ブイキューブ	16,800	525.00	8,820,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,600	529.00	1,375,400
サイバーリンクス	3,500	907.00	3,174,500
ディー・エル・イー	7,800	240.00	1,872,000
フィックスターズ	15,800	1,409.00	22,262,200
CARTA HOLDINGS	6,600	1,466.00	9,675,600
オブティム	11,500	925.00	10,637,500
セレス	5,600	1,430.00	8,008,000
SHIFT	9,300	23,830.00	221,619,000
特種東海製紙	6,300	3,000.00	18,900,000
ティーガイア	14,700	1,652.00	24,284,400
セック	1,500	3,270.00	4,905,000
テクマトリックス	25,600	1,613.00	41,292,800
プロシップ	6,100	1,389.00	8,472,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,100	2,617.00	107,558,700
GMOペイメントゲートウェイ	28,000	10,820.00	302,960,000
ザッパラス	3,000	362.00	1,086,000
システムリサーチ	4,400	2,409.00	10,599,600
インターネットイニシアティブ	78,300	2,773.00	217,125,900
さくらインターネット	15,700	680.00	10,676,000
ヴィンクス	3,200	1,420.00	4,544,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,300	4,065.00	17,479,500
SRAホールディングス	7,200	3,100.00	22,320,000
システムインテグレータ	3,300	431.00	1,422,300
朝日ネット	15,100	590.00	8,909,000
eBASE	19,700	704.00	13,868,800
アバントグループ	17,700	1,337.00	23,664,900
アドソル日進	5,900	1,846.00	10,891,400
ODKソリューションズ	2,400	591.00	1,418,400
フリービット	7,400	1,524.00	11,277,600
コムチュア	18,600	2,016.00	37,497,600
サイバーコム	1,800	1,583.00	2,849,400
アステリア	11,000	630.00	6,930,000
アイル	6,600	2,754.00	18,176,400
王子ホールディングス	583,600	539.00	314,560,400
日本製紙	73,000	1,100.00	80,300,000
三菱製紙	13,100	419.00	5,488,900
北越コーポレーション	88,500	914.00	80,889,000
中越パルプ工業	4,400	1,039.00	4,571,600
巴川製紙所	3,400	689.00	2,342,600
大王製紙	61,900	1,123.00	69,513,700
阿波製紙	2,600	573.00	1,489,800
マークラインズ	7,600	2,396.00	18,209,600
メディカル・データ・ビジョン	20,900	826.00	17,263,400

g u m i	20,600	725.00	14,935,000
ショーケース	2,500	308.00	770,000
モバイルファクトリー	2,300	913.00	2,099,900
テラスカイ	6,000	2,543.00	15,258,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,100	1,642.00	13,300,200
P C I ホールディングス	4,100	1,045.00	4,284,500
アイビーシー	1,700	611.00	1,038,700
ネオジャパン	4,700	923.00	4,338,100
P R T I M E S	3,500	1,412.00	4,942,000
ラクス	66,300	2,077.00	137,705,100
ランドコンピュータ	2,600	1,124.00	2,922,400
ダブルスタンダード	5,700	2,051.00	11,690,700
オープンドア	9,800	1,488.00	14,582,400
マイネット	3,500	326.00	1,141,000
アカツキ	6,700	2,271.00	15,215,700
ベネフィットジャパン	700	1,259.00	881,300
U b i c o mホールディングス	4,300	2,375.00	10,212,500
カナミックネットワーク	15,100	457.00	6,900,700
ノムラシステムコーポレーション	10,300	114.00	1,174,200
レンゴー	127,600	862.00	109,991,200
トーモク	8,100	1,621.00	13,130,100
ザ・パック	10,400	3,170.00	32,968,000
チェンジホールディングス	34,300	2,311.00	79,267,300
シンクロ・フード	6,900	496.00	3,422,400
オークネット	6,900	1,643.00	11,336,700
キャピタル・アセット・プランニング	2,100	713.00	1,497,300
セグエグループ	3,000	794.00	2,382,000
エイトレッド	1,700	1,453.00	2,470,100
マクロミル	27,500	896.00	24,640,000
ビーグリー	1,800	1,238.00	2,228,400
オロ	4,200	2,438.00	10,239,600
ユーザーローカル	5,000	1,973.00	9,865,000
テモナ	2,400	284.00	681,600
ニーズウェル	3,000	1,113.00	3,339,000
マネーフォワード	33,800	5,480.00	185,224,000
サインポスト	4,200	563.00	2,364,600
レゾナック・ホールディングス	135,400	2,144.00	290,297,600
住友化学	1,039,300	452.00	469,763,600
住友精化	5,800	4,465.00	25,897,000
日産化学	66,500	5,980.00	397,670,000
ラサ工業	5,400	2,262.00	12,214,800
クレハ	12,000	8,580.00	102,960,000
多木化学	5,400	4,285.00	23,139,000
テイカ	9,500	1,224.00	11,628,000
石原産業	25,300	1,219.00	30,840,700
片倉コープアグリ	2,200	1,689.00	3,715,800
日本曹達	15,000	4,740.00	71,100,000
東ソー	187,000	1,797.00	336,039,000
トクヤマ	45,200	2,193.00	99,123,600

セントラル硝子	22,500	2,937.00	66,082,500
東亜合成	70,300	1,214.00	85,344,200
大阪ソーダ	8,400	4,380.00	36,792,000
関東電化工業	27,100	1,045.00	28,319,500
SUN ASTERISK	9,900	960.00	9,504,000
デンカ	51,000	2,724.00	138,924,000
イビデン	81,000	5,870.00	475,470,000
信越化学工業	1,164,500	3,978.00	4,632,381,000
日本カーバイド工業	4,100	1,305.00	5,350,500
電算システムホールディングス	6,800	2,699.00	18,353,200
堺化学工業	10,700	1,849.00	19,784,300
第一稀元素化学工業	12,800	1,012.00	12,953,600
エア・ウォーター	132,200	1,727.00	228,309,400
日本酸素ホールディングス	135,900	2,484.00	337,575,600
日本化学工業	4,700	1,860.00	8,742,000
東邦アセチレン	2,300	1,369.00	3,148,700
日本パーカライジング	69,400	1,067.00	74,049,800
高压ガス工業	20,400	757.00	15,442,800
チタン工業	1,300	1,456.00	1,892,800
四国化成ホールディングス	16,700	1,423.00	23,764,100
戸田工業	3,200	2,483.00	7,945,600
ステラ ケミファ	8,300	2,752.00	22,841,600
保土谷化学工業	4,000	3,205.00	12,820,000
日本触媒	21,300	5,480.00	116,724,000
大日精化工業	9,700	1,877.00	18,206,900
カネカ	32,000	3,635.00	116,320,000
協和キリン	169,500	3,010.00	510,195,000
APPIER GROUP	53,100	1,476.00	78,375,600
三菱瓦斯化学	104,600	1,980.00	207,108,000
三井化学	115,500	3,450.00	398,475,000
JSR	130,800	3,070.00	401,556,000
東京応化工業	24,500	7,180.00	175,910,000
大阪有機化学工業	10,500	2,074.00	21,777,000
三菱ケミカルグループ	945,500	790.20	747,134,100
KHネオケム	23,300	2,383.00	55,523,900
ダイセル	206,000	1,092.00	224,952,000
住友ベークライト	20,800	5,160.00	107,328,000
積水化学工業	286,500	1,871.00	536,041,500
日本ゼオン	84,000	1,400.00	117,600,000
アイカ工業	35,400	3,010.00	106,554,000
UBE	72,200	2,168.00	156,529,600
積水樹脂	20,400	2,145.00	43,758,000
タキロンシーアイ	30,700	498.00	15,288,600
旭有機材	9,300	3,275.00	30,457,500
ニチバン	8,700	2,033.00	17,687,100
リケンテクノス	30,200	612.00	18,482,400
大倉工業	6,500	2,127.00	13,825,500
積水化成成品工業	19,600	435.00	8,526,000
群栄化学工業	2,800	2,637.00	7,383,600
タイガースポリマー	5,100	495.00	2,524,500

ミライアル	3,300	1,511.00	4,986,300
ダイキアクシス	4,000	732.00	2,928,000
ダイキョーニシカワ	31,000	684.00	21,204,000
竹本容器	3,700	806.00	2,982,200
森六ホールディングス	7,100	1,966.00	13,958,600
恵和	9,100	1,370.00	12,467,000
日本化薬	107,000	1,254.00	134,178,000
カーリットホールディングス	12,600	707.00	8,908,200
ソルクシーズ	8,800	358.00	3,150,400
C Lホールディングス	4,000	938.00	3,752,000
プレステージ・インターナショナル	60,500	587.00	35,513,500
フェイス	3,100	509.00	1,577,900
プロトコーポレーション	17,500	1,201.00	21,017,500
ハイマックス	4,400	1,430.00	6,292,000
アミューズ	7,800	1,871.00	14,593,800
野村総合研究所	279,500	3,455.00	965,672,500
ドリームインキュベータ	4,400	2,722.00	11,976,800
サイバネットシステム	11,800	888.00	10,478,400
クイック	11,000	1,950.00	21,450,000
T A C	5,500	204.00	1,122,000
C Eホールディングス	5,600	538.00	3,012,800
日本システム技術	4,500	2,146.00	9,657,000
電通グループ	141,300	4,840.00	683,892,000
インテージホールディングス	15,900	1,573.00	25,010,700
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,800	1,372.00	5,213,600
東邦システムサイエンス	3,100	1,138.00	3,527,800
ぴあ	4,800	3,345.00	16,056,000
イオンファンタジー	6,200	3,255.00	20,181,000
ソースネクスト	71,300	235.00	16,755,500
シーティーエス	15,900	748.00	11,893,200
ネクシィーズグループ	3,500	626.00	2,191,000
インフォコム	18,100	2,215.00	40,091,500
メディカルシステムネットワーク	12,800	450.00	5,760,000
日本精化	8,000	2,550.00	20,400,000
扶桑化学工業	13,000	3,765.00	48,945,000
トリケミカル研究所	18,700	2,266.00	42,374,200
シンプレクス・ホールディングス	24,000	2,394.00	57,456,000
HEROZ	4,700	1,186.00	5,574,200
ラクスル	33,600	1,442.00	48,451,200
メルカリ	84,500	2,657.00	224,516,500
I P S	4,600	2,544.00	11,702,400
F I G	12,600	293.00	3,691,800
システムサポート	5,400	1,958.00	10,573,200
A D E K A	48,900	2,318.00	113,350,200
日油	43,300	6,310.00	273,223,000
ミヨシ油脂	3,800	1,009.00	3,834,200
新日本理化	15,000	214.00	3,210,000
ハリマ化成グループ	7,600	862.00	6,551,200
イーソル	9,000	961.00	8,649,000
アルテリア・ネットワークス	13,100	1,291.00	16,912,100

東海ソフト	1,600	1,081.00	1,729,600
ウイングアーク1st	14,500	2,193.00	31,798,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,800	1,569.00	5,962,200
サーバーワークス	2,800	1,983.00	5,552,400
東名	800	2,100.00	1,680,000
ヴィッツ	1,100	1,188.00	1,306,800
トピラシステムズ	2,700	975.00	2,632,500
Sansan	45,900	1,760.00	80,784,000
Link-U	2,600	992.00	2,579,200
ギフトイ	15,200	2,408.00	36,601,600
花王	341,100	5,453.00	1,860,018,300
第一工業製薬	5,000	1,915.00	9,575,000
石原ケミカル	6,400	1,493.00	9,555,200
日華化学	4,400	858.00	3,775,200
ニイタカ	2,000	2,172.00	4,344,000
三洋化成工業	8,600	4,295.00	36,937,000
メドレー	18,800	3,560.00	66,928,000
ベース	4,800	6,060.00	29,088,000
JMDC	23,000	4,790.00	110,170,000
武田薬品工業	1,241,400	4,593.00	5,701,750,200
アステラス製薬	1,325,100	2,069.00	2,741,631,900
住友ファーマ	104,000	801.00	83,304,000
塩野義製薬	176,800	6,201.00	1,096,336,800
わかもと製薬	10,200	249.00	2,539,800
日本新薬	33,100	6,230.00	206,213,000
中外製薬	439,100	3,588.00	1,575,490,800
科研製薬	24,000	3,810.00	91,440,000
エーザイ	170,600	8,156.00	1,391,413,600
理研ビタミン	11,900	2,051.00	24,406,900
ロート製薬	135,900	2,811.00	382,014,900
小野薬品工業	270,600	2,731.50	739,143,900
久光製薬	31,200	3,785.00	118,092,000
有機合成薬品工業	8,100	292.00	2,365,200
持田製薬	16,100	3,505.00	56,430,500
参天製薬	255,600	1,152.00	294,451,200
扶桑薬品工業	4,400	2,027.00	8,918,800
日本ケミファ	1,100	1,809.00	1,989,900
ツムラ	44,200	2,769.00	122,389,800
テルモ	430,200	4,112.00	1,768,982,400
H. U. グループホールディングス	42,100	2,787.00	117,332,700
キッセイ薬品工業	21,700	2,731.00	59,262,700
生化学工業	26,800	845.00	22,646,000
栄研化学	22,800	1,570.00	35,796,000
鳥居薬品	7,500	3,295.00	24,712,500
JCRファーマ	47,500	1,434.00	68,115,000
東和薬品	21,600	1,943.00	41,968,800
富士製薬工業	10,400	1,284.00	13,353,600
ゼリア新薬工業	19,500	2,468.00	48,126,000
そーせいグループ	48,200	2,858.00	137,755,600

第一三共	1,222,000	4,565.00	5,578,430,000
杏林製薬	30,400	1,749.00	53,169,600
大幸薬品	25,500	384.00	9,792,000
ダイト	9,800	2,530.00	24,794,000
大塚ホールディングス	320,900	4,703.00	1,509,192,700
大正製薬ホールディングス	31,200	5,930.00	185,016,000
ペプチドリーム	68,000	1,842.00	125,256,000
大日本塗料	17,100	884.00	15,116,400
日本ペイントホールディングス	619,900	1,253.00	776,734,700
関西ペイント	128,300	2,008.00	257,626,400
神東塗料	9,400	139.00	1,306,600
中国塗料	23,000	1,188.00	27,324,000
日本特殊塗料	6,900	1,045.00	7,210,500
藤倉化成	18,900	439.00	8,297,100
太陽ホールディングス	21,300	2,580.00	54,954,000
D I C	54,800	2,510.00	137,548,000
サカタインクス	31,200	1,117.00	34,850,400
東洋インキＳＣホールディングス	27,500	2,212.00	60,830,000
T&K TOKA	12,500	1,164.00	14,550,000
アルプス技研	12,500	2,556.00	31,950,000
サニックス	23,000	283.00	6,509,000
日本空調サービス	15,600	740.00	11,544,000
オリエンタルランド	760,900	4,894.00	3,723,844,600
フォーカスシステムズ	10,200	1,013.00	10,332,600
ダスキン	32,000	3,350.00	107,200,000
パーク２４	107,400	2,144.00	230,265,600
明光ネットワークジャパン	17,400	659.00	11,466,600
ファルコホールディングス	6,500	2,032.00	13,208,000
クレスコ	10,800	1,811.00	19,558,800
フジ・メディア・ホールディングス	134,700	1,298.00	174,840,600
秀英予備校	2,500	408.00	1,020,000
田谷	1,700	512.00	870,400
ラウンドワン	120,200	581.00	69,836,200
リゾートトラスト	56,800	2,253.00	127,970,400
オービック	46,900	21,500.00	1,008,350,000
ジャストシステム	20,200	3,845.00	77,669,000
TDCソフト	11,800	1,515.00	17,877,000
Zホールディングス	1,996,300	355.90	710,483,170
ビー・エム・エル	17,800	3,095.00	55,091,000
トレンドマイクロ	81,000	6,580.00	532,980,000
りらいあコミュニケーションズ	23,700	1,460.00	34,602,000
I Dホールディングス	9,500	1,131.00	10,744,500
リソー教育	65,300	290.00	18,937,000
日本オラクル	26,800	10,360.00	277,648,000
早稲田アカデミー	8,000	1,404.00	11,232,000
アルファシステムズ	4,400	4,215.00	18,546,000
フューチャー	34,900	1,658.00	57,864,200
CAC Holdings	8,600	1,746.00	15,015,600
S Bテクノロジー	6,000	2,481.00	14,886,000
トーセ	3,100	747.00	2,315,700

ユー・エス・エス	147,900	2,292.00	338,986,800
オービックビジネスコンサルタント	27,600	5,120.00	141,312,000
伊藤忠テクノソリューションズ	75,300	3,495.00	263,173,500
アイティフォー	18,500	893.00	16,520,500
東京個別指導学院	17,000	541.00	9,197,000
東計電算	2,000	6,680.00	13,360,000
サイバーエージェント	317,600	1,134.00	360,158,400
楽天グループ	666,300	667.00	444,422,100
エックスネット	1,600	1,003.00	1,604,800
クリーク・アンド・リバー社	8,400	2,087.00	17,530,800
SBIグローバルアセットマネジメント	23,500	503.00	11,820,500
テー・オー・ダブリュー	28,300	333.00	9,423,900
大塚商会	79,500	5,070.00	403,065,000
サイボウズ	19,300	2,709.00	52,283,700
山田コンサルティンググループ	7,300	1,551.00	11,322,300
セントラルスポーツ	5,400	2,551.00	13,775,400
パラカ	4,900	1,979.00	9,697,100
電通国際情報サービス	17,000	4,825.00	82,025,000
ACCESS	16,600	860.00	14,276,000
デジタルガレージ	24,900	4,725.00	117,652,500
イーエムシステムズ	23,400	789.00	18,462,600
ウェザーニューズ	4,300	6,920.00	29,756,000
C I J	23,300	562.00	13,094,600
ビジネスエンジニアリング	2,300	3,575.00	8,222,500
日本エンタープライズ	11,200	145.00	1,624,000
WOWOW	10,600	1,298.00	13,758,800
スカラ	13,000	756.00	9,828,000
インテリジェント ウェイブ	5,800	733.00	4,251,400
フルキャストホールディングス	13,700	2,414.00	33,071,800
エン・ジャパン	26,000	2,372.00	61,672,000
あすか製薬ホールディングス	14,400	1,318.00	18,979,200
サワイグループホールディングス	32,100	3,940.00	126,474,000
富士フイルムホールディングス	269,200	7,200.00	1,938,240,000
コニカミノルタ	315,500	581.00	183,305,500
資生堂	292,900	6,559.00	1,921,131,100
ライオン	168,300	1,470.00	247,401,000
高砂香料工業	9,500	2,614.00	24,833,000
マンダム	30,300	1,593.00	48,267,900
ミルボン	20,800	5,730.00	119,184,000
ファンケル	61,400	2,278.00	139,869,200
コーセー	28,500	15,500.00	441,750,000
コタ	12,900	1,663.00	21,452,700
シーボン	1,400	1,596.00	2,234,400
ポーラ・オルビスホールディングス	71,900	2,076.00	149,264,400
ノエビアホールディングス	12,500	5,550.00	69,375,000
アジュバンホールディングス	2,600	928.00	2,412,800
新日本製薬	8,000	1,422.00	11,376,000
アクシージア	7,100	1,172.00	8,321,200
エステー	10,900	1,596.00	17,396,400



アグロ カネショウ	5,600	1,785.00	9,996,000
コニシ	23,400	2,105.00	49,257,000
長谷川香料	26,800	3,285.00	88,038,000
星光PMC	5,600	581.00	3,253,600
小林製薬	40,800	8,350.00	340,680,000
荒川化学工業	11,900	996.00	11,852,400
メック	11,500	2,598.00	29,877,000
日本高純度化学	3,500	2,457.00	8,599,500
タカラバイオ	37,800	1,737.00	65,658,600
JCU	15,700	3,280.00	51,496,000
新田ゼラチン	6,700	910.00	6,097,000
OATアグリオ	4,500	1,361.00	6,124,500
デクセリアルズ	40,500	2,574.00	104,247,000
アース製薬	12,700	5,060.00	64,262,000
北興化学工業	14,100	911.00	12,845,100
大成ラミック	4,400	2,902.00	12,768,800
クミアイ化学工業	55,700	920.00	51,244,000
日本農薬	25,700	695.00	17,861,500
富士興産	2,600	1,194.00	3,104,400
ニチレキ	16,600	1,768.00	29,348,800
ユシロ化学工業	7,300	892.00	6,511,600
ビーピー・カストロール	4,200	928.00	3,897,600
富士石油	28,600	265.00	7,579,000
MORESCO	3,600	1,150.00	4,140,000
出光興産	155,800	2,889.00	450,106,200
ENEOSホールディングス	2,379,500	479.80	1,141,684,100
コスモエネルギーホールディングス	55,500	4,335.00	240,592,500
テスホールディングス	14,800	1,209.00	17,893,200
インフロンア・ホールディングス	143,700	1,121.00	161,087,700
横浜ゴム	79,800	2,918.00	232,856,400
TOYO TIRE	80,600	1,619.00	130,491,400
ブリヂストン	447,900	5,507.00	2,466,585,300
住友ゴム工業	137,600	1,252.00	172,275,200
藤倉コンポジット	7,700	1,039.00	8,000,300
オカモト	7,800	4,070.00	31,746,000
アキレス	8,900	1,473.00	13,109,700
フコク	7,400	1,089.00	8,058,600
ニッタ	14,300	3,090.00	44,187,000
クリエートメディック	3,600	910.00	3,276,000
住友理工	27,300	733.00	20,010,900
三ツ星ベルト	20,500	3,910.00	80,155,000
バンドー化学	22,300	1,110.00	24,753,000
AGC	142,800	5,070.00	723,996,000
日本板硝子	71,500	652.00	46,618,000
石塚硝子	1,700	1,578.00	2,682,600
有沢製作所	22,800	1,272.00	29,001,600
日本山村硝子	4,100	731.00	2,997,100
日本電気硝子	57,300	2,483.00	142,275,900
オハラ	6,600	1,176.00	7,761,600
住友大阪セメント	19,800	3,855.00	76,329,000

太平洋セメント	89,300	2,460.00	219,678,000
リソルホールディングス	1,000	4,840.00	4,840,000
日本ヒューム	12,300	820.00	10,086,000
日本コンクリート工業	27,400	262.00	7,178,800
三谷セキサン	5,900	5,040.00	29,736,000
アジアパイルホールディングス	21,900	760.00	16,644,000
東海カーボン	117,600	1,235.00	145,236,000
日本カーボン	8,000	4,195.00	33,560,000
東洋炭素	8,800	4,200.00	36,960,000
ノリタケカンパニーリミテド	7,000	4,765.00	33,355,000
TOTO	92,600	4,565.00	422,719,000
日本碍子	163,100	1,744.00	284,446,400
日本特殊陶業	106,800	2,622.00	280,029,600
ダントーホールディングス	7,700	643.00	4,951,100
MARUWA	5,200	17,510.00	91,052,000
品川リフラクトリーズ	4,000	4,725.00	18,900,000
黒崎播磨	2,900	6,320.00	18,328,000
ヨータイ	9,400	1,465.00	13,771,000
東京窯業	10,000	352.00	3,520,000
ニッカトー	4,900	631.00	3,091,900
フジインコーポレーテッド	11,200	7,210.00	80,752,000
クニミネ工業	3,200	953.00	3,049,600
エーアンドエーマテリアル	2,000	932.00	1,864,000
ニチアス	35,500	2,738.00	97,199,000
日本製鉄	646,200	2,937.00	1,897,889,400
神戸製鋼所	290,300	1,016.00	294,944,800
中山製鋼所	29,700	881.00	26,165,700
合同製鐵	7,200	3,120.00	22,464,000
JFEホールディングス	385,700	1,633.00	629,848,100
東京製鐵	40,600	1,363.00	55,337,800
共英製鋼	16,500	1,799.00	29,683,500
大和工業	23,800	5,460.00	129,948,000
東京鐵鋼	6,900	2,281.00	15,738,900
大阪製鐵	6,700	1,305.00	8,743,500
淀川製鋼所	16,500	2,879.00	47,503,500
中部鋼鈹	11,900	2,062.00	24,537,800
丸一鋼管	44,000	3,120.00	137,280,000
モリ工業	2,600	3,620.00	9,412,000
大同特殊鋼	18,200	5,290.00	96,278,000
日本高周波鋼業	4,000	337.00	1,348,000
日本冶金工業	10,500	3,965.00	41,632,500
山陽特殊製鋼	14,300	2,619.00	37,451,700
愛知製鋼	8,400	2,750.00	23,100,000
日本金属	2,500	972.00	2,430,000
大平洋金属	10,300	1,843.00	18,982,900
新日本電工	92,300	348.00	32,120,400
栗本鐵工所	6,900	2,089.00	14,414,100
虹 技	1,400	1,073.00	1,502,200
日本鑄鐵管	1,200	1,045.00	1,254,000
日本製鋼所	38,900	2,469.00	96,044,100

三菱製鋼	9,100	1,170.00	10,647,000
日亜鋼業	11,700	318.00	3,720,600
日本精線	2,000	4,540.00	9,080,000
エンビプロ・ホールディングス	7,700	596.00	4,589,200
大紀アルミニウム工業所	20,600	1,426.00	29,375,600
日本軽金属ホールディングス	39,000	1,432.00	55,848,000
三井金属鉱業	42,000	3,295.00	138,390,000
東邦亜鉛	8,500	1,899.00	16,141,500
三菱マテリアル	96,300	2,293.00	220,815,900
住友金属鉱山	167,300	5,036.00	842,522,800
DOWAホールディングス	32,400	4,465.00	144,666,000
古河機械金属	21,300	1,354.00	28,840,200
エス・サイエンス	68,000	26.00	1,768,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	21,200	2,946.00	62,455,200
東邦チタニウム	26,100	2,014.00	52,565,400
UACJ	20,200	2,714.00	54,822,800
CKサンエツ	2,700	4,320.00	11,664,000
古河電気工業	48,000	2,526.00	121,248,000
住友電気工業	498,300	1,735.00	864,550,500
フジクラ	154,800	936.00	144,892,800
SWCC	16,100	1,774.00	28,561,400
タツタ電線	29,400	715.00	21,021,000
カナレ電気	1,700	1,377.00	2,340,900
平河ビューテック	8,300	1,488.00	12,350,400
いよぎんホールディングス	163,900	782.00	128,169,800
しずおかフィナンシャルグループ	311,300	1,005.00	312,856,500
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	116,000	894.00	103,704,000
リョービ	15,400	1,597.00	24,593,800
アーレスティ	12,400	595.00	7,378,000
アサヒホールディングス	58,400	1,990.00	116,216,000
東洋製罐グループホールディングス	95,500	1,974.00	188,517,000
ホッカンホールディングス	7,800	1,403.00	10,943,400
コロナ	8,100	939.00	7,605,900
横河ブリッジホールディングス	18,100	2,248.00	40,688,800
駒井ハルテック	1,800	1,829.00	3,292,200
高田機工	600	2,664.00	1,598,400
三和ホールディングス	132,900	1,505.00	200,014,500
文化シャッター	41,600	1,147.00	47,715,200
三協立山	16,500	684.00	11,286,000
アルインコ	11,000	1,007.00	11,077,000
東洋シャッター	2,300	535.00	1,230,500
LIXIL	210,200	1,992.00	418,718,400
日本フィルコン	7,400	479.00	3,544,600
ノーリツ	21,300	1,874.00	39,916,200
長府製作所	14,600	2,475.00	36,135,000
リンナイ	78,500	3,285.00	257,872,500
ユニプレス	25,100	960.00	24,096,000
ダイニチ工業	5,600	708.00	3,964,800
日東精工	20,900	608.00	12,707,200
三洋工業	1,300	1,935.00	2,515,500

岡部	23,200	785.00	18,212,000
ジーテクト	16,100	1,489.00	23,972,900
東プレ	25,400	1,389.00	35,280,600
高周波熱錬	22,300	729.00	16,256,700
東京製綱	8,500	1,153.00	9,800,500
サンコール	10,000	583.00	5,830,000
モリテックスチール	8,300	304.00	2,523,200
パイオラックス	19,900	2,089.00	41,571,100
エイチワン	14,800	670.00	9,916,000
日本発条	127,700	1,010.00	128,977,000
中央発條	10,700	703.00	7,522,100
アドバネクス	1,400	1,033.00	1,446,200
三浦工業	59,000	3,680.00	217,120,000
タクマ	43,400	1,430.00	62,062,000
テクノプロ・ホールディングス	85,100	3,300.00	280,830,000
アトラグループ	2,600	182.00	473,200
インターワークス	3,000	361.00	1,083,000
アイ・アールジャパンホールディングス	7,500	2,120.00	15,900,000
Ke e P e r 技研	8,900	5,570.00	49,573,000
ファーストロジック	1,300	869.00	1,129,700
三機サービス	1,700	1,162.00	1,975,400
G u n o s y	11,400	586.00	6,680,400
デザインワン・ジャパン	2,800	183.00	512,400
イー・ガーディアン	5,400	2,235.00	12,069,000
リブセンス	5,100	281.00	1,433,100
ジャパンマテリアル	44,000	2,034.00	89,496,000
ベクトル	22,600	1,295.00	29,267,000
ウチヤマホールディングス	4,900	277.00	1,357,300
チャーム・ケア・コーポレーション	12,000	1,079.00	12,948,000
キャリアリンク	5,300	2,206.00	11,691,800
I B J	8,800	634.00	5,579,200
アサンテ	7,100	1,655.00	11,750,500
バリューHR	12,600	1,502.00	18,925,200
M&Aキャピタルパートナーズ	11,600	3,445.00	39,962,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,100	1,076.00	5,487,600
E R I ホールディングス	2,900	1,442.00	4,181,800
アビスト	1,800	3,045.00	5,481,000
シグマクシス・ホールディングス	21,800	1,081.00	23,565,800
ウィルグループ	12,000	1,082.00	12,984,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,800	142.00	1,675,600
メドピア	12,600	1,102.00	13,885,200
レアジョブ	2,200	1,483.00	3,262,600
リクルートホールディングス	1,064,500	3,757.00	3,999,326,500
エラン	19,000	1,029.00	19,551,000
ツガミ	31,400	1,427.00	44,807,800
オークマ	14,100	6,100.00	86,010,000
芝浦機械	14,100	3,185.00	44,908,500
アマダ	225,400	1,285.00	289,639,000

アイダエンジニアリング	29,100	882.00	25,666,200
TAKISAWA	2,900	1,336.00	3,874,400
FUJI	61,400	2,327.00	142,877,800
牧野フライス製作所	15,600	4,775.00	74,490,000
オーエスジー	67,400	1,958.00	131,969,200
ダイジェット工業	1,100	862.00	948,200
旭ダイヤモンド工業	39,400	932.00	36,720,800
DMG森精機	85,600	2,189.00	187,378,400
ソディック	38,900	760.00	29,564,000
ディスコ	68,000	16,120.00	1,096,160,000
日東工器	6,900	2,044.00	14,103,600
日進工具	11,800	1,142.00	13,475,600
パンチ工業	9,900	572.00	5,662,800
富士ダイス	5,100	745.00	3,799,500
土木管理総合試験所	4,700	335.00	1,574,500
日本郵政	1,884,300	1,126.50	2,122,663,950
ベルシステム24ホールディングス	19,300	1,427.00	27,541,100
鎌倉新書	16,300	924.00	15,061,200
SMN	2,700	464.00	1,252,800
一蔵	1,400	610.00	854,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	676.00	1,419,600
エアトリ	10,500	2,712.00	28,476,000
アトラエ	8,500	824.00	7,004,000
ストライク	6,100	3,510.00	21,411,000
ソラスト	39,600	638.00	25,264,800
セラク	4,400	1,657.00	7,290,800
インソース	31,200	1,225.00	38,220,000
豊田自動織機	102,300	7,810.00	798,963,000
豊和工業	6,000	848.00	5,088,000
石川製作所	2,800	1,393.00	3,900,400
東洋機械金属	7,600	677.00	5,145,200
津田駒工業	2,000	500.00	1,000,000
エンシュウ	2,300	698.00	1,605,400
島精機製作所	22,500	1,861.00	41,872,500
オプトラン	20,900	2,113.00	44,161,700
NCホールディングス	2,200	1,899.00	4,177,800
イワキ	9,400	1,312.00	12,332,800
フリー	14,800	1,159.00	17,153,200
ヤマシンフィルタ	33,700	346.00	11,660,200
日阪製作所	13,700	930.00	12,741,000
やまびこ	23,100	1,356.00	31,323,600
野村マイクロ・サイエンス	4,800	4,380.00	21,024,000
平田機工	6,800	6,850.00	46,580,000
PEGASUS	15,600	634.00	9,890,400
マルマエ	6,100	1,590.00	9,699,000
タツモ	7,700	1,834.00	14,121,800
ナブテスコ	88,600	3,170.00	280,862,000
三井海洋開発	17,700	1,436.00	25,417,200
レオン自動機	14,900	1,290.00	19,221,000
SMC	45,800	69,400.00	3,178,520,000

ホソカワミクロン	9,900	2,969.00	29,393,100
ユニオンツール	6,200	3,290.00	20,398,000
オイレス工業	19,800	1,737.00	34,392,600
日精エー・エス・ビー機械	5,600	4,300.00	24,080,000
サトーホールディングス	20,100	2,311.00	46,451,100
技研製作所	13,300	2,123.00	28,235,900
日本エアーテック	7,100	1,114.00	7,909,400
カワタ	3,200	871.00	2,787,200
日精樹脂工業	10,500	1,025.00	10,762,500
オカダアイヨン	3,400	1,833.00	6,232,200
ワイエイシイホールディングス	4,600	2,939.00	13,519,400
小松製作所	661,900	3,332.00	2,205,450,800
住友重機械工業	83,600	3,275.00	273,790,000
日立建機	56,300	3,335.00	187,760,500
日工	20,900	643.00	13,438,700
巴工業	6,100	2,445.00	14,914,500
井関農機	13,200	1,209.00	15,958,800
TOWA	14,400	2,119.00	30,513,600
丸山製作所	1,900	1,897.00	3,604,300
北川鉄工所	5,500	1,136.00	6,248,000
シンニッタン	12,100	249.00	3,012,900
ローツェ	7,400	9,990.00	73,926,000
タカキタ	3,100	449.00	1,391,900
クボタ	747,500	2,076.00	1,551,810,000
荏原実業	6,800	2,947.00	20,039,600
東洋エンジニアリング	18,200	580.00	10,556,000
三菱化工機	4,500	2,450.00	11,025,000
月島ホールディングス	19,100	1,129.00	21,563,900
帝国電機製作所	9,900	2,418.00	23,938,200
東京機械製作所	2,600	539.00	1,401,400
新東工業	28,500	1,019.00	29,041,500
澁谷工業	13,300	2,595.00	34,513,500
アイチコーポレーション	19,700	845.00	16,646,500
小森コーポレーション	32,700	1,064.00	34,792,800
鶴見製作所	10,800	2,379.00	25,693,200
日本ギア工業	3,700	485.00	1,794,500
酒井重工業	1,800	4,205.00	7,569,000
荏原製作所	57,800	5,980.00	345,644,000
石井鐵工所	1,000	2,305.00	2,305,000
西島製作所	12,200	1,634.00	19,934,800
北越工業	14,200	1,387.00	19,695,400
ダイキン工業	168,600	25,675.00	4,328,805,000
オルガノ	19,400	3,335.00	64,699,000
トーヨーカネツ	5,400	2,729.00	14,736,600
栗田工業	79,000	5,600.00	442,400,000
椿本チエイン	20,000	3,525.00	70,500,000
大同工業	4,400	727.00	3,198,800
日機装	32,600	954.00	31,100,400
木村化工機	10,800	726.00	7,840,800
レイズネクスト	19,900	1,465.00	29,153,500

アネスト岩田	24,000	1,030.00	24,720,000
ダイフク	218,500	2,529.00	552,586,500
サムコ	3,800	4,870.00	18,506,000
加藤製作所	5,200	1,334.00	6,936,800
油研工業	1,700	2,052.00	3,488,400
タダノ	74,500	1,047.00	78,001,500
フジテック	49,500	3,720.00	184,140,000
CKD	39,100	2,136.00	83,517,600
平和	47,000	2,685.00	126,195,000
理想科学工業	12,600	2,498.00	31,474,800
SANKYO	27,800	5,920.00	164,576,000
日本金銭機械	15,500	1,271.00	19,700,500
マースグループホールディングス	8,300	3,025.00	25,107,500
フクシマガリレイ	10,400	5,090.00	52,936,000
オーイズミ	4,100	577.00	2,365,700
ダイコク電機	7,700	3,030.00	23,331,000
竹内製作所	25,600	3,735.00	95,616,000
アマノ	40,100	2,841.00	113,924,100
JUKI	21,900	645.00	14,125,500
サンデン	16,300	227.00	3,700,100
ジャノメ	14,300	628.00	8,980,400
ブラザー工業	188,700	2,136.00	403,063,200
マックス	17,400	2,201.00	38,297,400
モリタホールディングス	24,600	1,526.00	37,539,600
グローリー	33,900	2,859.00	96,920,100
新晃工業	14,200	1,814.00	25,758,800
大和冷機工業	21,600	1,415.00	30,564,000
セガサミーホールディングス	113,600	2,713.00	308,196,800
日本ピストンリング	3,700	1,358.00	5,024,600
リケン	5,600	2,734.00	15,310,400
T P R	16,100	1,399.00	22,523,900
ツバキ・ナカシマ	34,900	991.00	34,585,900
ホシザキ	90,900	4,885.00	444,046,500
大豊工業	12,200	749.00	9,137,800
日本精工	259,500	775.00	201,112,500
NTN	278,400	340.00	94,656,000
ジェイテクト	125,700	1,152.00	144,806,400
不二越	10,400	3,860.00	40,144,000
ミネベアミツミ	245,700	2,574.00	632,431,800
日本トムソン	34,600	593.00	20,517,800
THK	81,500	3,020.00	246,130,000
ユーシン精機	11,200	793.00	8,881,600
前澤給装工業	9,900	1,073.00	10,622,700
イーグル工業	15,600	1,306.00	20,373,600
前澤工業	6,300	787.00	4,958,100
日本ピラー工業	13,100	3,775.00	49,452,500
キッツ	52,000	947.00	49,244,000
日立製作所	686,900	7,812.00	5,366,062,800
東芝	271,900	4,427.00	1,203,701,300
三菱電機	1,460,000	1,748.00	2,552,080,000

富士電機	85,900	5,440.00	467,296,000
東洋電機製造	3,500	1,077.00	3,769,500
安川電機	167,400	5,630.00	942,462,000
シンフォニアテクノロジー	15,600	1,763.00	27,502,800
明電舎	21,400	1,885.00	40,339,000
オリジン	2,500	1,277.00	3,192,500
山洋電気	6,100	6,780.00	41,358,000
デンヨー	10,800	1,941.00	20,962,800
PHCホールディングス	19,700	1,437.00	28,308,900
ソシオネクスト	19,400	12,070.00	234,158,000
ペイカレント・コンサルティング	113,800	4,905.00	558,189,000
Orchestra Holdings	3,100	1,540.00	4,774,000
アイモバイル	6,400	1,300.00	8,320,000
キャリアインデックス	3,800	342.00	1,299,600
MS-Japan	3,700	1,029.00	3,807,300
船場	1,500	782.00	1,173,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	51,200	2,015.00	103,168,000
フルテック	1,600	1,102.00	1,763,200
グリーンズ	3,800	1,543.00	5,863,400
ツナググループ・ホールディングス	3,100	679.00	2,104,900
GAMEWITH	3,300	377.00	1,244,100
MS&Consulting	1,300	600.00	780,000
ウェルビー	10,500	674.00	7,077,000
エル・ティー・エス	1,800	2,571.00	4,627,800
ミダックホールディングス	8,700	1,939.00	16,869,300
日総工産	10,800	786.00	8,488,800
キュービーネットホールディングス	6,800	1,427.00	9,703,600
RPAホールディングス	19,500	372.00	7,254,000
三櫻工業	21,300	690.00	14,697,000
マキタ	175,700	3,640.00	639,548,000
東芝テック	21,100	3,810.00	80,391,000
芝浦メカトロニクス	2,700	15,420.00	41,634,000
マブチモーター	35,100	3,880.00	136,188,000
ニデック	343,700	6,768.00	2,326,161,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	10,400	521.00	5,418,400
トレックス・セミコンダクター	6,600	2,314.00	15,272,400
東光高岳	8,500	2,129.00	18,096,500
ダブル・スコープ	46,200	1,173.00	54,192,600
宮越ホールディングス	6,300	795.00	5,008,500
ダイヘン	12,800	4,540.00	58,112,000
ヤーマン	24,400	1,136.00	27,718,400
JVCケンウッド	128,600	524.00	67,386,400
ミマキエンジニアリング	13,400	656.00	8,790,400
I-PEX	7,800	1,433.00	11,177,400
大崎電気工業	33,500	574.00	19,229,000
オムロン	129,400	8,167.00	1,056,809,800
日東工業	19,000	2,779.00	52,801,000
IDEC	20,900	3,450.00	72,105,000



正興電機製作所	4,100	1,024.00	4,198,400
不二電機工業	2,200	1,114.00	2,450,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,400	2,428.00	112,659,200
サクサホールディングス	2,300	2,108.00	4,848,400
メルコホールディングス	3,600	3,325.00	11,970,000
テクノメディカ	3,400	1,826.00	6,208,400
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,800	930.00	4,464,000
日本電気	199,800	5,950.00	1,188,810,000
富士通	140,800	18,005.00	2,535,104,000
沖電気工業	63,900	754.00	48,180,600
岩崎通信機	4,800	834.00	4,003,200
電気興業	5,700	2,324.00	13,246,800
サンケン電気	13,100	10,570.00	138,467,000
ナカヨ	1,800	1,152.00	2,073,600
アイホン	8,600	2,205.00	18,963,000
ルネサスエレクトロニクス	921,700	1,844.00	1,699,614,800
セイコーエプソン	181,200	2,066.00	374,359,200
ワコム	107,400	733.00	78,724,200
アルバック	33,600	5,440.00	182,784,000
アクセル	4,100	1,573.00	6,449,300
E I Z O	10,300	4,435.00	45,680,500
ジャパンディスプレイ	542,400	40.00	21,696,000
日本信号	32,200	1,159.00	37,319,800
京三製作所	29,600	428.00	12,668,800
能美防災	19,100	1,821.00	34,781,100
ホーチキ	10,600	1,629.00	17,267,400
星和電機	4,400	479.00	2,107,600
エレコム	33,800	1,291.00	43,635,800
パナソニック ホールディングス	1,668,600	1,309.00	2,184,197,400
シャープ	170,100	984.00	167,378,400
アンリツ	99,500	1,244.00	123,778,000
富士通ゼネラル	40,000	3,430.00	137,200,000
ソニーグループ	989,400	12,345.00	12,214,143,000
TDK	223,700	4,845.00	1,083,826,500
帝国通信工業	6,400	1,540.00	9,856,000
タムラ製作所	60,600	796.00	48,237,600
アルプスアルパイン	126,200	1,176.00	148,411,200
池上通信機	3,500	596.00	2,086,000
日本電波工業	16,900	1,195.00	20,195,500
鈴木	7,600	1,030.00	7,828,000
メイコー	15,400	2,689.00	41,410,600
日本トリム	3,200	2,905.00	9,296,000
ローランド ディー. ジー.	7,700	3,455.00	26,603,500
フォスター電機	13,100	1,230.00	16,113,000
SMK	3,400	2,490.00	8,466,000
ヨコオ	11,200	2,030.00	22,736,000
ティアック	16,900	117.00	1,977,300
ホシデン	33,000	1,798.00	59,334,000
ヒロセ電機	23,400	18,450.00	431,730,000

日本航空電子工業	29,000	2,459.00	71,311,000
TOA	16,100	861.00	13,862,100
マクセル	28,600	1,480.00	42,328,000
古野電気	18,400	940.00	17,296,000
スミダコーポレーション	12,900	1,669.00	21,530,100
アイコム	5,400	2,793.00	15,082,200
リオン	5,800	1,852.00	10,741,600
横河電機	154,500	2,228.00	344,226,000
新電元工業	5,400	3,505.00	18,927,000
アズビル	97,700	3,815.00	372,725,500
東亜ディーケーケー	5,200	838.00	4,357,600
日本光電工業	64,600	3,900.00	251,940,000
チノー	5,800	2,082.00	12,075,600
共和電業	10,200	361.00	3,682,200
日本電子材料	9,200	1,412.00	12,990,400
堀場製作所	31,100	7,670.00	238,537,000
アドバンテスト	110,200	11,020.00	1,214,404,000
小野測器	4,100	453.00	1,857,300
エスベック	11,200	2,080.00	23,296,000
キーエンス	139,900	63,700.00	8,911,630,000
日置電機	7,300	8,820.00	64,386,000
シスメックス	120,600	9,079.00	1,094,927,400
日本マイクロニクス	23,000	1,249.00	28,727,000
メガチップス	11,500	3,240.00	37,260,000
OBARA GROUP	7,700	4,205.00	32,378,500
IMAGICA GROUP	11,700	628.00	7,347,600
澤藤電機	1,300	1,135.00	1,475,500
デンソー	288,500	8,068.00	2,327,618,000
原田工業	4,800	814.00	3,907,200
コーセル	16,800	1,110.00	18,648,000
イリソ電子工業	12,900	4,650.00	59,985,000
オブテックスグループ	25,700	2,060.00	52,942,000
千代田インテグレ	4,900	2,364.00	11,583,600
レーザーテック	64,100	17,955.00	1,150,915,500
スタンレー電気	99,500	2,958.00	294,321,000
ウシオ電機	71,100	1,735.00	123,358,500
岡谷電機産業	8,400	304.00	2,553,600
ヘリオス テクノ ホールディング	10,000	770.00	7,700,000
エノモト	2,800	1,720.00	4,816,000
日本セラミック	14,200	2,778.00	39,447,600
遠藤照明	4,900	1,385.00	6,786,500
古河電池	10,300	1,129.00	11,628,700
双信電機	4,400	378.00	1,663,200
山一電機	12,200	1,850.00	22,570,000
図研	12,200	3,410.00	41,602,000
日本電子	35,000	4,115.00	144,025,000
カシオ計算機	104,200	1,324.00	137,960,800
ファナック	686,400	4,583.00	3,145,771,200
日本シイエムケイ	29,700	472.00	14,018,400
エンプラス	4,100	4,285.00	17,568,500

大真空	17,000	696.00	11,832,000
ローム	64,600	10,460.00	675,716,000
浜松ホトニクス	112,200	7,400.00	830,280,000
三井ハイテック	14,400	8,230.00	118,512,000
新光電気工業	49,500	3,945.00	195,277,500
京セラ	217,300	7,179.00	1,559,996,700
協栄産業	1,100	2,019.00	2,220,900
太陽誘電	68,100	4,190.00	285,339,000
村田製作所	424,200	7,800.00	3,308,760,000
双葉電子工業	26,600	526.00	13,991,600
日東電工	101,800	8,800.00	895,840,000
北陸電気工業	4,100	1,262.00	5,174,200
東海理化電機製作所	39,400	1,830.00	72,102,000
ニチコン	28,600	1,335.00	38,181,000
日本ケミコン	13,800	2,112.00	29,145,600
KOA	21,200	1,731.00	36,697,200
三井E&S	65,700	536.00	35,215,200
日立造船	115,700	836.00	96,725,200
三菱重工業	247,000	5,196.00	1,283,412,000
川崎重工業	105,400	2,966.00	312,616,400
IHI	89,000	3,495.00	311,055,000
名村造船所	27,900	422.00	11,773,800
サノヤスホールディングス	14,600	135.00	1,971,000
スプリックス	3,200	933.00	2,985,600
マネジメントソリューションズ	7,900	3,210.00	25,359,000
プロレド・パートナーズ	3,400	510.00	1,734,000
and factory	3,300	384.00	1,267,200
テノ.ホールディングス	1,400	781.00	1,093,400
フロンティア・マネジメント	4,800	940.00	4,512,000
ピアラ	1,800	528.00	950,400
コプロ・ホールディングス	1,800	1,443.00	2,597,400
ギークス	1,600	1,141.00	1,825,600
アンビスホールディングス	15,400	2,875.00	44,275,000
カーブスホールディングス	39,300	790.00	31,047,000
フォーラムエンジニアリング	8,400	848.00	7,123,200
FAST FITNESS JAPAN	4,900	1,697.00	8,315,300
日本車輛製造	5,400	2,091.00	11,291,400
三菱ロジスネクスト	22,300	1,037.00	23,125,100
近畿車輛	1,500	1,515.00	2,272,500
一家ホールディングス	2,600	638.00	1,658,800
フルサト・マルカホールディングス	14,700	2,646.00	38,896,200
ヤマエグループホールディングス	8,400	2,265.00	19,026,000
ジャパクラフトホールディングス	3,400	576.00	1,958,400
FPG	46,600	1,088.00	50,700,800
島根銀行	3,700	482.00	1,783,400
じもとホールディングス	9,500	396.00	3,762,000
全国保証	36,000	4,995.00	179,820,000
めぶきフィナンシャルグループ	683,400	339.00	231,672,600
ジャパンインベストメントアドバイ	11,300	1,116.00	12,610,800

ザー				
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,600	2,702.00	47,555,200	
九州フィナンシャルグループ	242,300	484.00	117,273,200	
かんぽ生命保険	167,200	2,198.00	367,505,600	
ゆうちょ銀行	386,000	1,082.00	417,652,000	
あんしん保証	5,300	264.00	1,399,200	
富山第一銀行	45,700	664.00	30,344,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	759,300	505.00	383,446,500	
ジェイリース	3,600	2,008.00	7,228,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	85,500	1,094.00	93,537,000	
イントラスト	4,100	959.00	3,931,900	
日本モーゲージサービス	5,900	672.00	3,964,800	
CASA	4,200	867.00	3,641,400	
アルヒ	17,000	1,082.00	18,394,000	
プレミアグループ	23,200	1,640.00	38,048,000	
日産自動車	1,986,800	501.00	995,386,800	
いすゞ自動車	406,600	1,602.00	651,373,200	
トヨタ自動車	7,679,900	1,856.00	14,253,894,400	
日野自動車	180,300	535.00	96,460,500	
三菱自動車工業	545,600	511.00	278,801,600	
エフテック	7,500	785.00	5,887,500	
レシップホールディングス	4,300	477.00	2,051,100	
GMB	2,100	1,693.00	3,555,300	
ファルテック	1,800	597.00	1,074,600	
武蔵精密工業	34,200	1,817.00	62,141,400	
日産車体	24,700	954.00	23,563,800	
新明和工業	43,900	1,207.00	52,987,300	
極東開発工業	23,100	1,768.00	40,840,800	
トピー工業	11,300	1,989.00	22,475,700	
ティラド	3,500	2,428.00	8,498,000	
曙ブレーキ工業	85,300	147.00	12,539,100	
タチエス	22,100	1,250.00	27,625,000	
NOK	54,300	1,850.00	100,455,000	
フタバ産業	37,500	457.00	17,137,500	
KYB	13,500	4,320.00	58,320,000	
市光工業	20,100	539.00	10,833,900	
大同メタル工業	27,400	536.00	14,686,400	
プレス工業	62,500	539.00	33,687,500	
ミクニ	12,500	341.00	4,262,500	
太平洋工業	32,100	1,202.00	38,584,200	
河西工業	14,400	198.00	2,851,200	
アイシン	107,900	3,930.00	424,047,000	
マツダ	462,600	1,237.00	572,236,200	
今仙電機製作所	6,900	711.00	4,905,900	
本田技研工業	1,136,900	3,611.00	4,105,345,900	
スズキ	256,900	4,802.00	1,233,633,800	
SUBARU	442,500	2,206.50	976,376,250	
安永	4,700	1,019.00	4,789,300	

ヤマハ発動機	219,800	3,470.00	762,706,000
小糸製作所	168,200	2,615.00	439,843,000
T B K	10,800	285.00	3,078,000
エクセディ	22,900	2,070.00	47,403,000
ミツバ	26,200	599.00	15,693,800
豊田合成	40,800	2,274.00	92,779,200
愛三工業	23,100	934.00	21,575,400
盟和産業	1,500	982.00	1,473,000
日本プラスト	8,500	426.00	3,621,000
ヨロズ	13,100	900.00	11,790,000
エフ・シー・シー	24,800	1,720.00	42,656,000
新家工業	2,400	2,094.00	5,025,600
シマノ	57,200	20,800.00	1,189,760,000
テイ・エス テック	64,000	1,854.00	118,656,000
三十三フィナンシャルグループ	12,300	1,570.00	19,311,000
第四北越フィナンシャルグループ	21,600	3,025.00	65,340,000
ひろぎんホールディングス	179,700	668.00	120,039,600
マーキュリアホールディングス	6,300	728.00	4,586,400
おきなわフィナンシャルグループ	13,100	2,052.00	26,881,200
ダイレクトマーケティングミックス	17,200	1,261.00	21,689,200
ポピンズ	2,100	1,949.00	4,092,900
L I T A L I C O	11,200	2,536.00	28,403,200
十六フィナンシャルグループ	17,800	2,941.00	52,349,800
北國フィナンシャルホールディングス	15,500	4,785.00	74,167,500
ネットプロテクションズホールディングス	45,600	500.00	22,800,000
プロクレアホールディングス	16,900	2,155.00	36,419,500
あいちフィナンシャルグループ	19,300	2,119.00	40,896,700
ジャムコ	5,900	1,384.00	8,165,600
小野建	14,600	1,540.00	22,484,000
はるやまホールディングス	4,800	504.00	2,419,200
南陽	2,200	2,341.00	5,150,200
ノジマ	48,300	1,480.00	71,484,000
佐鳥電機	7,200	1,673.00	12,045,600
カップ・クリエイト	23,300	1,514.00	35,276,200
エコートレーディング	2,200	747.00	1,643,400
伯東	8,500	4,670.00	39,695,000
コンドーテック	11,400	1,015.00	11,571,000
中山福	6,100	345.00	2,104,500
ライトオン	8,700	579.00	5,037,300
ナガイレーベン	18,700	2,089.00	39,064,300
三菱食品	13,700	3,560.00	48,772,000
良品計画	161,500	1,424.00	229,976,000
パリミキホールディングス	14,400	335.00	4,824,000
松田産業	11,300	2,311.00	26,114,300
第一興商	57,300	2,519.00	144,338,700
メディopalホールディングス	141,500	2,100.00	297,150,000
アドヴァングループ	14,100	938.00	13,225,800
S P K	6,600	1,770.00	11,682,000
萩原電気ホールディングス	5,700	3,420.00	19,494,000

アルビス	4,900	2,469.00	12,098,100
アズワン	21,100	5,910.00	124,701,000
スズデン	5,200	2,354.00	12,240,800
尾家産業	2,700	1,223.00	3,302,100
シモジマ	10,200	1,141.00	11,638,200
ドウシシャ	15,700	2,128.00	33,409,600
小津産業	2,500	1,787.00	4,467,500
コナカ	12,400	354.00	4,389,600
高速	7,700	2,125.00	16,362,500
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,614.00	2,421,000
G-7ホールディングス	18,400	1,440.00	26,496,000
たけびし	5,600	1,677.00	9,391,200
イオン北海道	21,900	821.00	17,979,900
コジマ	24,400	569.00	13,883,600
ヒマラヤ	3,600	953.00	3,430,800
コーナン商事	20,000	3,630.00	72,600,000
ネットワンシステムズ	52,300	3,300.00	172,590,000
エコス	5,500	1,890.00	10,395,000
ワタミ	17,900	940.00	16,826,000
マルシェ	3,800	425.00	1,615,000
リックス	2,400	2,894.00	6,945,600
システムソフト	48,700	81.00	3,944,700
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	298,700	2,526.00	754,516,200
丸文	13,200	1,245.00	16,434,000
西松屋チェーン	32,800	1,613.00	52,906,400
ゼンショーホールディングス	81,000	4,325.00	350,325,000
ハビネット	12,600	1,966.00	24,771,600
幸楽苑ホールディングス	9,600	1,080.00	10,368,000
ハークスレイ	4,000	725.00	2,900,000
橋本総業ホールディングス	5,900	1,124.00	6,631,600
日本ライフライン	43,400	947.00	41,099,800
サイゼリヤ	21,900	3,420.00	74,898,000
タカショー	12,900	709.00	9,146,100
VTホールディングス	56,200	541.00	30,404,200
アルゴグラフィックス	12,900	3,905.00	50,374,500
魚力	4,600	2,190.00	10,074,000
IDOM	44,700	863.00	38,576,100
日本エム・ディ・エム	8,300	1,001.00	8,308,300
ポブラ	3,000	290.00	870,000
フジ・コーポレーション	8,400	1,318.00	11,071,200
ユナイテッドアローズ	15,800	1,983.00	31,331,400
進和	9,100	2,142.00	19,492,200
エスケイジャパン	2,800	539.00	1,509,200
ダイトロン	5,800	2,651.00	15,375,800
ハイデイ日高	22,000	2,308.00	50,776,000
シークス	21,100	1,394.00	29,413,400
YU-WA CREATION HOLDINGS	6,800	201.00	1,366,800
コロワイド	68,200	2,116.00	144,311,200

ピーシーデポコーポレーション	16,500	300.00	4,950,000
田中商事	3,300	648.00	2,138,400
オーハシテクニカ	7,200	1,619.00	11,656,800
壺番屋	11,700	5,340.00	62,478,000
白銅	5,400	2,744.00	14,817,600
トップカルチャー	3,800	193.00	733,400
P L A N T	2,700	730.00	1,971,000
スギホールディングス	29,800	5,770.00	171,946,000
ダイコー通産	1,200	1,262.00	1,514,400
薬王堂ホールディングス	8,300	2,465.00	20,459,500
島津製作所	170,300	4,265.00	726,329,500
JMS	13,000	529.00	6,877,000
クボテック	2,600	208.00	540,800
長野計器	10,200	1,308.00	13,341,600
ブイ・テクノロジー	6,800	3,055.00	20,774,000
スター精密	26,600	1,779.00	47,321,400
東京計器	10,700	1,236.00	13,225,200
愛知時計電機	5,500	1,569.00	8,629,500
インターアクション	6,600	1,326.00	8,751,600
オーバル	9,600	448.00	4,300,800
東京精密	30,700	5,110.00	156,877,000
マニー	55,900	1,739.00	97,210,100
ニコン	202,200	1,448.00	292,785,600
トプコン	73,600	1,953.00	143,740,800
オリンパス	860,900	2,426.00	2,088,543,400
理研計器	8,700	5,170.00	44,979,000
S C R E E Nホールディングス	23,900	11,170.00	266,963,000
キヤノン電子	15,500	1,896.00	29,388,000
タムロン	10,500	3,450.00	36,225,000
H O Y A	298,700	15,065.00	4,499,915,500
シード	5,600	612.00	3,427,200
ノーリツ鋼機	13,300	2,270.00	30,191,000
A&Dホロンホールディングス	20,400	1,376.00	28,070,400
朝日インテック	156,300	2,517.00	393,407,100
キヤノン	767,400	3,248.00	2,492,515,200
リコー	350,700	1,132.00	396,992,400
シチズン時計	153,800	757.00	116,426,600
リズム	3,400	1,971.00	6,701,400
大研医器	8,100	499.00	4,041,900
メニコン	48,000	2,869.00	137,712,000
シンシア	1,000	594.00	594,000
K Y O R I T S U	16,100	147.00	2,366,700
中本パックス	3,300	1,580.00	5,214,000
スノーピーク	23,900	2,034.00	48,612,600
パラマウントベッドホールディングス	32,300	2,434.00	78,618,200
トランザクション	9,200	1,748.00	16,081,600
粧美堂	3,000	391.00	1,173,000
ニホンフラッシュ	13,100	1,063.00	13,925,300
前田工織	11,800	3,270.00	38,586,000
永大産業	11,600	223.00	2,586,800

アートネイチャー	14,400	788.00	11,347,200
バンダイナムコホールディングス	383,200	3,101.00	1,188,303,200
アイフイスジャパン	3,100	617.00	1,912,700
SHOEI	31,600	2,555.00	80,738,000
フランスベッドホールディングス	17,400	1,093.00	19,018,200
マーベラス	22,800	679.00	15,481,200
パイロットコーポレーション	21,900	4,510.00	98,769,000
萩原工業	9,300	1,282.00	11,922,600
エイベックス	23,800	1,545.00	36,771,000
フジシールインターナショナル	28,300	1,535.00	43,440,500
タカラトミー	64,600	1,522.00	98,321,200
広済堂ホールディングス	7,300	2,683.00	19,585,900
エステールホールディングス	2,600	608.00	1,580,800
レック	20,000	853.00	17,060,000
タカノ	4,100	748.00	3,066,800
三光合成	17,600	540.00	9,504,000
プロネクス	11,600	1,006.00	11,669,600
ホクシン	8,200	137.00	1,123,400
ウッドワン	3,600	1,128.00	4,060,800
大建工業	8,500	2,407.00	20,459,500
きもと	16,000	188.00	3,008,000
凸版印刷	182,900	2,867.00	524,374,300
大日本印刷	152,900	3,905.00	597,074,500
共同印刷	3,900	2,823.00	11,009,700
NISSHA	26,600	1,849.00	49,183,400
光村印刷	600	1,240.00	744,000
藤森工業	11,100	3,160.00	35,076,000
ヴィア・ホールディングス	17,100	90.00	1,539,000
TAKARA & COMPANY	9,000	2,435.00	21,915,000
前澤化成工業	9,000	1,627.00	14,643,000
未来工業	5,000	2,380.00	11,900,000
アシックス	129,100	3,850.00	497,035,000
ツツミ	2,500	2,249.00	5,622,500
ウェーブロックホールディングス	3,200	601.00	1,923,200
JSP	9,900	1,600.00	15,840,000
ニチハ	17,600	2,903.00	51,092,800
ローランド	10,300	4,260.00	43,878,000
エフピコ	26,500	3,080.00	81,620,000
小松ウオール工業	5,100	2,409.00	12,285,900
ヤマハ	88,200	5,350.00	471,870,000
河合楽器製作所	3,800	3,180.00	12,084,000
クリナップ	15,700	743.00	11,665,100
ピジョン	89,100	2,117.00	188,624,700
天馬	11,900	2,348.00	27,941,200
キングジム	12,400	920.00	11,408,000
象印マホービン	41,800	1,777.00	74,278,600
リンテック	28,100	2,270.00	63,787,000
信越ポリマー	25,900	1,351.00	34,990,900
東リ	24,500	298.00	7,301,000
イトーキ	28,700	822.00	23,591,400



任天堂	883,000	5,739.00	5,067,537,000
三菱鉛筆	19,900	1,787.00	35,561,300
松風	6,300	2,116.00	13,330,800
タカラスタンダード	25,800	1,661.00	42,853,800
コクヨ	67,400	1,995.00	134,463,000
ナカバヤシ	15,100	479.00	7,232,900
ニフコ	50,600	3,850.00	194,810,000
立川ブラインド工業	6,500	1,272.00	8,268,000
グローブライド	11,300	2,493.00	28,170,900
オカムラ	42,100	1,520.00	63,992,000
バルカー	11,700	3,510.00	41,067,000
MUTOHホールディングス	1,500	1,730.00	2,595,000
伊藤忠商事	911,800	4,595.00	4,189,721,000
丸紅	1,154,800	1,914.00	2,210,287,200
スクロール	22,000	809.00	17,798,000
高島	1,800	2,835.00	5,103,000
ヨンドシーホールディングス	12,700	1,791.00	22,745,700
三陽商会	4,200	1,656.00	6,955,200
長瀬産業	67,900	2,196.00	149,108,400
ナイガイ	3,700	262.00	969,400
蝶理	7,900	2,623.00	20,721,700
豊田通商	129,600	5,770.00	747,792,000
オンワードホールディングス	90,800	393.00	35,684,400
三共生興	21,300	584.00	12,439,200
兼松	57,500	1,784.00	102,580,000
美津濃	13,900	3,410.00	47,399,000
ツカモトコーポレーション	1,700	1,563.00	2,657,100
ルックホールディングス	3,100	2,282.00	7,074,200
三井物産	1,050,300	4,213.00	4,424,913,900
日本紙パルプ商事	7,900	5,360.00	42,344,000
東京エレクトロン	296,000	15,690.00	4,644,240,000
カメイ	15,700	1,627.00	25,543,900
東都水産	600	6,720.00	4,032,000
OUGホールディングス	1,700	2,505.00	4,258,500
スターゼン	11,300	2,316.00	26,170,800
セイコーグループ	21,700	2,967.00	64,383,900
山善	39,900	1,055.00	42,094,500
椿本興業	2,300	4,170.00	9,591,000
住友商事	916,400	2,480.00	2,272,672,000
BIPROGY	51,600	3,490.00	180,084,000
内田洋行	6,000	5,310.00	31,860,000
三菱商事	915,300	5,045.00	4,617,688,500
第一実業	5,200	5,770.00	30,004,000
キャノンマーケティングジャパン	34,300	3,400.00	116,620,000
西華産業	5,800	2,297.00	13,322,600
佐藤商事	10,300	1,447.00	14,904,100
菱洋エレクトロ	12,600	2,548.00	32,104,800
東京産業	13,500	882.00	11,907,000
ユアサ商事	13,300	3,965.00	52,734,500
神鋼商事	3,700	5,810.00	21,497,000

トルク	6,200	212.00	1,314,400
阪和興業	26,600	4,205.00	111,853,000
正栄食品工業	9,800	3,985.00	39,053,000
カナデン	9,900	1,226.00	12,137,400
RYODEN	11,900	2,039.00	24,264,100
ニプロ	116,600	1,019.00	118,815,400
岩谷産業	33,700	6,480.00	218,376,000
ナイス	3,100	1,339.00	4,150,900
ニチモウ	1,400	3,130.00	4,382,000
極東貿易	8,800	1,534.00	13,499,200
アステナホールディングス	25,600	456.00	11,673,600
三愛オブリ	39,100	1,481.00	57,907,100
稲畑産業	29,900	2,791.00	83,450,900
G S I クレオス	8,600	1,895.00	16,297,000
明和産業	19,700	673.00	13,258,100
クワザワホールディングス	3,700	472.00	1,746,400
キムラタン	64,300	22.00	1,414,600
ゴールドウイン	24,800	12,170.00	301,816,000
ユニ・チャーム	292,200	5,516.00	1,611,775,200
デサント	24,100	4,415.00	106,401,500
キング	4,800	596.00	2,860,800
ワキタ	27,200	1,382.00	37,590,400
ヤマトインターナショナル	8,600	284.00	2,442,400
東邦ホールディングス	36,900	2,695.00	99,445,500
サンゲツ	37,100	2,274.00	84,365,400
ミツウロコグループホールディングス	18,900	1,333.00	25,193,700
シナネンホールディングス	4,800	3,700.00	17,760,000
伊藤忠エネクス	36,700	1,213.00	44,517,100
サンリオ	41,900	6,100.00	255,590,000
サンワテクノス	7,600	1,966.00	14,941,600
リョーサン	15,700	3,285.00	51,574,500
新光商事	19,900	1,211.00	24,098,900
トーヨー	6,300	2,427.00	15,290,100
三信電気	6,000	2,330.00	13,980,000
東陽テクニカ	15,000	1,431.00	21,465,000
モスフードサービス	21,800	3,130.00	68,234,000
加賀電子	12,000	5,000.00	60,000,000
三益半導体工業	11,100	2,674.00	29,681,400
都築電気	7,400	1,547.00	11,447,800
ソーダニッカ	8,400	822.00	6,904,800
立花エレテック	10,800	2,133.00	23,036,400
木曽路	22,400	2,392.00	53,580,800
S R S ホールディングス	24,400	1,010.00	24,644,000
千趣会	27,200	414.00	11,260,800
タカキュー	8,100	79.00	639,900
リテールパートナーズ	22,000	1,574.00	34,628,000
ケーヨー	23,900	828.00	19,789,200
上新電機	13,200	2,019.00	26,650,800
日本瓦斯	79,300	1,946.00	154,317,800
ロイヤルホールディングス	28,700	2,841.00	81,536,700

東天紅	600	782.00	469,200
いなげや	14,400	1,578.00	22,723,200
チョダ	14,100	855.00	12,055,500
ライフコーポレーション	12,900	2,936.00	37,874,400
リンガーハット	19,100	2,394.00	45,725,400
MrMaxHD	20,700	620.00	12,834,000
テンアライド	12,800	263.00	3,366,400
AOKIホールディングス	27,500	959.00	26,372,500
オークワ	23,700	891.00	21,116,700
コメリ	22,800	3,065.00	69,882,000
青山商事	31,600	929.00	29,356,400
しまむら	17,400	12,560.00	218,544,000
はせがわ	5,400	346.00	1,868,400
高島屋	111,600	1,994.00	222,530,400
松屋	25,100	1,169.00	29,341,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	72,000	1,603.00	115,416,000
近鉄百貨店	6,400	2,534.00	16,217,600
丸井グループ	109,100	2,147.00	234,237,700
クレディセゾン	87,300	1,873.00	163,512,900
アクシアル リテイリング	10,100	3,370.00	34,037,000
井筒屋	5,400	330.00	1,782,000
イオン	501,600	2,739.50	1,374,133,200
イズミ	22,500	3,130.00	70,425,000
フォーバル	5,600	1,183.00	6,624,800
平和堂	24,700	2,077.00	51,301,900
フジ	22,700	1,773.00	40,247,100
ヤオコー	16,700	7,150.00	119,405,000
ゼビオホールディングス	20,000	1,202.00	24,040,000
ケーズホールディングス	104,600	1,192.00	124,683,200
PALTAC	23,300	5,060.00	117,898,000
三谷産業	25,900	317.00	8,210,300
Olympicグループ	4,300	535.00	2,300,500
日産東京販売ホールディングス	14,700	349.00	5,130,300
SBI新生銀行	32,200	2,435.00	78,407,000
あおぞら銀行	86,600	2,440.00	211,304,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,626,900	848.30	7,318,199,270
りそなホールディングス	1,741,100	658.40	1,146,340,240
三井住友トラスト・ホールディングス	250,300	4,889.00	1,223,716,700
三井住友フィナンシャルグループ	1,006,600	5,563.00	5,599,715,800
千葉銀行	383,900	865.00	332,073,500
群馬銀行	267,400	452.00	120,864,800
武蔵野銀行	17,700	2,156.00	38,161,200
千葉興業銀行	25,000	532.00	13,300,000
筑波銀行	60,400	205.00	12,382,000
七十七銀行	44,100	2,180.00	96,138,000
秋田銀行	9,200	1,731.00	15,925,200
山形銀行	15,300	1,069.00	16,355,700
岩手銀行	9,400	2,094.00	19,683,600
東邦銀行	108,800	224.00	24,371,200
東北銀行	5,200	980.00	5,096,000

ふくおかフィナンシャルグループ	110,000	2,494.00	274,340,000
スルガ銀行	121,400	520.00	63,128,000
八十二銀行	282,600	572.00	161,647,200
山梨中央銀行	14,100	1,109.00	15,636,900
大垣共立銀行	26,200	1,816.00	47,579,200
福井銀行	12,300	1,449.00	17,822,700
清水銀行	5,500	1,438.00	7,909,000
富山銀行	1,600	1,628.00	2,604,800
滋賀銀行	22,900	2,779.00	63,639,100
南都銀行	20,700	2,431.00	50,321,700
百五銀行	129,700	382.00	49,545,400
京都銀行	43,600	6,580.00	286,888,000
紀陽銀行	49,300	1,574.00	77,598,200
ほくほくフィナンシャルグループ	87,500	961.00	84,087,500
山陰合同銀行	86,200	750.00	64,650,000
鳥取銀行	3,400	1,173.00	3,988,200
百十四銀行	12,600	1,833.00	23,095,800
四国銀行	21,900	865.00	18,943,500
阿波銀行	19,300	2,008.00	38,754,400
大分銀行	8,300	2,034.00	16,882,200
宮崎銀行	9,000	2,401.00	21,609,000
佐賀銀行	8,100	1,635.00	13,243,500
琉球銀行	31,600	911.00	28,787,600
セブン銀行	493,400	277.00	136,671,800
みずほフィナンシャルグループ	1,992,200	1,973.00	3,930,610,600
高知銀行	3,600	679.00	2,444,400
山口フィナンシャルグループ	152,100	828.00	125,938,800
芙蓉総合リース	12,700	9,740.00	123,698,000
みずほリース	20,500	3,850.00	78,925,000
東京センチュリー	25,700	4,615.00	118,605,500
SBIホールディングス	199,400	2,649.00	528,210,600
日本証券金融	55,200	1,018.00	56,193,600
アイフル	228,100	369.00	84,168,900
日本アジア投資	8,500	254.00	2,159,000
長野銀行	3,300	1,456.00	4,804,800
名古屋銀行	9,100	3,370.00	30,667,000
北洋銀行	208,700	281.00	58,644,700
大光銀行	3,200	1,093.00	3,497,600
愛媛銀行	18,600	841.00	15,642,600
トマト銀行	3,500	1,023.00	3,580,500
京葉銀行	63,000	551.00	34,713,000
栃木銀行	63,100	266.00	16,784,600
北日本銀行	4,800	2,047.00	9,825,600
東和銀行	25,300	538.00	13,611,400
福島銀行	11,100	225.00	2,497,500
大東銀行	4,200	642.00	2,696,400
リコーリース	13,100	3,960.00	51,876,000
イオンフィナンシャルサービス	79,100	1,209.00	95,631,900
アコム	245,800	336.00	82,588,800
ジャックス	14,700	4,545.00	66,811,500

オリエントコーポレーション	36,000	1,132.00	40,752,000
オリックス	904,200	2,286.00	2,067,001,200
三菱HCキャピタル	537,000	706.00	379,122,000
ジャフコグループ	46,000	1,705.00	78,430,000
九州リースサービス	5,000	880.00	4,400,000
トモニホールディングス	111,300	366.00	40,735,800
大和証券グループ本社	985,000	631.00	621,535,000
野村ホールディングス	2,536,800	477.70	1,211,829,360
岡三証券グループ	121,000	429.00	51,909,000
丸三証券	45,900	422.00	19,369,800
東洋証券	45,700	319.00	14,578,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	150,000	355.00	53,250,000
光世証券	2,500	417.00	1,042,500
水戸証券	37,000	296.00	10,952,000
いちよし証券	25,400	591.00	15,011,400
松井証券	81,400	771.00	62,759,400
SOMPOホールディングス	236,400	5,680.00	1,342,752,000
日本取引所グループ	387,100	2,194.00	849,297,400
マネックスグループ	148,400	506.00	75,090,400
極東証券	17,200	620.00	10,664,000
岩井コスモホールディングス	15,700	1,324.00	20,786,800
アイザワ証券グループ	19,900	740.00	14,726,000
フィデアホールディングス	14,200	1,339.00	19,013,800
池田泉州ホールディングス	176,300	235.00	41,430,500
アニコムホールディングス	46,800	529.00	24,757,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	280,300	4,479.00	1,255,463,700
マネーパートナーズグループ	11,200	269.00	3,012,800
スパークス・グループ	15,400	1,438.00	22,145,200
小林洋行	2,900	244.00	707,600
第一生命ホールディングス	673,000	2,471.50	1,663,319,500
東京海上ホールディングス	1,361,600	2,719.50	3,702,871,200
アドバンテッジリスクマネジメント	5,100	474.00	2,417,400
イー・ギャランティ	22,400	2,034.00	45,561,600
アサックス	4,900	620.00	3,038,000
NECキャピタルソリューション	6,800	2,743.00	18,652,400
T&Dホールディングス	369,700	1,680.00	621,096,000
アドバンスクリエイト	8,000	1,120.00	8,960,000
三井不動産	595,300	2,649.50	1,577,247,350
三菱地所	831,200	1,653.00	1,373,973,600
平和不動産	22,400	3,850.00	86,240,000
東京建物	131,300	1,700.00	223,210,000
京阪神ビルディング	23,200	1,239.00	28,744,800
住友不動産	249,000	3,118.00	776,382,000
太平洋興発	4,000	831.00	3,324,000
テーオーシー	24,900	658.00	16,384,200
東京楽天地	2,300	4,305.00	9,901,500
レオパレス21	155,000	380.00	58,900,000
スターツコーポレーション	19,800	2,594.00	51,361,200

フジ住宅	19,300	703.00	13,567,900
空港施設	16,700	578.00	9,652,600
明和地所	5,100	838.00	4,273,800
ゴールドクレスト	13,100	1,785.00	23,383,500
リログループ	80,000	2,086.00	166,880,000
エスリード	6,500	2,217.00	14,410,500
日神グループホールディングス	22,100	468.00	10,342,800
日本エスコン	31,000	872.00	27,032,000
MIRARTHホールディングス	69,600	390.00	27,144,000
AVANTIA	6,000	833.00	4,998,000
イオンモール	71,400	1,850.00	132,090,000
毎日コムネット	4,000	839.00	3,356,000
ファースト住建	4,300	1,105.00	4,751,500
ランド	829,100	9.00	7,461,900
カチタス	37,000	2,620.00	96,940,000
東祥	10,000	1,370.00	13,700,000
トーセイ	22,900	1,642.00	37,601,800
穴吹興産	2,100	2,360.00	4,956,000
サンフロンティア不動産	23,000	1,334.00	30,682,000
FJネクストホールディングス	14,500	1,036.00	15,022,000
インテリックス	2,600	573.00	1,489,800
ランドビジネス	4,000	271.00	1,084,000
サンネクスタグループ	3,200	1,023.00	3,273,600
グランディハウス	9,000	563.00	5,067,000
東武鉄道	153,600	3,520.00	540,672,000
相鉄ホールディングス	46,200	2,691.00	124,324,200
東急	392,200	1,949.00	764,397,800
京浜急行電鉄	158,700	1,341.00	212,816,700
小田急電鉄	212,000	2,034.00	431,208,000
京王電鉄	74,000	5,130.00	379,620,000
京成電鉄	90,200	5,050.00	455,510,000
富士急行	17,200	5,220.00	89,784,000
東日本旅客鉄道	237,200	7,897.00	1,873,168,400
西日本旅客鉄道	178,700	6,041.00	1,079,526,700
東海旅客鉄道	107,700	16,920.00	1,822,284,000
西武ホールディングス	169,200	1,585.00	268,182,000
鴻池運輸	23,900	1,627.00	38,885,300
西日本鉄道	37,400	2,518.00	94,173,200
ハマキョウレックス	11,000	3,495.00	38,445,000
サカイ引越センター	6,700	4,860.00	32,562,000
近鉄グループホールディングス	139,600	4,705.00	656,818,000
阪急阪神ホールディングス	186,200	4,335.00	807,177,000
南海電気鉄道	66,700	3,215.00	214,440,500
京阪ホールディングス	77,000	3,765.00	289,905,000
神戸電鉄	3,800	3,225.00	12,255,000
名古屋鉄道	154,300	2,226.00	343,471,800
山陽電気鉄道	10,500	2,414.00	25,347,000
アルプス物流	11,200	1,242.00	13,910,400
トランコム	4,100	6,710.00	27,511,000
ヤマトホールディングス	178,800	2,350.00	420,180,000

山九	35,500	4,845.00	171,997,500
日新	10,600	2,138.00	22,662,800
丸運	5,600	247.00	1,383,200
丸全昭和運輸	8,700	3,470.00	30,189,000
センコーグループホールディングス	74,100	977.00	72,395,700
トナミホールディングス	2,500	4,600.00	11,500,000
ニッコンホールディングス	44,700	2,687.00	120,108,900
日本石油輸送	900	2,608.00	2,347,200
福山通運	10,600	3,680.00	39,008,000
セイノーホールディングス	86,900	1,498.00	130,176,200
エスライン	3,200	808.00	2,585,600
神奈川中央交通	4,000	3,210.00	12,840,000
AZ-COM丸和ホールディングス	33,700	1,963.00	66,153,100
C&Fロジホールディングス	13,500	1,304.00	17,604,000
日本郵船	373,600	3,153.00	1,177,960,800
商船三井	246,100	3,200.00	787,520,000
川崎汽船	104,900	3,185.00	334,106,500
NSユナイテッド海運	7,500	3,645.00	27,337,500
明治海運	10,600	618.00	6,550,800
飯野海運	51,300	988.00	50,684,400
共栄タンカー	2,000	917.00	1,834,000
九州旅客鉄道	98,700	3,115.00	307,450,500
SGホールディングス	268,000	2,075.00	556,100,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	52,100	8,160.00	425,136,000
日本航空	342,900	2,692.00	923,086,800
ANAホールディングス	379,900	3,021.00	1,147,677,900
ビーウィズ	3,600	2,000.00	7,200,000
パスコ	2,100	1,572.00	3,301,200
TREホールディングス	30,300	1,220.00	36,966,000
人・夢・技術グループ	5,400	1,528.00	8,251,200
西本Wismettacホールディングス	3,800	4,015.00	15,257,000
シルバーライフ	2,800	1,297.00	3,631,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	2,229.00	2,006,100
Genky DrugStores	6,500	4,030.00	26,195,000
コア商事ホールディングス	8,300	718.00	5,959,400
KPPグループホールディングス	34,500	654.00	22,563,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,900	994.00	1,888,600
ブックオフグループホールディングス	7,500	1,337.00	10,027,500
ギフトホールディングス	3,100	5,120.00	15,872,000
三菱倉庫	30,000	3,440.00	103,200,000
三井倉庫ホールディングス	13,000	4,040.00	52,520,000
住友倉庫	37,700	2,280.00	85,956,000
澁澤倉庫	5,600	2,350.00	13,160,000
ヤマタネ	6,600	1,689.00	11,147,400
東陽倉庫	14,600	284.00	4,146,400
乾汽船	17,700	1,669.00	29,541,300
日本トランスシティ	28,200	660.00	18,612,000
ケイヒン	2,000	1,693.00	3,386,000

中央倉庫	6,800	1,092.00	7,425,600
川西倉庫	1,900	1,013.00	1,924,700
安田倉庫	9,700	1,067.00	10,349,900
ファイブホールディングス	2,000	1,462.00	2,924,000
大栄環境	36,600	1,896.00	69,393,600
日本管財ホールディングス	15,100	2,670.00	40,317,000
東洋埠頭	3,200	1,470.00	4,704,000
上組	67,000	3,010.00	201,670,000
サンリツ	2,500	747.00	1,867,500
キムラユニティー	5,200	1,138.00	5,917,600
キューソー流通システム	6,600	1,034.00	6,824,400
東海運	6,600	303.00	1,999,800
エーアイテイー	8,800	1,618.00	14,238,400
内外トランスライン	5,100	2,552.00	13,015,200
ショーエイコーポレーション	3,200	569.00	1,820,800
日本コンセプト	4,400	1,680.00	7,392,000
TBSホールディングス	71,800	2,079.00	149,272,200
日本テレビホールディングス	124,200	1,225.00	152,145,000
朝日放送グループホールディングス	13,200	669.00	8,830,800
テレビ朝日ホールディングス	34,000	1,568.00	53,312,000
スカパーJ SATホールディングス	124,500	563.00	70,093,500
テレビ東京ホールディングス	10,100	2,540.00	25,654,000
日本BS放送	3,900	891.00	3,474,900
ビジョン	18,500	1,654.00	30,599,000
スマートバリュー	2,700	431.00	1,163,700
USEN-NEXT HOLDINGS	15,700	2,987.00	46,895,900
ワイヤレスゲート	4,700	235.00	1,104,500
日本通信	129,400	255.00	32,997,000
クロップス	1,800	1,132.00	2,037,600
日本電信電話	1,797,400	4,178.00	7,509,537,200
KDDI	1,084,000	4,212.00	4,565,808,000
ソフトバンク	2,253,500	1,542.00	3,474,897,000
光通信	16,500	18,420.00	303,930,000
エムティーアイ	9,600	515.00	4,944,000
GMOインターネットグループ	51,800	2,680.00	138,824,000
ファイバーゲート	7,500	1,268.00	9,510,000
アイドママーケティングコミュニケーション	2,600	285.00	741,000
KADOKAWA	74,200	2,891.00	214,512,200
学研ホールディングス	23,300	879.00	20,480,700
ゼンリン	24,000	920.00	22,080,000
昭文社ホールディングス	4,700	297.00	1,395,900
インプレスホールディングス	9,600	230.00	2,208,000
東京電力ホールディングス	1,260,800	489.00	616,531,200
中部電力	515,400	1,548.00	797,839,200
関西電力	540,100	1,479.00	798,807,900
中国電力	222,700	723.00	161,012,100
北陸電力	132,000	661.00	87,252,000
東北電力	341,900	721.00	246,509,900



四国電力	119,400	825.00	98,505,000
九州電力	322,400	835.00	269,204,000
北海道電力	135,100	519.00	70,116,900
沖縄電力	32,800	1,112.00	36,473,600
電源開発	105,300	2,208.00	232,502,400
エフオン	9,100	657.00	5,978,700
イーレックス	24,800	1,791.00	44,416,800
レノバ	37,200	1,912.00	71,126,400
東京瓦斯	295,700	2,842.00	840,379,400
大阪瓦斯	283,300	2,249.00	637,141,700
東邦瓦斯	55,100	2,501.00	137,805,100
北海道瓦斯	8,400	2,078.00	17,455,200
広島ガス	29,500	378.00	11,151,000
西部ガスホールディングス	13,100	1,932.00	25,309,200
静岡ガス	31,900	1,144.00	36,493,600
メタウォーター	17,500	1,811.00	31,692,500
アイネット	8,500	1,307.00	11,109,500
松竹	8,000	12,260.00	98,080,000
東宝	87,800	5,420.00	475,876,000
エイチ・アイ・エス	37,600	2,029.00	76,290,400
東映	3,900	18,170.00	70,863,000
ラックランド	6,000	3,260.00	19,560,000
エヌ・ティ・ティ・データ	440,200	1,862.00	819,652,400
共立メンテナンス	24,600	5,530.00	136,038,000
イチネンホールディングス	15,200	1,335.00	20,292,000
建設技術研究所	7,400	3,495.00	25,863,000
スペース	10,400	944.00	9,817,600
アインホールディングス	20,400	5,760.00	117,504,000
燦ホールディングス	6,100	2,315.00	14,121,500
ピー・シー・エー	8,100	1,092.00	8,845,200
スバル興業	600	9,710.00	5,826,000
東京テアトル	4,100	1,143.00	4,686,300
タナベコンサルティンググループ	4,400	899.00	3,955,600
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,817.00	10,902,000
ナガワ	3,900	6,320.00	24,648,000
東京都競馬	12,000	4,130.00	49,560,000
常磐興産	3,900	1,259.00	4,910,100
カナモト	26,300	2,259.00	59,411,700
DTS	29,900	3,245.00	97,025,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	70,500	6,650.00	468,825,000
シーイーシー	19,700	1,422.00	28,013,400
カプコン	139,400	5,220.00	727,668,000
ニシオホールディングス	13,400	3,275.00	43,885,000
アイ・エス・ビー	7,200	1,525.00	10,980,000
アゴーラ ホスピタリティー グループ	62,500	25.00	1,562,500
日本空港ビルデング	48,700	6,790.00	330,673,000
トランス・コスモス	17,900	3,275.00	58,622,500
乃村工藝社	62,700	935.00	58,624,500

ジャステック	8,600	1,239.00	10,655,400
S C S K	114,500	2,103.00	240,793,500
藤田観光	6,400	3,645.00	23,328,000
KNT-CTホールディングス	8,600	1,586.00	13,639,600
トーカイ	12,700	2,031.00	25,793,700
白洋舎	1,400	2,258.00	3,161,200
セコム	146,400	8,745.00	1,280,268,000
NSW	5,500	2,162.00	11,891,000
セントラル警備保障	7,800	2,833.00	22,097,400
アイネス	9,900	1,416.00	14,018,400
丹青社	27,900	829.00	23,129,100
メイテック	56,100	2,270.00	127,347,000
TKC	22,400	3,660.00	81,984,000
富士ソフト	15,900	8,110.00	128,949,000
応用地質	13,400	2,066.00	27,684,400
船井総研ホールディングス	29,900	2,572.00	76,902,800
NSD	50,100	2,566.00	128,556,600
進学会ホールディングス	3,700	297.00	1,098,900
丸紅建材リース	900	2,009.00	1,808,100
オオバ	7,000	798.00	5,586,000
コナミグループ	60,000	6,550.00	393,000,000
いであ	2,500	1,646.00	4,115,000
学究社	5,700	2,176.00	12,403,200
ベネッセホールディングス	53,700	1,967.00	105,627,900
イオンディライト	15,900	3,055.00	48,574,500
ナック	6,400	958.00	6,131,200
福井コンピュータホールディングス	9,700	2,668.00	25,879,600
ダイセキ	29,300	4,075.00	119,397,500
ステップ	5,200	1,805.00	9,386,000
泉州電業	7,400	3,085.00	22,829,000
元気寿司	4,200	3,325.00	13,965,000
トラスコ中山	31,100	2,294.00	71,343,400
ヤマダホールディングス	606,700	449.00	272,408,300
オートバックスセブン	51,500	1,527.00	78,640,500
モリト	10,600	1,086.00	11,511,600
アークランズ	21,600	1,537.00	33,199,200
ニトリホールディングス	59,900	17,270.00	1,034,473,000
グルメ杵屋	12,000	1,073.00	12,876,000
愛眼	8,700	170.00	1,479,000
ケーユーホールディングス	8,700	1,444.00	12,562,800
吉野家ホールディングス	57,900	2,501.00	144,807,900
加藤産業	18,300	3,770.00	68,991,000
北恵	2,600	747.00	1,942,200
イノテック	9,300	1,386.00	12,889,800
イエローハット	26,100	1,918.00	50,059,800
松屋フーズホールディングス	7,000	4,320.00	30,240,000
J B C Cホールディングス	10,200	2,265.00	23,103,000
J Kホールディングス	11,400	1,061.00	12,095,400
サガミホールディングス	23,800	1,343.00	31,963,400
日伝	8,800	2,052.00	18,057,600

関西フードマーケット	13,400	1,562.00	20,930,800
ミロク情報サービス	12,700	1,716.00	21,793,200
北沢産業	6,100	464.00	2,830,400
杉本商事	6,600	2,027.00	13,378,200
因幡電機産業	38,400	3,075.00	118,080,000
王将フードサービス	9,700	6,210.00	60,237,000
ミニストップ	10,800	1,416.00	15,292,800
アークス	27,100	2,492.00	67,533,200
バローホールディングス	28,200	2,096.00	59,107,200
東テク	4,900	4,315.00	21,143,500
ミスミグループ本社	223,300	3,345.00	746,938,500
アルテック	6,400	262.00	1,676,800
ベルク	7,400	6,090.00	45,066,000
大 庄	6,200	1,178.00	7,303,600
タキヒヨー	2,800	1,015.00	2,842,000
ファーストリテイリング	66,600	30,970.00	2,062,602,000
ソフトバンクグループ	692,000	5,120.00	3,543,040,000
蔵王産業	1,900	2,269.00	4,311,100
スズケン	43,300	3,975.00	172,117,500
サンドラッグ	56,200	3,750.00	210,750,000
サックスパー ホールディングス	14,100	894.00	12,605,400
ジェコス	8,900	893.00	7,947,700
ヤマザワ	2,100	1,285.00	2,698,500
やまや	2,400	2,692.00	6,460,800
グローセル	13,800	413.00	5,699,400
ベルーナ	35,600	755.00	26,878,000
合計	165,544,500		414,358,183,660

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年5月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,607,777,757
コール・ローン	14,088,871,722
株式	905,076,481,832
投資信託受益証券	1,594,493,949
投資証券	18,389,431,999
派生商品評価勘定	50,166,691
未収入金	42,605,753
未収配当金	1,402,892,439
差入委託証拠金	6,980,701,292
流動資産合計	955,233,423,434
資産合計	955,233,423,434
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	63,047,251
未払解約金	14,845,906,000
流動負債合計	14,908,953,251
負債合計	14,908,953,251
純資産の部	
元本等	
元本	146,902,072,648
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	793,422,397,535
元本等合計	940,324,470,183
純資産合計	940,324,470,183
負債純資産合計	955,233,423,434

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年5月8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	121,262,425,171円
同期中追加設定元本額	63,975,677,055円
同期中一部解約元本額	38,336,029,578円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,271,347,065円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,230,953円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	10,077,678円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	26,413,429円

グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,753,043円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	20,907,437円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	21,917,971円
たわらノーロード 先進国株式	46,140,959,732円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	341,994,143円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	3,046,016,723円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	851,745,187円
たわらノーロード バランス (堅実型)	89,207,273円
たわらノーロード バランス (標準型)	772,926,036円
たわらノーロード バランス (積極型)	977,538,806円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,335円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	72,047,885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)	288,583,162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)	258,126,654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)	430,228,913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)	643,368円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	21,148,247円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,525,679円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,706,532円
たわらノーロード 全世界株式	714,260,844円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,710,711,676円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	2,882,847,110円
O n e グローバルバランス	9,105,811円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	156,476,894円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	808,278,488円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,053,179,377円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	93,944,590円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	255,601,761円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	250,316,421円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,883,685円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	662,291,338円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	122,553,509円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	175,170,692円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	197,632,417円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	315,085,692円
投資のソムリエ	8,703,567,758円
クルーズコントロール	102,457,357円
投資のソムリエ<DC年金>	678,329,908円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	203,140,330円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	249,072,977円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	717,227,766円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,865,121,961円
ワールドアセットバランス (基本コース)	141,819,504円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	326,556,864円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	48,414,493円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	23,946,299円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	5,135,491円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	110,777,724円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	140,558,358円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	695,249,413円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	147,808,852円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	47,729,102円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	26,421,048円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	15,876,566円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	112,890,717円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,471,385円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	41,172,191円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	319,011円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	341,688円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	178,485円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	305,114円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	823,988円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	300,781円
MSCIコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	357,837,503円
DIAM外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	40,297,135円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,117,797,619円
DIAM先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	201,241,409円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,283,392,066円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	231,184,354円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	363,221円
DIAMワールドバランス２５VA（適格機関投資家限定）	6,818,823円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	570,140円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,572,693円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	8,058,737円
DIAMグローバル・バランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	23,709,257円
DIAMグローバル・バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	49,076,181円
DIAM国際分散バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,672,471円
DIAM国際分散バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	12,617,250円
DIAM国内重視バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,116,020円
DIAM国内重視バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	33,270円
DIAM世界バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	3,139,914円
DIAM世界バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	21,696,086円
DIAMバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	143,666,153円
DIAMバランスファンド３７．５VA（適格機関投資家限定）	241,265,970円
DIAMバランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	817,540,550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）	37,931,448円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA２（適格機関投資家限定）	33,118,096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）	227,364,738円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	7,562,912円
DIAM世界バランスファンド５５VA（適格機関投資家限定）	159,619円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	96,210,593円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	8,662,271円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	28,353,993円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	42,999,507円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	90,627,465円
動的パッケージファンド<DC年金>	11,694,657円
コア資産形成ファンド	7,812,638円
MHAM外国株式インデックスファンド (ファンドラップ)	3,246,693,798円
MHAM外国株式インデックスファンド	138,510,542円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	6,287,002円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,437,313,157円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,390,699,256円
計	146,902,072,648円
2. 受益権の総数	146,902,072,648口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年5月10日 至 2023年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年5月8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



<p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
-----------------------------------	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年5月8日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,062,079,641	
投資信託受益証券	35,563,424	
投資証券	△1,146,385,617	
合計	△48,742,552	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年2月16日から2023年5月8日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年5月8日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	901,460,576	—	896,294,240	5,166,336
イギリス・ポンド	901,460,576	—	896,294,240	5,166,336
買建	509,670,285	—	509,704,259	33,974
アメリカ・ドル	372,443,130	—	372,467,115	23,985
イギリス・ポンド	25,080,846	—	25,083,418	2,572
オーストラリア・ドル	9,383,815	—	9,385,164	1,349
カナダ・ドル	19,983,546	—	19,984,833	1,287
ユーロ	82,778,948	—	82,783,729	4,781
合計	1,411,130,861	—	1,405,998,499	5,200,310

(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ではありません。

株式関連

種類	2023年5月8日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	15,294,233,734	—		15,276,152,864	△18,080,870
合計	15,294,233,734	—		15,276,152,864	△18,080,870

(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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2023年5月8日現在	
1口当たり純資産額	6.4010円
(1万口当たり純資産額)	(64,010円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年5月8日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,240,262	105.655	131,039,881.610	
	ABBOTT LABORATORIES	235,405	111.260	26,191,160.300	
	AES CORP	90,680	22.670	2,055,715.600	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	121,909	123.650	15,074,047.850	
	ADVANCED MICRO DEVICES	216,444	89.840	19,445,328.960	
	ADOBE INC	62,483	348.400	21,769,077.200	
	CHUBB LTD	55,721	198.930	11,084,578.530	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	30,190	296.700	8,957,373.000	
	ALLSTATE CORP	36,651	115.730	4,241,620.230	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	90,469	198.420	17,950,858.980	
	AMGEN INC	71,881	236.530	17,002,012.930	

HESS CORP	36,375	136.300	4,957,912.500	
AMERICAN EXPRESS CO	85,374	152.650	13,032,341.100	
AMERICAN ELECTRIC POWER	67,905	92.110	6,254,729.550	
AFLAC INC	77,524	67.590	5,239,847.160	
AMERICAN INTL GROUP	101,141	53.790	5,440,374.390	
ANALOG DEVICES	68,039	183.390	12,477,672.210	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	93,288	62.090	5,792,251.920	
VALERO ENERGY CORP	52,681	107.040	5,638,974.240	
ANSYS INC	12,049	301.680	3,634,942.320	
APPLE INC	2,149,820	173.570	373,144,257.400	
APPLIED MATERIALS INC	114,199	116.060	13,253,935.940	
ALBEMARLE CORP	15,528	179.700	2,790,381.600	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	75,031	75.960	5,699,354.760	
AMEREN CORP	32,830	90.470	2,970,130.100	
ARROW ELECTRONICS INC	9,826	119.640	1,175,582.640	
AUTODESK INC	29,554	194.940	5,761,256.760	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	55,700	215.480	12,002,236.000	
AUTOZONE INC	2,591	2,691.580	6,973,883.780	
AVERY DENNISON CORP	11,542	172.080	1,986,147.360	
BALL CORP	45,691	58.600	2,677,492.600	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	175,639	323.880	56,885,959.320	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	104,946	41.170	4,320,626.820	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	46.050	3,285,068.850	
BECTON DICKINSON & CO	38,402	253.660	9,741,051.320	
AMETEK INC	30,909	145.020	4,482,423.180	
VERIZON COMM INC	569,032	37.830	21,526,480.560	
WR BERKLEY CORP	30,631	58.650	1,796,508.150	
BEST BUY CO INC	29,593	73.570	2,177,157.010	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	385.240	1,163,810.040	
YUM! BRANDS INC	38,365	137.490	5,274,803.850	
FIRSTENERGY CORP	75,630	39.700	3,002,511.000	
BOEING CO	76,014	198.340	15,076,616.760	
ROBERT HALF INTL INC	14,456	69.000	997,464.000	
BORGWARNER INC	29,975	44.610	1,337,184.750	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	193,284	51.540	9,961,857.360	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	104.500	1,800,848.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	22,659	124.510	2,821,272.090	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,083	1,424.990	4,393,244.170	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	287,363	68.140	19,580,914.820	
ONEOK INC	58,247	64.510	3,757,513.970	
AMERICAN FINANCIAL GROUP	9,709	115.840	1,124,690.560	

INC				
UNITED RENTALS INC	9,015	342.050	3,083,580.750	
SEMPRA ENERGY	41,946	154.920	6,498,274.320	
FEDEX CORP	33,799	229.300	7,750,110.700	
VERISIGN INC	13,302	219.490	2,919,655.980	
AMPHENOL CORP	80,212	75.710	6,072,850.520	
BROWN-FORMAN CORP	43,429	64.670	2,808,553.430	
QUANTA SERVICES INC	19,621	171.070	3,356,564.470	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	3.730	379,583.450	
CSX CORP	285,564	31.860	9,098,069.040	
COTERRA ENERGY INC	112,611	25.090	2,825,409.990	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	54.740	1,476,775.720	
CONSTELLATION BRANDS INC	22,672	223.440	5,065,831.680	
CARDINAL HEALTH INC	34,421	83.200	2,863,827.200	
CARLISLE COS INC	7,522	213.580	1,606,548.760	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	10.010	1,324,232.910	
CATERPILLAR INC	69,997	215.090	15,055,654.730	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	120.960	1,527,845.760	
JPMORGAN CHASE & CO	395,707	136.740	54,108,975.180	
CHURCH & DWIGHT CO INC	31,461	97.530	3,068,391.330	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19,878	105.240	2,091,960.720	
CINTAS CORP	11,988	466.370	5,590,843.560	
CISCO SYSTEMS INC	552,313	46.250	25,544,476.250	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	14.930	1,035,709.030	
CLOROX COMPANY	16,085	169.600	2,728,016.000	
COCA-COLA CO/THE	555,881	64.020	35,587,501.620	
COPART INC	58,789	78.890	4,637,864.210	
COGNEX CORP	25,772	49.600	1,278,291.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	107,989	80.590	8,702,833.510	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	36,790	176.570	6,496,010.300	
MOLINA HEALTHCARE INC	7,515	299.530	2,250,967.950	
NRG ENERGY, INC.	28,364	31.280	887,225.920	
COMCAST CORP-CL A	582,232	40.430	23,539,639.760	
CONAGRA BRANDS INC	60,680	37.820	2,294,917.600	
CONSOLIDATED EDISON INC	48,354	99.490	4,810,739.460	
CMS ENERGY CORP	36,631	61.980	2,270,389.380	
COOPER COS INC	6,342	385.940	2,447,631.480	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	64.890	1,640,484.090	
CORNING INC	107,051	31.480	3,369,965.480	
WOLFSPEED INC	15,684	40.970	642,573.480	
SEALED AIR CORP	17,610	42.540	749,129.400	
HEICO CORP-CL A	9,463	135.470	1,281,952.610	
CUMMINS INC	19,320	226.380	4,373,661.600	
DARLING INTERNATIONAL INC	20,032	57.690	1,155,646.080	
DR HORTON INC	44,965	108.120	4,861,615.800	

DANAHER CORP	93,159	242.440	22,585,467.960	
MOODY'S CORP	22,447	304.640	6,838,254.080	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	70,798	63.290	4,480,805.420	
TARGET CORP	62,648	156.300	9,791,882.400	
DEERE & CO	38,577	381.090	14,701,308.930	
MORGAN STANLEY	170,897	84.880	14,505,737.360	
REPUBLIC SERVICES INC	30,250	145.860	4,412,265.000	
COSTAR GROUP INC	53,950	74.600	4,024,670.000	
THE WALT DISNEY CO	245,462	100.520	24,673,840.240	
DOLLAR TREE INC	30,183	155.470	4,692,551.010	
DOVER CORP	17,510	144.510	2,530,370.100	
OMNICOM GROUP	26,570	89.750	2,384,657.500	
DTE ENERGY CO	27,080	113.360	3,069,788.800	
DUKE ENERGY CORP	104,098	99.360	10,343,177.280	
DARDEN RESTAURANTS INC	15,676	153.090	2,399,838.840	
EBAY INC	75,181	45.630	3,430,509.030	
BANK OF AMERICA CORP	972,706	27.710	26,953,683.260	
CITIGROUP INC	259,721	46.320	12,030,276.720	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	80.950	1,359,150.500	
EATON CORP PLC	53,791	171.050	9,200,950.550	
CADENCE DESIGN SYS INC	37,427	205.240	7,681,517.480	
DISH NETWORK CORP	24,416	7.120	173,841.920	
ECOLAB INC	35,033	173.670	6,084,181.110	
PERKINELMER INC	17,972	129.870	2,334,023.640	
ELECTRONIC ARTS INC	37,893	125.420	4,752,540.060	
SALESFORCE INC	134,432	197.590	26,562,418.880	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	228.030	768,917.160	
EMERSON ELECTRIC CO	80,180	84.400	6,767,192.000	
ATMOS ENERGY CORP	17,504	117.560	2,057,770.240	
ENTERGY CORP	26,546	107.360	2,849,978.560	
EOG RESOURCES INC	80,746	114.170	9,218,770.820	
EQUIFAX INC	17,053	200.110	3,412,475.830	
EQT CORP	40,996	32.350	1,326,220.600	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	31,545	203.540	6,420,669.300	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	20,309	117.670	2,389,760.030	
EXXON MOBIL CORP	556,010	108.680	60,427,166.800	
FMC CORP	17,711	113.490	2,010,021.390	
NEXTERA ENERGY INC	267,991	75.510	20,236,000.410	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	405.850	2,196,460.200	
FAIR ISAAC CORP	3,376	731.980	2,471,164.480	
ASSURANT INC	8,276	130.940	1,083,659.440	
FASTENAL CO	78,930	54.660	4,314,313.800	
FIFTH THIRD BANCORP	87,493	24.920	2,180,325.560	
M&T BANK CORP	24,502	118.580	2,905,447.160	
FIRST HORIZON CORP	69,634	10.940	761,795.960	
FISERV INC	81,733	120.300	9,832,479.900	
FORD MOTOR CO	538,775	11.990	6,459,912.250	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	25.540	968,374.640	

FREEMPORT-MCMORAN INC	187,677	36.470	6,844,580.190	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	1,003.730	1,592,919.510	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	27,730	213.820	5,929,228.600	
DENTSPLY SIRONA INC	33,798	41.300	1,395,857.400	
GENERAL DYNAMICS CORP	32,087	211.920	6,799,877.040	
GENERAL MILLS INC	78,625	89.810	7,061,311.250	
GENUINE PARTS CO	17,649	173.730	3,066,160.770	
GILEAD SCIENCES INC	168,328	79.750	13,424,158.000	
GARTNER INC	10,481	303.570	3,181,717.170	
MCKESSON CORP	19,309	365.870	7,064,583.830	
NVIDIA CORP	332,062	286.800	95,235,381.600	
GRACO INC	23,985	78.640	1,886,180.400	
GENERAL ELECTRIC CO	146,590	100.240	14,694,181.600	
WW GRAINGER INC	6,276	675.510	4,239,500.760	
HALLIBURTON CO	125,763	29.880	3,757,798.440	
MONSTER BEVERAGE CORP	106,953	59.710	6,386,163.630	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	45,599	327.020	14,911,784.980	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	26,202	187.730	4,918,901.460	
HASBRO INC	21,174	60.380	1,278,486.120	
HENRY SCHEIN INC	17,431	79.750	1,390,122.250	
HEICO CORP	6,878	170.090	1,169,879.020	
HERSHEY FOODS CORP	20,089	275.330	5,531,104.370	
HP INC	138,109	30.130	4,161,224.170	
F5 INC	8,981	133.220	1,196,448.820	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	85.730	1,313,555.060	
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,222	214.120	1,332,254.640	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	28.850	1,261,177.750	
HOLOGIC INC	34,146	83.740	2,859,386.040	
HOME DEPOT INC	137,588	289.620	39,848,236.560	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	96.630	2,543,204.970	
HORMEL FOODS CORP	38,851	41.200	1,600,661.200	
CENTERPOINT ENERGY INC	80,118	30.520	2,445,201.360	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,776	282.560	1,349,506.560	
HUBBELL INC	6,903	272.090	1,878,237.270	
HUMANA INC	17,317	535.020	9,264,941.340	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,380	179.120	1,859,265.600	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	182,806	9.850	1,800,639.100	
BIOGEN INC	19,778	318.060	6,290,590.680	
IDEX CORP	9,332	210.930	1,968,398.760	
ILLINOIS TOOL WORKS	41,288	230.310	9,509,039.280	
INTUIT INC	35,622	425.950	15,173,190.900	
IDEXX LABORATORIES INC	11,400	488.490	5,568,786.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	31,231	176.810	5,521,953.110	
INTEL CORP	555,519	30.990	17,215,533.810	
INTL FLAVORS &	35,897	96.450	3,462,265.650	

FRAGRANCES				
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	32.350	1,428,349.550	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	35.590	1,924,102.170	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9,506	152.930	1,453,752.580	
INCYTE CORP	24,449	66.560	1,627,325.440	
JOHNSON & JOHNSON	353,492	162.680	57,506,078.560	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	44,033	69.730	3,070,421.090	
KLA CORPORATION	19,222	385.660	7,413,156.520	
DEVON ENERGY CORP	86,347	50.360	4,348,434.920	
KELLOGG CO	32,655	70.350	2,297,279.250	
KEYCORP	118,955	9.830	1,169,327.650	
KIMBERLY-CLARK CORP	46,140	145.180	6,698,605.200	
BLACKROCK INC/NEW YORK	20,163	644.480	12,994,650.240	
KROGER CO	93,167	49.230	4,586,611.410	
LAM RESEARCH CORP	18,529	529.760	9,815,923.040	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	413.000	2,709,693.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,551	135.370	1,834,398.870	
AKAMAI TECHNOLOGIES	19,837	78.560	1,558,394.720	
PLUG POWER INC	74,825	9.290	695,124.250	
LENNAR CORP	32,795	113.440	3,720,264.800	
ELI LILLY & CO	109,033	427.810	46,645,407.730	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	33.710	949,138.760	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	98,414	175.740	17,295,276.360	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	40,493	133.300	5,397,716.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	31,757	455.540	14,466,583.780	
LOEWS CORP	29,698	58.620	1,740,896.760	
LOWE'S COS INC	81,444	205.810	16,761,989.640	
DOMINION ENERGY INC	114,318	56.490	6,457,823.820	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	43.140	1,742,899.140	
MCCORMICK & CO INC	35,510	88.950	3,158,614.500	
MCDONALD'S CORPORATION	98,911	296.600	29,337,002.600	
S&P GLOBAL INC	44,553	354.190	15,780,227.070	
EVEREST RE GROUP LTD	5,666	375.400	2,127,016.400	
MARKEL CORPORATION	1,713	1,352.130	2,316,198.690	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	82,034	88.740	7,279,697.160	
MARSH & MCLENNAN COS	66,743	179.360	11,971,024.480	
MASCO CORP	28,937	53.450	1,546,682.650	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	8,614	397.660	3,425,443.240	
METLIFE INC	90,251	54.660	4,933,119.660	
MEDTRONIC PLC	179,327	90.060	16,150,189.620	
ACTIVISION BLIZZARD INC	106,328	76.000	8,080,928.000	

CVS HEALTH CORP	177,420	70.680	12,540,045.600	
MERCK & CO. INC.	342,191	117.680	40,269,036.880	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,157	81.220	4,804,731.540	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,455	223.860	2,564,316.300	
MICROSOFT CORP	956,655	310.650	297,184,875.750	
MICRON TECH INC	147,693	61.230	9,043,242.390	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	74,690	75.180	5,615,194.200	
3M CO	75,232	103.350	7,775,227.200	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	100.220	632,488.420	
ENTEGRIS INC	20,987	78.770	1,653,145.990	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	6,445	191.250	1,232,606.250	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,690	281.560	6,388,596.400	
ILLUMINA INC	21,684	199.660	4,329,427.440	
XCEL ENERGY INC	74,522	69.570	5,184,495.540	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,755	97.400	1,437,137.000	
NETAPP INC	28,265	63.850	1,804,720.250	
NEWELL BRANDS INC	41,984	10.110	424,458.240	
NEWMONT CORP	107,944	48.720	5,259,031.680	
NVR INC	405	5,852.470	2,370,250.350	
NIKE INC-CL B	169,660	126.590	21,477,259.400	
NORDSON CORP	6,447	220.170	1,419,435.990	
NORFOLK SOUTHERN CORP	31,621	208.720	6,599,935.120	
EVERSOURCE ENERGY	48,081	77.440	3,723,392.640	
NISOURCE INC	53,270	28.540	1,520,325.800	
NORTHERN TRUST CORP	28,092	73.030	2,051,558.760	
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,567	446.810	8,742,731.270	
WELLS FARGO & CO	512,918	37.940	19,460,108.920	
NUCOR CORP	34,996	142.320	4,980,630.720	
CHENIERE ENERGY INC	30,839	148.190	4,570,031.410	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	52,546	88.010	4,624,573.460	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,019	60.690	6,009,463.110	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13,006	316.970	4,122,511.820	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,516	940.780	8,011,682.480	
ORACLE CORP	218,251	96.970	21,163,799.470	
PACCAR INC	71,053	72.760	5,169,816.280	
PTC INC	15,968	129.060	2,060,830.080	
EXELON CORP	134,582	42.850	5,766,838.700	
PARKER HANNIFIN CORP	17,462	333.300	5,820,084.600	
PAYCHEX INC	44,228	107.830	4,769,105.240	
ALIGN TECHNOLOGY INC	9,713	313.640	3,046,385.320	
PPL CORPORATION	102,363	28.750	2,942,936.250	
PEPSICO INC	186,384	194.270	36,208,819.680	
PENTAIR PLC	25,821	57.870	1,494,261.270	



PFIZER INC	758,190	38.490	29,182,733.100	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	43.070	1,412,523.720	
CONOCOPHILLIPS	167,119	100.370	16,773,734.030	
PG&E CORP	197,651	17.270	3,413,432.770	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	31,078	212.220	6,595,373.160	
ALTRIA GROUP INC	243,422	46.690	11,365,373.180	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	55,104	116.180	6,401,982.720	
BROWN & BROWN INC	30,650	65.310	2,001,751.500	
GARMIN LTD	19,911	103.780	2,066,363.580	
PPG INDUSTRIES INC	31,297	138.030	4,319,924.910	
COSTCO WHOLESALE CORP	59,677	499.060	29,782,403.620	
T ROWE PRICE GROUP INC	31,190	107.470	3,351,989.300	
QUEST DIAGNOSTICS	14,536	136.510	1,984,309.360	
PROCTER & GAMBLE CO	320,215	156.030	49,963,146.450	
PROGRESSIVE CORP	78,404	129.520	10,154,886.080	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68,538	63.820	4,374,095.160	
PULTE GROUP INC	29,050	67.020	1,946,931.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,196	104.780	3,897,396.880	
QUALCOMM INC	151,084	108.780	16,434,917.520	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	25,844	86.200	2,227,752.800	
EXACT SCIENCES CORP	23,386	67.300	1,573,877.800	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	7,931	243.560	1,931,674.360	
REGENERON PHARMACEUTICALS	14,366	762.100	10,948,328.600	
REPLIGEN CORP	6,730	160.160	1,077,876.800	
RESMED INC	20,171	231.650	4,672,612.150	
US BANCORP	192,993	30.740	5,932,604.820	
SEAGEN INC	18,653	199.870	3,728,175.110	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	46,675	74.810	3,491,756.750	
ROSS STORES INC	47,578	104.440	4,969,046.320	
ROLLINS INC	25,920	41.770	1,082,678.400	
ROPER TECHNOLOGIES INC	14,373	458.120	6,584,558.760	
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,768	283.420	4,468,966.560	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	31,833	75.610	2,406,893.130	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	81.210	1,337,285.070	
ACCENTURE PLC-CL A	84,849	265.650	22,540,136.850	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	182,912	77.560	14,186,654.720	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,340	227.820	3,266,938.800	
AXON ENTERPRISE INC	9,177	219.910	2,018,114.070	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	31,733	182.300	5,784,925.900	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	82,528	55.750	4,600,936.000	

BOOKING HOLDINGS INC	5,209	2,569.300	13,383,483.700
SCHLUMBERGER LTD	193,046	45.750	8,831,854.500
SCHWAB (CHARLES) CORP	197,863	49.240	9,742,774.120
POOL CORP	5,406	353.960	1,913,507.760
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	28,920	137.910	3,988,357.200
BUNGE LTD	21,715	90.550	1,966,293.250
SEI INVESTMENTS CO	14,477	59.330	858,920.410
ELEVANCE HEALTH INC	32,178	464.470	14,945,715.660
AMERISOURCEBERGEN CORP	21,286	167.990	3,575,835.140
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31,921	71.510	2,282,670.710
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	33,603	230.840	7,756,916.520
CENTENE CORP	78,244	68.390	5,351,107.160
SMITH (A. O.) CORP	19,467	70.380	1,370,087.460
SNAP-ON INC	7,068	260.810	1,843,405.080
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	50,944	82.050	4,179,955.200
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	123.770	886,812.050
EDISON INTERNATIONAL	52,609	73.560	3,869,918.040
SOUTHERN CO	146,824	74.940	11,002,990.560
TRUIST FINANCIAL CORP	182,655	28.690	5,240,371.950
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	29.660	584,302.000
AT&T INC	962,665	17.130	16,490,451.450
CHEVRON CORP	248,161	160.210	39,757,873.810
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	85.470	1,647,006.900
STATE STREET CORP	50,667	68.500	3,470,689.500
STARBUCKS CORP	154,460	107.210	16,559,656.600
STEEL DYNAMICS INC	22,937	98.200	2,252,413.400
STRYKER CORP	45,731	284.710	13,020,073.010
NETFLIX INC	59,920	322.760	19,339,779.200
GEN DIGITAL INC	89,004	17.150	1,526,418.600
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,318	58.080	1,180,069.440
SYNOPSYS INC	20,823	371.560	7,736,993.880
SYSCO CORP	67,797	76.770	5,204,775.690
INTUITIVE SURGICAL INC	47,389	304.880	14,447,958.320
TELEFLEX INC	6,985	257.950	1,801,780.750
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	134,781	8.770	1,182,029.370
TERADYNE INC	22,066	92.630	2,043,973.580
TEXAS INSTRUMENTS INC	122,437	165.820	20,302,503.340
TEXTRON INC	25,824	66.150	1,708,257.600
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	52,868	546.380	28,886,017.840
GLOBE LIFE INC	12,153	108.290	1,316,048.370
TORO CO	14,644	105.910	1,550,946.040
DAVITA INC	6,813	88.470	602,746.110
TRACTOR SUPPLY CO	15,260	240.330	3,667,435.800

BIO-TECHNE CORP	20,652	83.130	1,716,800.760
TRIMBLE INC	36,251	48.050	1,741,860.550
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,112	389.740	1,992,350.880
TYSON FOODS INC	41,316	60.690	2,507,468.040
UGI CORP	33,476	30.500	1,021,018.000
MARATHON OIL CORP	84,059	22.930	1,927,472.870
UNION PACIFIC CORP	82,657	201.230	16,633,068.110
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	197,362	96.580	19,061,221.960
UNITEDHEALTH GROUP INC	126,297	494.280	62,426,081.160
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	142.800	1,156,108.800
VF CORP	51,762	22.120	1,144,975.440
PARAMOUNT GLOBAL	78,663	16.860	1,326,258.180
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	34,956	348.090	12,167,834.040
VULCAN MATERIALS CO	18,430	193.570	3,567,495.100
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	98,551	32.170	3,170,385.670
WALMART INC	201,882	151.770	30,639,631.140
WASTE MANAGEMENT INC	55,635	168.430	9,370,603.050
WATERS CORP	8,441	296.790	2,505,204.390
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	33.940	756,352.900
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	9,673	368.460	3,564,113.580
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,386	158.200	2,434,065.200
VAIL RESORTS INC	5,235	238.270	1,247,343.450
WESTERN DIGITAL CORP	40,723	33.450	1,362,184.350
WABTEC CORP	24,118	99.170	2,391,782.060
WHIRLPOOL CORP	6,832	137.020	936,120.640
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	104.120	2,315,108.200
WYNN RESORTS LTD	15,379	110.780	1,703,685.620
NASDAQ INC	47,600	54.920	2,614,192.000
CME GROUP INC	48,821	185.130	9,038,231.730
WILLIAMS COS INC	166,525	30.180	5,025,724.500
LKQ CORP	31,504	57.070	1,797,933.280
ALLIANT ENERGY CORP	33,966	55.110	1,871,866.260
WEC ENERGY GROUP INC	43,488	96.010	4,175,282.880
CARMAX INC	22,414	70.610	1,582,652.540
TJX COMPANIES INC	155,600	78.500	12,214,600.000
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	6,730	273.800	1,842,674.000
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	4.400	686,615.600
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	49.350	1,161,106.800
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,146	212.050	3,635,809.300
CBRE GROUP INC	41,089	74.550	3,063,184.950
LIBERTY GLOBAL PLC	35,049	18.970	664,879.530
REGIONS FINANCIAL CORP	122,025	16.540	2,018,293.500

DOMINO'S PIZZA INC	5,137	311.110	1,598,172.070	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,003	411.270	2,468,853.810	
WESTLAKE CORP	4,187	121.290	507,841.230	
T-MOBILE US INC	83,642	143.560	12,007,645.520	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	61.650	2,948,103.000	
MOSAIC CO/THE	48,502	39.110	1,896,913.220	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	300.330	1,462,907.430	
CELANESE CORP	13,613	105.900	1,441,616.700	
DEXCOM INC	52,999	120.820	6,403,339.180	
EXPEDIA GROUP INC	19,389	93.540	1,813,647.060	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	25,070	69.640	1,745,874.800	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,506	291.180	4,223,857.080	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	19.790	713,112.860	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	75,703	108.310	8,199,391.930	
LIVE NATION	25,515	77.160	1,968,737.400	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,784	2,028.210	7,674,746.640	
TRANSDIGM GROUP INC	7,059	767.190	5,415,594.210	
MASTERCARD INC	116,035	384.660	44,634,023.100	
OWENS CORNING	13,227	104.860	1,386,983.220	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	80.830	1,459,870.630	
AERCAP HOLDINGS NV	24,379	55.470	1,352,303.130	
FIRST SOLAR INC	13,287	178.600	2,373,058.200	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	15,300	152.870	2,338,911.000	
AECOM TECHNOLOGY CORP	17,000	83.700	1,422,900.000	
DELTA AIR LINES INC	21,592	33.940	732,832.480	
INSULET CORP	9,083	328.760	2,986,127.080	
DISCOVER FINANCIAL	35,918	95.960	3,446,691.280	
TE CONNECTIVITY LTD	43,069	122.940	5,294,902.860	
MASIMO CORP	7,328	187.900	1,376,931.200	
LULULEMON ATHLETICA INC	15,887	386.710	6,143,661.770	
VMWARE INC	29,109	124.120	3,613,009.080	
MERCADOLIBRE INC	6,180	1,243.590	7,685,386.200	
ULTA BEAUTY INC	6,797	520.050	3,534,779.850	
INVESCO LTD	57,267	16.570	948,914.190	
MSCI INC	10,921	473.650	5,172,731.650	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	209,639	95.560	20,033,102.840	
VISA INC	219,836	231.780	50,953,588.080	
KEURIG DR PEPPER INC	105,959	33.230	3,521,017.570	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,549	148.430	3,940,668.070	
MARATHON PETROLEUM CORP	63,984	106.900	6,839,889.600	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	63.850	1,033,220.700	

KINDER MORGAN INC/DELAWARE	279,350	17.040	4,760,124.000
XYLEM INC	25,527	108.970	2,781,677.190
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	33,932	92.400	3,135,316.800
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,330	197.510	1,250,238.300
SPLUNK INC	20,626	85.250	1,758,366.500
EPAM SYSTEMS INC	8,162	242.470	1,979,040.140
HCA HEALTHCARE INC	28,857	278.060	8,023,977.420
VERISK ANALYTICS INC	21,512	210.880	4,536,450.560
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,792	139.400	1,086,204.800
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,881	231.190	2,053,198.390
NXP SEMICONDUCTOR NV	35,214	166.820	5,874,399.480
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,741	93.080	1,837,492.280
TARGA RESOURCES CORP	26,950	71.880	1,937,166.000
LEAR CORP	9,620	123.600	1,189,032.000
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,261	136.580	2,084,347.380
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	28,639	55.350	1,585,168.650
DOLLAR GENERAL CORP	30,721	218.950	6,726,362.950
FORTINET INC	90,828	64.590	5,866,580.520
HORIZON PHARMA PLC	28,293	112.380	3,179,567.340
TESLA INC	362,277	170.060	61,608,826.620
GENERAC HOLDINGS INC	9,111	114.180	1,040,293.980
ENPHASE ENERGY INC	18,723	159.650	2,989,126.950
GENERAL MOTORS CO	193,897	33.260	6,449,014.220
ALLY FINANCIAL INC	39,230	25.320	993,303.600
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	10,655	190.820	2,033,187.100
APTIV PLC	37,576	93.420	3,510,349.920
PHILLIPS 66	64,680	93.440	6,043,699.200
META PLATFORMS INC	303,449	232.780	70,636,858.220
IQVIA HOLDINGS INC	25,473	188.520	4,802,169.960
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,180	132.800	2,812,704.000
SERVICENOW INC	27,592	434.800	11,997,001.600
PALO ALTO NETWORKS INC	41,229	183.930	7,583,249.970
WORKDAY INC	26,011	181.480	4,720,476.280
ABBVIE INC	238,853	148.030	35,357,409.590
ZOETIS INC	63,475	186.230	11,820,949.250
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	17.120	928,092.320
CDW CORP	18,651	165.990	3,095,879.490
HOWMET AEROSPACE INC	47,590	44.000	2,093,960.000
TWILIO INC	25,710	52.370	1,346,432.700
SNAP INC	152,250	8.230	1,253,017.500
TRADE DESK INC A	61,854	62.700	3,878,245.800
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	28,191	73.470	2,071,192.770

LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	28.950	256,062.750
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	28.810	572,483.510
OKTA INC	21,831	73.780	1,610,691.180
BLACK KNIGHT INC	21,663	54.060	1,171,101.780
BAKER HUGHES CO	137,839	28.220	3,889,816.580
LAMB WESTON HOLDINGS INC	18,557	112.090	2,080,054.130
BROADCOM INC	56,286	630.120	35,466,934.320
ARES MANAGEMENT CORP	19,534	81.950	1,600,811.300
MONGODB INC	9,021	241.290	2,176,677.090
BURLINGTON STORES INC	8,453	183.860	1,554,168.580
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	61,321	9.310	570,898.510
VEEVA SYSTEMS INC	18,727	179.100	3,354,005.700
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,938	41.560	1,036,423.280
EVERGY INC	33,192	62.590	2,077,487.280
ALLEGION PLC	13,423	108.090	1,450,892.070
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	56.700	1,038,403.800
STERIS PLC	14,147	189.180	2,676,329.460
DOCUSIGN INC	26,362	48.730	1,284,620.260
WIX.COM LTD	8,997	76.850	691,419.450
DROPBOX INC	45,227	21.310	963,787.370
KKR & CO INC	74,006	51.510	3,812,049.060
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	42.410	214,170.500
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,770	63.400	1,760,618.000
MODERNA INC	44,693	137.040	6,124,728.720
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	35,250	144.610	5,097,502.500
ARAMARK	31,133	34.790	1,083,117.070
CIGNA GROUP	41,150	260.740	10,729,451.000
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	45.390	1,487,430.300
DOW INC	96,707	54.410	5,261,827.870
OVINTIV INC	31,603	34.690	1,096,308.070
AMCOR PLC	188,789	10.420	1,967,181.380
PINTEREST INC	79,624	21.010	1,672,900.240
FOX CORP-A	36,501	31.970	1,166,936.970
FOX CORP-B	28,295	29.390	831,590.050
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	7.650	325,782.900
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	28,442	122.450	3,482,722.900
CHEWY INC	9,648	33.120	319,541.760
AVANTOR INC	97,157	20.050	1,947,997.850
DYNATRACE INC	32,648	43.960	1,435,206.080
CLOUDFLARE INC	35,474	44.070	1,563,339.180
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	71.840	991,392.000
CARRIER GLOBAL CORP	113,892	42.380	4,826,742.960
OTIS WORLDWIDE CORP	56,437	85.960	4,851,324.520
UBER TECHNOLOGIES INC	204,870	37.750	7,733,842.500
CORTEVA INC	97,725	58.250	5,692,481.250
MATCH GROUP INC	35,259	33.220	1,171,303.980
FERGUSON PLC	27,517	139.510	3,838,896.670

BILL HOLDINGS INC	11,988	94.040	1,127,351.520
BLACKSTONE INC	95,741	82.160	7,866,080.560
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,322	173.320	922,409.040
CARLYLE GROUP INC	24,530	26.700	654,951.000
DATADOG INC	35,218	76.570	2,696,642.260
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	55.940	1,437,042.660
INGERSOLL RAND INC	50,384	59.170	2,981,221.280
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	50,030	78.990	3,951,869.700
PAYCOM SOFTWARE INC	7,334	272.630	1,999,468.420
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	13.410	514,166.220
UNITY SOFTWARE INC	30,839	26.460	815,999.940
AON PLC	27,982	328.400	9,189,288.800
WARNER BROS DISCOVERY INC	320,115	12.890	4,126,282.350
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,412.150	1,279,407.900
BENTLEY SYSTEMS INC	28,502	42.600	1,214,185.200
COINBASE GLOBAL INC	17,399	58.240	1,013,317.760
AIRBNB INC	51,788	119.900	6,209,381.200
CONSTELLATION ENERGY CORP	44,942	79.490	3,572,439.580
ROYALTY PHARMA PLC	48,700	35.100	1,709,370.000
ROBLOX CORP	51,683	35.050	1,811,489.150
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	41,904	20.550	861,127.200
VIATRIS INC	150,826	9.280	1,399,665.280
CAESARS ENTERTAINMENT INC	26,734	44.680	1,194,475.120
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	78.640	1,246,129.440
HF SINCLAIR CORP	20,299	38.380	779,075.620
SNOWFLAKE INC	30,955	154.170	4,772,332.350
DOORDASH INC	33,971	62.900	2,136,775.900
ARISTA NETWORKS INC	33,511	137.980	4,623,847.780
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	55,400	60.530	3,353,362.000
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	234,244	7.410	1,735,748.040
FNF GROUP	31,004	34.140	1,058,476.560
JACOBS SOLUTIONS INC	16,615	119.130	1,979,344.950
MARVELL TECHNOLOGY INC	117,157	40.970	4,799,922.290
APA CORP	40,946	33.220	1,360,226.120
LINDE PLC	66,552	366.370	24,382,656.240
LUCID GROUP INC	44,910	7.730	347,154.300
U-HAUL HOLDING CO	11,981	54.850	657,157.850
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	172.570	642,132.970
TOAST INC	32,620	18.430	601,186.600
GRAB HOLDINGS LTD	168,328	3.020	508,350.560
CATALENT INC	20,564	47.750	981,931.000
SYNCHRONY FINANCIAL	65,868	27.340	1,800,831.120

	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	63,378	26.440	1,675,714.320	
	CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	132.880	695,892.560	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22,760	143.660	3,269,701.600	
	HUBSPOT INC	5,895	444.210	2,618,617.950	
	QORVO INC	14,144	92.910	1,314,119.040	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	80.120	1,228,640.200	
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	7,789	293.390	2,285,214.710	
	GODADDY INC	19,713	69.650	1,373,010.450	
	ETSY INC	18,558	90.000	1,670,220.000	
	TRANSUNION	25,708	64.690	1,663,050.520	
	ALCOA CORP	23,941	36.150	865,467.150	
	BLOCK INC	74,347	59.250	4,405,059.750	
	DUPONT DE NEMOURS INC	68,003	65.510	4,454,876.530	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	26,221	65.600	1,720,097.600	
	WESTROCK CO	34,286	28.450	975,436.700	
	KRAFT HEINZ CO	101,276	41.320	4,184,724.320	
	NOVOCURE LTD	12,317	68.230	840,388.910	
	FORTIVE CORP	42,608	64.720	2,757,589.760	
	WASTE CONNECTIONS INC	35,315	140.820	4,973,058.300	
	ALPHABET INC-CL A	803,970	105.570	84,875,112.900	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	173,258	14.110	2,444,670.380	
	PAYPAL HOLDINGS INC	145,052	74.970	10,874,548.440	
	SEA LTD ADR	50,316	78.410	3,945,277.560	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,768	24.030	1,364,135.040	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	48.680	1,089,166.320	
	ALPHABET INC-CL C	742,419	106.215	78,856,034.080	
	ZSCALER INC	12,304	89.460	1,100,715.840	
	ATLASSIAN CORP PLC	19,972	135.730	2,710,799.560	
	ROKU INC	15,660	54.970	860,830.200	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,968	350.850	5,251,522.800	
	VISTRA CORP	49,633	23.420	1,162,404.860	
アメリカ・ドル	小計	45,712,229		4,817,271,342.470 (651,006,049,224)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	14.695	675,426.280	
	ASHTREAD GROUP	58,565	46.370	2,715,659.050	
	SEVERN TRENT PLC	31,034	29.750	923,261.500	
	BARCLAYS PLC	2,207,571	1.532	3,381,998.770	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	5.034	625,202.660	
	BT GROUP PLC	904,198	1.555	1,406,027.890	
	BUNZL PLC	46,691	31.730	1,481,505.430	
	AVIVA PLC	353,288	4.146	1,464,732.040	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	68.440	1,408,016.120	



DIAGEO PLC	306,300	36.705	11,242,741.500
SCHRODERS PLC	110,366	4.698	518,499.460
DCC PLC	16,599	48.650	807,541.350
NATIONAL GRID PLC	497,162	11.505	5,719,848.810
KINGFISHER PLC	225,392	2.529	570,016.360
BAE SYSTEMS PLC	425,672	9.902	4,215,004.140
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	289,114	28.040	8,106,756.560
HALMA PLC	51,066	23.900	1,220,477.400
NEXT PLC	16,093	68.000	1,094,324.000
IMPERIAL BRANDS PLC	125,526	19.000	2,384,994.000
JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	19.435	388,233.560
ANGLO AMERICAN PLC	176,521	24.470	4,319,468.870
COMPASS GROUP PLC	240,717	20.690	4,980,434.730
HSBC HOLDINGS PLC	2,680,375	5.998	16,076,889.250
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.283	1,955,158.910
UNILEVER PLC	341,116	43.990	15,005,692.840
UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.945	991,277.700
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	19.230	814,409.730
PEARSON PLC	84,159	8.246	693,975.110
PERSIMMON PLC	56,474	13.675	772,281.950
PRUDENTIAL PLC	379,082	11.885	4,505,389.570
RIO TINTO PLC	153,140	49.920	7,644,748.800
VODAFONE GROUP PLC	3,693,933	0.950	3,509,236.350
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	97,637	64.340	6,281,964.580
RELX PLC	259,441	24.340	6,314,793.940
RENTOKIL INITIAL PLC	317,679	6.304	2,002,648.410
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	1.511	1,695,227.160
NATWEST GROUP PLC	684,417	2.593	1,774,693.280
ST JAMES' S PLACE PLC	67,448	11.265	759,801.720
SSE PLC	145,097	18.615	2,700,980.650
BP PLC	2,434,799	4.923	11,986,515.470
SAGE GROUP PLC (THE)	128,893	8.124	1,047,126.730
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.720	864,340.400
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	114.450	1,230,451.950
STANDARD CHARTERED PLC	316,670	6.052	1,916,486.840
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,257,724	0.458	4,240,037.590
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.260	718,027.380
TESCO PLC	1,032,016	2.830	2,920,605.280
3I GROUP PLC	125,530	17.730	2,225,646.900
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	12.660	1,594,273.800
GSK PLC	553,801	14.624	8,098,785.820
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	51,576	83.580	4,310,722.080
WPP PLC	142,785	8.890	1,269,358.650

	ASTRAZENECA PLC	208,861	119.220	24,900,408.420	
	WHITBREAD PLC	25,470	32.530	828,539.100	
	INTERTEK GROUP PLC	23,309	42.180	983,173.620	
	BURBERRY GROUP PLC	52,229	25.430	1,328,183.470	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	54.120	1,177,218.240	
	SAINSBURY (J) PLC	283,091	2.873	813,320.440	
	ADMIRAL GROUP PLC	21,325	22.360	476,827.000	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	44.660	736,398.740	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	18.740	345,846.700	
	ABRDN PLC	285,831	2.074	592,813.490	
	EXPERIAN PLC	121,741	26.930	3,278,485.130	
	MONDI PLC	58,887	12.820	754,931.340	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.924	292,728.400	
	OCADO GROUP PLC	69,766	4.955	345,690.530	
	INFORMA PLC	186,195	6.948	1,293,682.860	
	GLENCORE PLC	1,408,346	4.441	6,254,464.580	
	ENTAIN PLC	74,451	14.790	1,101,130.290	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	25.200	782,082.000	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,717	5.776	500,877.390	
	M&G PLC	270,401	2.029	548,643.620	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.626	621,247.440	
	HALEON PLC	703,324	3.415	2,401,851.460	
	SHELL PLC	951,603	23.905	22,748,069.710	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	6.430	712,656.190	
	イギリス・ポンド 小計	37,614,981		249,390,989.480 (42,566,054,084)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	32.410	6,073,763.640	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	228,914	28.900	6,615,614.600	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	5.150	1,482,030.950	
	FIRST INTERNATIONAL BANK OF ISRAEL LTD/THE	7,896	137.700	1,087,279.200	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	702.300	2,338,659.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	157.400	1,979,147.600	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.480	3,011,205.120	
	ICL GROUP LTD	103,067	22.390	2,307,670.130	
	NICE LTD	9,053	686.600	6,215,789.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	121.800	2,124,192.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	217.000	1,013,824.000	
	イスラエル・シュケル 小計	1,025,067		34,249,176.040 (1,271,034,872)	
オーストラリア・ ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	60.430	1,710,531.580	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	478,692	21.350	10,220,074.200	

FORTESCUE METALS GROUP LTD	234,609	20.250	4,750,832.250
TELSTRA GROUP LTD	482,855	4.330	2,090,762.150
ASX LTD	23,664	69.150	1,636,365.600
BHP GROUP LTD	680,355	44.050	29,969,637.750
AMPOL LTD	31,828	29.350	934,151.800
COMPUTERSHARE LT	72,081	21.750	1,567,761.750
CSL LIMITED	65,382	301.050	19,683,251.100
REA GROUP LTD	6,134	138.390	848,884.260
TRANSURBAN GROUP	405,358	14.730	5,970,923.340
COCHLEAR LTD	8,356	245.590	2,052,150.040
ORIGIN ENERGY LTD	213,229	8.420	1,795,388.180
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	227,639	96.130	21,882,937.070
RIO TINTO LIMITED	49,873	109.370	5,454,610.010
APA GROUP	164,300	10.410	1,710,363.000
ARISTOCRAT LEISU	76,675	37.570	2,880,679.750
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	4.960	1,786,006.720
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	33.640	2,044,201.880
IGO LTD	91,947	14.380	1,322,197.860
ORICA LTD	63,862	16.070	1,026,262.340
LEND LEASE CORP LTD	107,181	7.770	832,796.370
BLUESCOPE STEEL LTD	75,503	19.630	1,482,123.890
MACQUARIE GROUP LTD	50,698	177.350	8,991,290.300
SUNCORP GROUP LTD	161,737	12.500	2,021,712.500
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	430,429	26.580	11,440,802.820
NEWCREST MINING LTD	126,686	29.800	3,775,242.800
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.320	712,004.880
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	215,572	15.350	3,309,030.200
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	14.100	2,293,068.900
REECE LTD	31,558	18.090	570,884.220
SANTOS LTD	417,358	7.160	2,988,283.280
SONIC HEALTHCARE	64,897	35.730	2,318,769.810
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	31.610	821,385.850
WESFARMERS LTD	158,315	51.510	8,154,805.650
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	264,886	33.100	8,767,726.600
WOOLWORTHS GROUP LTD	169,400	39.080	6,620,152.000
SEEK LTD	39,064	23.600	921,910.400
MINERAL RESOURCES LTD	21,179	70.400	1,491,001.600
BRAMBLES LTD	177,669	14.180	2,519,346.420
PILBARA MINERALS LTD	327,947	4.400	1,442,966.800
AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.450	768,829.050
TREASURY WINE ESTATES	87,104	13.680	1,191,582.720

	LTD				
	XERO LTD	18,860	92.080	1,736,628.800	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	26.260	624,489.060	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	4.990	1,453,437.300	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	6.430	1,031,822.100	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	410,226	23.800	9,763,378.800	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.580	1,477,648.580	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	4.130	2,464,346.220	
	COLES GROUP LTD	171,684	18.250	3,133,233.000	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	68.000	1,449,080.000	
	オーストラリア・ドル 小計	9,384,345		217,907,753.550 (19,860,112,659)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	67,555	80.040	5,407,102.200	
	BARRICK GOLD CORP	239,565	27.050	6,480,233.250	
	BANK OF MONTREAL	90,726	117.730	10,681,171.980	
	BANK OF NOVA SCOTIA	160,517	66.940	10,745,007.980	
	NATIONAL BANK OF CANADA	46,066	101.560	4,678,462.960	
	BCE INC	7,697	64.440	495,994.680	
	BROOKFIELD CORP	194,244	41.980	8,154,363.120	
	SAPUTO INC	34,582	34.090	1,178,900.380	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	11.800	1,089,269.800	
	DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	11,508	102.220	1,176,347.760	
	CGI INC	27,918	134.490	3,754,691.820	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	64.050	1,348,764.900	
	CAE INC	40,808	29.550	1,205,876.400	
	CAMECO CORP	54,264	36.890	2,001,798.960	
	ROGERS COMM-CL B	46,626	65.890	3,072,187.140	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	123,724	55.560	6,874,105.440	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	151,940	77.090	11,713,054.600	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,465	174.650	1,129,112.250	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	39.320	642,095.600	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	77,911	163.070	12,704,946.770	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	39.490	857,446.370	
	OPEN TEXT CORP	33,217	55.410	1,840,553.970	
	EMPIRE CO LTD	20,608	35.140	724,165.120	
	KINROSS GOLD CORP	132,063	7.140	942,929.820	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	26,641	76.140	2,028,445.740	
	FORTIS INC	62,031	60.840	3,773,966.040	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	35.800	3,058,071.800	
	TELUS CORP	31,890	28.130	897,065.700	
	GREAT WEST LIFECO INC	34,208	38.530	1,318,034.240	
	IMPERIAL OIL LTD	27,246	62.340	1,698,515.640	
	ENBRIDGE INC	278,758	53.430	14,894,039.940	

IGM FINANCIAL INC	12,478	38.650	482,274.700
MANULIFE FINANCIAL CORP	249,587	26.490	6,611,559.630
LOBLAW CO LTD	21,600	122.340	2,642,544.000
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	112,792	67.210	7,580,750.320
MAGNA INTERNATIONAL INC	35,844	72.290	2,591,162.760
SUN LIFE FINANCIAL INC	81,434	65.130	5,303,796.420
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,229	929.420	3,001,097.180
METRO INC	30,428	77.000	2,342,956.000
EMERA INC	36,998	58.760	2,174,002.480
ONEX CORP	10,157	61.160	621,202.120
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	24.270	1,343,902.710
POWER CORP OF CANADA	76,591	35.810	2,742,723.710
QUEBECOR INC-B	17,195	33.640	578,439.800
ROYAL BANK OF CANADA	184,606	131.080	24,198,154.480
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	126,848	108.390	13,749,054.720
SUNCOR ENERGY INC	185,738	39.680	7,370,083.840
LUNDIN MINING CORP	77,139	10.710	826,158.690
TECK RESOURCES LTD-CL B	58,904	58.370	3,438,226.480
THOMSON REUTERS CORP	22,378	160.370	3,588,759.860
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,698	104.830	1,435,961.340
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	242,158	83.300	20,171,761.400
TC ENERGY CORP	139,293	55.940	7,792,050.420
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	100.380	813,278.760
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	175.110	1,722,907.290
INTACT FINANCIAL CORP	24,452	199.870	4,887,221.240
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	58,539	69.720	4,081,339.080
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,805	2,603.720	7,303,434.600
FRANCO-NEVADA CORP NPR	26,282	212.880	5,594,912.160
TOURMALINE OIL CORP	46,466	58.480	2,717,331.680
KEYERA CORP	39,467	31.390	1,238,869.130
PARKLAND CORP	15,665	33.010	517,101.650
ALTAGAS LTD	33,833	23.290	787,970.570
PEMBINA PIPELINE CORP	69,235	43.470	3,009,645.450
DOLLARAMA INC	36,204	82.960	3,003,483.840
CENOVUS ENERGY INC W/I	202,950	21.330	4,328,923.500
ARC RESOURCES LTD	78,639	17.250	1,356,522.750
NORTHLAND POWER INC	34,152	32.400	1,106,524.800
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	17.450	894,190.350
TMX GROUP LTD	7,040	140.840	991,513.600
BRP INC	4,307	99.210	427,297.470
IVANHOE MINES LTD	98,820	12.350	1,220,427.000
NUTRIEN LTD	71,801	87.030	6,248,841.030

	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	142.120	1,647,312.920	
	WSP GLOBAL INC	17,782	178.540	3,174,798.280	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,516	88.070	1,102,284.120	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	27,577	47.640	1,313,768.280	
	NUVEI CORP	7,929	54.540	432,447.660	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	46.870	754,747.610	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	43.290	2,261,859.210	
	AIR CANADA	41,444	20.460	847,944.240	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	41,208	95.800	3,947,726.400	
	SHOPIFY INC	158,231	83.040	13,139,502.240	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	196.340	1,028,232.580	
	HYDRO ONE LTD	46,225	39.590	1,830,047.750	
カナダ・ドル 小計		5,418,012		330,885,752.670 (33,406,225,590)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	169,000	3.620	611,780.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	244,510	31.900	7,799,869.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.000	275,800.000	
	SEATRUM LTD	7,235,222	0.130	940,578.860	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	33.760	523,280.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.540	952,092.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	1.100	837,312.300	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.450	1,192,605.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	459,198	12.650	5,808,854.700	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,092,930	2.590	2,830,688.700	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.880	956,676.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	153,766	27.990	4,303,910.340	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	7.100	309,560.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	17.060	747,228.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.880	1,002,980.000	
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	431,290	3.780	1,630,276.200		
シンガポール・ドル 小計		11,395,309		30,723,491.100 (3,131,338,213)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	57.360	1,361,382.240	
	NESTLE SA-REGISTERED	371,943	116.460	43,316,481.780	
	CIE FINANC RICHEMONT	70,991	147.950	10,503,118.450	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	94,934	283.700	26,932,775.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	201.400	1,069,635.400	
	SIKA INHABER	20,139	249.100	5,016,624.900	
	SGS SA-REG	23,250	81.180	1,887,435.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	291,679	93.210	27,187,399.590	

	BALOISE HOLDING AG -R	8,149	142.000	1,157,158.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,954.000	898,840.000	
	CLARIANT AG-REG	44,162	14.340	633,283.080	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	605.400	2,077,127.400	
	ABB LTD	212,002	32.040	6,792,544.080	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	29.680	588,910.560	
	GEBERIT AG	4,577	513.400	2,349,831.800	
	LONZA GROUP AG-REG	10,240	580.400	5,943,296.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	11,210.000	1,535,770.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	111,200.000	1,779,200.000	
	GIVAUDAN-REG	1,279	3,174.000	4,059,546.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	20,856	429.400	8,955,566.400	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,612	307.800	1,111,773.600	
	HOLCIM LTD	75,608	60.040	4,539,504.320	
	TEMENOS GROUP	7,082	72.580	514,011.560	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	105.000	490,665.000	
	SONOVA HOLDING AG	6,984	287.500	2,007,900.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,887	270.800	1,864,999.600	
	STRAUMANN HOLDING AG	14,531	142.050	2,064,128.550	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,215	297.400	956,141.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	54.600	505,541.400	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	191.800	521,696.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,978	548.200	2,180,739.600	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	90.650	444,456.950	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	732.000	592,920.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,636	80.100	1,092,243.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,956	861.000	2,545,116.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,865	62.600	1,681,749.000	
	SWISS RE LTD	41,653	88.780	3,697,953.340	
	BKW AG	3,194	156.900	501,138.600	
	SIG GROUP AG	38,322	25.640	982,576.080	
	ALCON INC	68,865	65.160	4,487,243.400	
	UBS GROUP AG	447,218	17.400	7,781,593.200	
	VAT GROUP AG	3,325	325.400	1,081,955.000	
スイス・フラン	小計	2,017,428		195,691,972.280 (29,698,213,713)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	361,234	148.400	53,607,125.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	194,204	130.950	25,431,013.800	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	55.360	23,140,480.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	252.700	6,508,288.500	
	INVESTOR AB-A SHS	62,097	221.800	13,773,114.600	
	LUNDBERGS B	7,859	489.100	3,843,836.900	
	SKF AB-B SHS	46,594	184.750	8,608,241.500	
	SANDVIK AB	150,884	206.200	31,112,280.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	114.300	25,414,376.400	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	153.600	6,748,723.200	

	SWEDBANK AB	130,971	171.950	22,520,463.450	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,465	145.850	13,486,020.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	184,499	87.720	16,184,252.280	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	211.000	5,105,778.000	
	VOLVO AB-B SHS	209,640	205.350	43,049,574.000	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	410.400	4,162,276.800	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	106.050	7,174,706.700	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	290.500	4,442,326.000	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	289.800	6,179,985.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	169.800	4,568,808.600	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	86.000	6,543,310.000	
	INVESTOR AB-B SHS	254,673	217.900	55,493,246.700	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	110,008	144.720	15,920,357.760	
	ASSA ABLOY AB-B	140,043	243.100	34,044,453.300	
	TELIA CO AB	344,810	27.290	9,409,864.900	
	BOLIDEN AB	36,260	366.700	13,296,542.000	
	ALFA LAVAL AB	35,313	384.000	13,560,192.000	
	KINNEVIK AB-B	36,278	168.900	6,127,354.200	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	44.610	3,253,942.620	
	INDUTRADE AB	39,178	255.000	9,990,390.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	90.060	4,302,076.140	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	114.200	24,305,414.400	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	256.000	4,705,280.000	
	HEXAGON AB-B SHS	275,826	116.100	32,023,398.600	
	SAGAX AB	28,022	241.800	6,775,719.600	
	EPIROC AB-A	84,563	204.800	17,318,502.400	
	EPIROC AB-B	61,487	174.900	10,754,076.300	
	ESSITY AB-B	86,900	310.900	27,017,210.000	
	EQT AB	55,194	213.700	11,794,957.800	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	51.610	4,118,013.510	
	VOLVO CAR AB	63,710	38.530	2,454,746.300	
	LIFCO AB	26,835	238.200	6,392,097.000	
	EVOLUTION AB	25,280	1,287.400	32,545,472.000	
	NORDEA BANK ABP	457,613	109.220	49,980,491.860	
	INVESTMENT AB LATOUR	13,616	228.400	3,109,894.400	
	スウェーデン・クローナ 小計	4,999,413		730,298,676.170 (9,705,669,406)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	12,549	1,123.500	14,098,801.500	
	A P MOLLER A/S	663	11,820.000	7,836,660.000	
	AP MOLLER MAERSK A	520	11,640.000	6,052,800.000	
	DANSKE BANK A/S	88,591	135.800	12,030,657.800	
	GENMAB A/S	8,614	2,731.000	23,524,834.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	345.600	10,297,152.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,680.500	1,467,076.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	223,550	1,094.000	244,563,700.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	140,190	189.380	26,549,182.200	



	COLOPLAST-B	15,343	980.000	15,036,140.000	
	DSV A/S	24,578	1,291.000	31,730,198.000	
	DEMANT A/S	11,367	292.500	3,324,847.500	
	TRYG A/S	44,887	156.450	7,022,571.150	
	PANDORA A/S	12,473	601.000	7,496,273.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	517.400	6,487,161.200	
	ORSTED A/S	26,911	630.800	16,975,458.800	
デンマーク・クローネ 小計		653,442		434,493,513.650 (8,685,525,338)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.750	1,437,983.750	
	EBOS GROUP LTD	25,631	44.190	1,132,633.890	
	FISHER & PAYKEL	78,460	27.000	2,118,420.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.170	1,132,426.460	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.445	404,965.130	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.350	1,280,297.800	
ニュージーランド・ドル 小計		789,612		7,506,727.030 (638,972,605)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	191.350	10,787,356.250	
	NORSK HYDRO ASA	210,898	73.160	15,429,297.680	
	TELENOR ASA	85,954	128.000	11,002,112.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	473.800	5,299,453.000	
	ORKLA ASA	116,068	75.460	8,758,491.280	
	EQUINOR ASA	132,805	310.500	41,235,952.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	431.900	8,566,304.600	
	AKER BP ASA	38,723	241.300	9,343,859.900	
	SALMAR ASA	7,248	448.700	3,252,177.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	181.900	4,678,649.900	
	ADEVINTA ASA	24,382	81.150	1,978,599.300	
DNB BANK ASA	139,232	185.400	25,813,612.800		
ノルウェー・クローネ 小計		868,425		146,145,866.810 (1,869,205,636)	
ユーロ	CRH PLC	102,020	44.740	4,564,374.800	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	23,185	177.350	4,111,859.750	
	KERRY GROUP PLC-A	20,761	95.540	1,983,505.940	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	61.420	1,342,641.200	
	UMICORE	24,290	29.580	718,498.200	
	AIR LIQUIDE	70,234	163.400	11,476,235.600	
	AIRBUS SE	80,311	122.200	9,814,004.200	
	AXA SA	250,734	28.860	7,236,183.240	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	85,994	28.340	2,437,069.960	
	ADIDAS AG	22,590	170.340	3,847,980.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	18.840	2,724,508.920	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	170.400	531,648.000	
	DANONE	88,043	60.390	5,316,916.770	
SAFRAN SA	46,683	137.700	6,428,249.100		

INTESA SANPAOLO	2, 233, 744	2. 432	5, 432, 465. 400
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	45, 234	107. 540	4, 864, 464. 360
ACCOR SA	20, 392	32. 170	656, 010. 640
BOUYGUES	29, 123	31. 610	920, 578. 030
BNP PARIBAS	147, 219	57. 890	8, 522, 507. 910
THALES SA	15, 023	136. 350	2, 048, 386. 050
CAPGEMINI SA	22, 531	167. 450	3, 772, 815. 950
UNICREDIT SPA	266, 042	18. 940	5, 038, 835. 480
D' IETEREN TRDG	2, 736	170. 500	466, 488. 000
COMMERZBANK AG	141, 036	9. 762	1, 376, 793. 430
EIFFAGE	11, 784	105. 050	1, 237, 909. 200
FRESENIUS SE & CO KGAA	58, 814	25. 420	1, 495, 051. 880
UNITED INTERNET	10, 010	14. 710	147, 247. 100
PUBLICIS GROUPE	29, 383	70. 420	2, 069, 150. 860
IBERDROLA SA	828, 982	11. 800	9, 781, 987. 600
ENI SPA	340, 270	13. 570	4, 617, 463. 900
JERONIMO MARTINS	34, 644	22. 920	794, 040. 480
KESKO OYJ-B	35, 252	19. 030	670, 845. 560
KBC GROUPE	35, 962	63. 380	2, 279, 271. 560
HANNOVER RUECK SE	8, 405	187. 300	1, 574, 256. 500
WARTSILA OYJ	50, 956	10. 720	546, 248. 320
L' OREAL	32, 571	424. 450	13, 824, 760. 950
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	37, 297	876. 900	32, 705, 739. 300
GEA GROUP AG	24, 987	40. 020	999, 979. 740
BOLLORE	114, 808	6. 060	695, 736. 480
MEDIOBANCA SPA	86, 792	9. 980	866, 184. 160
MICHELIN (CGDE) -B	88, 698	29. 430	2, 610, 382. 140
CONTINENTAL AG	13, 417	64. 040	859, 224. 680
DEUTSCHE POST AG-REG	136, 158	41. 875	5, 701, 616. 250
OMV AG	17, 258	42. 130	727, 079. 540
VERBUND AG	10, 663	78. 800	840, 244. 400
PERNOD-RICARD	28, 172	214. 500	6, 042, 894. 000
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23, 311	50. 960	1, 187, 928. 560
RENAULT SA	27, 902	32. 800	915, 185. 600
REPSOL SA	179, 874	13. 000	2, 338, 362. 000
REMY COINTREAU	2, 866	162. 400	465, 438. 400
MERCK KGAA	18, 389	165. 500	3, 043, 379. 500
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	62, 911	52. 100	3, 277, 663. 100
RWE AG	85, 480	41. 470	3, 544, 855. 600
SEB SA	2, 596	103. 300	268, 166. 800
SOCIETE GENERALE-A	115, 239	21. 620	2, 491, 467. 180
VINCI S. A.	72, 410	109. 080	7, 898, 482. 800
SODEXO	12, 910	96. 720	1, 248, 655. 200
SOFINA	2, 281	206. 600	471, 254. 600
SOLVAY SA	9, 070	107. 800	977, 746. 000
SCHNEIDER ELECTRIC SE	73, 488	158. 640	11, 658, 136. 320

VIVENDI SE	98,944	9.822	971,827.960
SAP SE	139,754	122.180	17,075,143.720
TELEFONICA S. A	750,387	4.025	3,020,307.670
TOTALENERGIES SE	335,862	56.130	18,851,934.060
VALEO	26,570	17.135	455,276.950
E. ON SE	308,720	12.110	3,738,599.200
VOEST-ALPINE AG	18,032	31.060	560,073.920
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	66.960	895,656.960
SIEMENS AG-REG	102,581	150.480	15,436,388.880
UPM-KYMMENE OYJ	77,752	30.160	2,345,000.320
ING GROEP NV-CVA	514,463	11.206	5,765,072.370
PUMA AG	12,194	51.860	632,380.840
BAYER AG	133,908	58.700	7,860,399.600
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	12.035	902,143.600
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	73.780	1,784,811.980
MERCEDES-BENZ GROUP AG	109,427	66.680	7,296,592.360
BASF SE	126,695	47.525	6,021,179.870
BEIERSDORF AG	12,940	126.000	1,630,440.000
HEIDELBERGCEMENT AG	17,008	69.920	1,189,199.360
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	25,398	42.430	1,077,637.140
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	341.050	2,268,323.550
ORANGE	280,606	11.638	3,265,692.620
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	45.660	2,925,892.800
RANDSTAD NV	15,584	47.910	746,629.440
ALLIANZ SE	53,972	215.950	11,655,253.400
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	377,252	4.866	1,835,708.230
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	143,719	31.315	4,500,560.480
HERMES INTL	4,325	1,993.800	8,623,185.000
ENDESA S. A.	37,701	20.420	769,854.420
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	9.199	665,474.050
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	32.410	1,480,683.260
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	19,069	338.100	6,447,228.900
ARCELOR MITTAL (NL)	64,774	24.630	1,595,383.620
DASSAULT SYSTEMES SA	92,308	36.515	3,370,626.620
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	25,380	31.760	806,068.800
RHEINMETALL STAMM	5,596	266.400	1,490,774.400
HEINEKEN NV	34,576	104.400	3,609,734.400
AKZO NOBEL	23,353	75.120	1,754,277.360
ASML HOLDING NV	54,297	585.600	31,796,323.200
AEGON NV	232,433	4.017	933,683.360
VOLKSWAGEN AG	3,315	153.000	507,195.000
VOLKSWAGEN AG PFD	25,053	127.160	3,185,739.480
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	835,535	6.290	5,255,515.150
KERING	10,209	561.400	5,731,332.600

ACCIONA S. A.	2, 642	169. 700	448, 347. 400
FORTUM OYJ	54, 194	13. 570	735, 412. 580
AGEAS	24, 086	40. 430	973, 796. 980
UCB SA	16, 732	82. 580	1, 381, 728. 560
NEMETSCHEK SE	9, 878	67. 320	664, 986. 960
CARREFOUR SA	76, 528	17. 815	1, 363, 346. 320
NATURGY ENERGY GROUP SA	17, 677	28. 520	504, 148. 040
NOKIA OYJ	745, 504	3. 762	2, 804, 586. 040
KONINKLIJKE PHILIPS NV	115, 512	19. 190	2, 216, 675. 280
WOLTERS KLUWER-CVA	35, 602	108. 750	3, 871, 717. 500
SANOFI	153, 586	101. 560	15, 598, 194. 160
STMICROELECTRONICS NV	93, 810	38. 570	3, 618, 251. 700
ELISA OYJ	20, 242	56. 260	1, 138, 814. 920
BANCO SANTANDER SA	2, 306, 214	3. 149	7, 262, 267. 880
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49, 011	16. 610	814, 072. 710
QIAGEN N. V.	34, 306	41. 670	1, 429, 531. 020
DEUTSCHE BANK AG-REG	276, 499	9. 665	2, 672, 362. 830
BMW VORZUG	7, 821	101. 900	796, 959. 900
ENEL SPA	1, 105, 481	6. 162	6, 811, 973. 920
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	436, 835	21. 410	9, 352, 637. 350
SARTORIUS AG	3, 651	363. 300	1, 326, 408. 300
INFINEON TECHNOLOGIES AG	178, 950	33. 185	5, 938, 455. 750
RATIONAL AG	516	704. 000	363, 264. 000
CARL ZEISS MEDITEC AG	4, 866	120. 700	587, 326. 200
BECHTLE AG	14, 521	42. 470	616, 706. 870
KONINKLIJKE KPN NV	504, 342	3. 305	1, 666, 850. 310
EUROFINS SCIENTIFIC	17, 824	65. 000	1, 158, 560. 000
TELEPERFORMANCE	7, 845	160. 900	1, 262, 260. 500
DEUTSCHE BOERSE AG	25, 951	175. 750	4, 560, 888. 250
EURAZEO	5, 673	65. 600	372, 148. 800
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12, 918	80. 380	1, 038, 348. 840
HEINEKEN HOLDING NV-A	17, 690	87. 200	1, 542, 568. 000
INDITEX	150, 465	31. 670	4, 765, 226. 550
ESSILORLUXOTTICA	39, 632	183. 860	7, 286, 739. 520
SNAM SPA	256, 415	5. 074	1, 301, 049. 710
CREDIT AGRICOLE SA	166, 921	11. 062	1, 846, 480. 100
ENAGAS	38, 270	18. 280	699, 575. 600
WENDEL	5, 449	101. 400	552, 528. 600
TENARIS SA	55, 855	12. 420	693, 719. 100
TELECOM ITALIA SPA	908, 286	0. 268	243, 420. 640
TERNA SPA	207, 655	7. 972	1, 655, 425. 660
BIOMERIEUX	4, 870	98. 080	477, 649. 600
GRIFOLS SA	31, 982	9. 500	303, 829. 000
FERROVIAL SA	63, 513	29. 040	1, 844, 417. 520
NESTE OYJ	56, 226	42. 450	2, 386, 793. 700
RECORDATI SPA	17, 680	42. 480	751, 046. 400
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	58, 797	12. 290	722, 615. 130
MTU AERO ENGINES HOLDING	7, 294	227. 900	1, 662, 302. 600

AG				
KONE OYJ	49,300	52.840	2,605,012.000	
ELIA GROUP	4,078	126.000	513,828.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	255.600	985,338.000	
ENGIE	241,494	14.554	3,514,703.670	
ALSTOM	47,494	23.170	1,100,435.980	
IPSEN SA	3,873	112.200	434,550.600	
ARKEMA SA	10,961	87.540	959,525.940	
LEGRAND SA	34,352	85.180	2,926,103.360	
AMPLIFON SPA	20,249	35.890	726,736.610	
ADP	3,975	142.400	566,040.000	
ORION OYJ	13,559	43.200	585,748.800	
METSO CORPORATION	79,058	10.505	830,504.290	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.570	627,921.420	
SYMRISE AG	17,265	109.900	1,897,423.500	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	33.610	1,089,703.420	
PRYSMIAN SPA	31,596	37.460	1,183,586.160	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	104.450	253,709.050	
CAIXABANK	565,553	3.212	1,816,556.230	
BUREAU VERITAS SA	39,729	25.690	1,020,638.010	
GETLINK	63,509	16.600	1,054,249.400	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	20.210	802,094.480	
AMADEUS IT GROUP SA	62,816	62.800	3,944,844.800	
BRENTAG SE	21,559	74.700	1,610,457.300	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	19.755	487,691.680	
EDENRED	31,091	58.460	1,817,579.860	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	137,436	3.124	429,350.060	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	54.900	450,674.100	
VONOVIA SE	92,440	18.670	1,725,854.800	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	134,537	8.910	1,198,724.670	
KNORR-BREMSE AG	10,342	64.680	668,920.560	
OCI NV	12,329	23.660	291,704.140	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	39,737	57.160	2,271,366.920	
FERRARI NV	16,685	269.500	4,496,607.500	
CNH INDUSTRIAL NV	143,842	12.665	1,821,758.930	
AROUNDTOWN SA	113,225	1.079	122,169.770	
AIB GROUP PLC	147,578	3.832	565,518.890	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	37.540	649,179.220	
MONCLER SPA	29,763	67.180	1,999,478.340	
NEXI SPA	83,576	7.390	617,626.640	
PROSUS NV	109,400	67.350	7,368,090.000	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	115.450	1,751,838.300	
JDE PEET'S BV	14,385	27.840	400,478.400	
EXOR NV	14,142	75.120	1,062,347.040	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	22.520	1,686,567.840	
EURONEXT NV	14,089	72.150	1,016,521.350	

	IMCD NV	8,848	137.800	1,219,254.400	
	WORLDLINE SA	29,916	39.470	1,180,784.520	
	NN GROUP NV	36,289	33.310	1,208,786.590	
	FINECOBANK SPA	75,180	13.515	1,016,057.700	
	ARGENX SE	7,482	364.500	2,727,189.000	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	92,502	19.200	1,776,038.400	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	64,874	29.090	1,887,184.660	
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	32.720	321,375.840	
	DSM-FIRMENICH AG	22,201	117.580	2,610,393.580	
	ZALANDO SE	31,321	32.650	1,022,630.650	
	STELLANTIS NV	309,373	14.726	4,555,826.790	
	AENA SME SA	9,989	146.100	1,459,392.900	
	CELLNEX TELECOM SAU	76,430	38.250	2,923,447.500	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	16.370	371,107.900	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	14.140	747,086.900	
	SCOUT24 SE	10,048	59.500	597,856.000	
	COVESTRO AG	27,558	40.130	1,105,902.540	
	HELLOFRESH SE	17,856	24.690	440,864.640	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	117,633	58.720	6,907,409.760	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.476	558,032.160	
	AMUNDI SA	12,553	59.850	751,297.050	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	12.580	526,837.820	
	ADYEN NV	2,995	1,433.400	4,293,033.000	
	DELIVERY HERO SE	22,564	39.600	893,534.400	
	ユーロ 小計	24,423,502		646,375,766.720 (96,258,279,180)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	14.260	3,664,820.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	59.350	14,350,592.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	46.750	4,362,429.500	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	166,391	319.600	53,178,563.600	
	MTR CORP	192,441	39.900	7,678,395.900	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	114.300	10,869,472.800	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	28.550	4,881,250.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	46.150	9,821,643.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	7.150	10,985,302.900	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	322,904	53.850	17,388,380.400	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	498,995	24.550	12,250,327.250	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	20.900	3,617,079.400	
	SINO LAND CO	411,200	10.460	4,301,152.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	110.600	22,624,889.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	61.450	3,258,079.000	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	180,156	85.250	15,358,299.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	13.900	2,474,200.000	
	AIA GROUP LTD	1,576,516	81.550	128,564,879.800	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	10.420	4,825,877.120	
	SANDS CHINA LTD	335,800	26.900	9,033,020.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	13.420	1,878,800.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	20.800	4,193,280.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	42.400	10,860,124.000	
	ESR GROUP LTD	216,400	12.400	2,683,360.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	22.150	5,869,750.000	
	WH GROUP LTD	931,500	4.430	4,126,545.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	53.700	19,839,196.500	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	46.550	12,391,377.250	
香港・ドル	小計	10,009,869		405,331,086.620 (6,979,801,312)	
合計		154,311,634		905,076,481,832 (905,076,481,832)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年5月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,308,632.220		
		GOODMAN GROUP	221,417.000	4,428,340.000		
		GPT GROUP	219,223.000	971,157.890		
		MIRVAC GROUP	474,881.000	1,120,719.160		
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,876,871.300		
		STOCKLAND	369,843.000	1,671,690.360		
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,129,485.150		
		オーストラリア・ドル 小計		2,642,195.000	12,506,896.080 (1,139,878,508)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCOTT TRUST	24,589.000	26,802.010		
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,637,440.480		
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,260,339.080		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	834,416.000		
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	701,515.000		
		シンガポール・ドル 小計		2,132,098.000	4,460,512.570 (454,615,441)	
投資信託受益証券	合計		4,774,293	1,594,493,949 (1,594,493,949)		
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,814.000	2,573,442.960		

	AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,479,147.390	
	AMERICAN TOWER CORP	62,580.000	12,312,615.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58,993.000	1,124,996.510	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,496.000	3,504,406.000	
	BOSTON PROPERTIES INC	24,257.000	1,259,666.010	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	13,271.000	1,464,454.850	
	CROWN CASTLE INC	58,995.000	6,990,907.500	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	39,801.000	3,837,612.420	
	EQUINIX INC	12,548.000	9,285,520.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22,301.000	1,542,783.180	
	EQUITY RESIDENTIAL	46,059.000	2,919,219.420	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,270.000	1,819,400.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	18,024.000	2,789,033.760	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,776,386.850	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	64,831.000	1,305,048.030	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68,971.000	1,481,497.080	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,629,959.520	
	INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,975,801.090	
	IRON MOUNTAIN INC	39,185.000	2,209,642.150	
	KIMCO REALTY	79,991.000	1,504,630.710	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	622,735.470	
	MID AMERICA	14,440.000	2,200,511.600	
	PROLOGIS INC	124,897.000	15,893,143.250	
	PUBLIC STORAGE	21,100.000	6,243,701.000	
	REALTY INCOME CORP	86,588.000	5,450,714.600	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,172,950.140	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	14,868.000	3,562,224.120	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	44,425.000	4,866,758.750	
	SUN COMMUNITIES INC	15,529.000	2,123,435.460	
	UDR INC	41,516.000	1,715,856.280	
	VENTAS INC	53,843.000	2,576,387.550	
	VICI PROPERTIES INC	129,458.000	4,247,516.980	
	WELLTOWER INC	64,928.000	5,113,729.280	
	WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,035,686.050	
	WP CAREY INC	27,925.000	2,045,227.000	
アメリカ・ドル	小計	1,747,139.000	126,656,747.960 (17,116,392,919)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	474,419.110	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,945.000	851,857.810	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,366,540.510	
イギリス・ポンド	小計	412,137.000	2,692,817.430	



				(459,610,079)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000		431,739.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000		299,009.520	
カナダ・ドル 小計		23,146.000		730,748.520 (73,776,371)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000		256,086.300	
	GECINA SA	9,166.000		912,017.000	
	KLEPIERRE	25,279.000		558,160.320	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	13,535.000		615,977.850	
	WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000		541,121.560	
ユーロ 小計		73,192.000		2,883,363.030 (429,390,422)	
香港・ドル	LINK REIT	349,516.000		18,017,549.800	
香港・ドル 小計		349,516.000		18,017,549.800 (310,262,208)	
投資証券 合計		2,605,130		18,389,431,999 (18,389,431,999)	
合計				19,983,925,948 (19,983,925,948)	

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

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における ( ) 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における ( ) 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 600銘柄	69.23	—	—	72.22
	投資証券 36銘柄	—	—	1.82	
イギリス・ポンド	株式 76銘柄	4.53	—	—	4.65
	投資証券 3銘柄	—	—	0.05	
イスラエル・シケル	株式 11銘柄	0.14	—	—	0.14
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	2.11	—	—	2.27
	投資信託受益証券 7銘柄	—	0.12	—	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.55	—	—	3.62
	投資証券 2銘柄	—	—	0.01	
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	0.33	—	—	0.39
	投資信託受益証券 5銘柄	—	0.05	—	
スイス・フラン	株式 42銘柄	3.16	—	—	3.21
スウェーデン・クローナ	株式 45銘柄	1.03	—	—	1.05
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.92	—	—	0.94
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.07	—	—	0.07
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.20	—	—	0.20
ユーロ	株式 221銘柄	10.24	—	—	10.45
	投資証券 5銘柄	—	—	0.05	

香港・ドル	株式	28銘柄	0.74	—	—	0.79
	投資証券	1銘柄	—	—	0.03	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
  
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期中間計算期間（2023年5月9日から2023年11月8日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年1月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア資産形成ファンドの2023年5月9日から2023年11月8日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、コア資産形成ファンドの2023年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年5月9日から2023年11月8日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 【中間財務諸表】

## 【コア資産形成ファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2023年5月8日現在	第9期中間計算期間末 2023年11月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,214,441	99,781,636
親投資信託受益証券	494,264,072	380,109,432
未収入金	6,000,000	4,000,000
流動資産合計	510,478,513	483,891,068
資産合計	510,478,513	483,891,068
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,709,001	3,719,471
未払受託者報酬	106,320	108,889
未払委託者報酬	2,286,634	2,342,225
その他未払費用	9,391	9,602
流動負債合計	4,111,346	6,180,187
負債合計	4,111,346	6,180,187
純資産の部		
元本等		
元本	501,112,217	462,534,646
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	5,254,950	15,176,235
(分配準備積立金)	7,212,978	6,040,039
元本等合計	506,367,167	477,710,881
純資産合計	506,367,167	477,710,881
負債純資産合計	510,478,513	483,891,068

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期中間計算期間 自 2022年5月10日 至 2022年11月9日	第9期中間計算期間 自 2023年5月9日 至 2023年11月8日
営業収益		
受取利息	53	209
有価証券売買等損益	△5,120,642	13,845,360
その他収益	3,001	315
営業収益合計	△5,117,588	13,845,884
営業費用		
支払利息	2,316	8,961
受託者報酬	105,812	108,889
委託者報酬	2,275,756	2,342,225
その他費用	9,323	9,602
営業費用合計	2,393,207	2,469,677
営業利益又は営業損失 (△)	△7,510,795	11,376,207
経常利益又は経常損失 (△)	△7,510,795	11,376,207
中間純利益又は中間純損失 (△)	△7,510,795	11,376,207
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	△155,091	1,910,488
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	7,813,265	5,254,950
剰余金増加額又は欠損金減少額	609,965	1,412,149
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	609,965	1,412,149
剰余金減少額又は欠損金増加額	495,024	956,583
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	495,024	956,583
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	572,502	15,176,235

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第9期中間計算期間	
	自 2023年5月9日	至 2023年11月8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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第8期	第9期中間計算期間末
	2023年5月8日現在	2023年11月8日現在
1. 期首元本額	457,372,342円	501,112,217円
期中追加設定元本額	106,738,897円	46,553,299円
期中一部解約元本額	62,999,022円	85,130,870円
2. 受益権の総数	501,112,217口	462,534,646口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期	第9期中間計算期間末
	2023年5月8日現在	2023年11月8日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。



(1口当たり情報に関する注記)

	第8期 2023年5月8日現在	第9期中間計算期間末 2023年11月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0105円 (10,105円)	1.0328円 (10,328円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年11月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,051,059,188
国債証券	358,445,059,950
地方債証券	30,152,878,930
特殊債券	28,534,484,198
社債券	24,106,312,470
未収利息	704,439,437
前払費用	46,179,306
流動資産合計	444,040,413,479
資産合計	444,040,413,479
負債の部	
流動負債	
未払解約金	750,101,000
流動負債合計	750,101,000
負債合計	750,101,000
純資産の部	
元本等	
元本	362,306,384,978
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	80,983,927,501
元本等合計	443,290,312,479
純資産合計	443,290,312,479
負債純資産合計	444,040,413,479

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年5月9日 至 2023年11月8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。時価評価にあつては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月8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	383,609,412,287円
同期中追加設定元本額	211,809,697,678円
同期中一部解約元本額	233,112,724,987円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	26,200,657,078円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	56,117,188円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	86,648,665円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	49,144,456円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	783,327,260円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	265,357,375円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	40,190,856円
たわらノーロード 国内債券	19,029,834,226円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,187,013,547円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,479,322,658円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,800,851,028円
たわらノーロード バランス（積極型）	368,455,838円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	168,083,001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）	2,234,367,497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）	2,378,496,302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）	666,638,782円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	30,634,639円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	22,095,690円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	187,945,069円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	5,443,254円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,711,685,463円
O n eグローバルバランス	74,500,940円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	10,586,168,424円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	15,587,210,751円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	6,862,150,763円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,571,332,885円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,644,433,665円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	495,917,205円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	75,882,531円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,859,473,215円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,036,864円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	5,140,138,301円

D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,247,433,102円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	455,345,604円
投資のソムリエ	48,755,144,690円
クルーズコントロール	945,604,294円
投資のソムリエ<DC年金>	4,426,214,294円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	6,131,863,789円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,884,407,116円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	4,889,246,894円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	17,070,989,335円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	494,182,919円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	247,534,442円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	39,573,645円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,038,037,307円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,275,393,705円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,025,487,006円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,992,311,336円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	537,115,716円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	270,727,411円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	164,115,791円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,907,985,239円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	39,354,556円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	142,397,182円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,157,245,577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)	1,161,743,356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)	1,543,712,464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)	699,918,493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)	1,142,785,124円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	2,955,034,667円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,960,125,052円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,031,852,217円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	2,008,043,556円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,273,967,075円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,294,012,068円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,444,243,508円
A M O n e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)	579,745,060円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	260,244,071円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	4,665,654,869円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII(適格機関投資家限定)	4,676,992,168円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV(適格機関投資家限定)	4,633,549,045円

インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,911,791,139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）	22,590,349円
AMOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	911,099,189円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	150,198,795円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	90,081,664円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	20,867,630円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	59,520,329円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	29,453,269円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	360,180円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	7,872,702円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	93,474,044円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	2,741,717,872円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,107,828,436円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,226,053,788円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	54,190,575円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	129,518,890円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	1,597,146,325円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	101,801,314円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	548,116円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	1,607,600,961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）	34,239,010円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	264,839,337円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	465,519,383円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	801,924,823円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	203,070,561円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	95,507,648円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	748,262,131円
動的パッケージファンド<DC年金>	252,040,406円
コア資産形成ファンド	148,890,039円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	18,405,887,605円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	29,908,755,893円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	18,533,509,360円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	448,028,025円
計	362,306,384,978円
2. 受益権の総数	362,306,384,978口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月8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

<p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>
-----------------------------------	---

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年11月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2235円 (12,235円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年11月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	751,313,435
コール・ローン	870,859,026
国債証券	242,585,170,619
未収利息	1,781,079,170
前払費用	247,361,235
流動資産合計	246,235,783,485
資産合計	246,235,783,485
負債の部	
流動負債	
未払金	13,155,573
未払解約金	242,666,000
流動負債合計	255,821,573
負債合計	255,821,573
純資産の部	
元本等	
元本	109,820,356,602
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	136,159,605,310
元本等合計	245,979,961,912
純資産合計	245,979,961,912
負債純資産合計	246,235,783,485

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年5月9日 至 2023年11月8日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月8日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	102,423,436,687円
同期中追加設定元本額	22,282,370,341円
同期中一部解約元本額	14,885,450,426円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,783,725,956円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,189,821円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	14,092,058円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	35,263,715円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	30,569,496円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	42,934,640円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,839,202円
たわらノーロード 先進国債券	19,410,849,042円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	362,726,680円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,981,453,885円
たわらノーロード バランス（堅実型）	69,377,131円
たわらノーロード バランス（標準型）	372,922,404円
たわらノーロード バランス（積極型）	82,137,976円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	16,156,459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）	1,032,608,102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）	1,830,510,865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）	895,326,927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）	550,540,535円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,847,830円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,460,234円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	195,517,101円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	16,017,297円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	24,915,361円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,765,486,723円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	1,240,630,831円
O n e グローバルバランス	44,761,523円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	742,958,950円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,399,514,656円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,802,663,389円



D I A M DC バランス30インデックスファンド	417,961,242円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	799,847,587円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,923,572円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	900,485,447円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	36,065,068円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	159,329,380円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	160,868,965円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	255,538,529円
クルーズコントロール	800,542,215円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	763,238,250円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	684,522,847円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	178,379,721円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	434,500,962円
O n e グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	8,667,120円
O n e グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	72,395,001円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	989,890,513円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	448,213,963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)	449,679,996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)	86,898,161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)	271,425,746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)	442,596,576円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	1,108,836,762円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	460,369,384円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	399,715,170円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	538,748,017円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	4,723,514,997円
D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,383,411,353円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,513,354,327円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,275,247,877円
A M O n e 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)	179,244,485円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	44,153,123円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	740,584,887円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	334,920,368円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	200,921,136円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,631,277円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	22,108,265円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,567,235円

D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	50,401円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	4,387,631円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	34,719,816円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,334,318,081円
D I A Mバランスファンド3 7. 5 V A (適格機関投資家限定)	1,270,738,508円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,349,860,427円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	50,322,676円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	101,048,537円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	1,189,747,073円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	205,627,469円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	152,854円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	223,363,702円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	258,829,926円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	356,677,701円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	34,496,911円
動的パッケージファンド<D C年金>	51,874,906円
コア資産形成ファンド	31,020,227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>	3,345,516,118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>	11,768,206,110円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	6,130,196,583円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	4,924,190,978円
計	109,820,356,602円
2. 受益権の総数	109,820,356,602口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年11月8日現在
1口当たり純資産額	2.2398円
(1万口当たり純資産額)	(22,398円)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年11月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	26,526,093,627
株式	458,739,254,950
派生商品評価勘定	83,811,590
未収配当金	4,273,042,420
差入委託証拠金	629,397,061
流動資産合計	490,251,599,648
資産合計	490,251,599,648
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	150,688,620
前受金	69,195,000
未払金	17,298,640,678
未払解約金	2,564,351,000
流動負債合計	20,082,875,298
負債合計	20,082,875,298
純資産の部	
元本等	
元本	117,055,652,096
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	353,113,072,254
元本等合計	470,168,724,350
純資産合計	470,168,724,350
負債純資産合計	490,251,599,648

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年5月9日 至 2023年11月8日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月8日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	119,728,617,791円
同期中追加設定元本額	29,545,022,437円
同期中一部解約元本額	32,217,988,132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	2,502,735,291円
たわらノーロード 国内株式くらっ専用	3,605,104,934円
One DC 国内株式インデックスファンド	29,559,603,462円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,516,943,207円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,577,038円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	9,370,446円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	22,495,249円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	22,010,585円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	28,698,928円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	18,397,544円
たわらノーロード TOPIX	2,084,728,241円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,642,174,287円
たわらノーロード バランス (堅実型)	50,391,431円
たわらノーロード バランス (標準型)	366,690,170円
たわらノーロード バランス (積極型)	598,943,342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)	2,993,069円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	173,252,634円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	453,121,420円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	368,622,675円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	515,189,410円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	392,700円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,635,951円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	33,790,129円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,071,295円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	13,451,888円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,588,249,067円
O n eグローバルバランス	33,999,662円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	961,630,743円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,418,991,298円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,922,849,280円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	306,213,801円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	987,834,142円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,100,764,791円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,853,968円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,085,520,568円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	292,513,153円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	335,914,476円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	564,918,464円
投資のソムリエ	6,344,832,449円
クルーズコントロール	290,308,484円
投資のソムリエ<DC年金>	576,560,559円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	334,624,932円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,062,716,981円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	594,497,310円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,074,245,848円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	70,653,969円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	35,353,428円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,815,187円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	84,171,277円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,399,805円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	703,167,514円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	241,685,779円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	63,263,011円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	38,591,935円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	23,401,287円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	483,673,291円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,628,774円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,781,674円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	39,185,527円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	3,395,818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)	3,548,106円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	17,749,444円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	2,245,416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)	3,530,884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)	9,011,332円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	163,967,415円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	3,146,215円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	153,515,989円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022-10（適格機関投資家限定）	388,522,865円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	188,342,125円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	16,465,297円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	24,445,923円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	5,911,685円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	2,944,011円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	38,657,439円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	69,671,327円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,759,882円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	12,255,288円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,637,170円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	83,454円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,620,579円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	19,246,360円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	317,506,728円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	434,055,950円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,305,696,471円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	11,153,843円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	15,981,457円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	163,272,497円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	31,453,948円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	56,403円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	186,207,786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）	10,581,318円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	40,881,296円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	107,865,638円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	148,640,126円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	19,040,833円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	12,647,006円
動的パッケージファンド<DC年金>	27,443,352円
コア資産形成ファンド	16,711,663円
MHAMトピックスファンド	816,400,312円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	45,122,365円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,260,862,552円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,895,394,030円
計	117,055,652,096円
2. 受益権の総数	117,055,652,096口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年11月8日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買建	11,369,535,000	—	11,302,820,000	△66,715,000
合計	11,369,535,000	—	11,302,820,000	△66,715,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年11月8日現在
1口当たり純資産額	4.0166円
(1万口当たり純資産額)	(40,166円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年11月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	63,477,477,409
コール・ローン	428,246,757
株式	1,131,554,631,398
投資信託受益証券	1,800,568,286
投資証券	20,695,417,310
派生商品評価勘定	292,662,307
未収入金	467,240
未収配当金	592,102,771
差入委託証拠金	7,688,454,711
流動資産合計	1,226,530,028,189
資産合計	1,226,530,028,189
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,276,188
未払金	57,502,595,847
未払解約金	168,872,000
流動負債合計	57,693,744,035
負債合計	57,693,744,035
純資産の部	
元本等	
元本	158,694,499,404
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	1,010,141,784,750
元本等合計	1,168,836,284,154
純資産合計	1,168,836,284,154
負債純資産合計	1,226,530,028,189



注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年5月9日 至 2023年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月8日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	146,902,072,648円
同期中追加設定元本額	45,122,689,768円
同期中一部解約元本額	33,330,263,012円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3, 846, 358, 832円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	1, 865, 878円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	7, 563, 940円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	20, 322, 262円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	26, 037, 325円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	23, 163, 510円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	16, 508, 496円
たわらノーロード 先進国株式	53, 831, 831, 458円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	288, 279, 705円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2, 864, 352, 690円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	909, 648, 205円
たわらノーロード バランス (堅実型)	86, 800, 206円
たわらノーロード バランス (標準型)	784, 374, 458円
たわらノーロード バランス (積極型)	1, 019, 306, 827円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1, 335円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	35, 535, 208円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	234, 015, 682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)	243, 755, 808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)	413, 435, 431円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1, 447円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	298, 227円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	14, 752, 724円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2, 762, 904円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11, 936, 092円
たわらノーロード 全世界株式	1, 216, 371, 952円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	56, 436, 480, 077円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3, 168, 557, 580円
O n e グローバルバランス	19, 753, 242円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	141, 675, 638円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	783, 702, 517円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1, 030, 919, 793円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	85, 303, 134円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	238, 474, 053円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	243, 718, 407円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17, 709, 590円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	665, 830, 785円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	120, 769, 833円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	162, 645, 558円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	188, 160, 203円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	314, 965, 580円
投資のソムリエ	10, 034, 767, 621円
クルーズコントロール	80, 010, 803円
投資のソムリエ<DC年金>	912, 156, 533円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	188, 057, 616円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	282, 741, 350円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	995, 798, 943円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3, 471, 962, 269円
ワールドアセットバランス (基本コース)	111, 623, 980円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	179, 027, 460円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	55, 188, 050円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	27,617,304円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	8,065,663円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	167,669,251円
４資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	139,485,397円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	628,254,473円
９資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	135,846,066円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	57,228,517円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	30,143,568円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	18,279,302円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	133,843,713円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,397,624円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	34,969,360円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	17,642,664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）	18,150,394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）	11,063,755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）	17,424,966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）	45,062,762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）	15,795,959円
MSCIコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	330,455,278円
DIAM外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	35,397,762円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,107,091,880円
DIAM先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	197,708,557円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,268,187,075円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	297,796,144円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	363,221円
DIAMワールドバランス２５VA（適格機関投資家限定）	5,884,820円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	29,608,819円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	4,656,604円
DIAMグローバル・バランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	21,757,872円
DIAMグローバル・バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	39,215,007円
DIAM国際分散バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,553,378円
DIAM国際分散バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	10,350,014円
DIAM国内重視バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,022,019円
DIAM国内重視バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	31,268円
DIAM世界バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	912,215円
DIAM世界バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	16,254,337円
DIAMバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	119,080,553円
DIAMバランスファンド３７．５VA（適格機関投資家限定）	213,734,391円
DIAMバランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	734,940,802円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	30,983,929円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA２（適格機関投資家限	26,423,563円

定)		
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)		185,550,431円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)		5,893,236円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)		141,051円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)		69,862,055円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)		5,957,128円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)		23,007,475円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)		40,468,225円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)		83,661,055円
動的パッケージファンド<DC年金>		14,184,867円
コア資産形成ファンド		8,328,147円
たわらノーロード 先進国株式 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>		2,675,407,212円
MHAM外国株式インデックスファンド		136,471,604円
たわらノーロード 先進国株式 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>		11,310,282円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]		1,672,117,081円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]		1,928,508,092円
計		158,694,499,404円
2. 受益権の総数		158,694,499,404口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年11月8日現在			
	契約額等 (円)	時価 (円)		評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				

売建	1,053,095,027	—	1,053,125,090	△30,063
アメリカ・ドル	810,636,840	—	810,651,371	△14,531
イギリス・ポンド	42,380,343	—	42,381,946	△1,603
オーストラリア・ドル	22,064,472	—	22,062,648	1,824
カナダ・ドル	35,651,360	—	35,650,936	424
ユーロ	142,362,012	—	142,378,189	△16,177
合計	1,053,095,027	—	1,053,125,090	△30,063

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### 株式関連

種類	2023年11月8日現在			
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買建	13,360,020,532	—	13,630,436,714	270,416,182
合計	13,360,020,532	—	13,630,436,714	270,416,182

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年11月8日現在
1口当たり純資産額	7.3653円
(1万口当たり純資産額)	(73,653円)

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2023年11月30日現在

I 資産総額	478,973,988円
II 負債総額	2,748,642円
III 純資産総額 (I - II)	476,225,346円
IV 発行済数量	455,541,830口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.0454円

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

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

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

2023年11月30日現在

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

I 資産総額	1,195,069,303,196円
II 負債総額	719,125,798円
III 純資産総額 (I - II)	1,194,350,177,398円
IV 発行済数量	158,799,662,749口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	7.5211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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2023年11月30日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2023年11月30日現在）

###### 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. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

###### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

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

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第39期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2023年5月25日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

---

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△0	△0
評価・換算差額等計	△0	△0
純資産合計	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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



(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							△11,280	△11,280	△11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△0	△0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			△11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	4,219
当期末残高	△0	△0	77,573

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△0	△0	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			△12,360
当期純利益			13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	1,461
当期末残高	△0	△0	79,034

## 重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
<p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p>	<p>時価法</p>
<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>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。</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(4) 時効後支払引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
<p>6. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投</p>

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

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過の取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

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

## 注記事項

(貸借対照表関係)

### ※1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

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

(損益計算書関係)

### ※1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

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

### ※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2. 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

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

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2023年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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



2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022年3月31日現在）

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

第38期（2023年3月31日現在）

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

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

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期（2022年3月31日現在）

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

第38期（2023年3月31日現在）

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第37期（2022年3月31日現在）

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

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

第38期（2023年3月31日現在）

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

(百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	239	180
関係会社株式		
非上場株式	5,349	5,810

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第37期（2022年3月31日現在）

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	—	—	—
小計	—	—	—
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額239百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

第38期（2023年3月31日現在）

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	—	—	—
小計	—	—	—
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額180百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	13	—	6

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（非積立型制度であります）を採用しております。確定拠出型の制度としては確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)	
	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	△14	31
退職給付の支払額	△185	△191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(百万円)	
	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	△35	△44
未認識過去勤務費用	△33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

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

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において20百万円、当事業年度において24百万円を営業外費用に計上しております。

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～3.76%	1.00%～3.56%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度97百万円、当事業年度103百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(注) 前事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないA種類株式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	金額	76,224百万円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

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



## (2) 損益計算書項目

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,429百万円	△8,039百万円
経常利益	△8,429百万円	△8,039百万円
税引前当期純利益	△8,429百万円	△8,039百万円
当期純利益	△7,015百万円	△6,744百万円
1株当たり当期純利益	△175,380円68銭	△168,617円97銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,618百万円	4,228百万円

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

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

(注) 成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(持分法損益等)

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	7,789	未払 手数料	1,592
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	16,373	未払 手数料	2,651

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	7,474	未払 手数料	1,579
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	13,932	未払 手数料	2,404

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森重 俊寛

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

### 中間監査意見

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

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

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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



## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)</p> <p>市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
<p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p>	<p>時価法</p>
<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>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中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>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、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投</p>

## 6. 収益及び費用の計上基準

資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

### (1) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

### (2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

### (3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

### (4) 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(金融商品関係)

第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)

### 1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

### 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

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

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

#### 投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。  
これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

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

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末  
(2023年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額4,888百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

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

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

(持分法損益等)

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



## (企業結合等関係)

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

### 1. 結合当事企業

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

### 2. 企業結合日

2016年10月1日

### 3. 企業結合の方法

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) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

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

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

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって見積り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。

# 約 款

## 運用の基本方針

約款第19条の規定に基づき、委託者の別に定める運用の基本方針は、次のものといたします。

### 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

- ①主として、各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行います。
- ②各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資割合については、各マザーファンドが主要投資対象とする資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析等を勘案のうえ配分比率を決定します。ただし、ファンドの価格変動リスクを勘案し、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券（以下、各主要投資対象マザーファンド受益証券を含め「マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を行う場合、および信託財産の純資産総額の50%を上限に預金等の短期金融商品への直接投資を行う場合があります。
- ③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ④マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。
- ⑤市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

- ①株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ②外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 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、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ⑤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には、制限を設けません。
- ⑥同一銘柄の転換社債、ならびに同一銘柄の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（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みます。）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。
- ⑦投資信託証券（マザーファンド受益証券および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。
- ⑧みなし有価証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。
- ⑨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。
- ⑩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。
- ⑪前各項の規定にかかわらず、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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

- ⑫デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます（ただし、この信託において取引可能なものに限り、以下同じ。）。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

#### 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ①分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。
- ②分配金額は、委託者が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
- ③収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

## 追加型証券投資信託 コア資産形成ファンド 約款

### <信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne 株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

### <信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

### <信託の目的および金額>

第3条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

### <信託金の限度額>

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

### <信託期間>

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2048年5月8日までとします。

### <受益権の取得申込みの勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

### <当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

### <受益権の分割および再分割>

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権について100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受託者と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところにしたがい、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。

### <追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法>

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第30条に規定する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従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（以下「純資産総額」といいます。）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。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

- ③第32条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

#### <信託日時の異なる受益権の内容>

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### <受益権の帰属と受益証券の不発行>

第11条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ②委託者は、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、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、委託者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。
- ③委託者は、第8条の規定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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、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。

#### <受益権の設定に係る受託者の通知>

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、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係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### <受益権の申込単位および価額>

第13条 委託者は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、委託者が自ら定める申込単位をもって当該取得の申込みに応ずることができるものとします。

- ②委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいい、以下、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関を総称して「指定販売会社」といいます。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、指定販売会社がそれぞれ委託者の承認を得て定める申込単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。
- ③前2項の取得申込者は、指定販売会社または委託者に、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この信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社または委託者（第49条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）は、当該取得申込みの代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、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を行うことができます。
- ④第1項および第2項の規定にかかわらず、取得申込日がニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行およびロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合には、原則として受益権の取得申込みの受け付けは行いません。
- ⑤第1項および第2項の場合の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税ならびに地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）

す。)を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みに係る受益権の価額は、1口につき1円とします。

⑥前項の手数料の額は、委託者および指定販売会社が、それぞれ別に定めるものとします。

⑦前各項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に応じた受益者が第46条第3項の規定に基づき収益分配金を再投資する場合、ならびに受益者が指定販売会社と結んだ別に定める収益分配金の再投資に関する契約（以下「別に定める契約」といいます。）に基づいて収益分配金を再投資する場合においては、委託者および指定販売会社は、1口の整数倍をもって当該取得の申込みに応ずることができるものとします。この場合の受益権の価額は、原則として第41条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑧前各項の規定にかかわらず、信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託者が合理的に判断する場合、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託者および指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付けを中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

#### <受益権の譲渡に係る記載または記録>

第14条 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係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係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、前項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委託者は、第1項に規定する振替について、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係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、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### <受益権の譲渡の対抗要件>

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

#### <投資の対象とする資産の種類>

第16条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項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25条、第26条および第27条に定めるものに限りません。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形（イ. に掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

#### <運用の指図範囲>

第17条 委託者は、信託金を、主として第1号から第5号までのアセットマネジメントOne 株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下総称して「マザーフ

ファンド」といいます。)の各受益証券(以下「マザーファンド受益証券」といいます。)を含む第6号から第27号までの有価証券(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. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
2. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
3. 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
4. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
5. MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券
6. 株券または新株引受権証書
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人が発行する債券
10. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
11. 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。)
12. 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。)
13. 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。)
14. 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。)
15. コマーシャル・ペーパー
16. 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
17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの(外国の者の発行する証券または証書で、第6号から第11号の証券または証書の性質を有するプリファードセキュリティーズ(ハイブリッド型のプリファードセキュリティーズを含みます。)およびこれらに類するものを含みます。)
18. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
19. 投資証券、投資法人債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、プリファードセキュリティーズ(投資証券および投資法人債券のハイブリッド型のものを含みます。)に該当するものを含みます。)
20. 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。)
21. 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。)
22. 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。)
23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
24. 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。)
25. 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。)
26. 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
27. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第6号の証券または証書、第17号および第22号の証券または証書のうち第6号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、第7号から第11号までの証券および第17号ならびに第22号の証券または証書のうち第7号から第11号までの証券の性質を有するものならびに第19号の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第18号の証券および第19号の証券（投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

②委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの

7. 金銭債権（ただし、流動性のあるプリファードセキュリティーズに該当するものに限り、前各号で該当するものならびに前項第17号および同項第19号に定める証券または証書を除きます。）

8. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に定めるものをいいます。）

9. 外国の法律に基づく権利であって前号に掲げる権利に類するもの（リミテッド・パートナーシップ（LP）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含みます。）を含みます。）

10. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）

11. 外国法人の社員権で前号に掲げる権利の性質を有するもの（リミテッド・ライアビリティー・カンパニー（LLC）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含みます。）を含みます。）

なお、第5号、第6号および第8号から第11号までの権利等を以下「みなし有価証券」といいます。

③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号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。

④委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券および取引所金融商品市場（金融商品取引法第2条第17項に規定する金融商品市場をいいます。）または外国金融商品市場に上場等（不動産投資信託証券については、予定を含みます。以下同じ。）され、かつこれらの市場において常時売却可能（市場の急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥委託者は、信託財産に属するみなし有価証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するみなし有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。

⑦前3項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券、新株予約権証券、投資信託証券およびみなし有価証券の時価総額の割合をそれぞれ乗じて得た額をいいます。

<利害関係人等との取引等>

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であつて、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第33条において同じ。）、第33条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第24条ないし第30条、第32条および第36条ないし第38条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第24条ないし第30条、第32条および第36条ないし第38条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

<運用の基本方針>

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

第20条 委託者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、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および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前項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、委託者が投資することを指図することができるものとします。

<同一銘柄の転換社債等への投資制限>

第21条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドに属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第22条 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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### <デリバティブ取引等に係る投資制限>

第23条 委託者は、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に定める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ることとなる投資の指図をしません。

#### <信用取引の運用指図・目的>

第24条 委託者は、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、株券の引き渡し又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前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### <先物取引等の運用指図・目的>

第25条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の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委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係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委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### <スワップ取引の運用指図・目的>

第26条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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



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

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的>

- 第27条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める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委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

<有価証券の貸付の指図および範囲>

- 第28条 委託者は、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各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者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委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

<公社債の空売りの指図および範囲>

- 第29条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ②前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

<公社債の借入れの指図および範囲>

- 第30条 委託者は、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前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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第1項の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

第31条 外貨建価値証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約の指図>

第32条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

<信託業務の委託等>

第33条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みません。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
  2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
  3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
  4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

<混蔵寄託>

第34条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第35条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第36条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求、有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第37条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第38条 委託者は、信託財産の効率的な運用および運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

④借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

第39条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第40条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰入れることができます。

③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第41条 この信託の計算期間は、毎年5月9日から翌年5月8日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は、平成27年4月20日から平成28年5月8日までとします。

②前項の規定にかかわらず、前項の原則により計算期間終了日に該当する日（以下「当該日」といいます。）が休業日のとき、計算期間終了日は当該日の翌日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第5条に定める信託期間の終了日とします。

<信託財産に関する報告等>

第42条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

#### <信託事務の諸費用および監査費用>

第43条 信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②前項の信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額は、第41条に規定する毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支弁します。

③信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用（債権回収に要する弁護士費用等を含みます。）等（第1項に掲げる租税、諸費用および利息と合わせて以下「諸経費」といいます。）については、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

#### <信託報酬等の総額>

第44条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第41条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の90の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、第41条に規定する毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③第1項の信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

#### <収益の分配方式>

第45条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等相当額を控除した後、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立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減して得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等相当額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、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立てることができます。

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

③毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越すものとします。

<収益分配金、償還金および一部解約金の支払い>

- 第46条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、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（当該収益分配金に係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係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係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指定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。）に支払います。
- ②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該再投資にかかる売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部もしくは一部について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が、当該申し出を受付けた受益権に帰属する収益分配金を除く。）をこの信託の受益権の取得申込金として、各受益者ごとに当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みに応じたものとし、当該再投資にかかる受益権の取得申込みに応じたことにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ④償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了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、当該信託終了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指定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。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係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。
- ⑤一部解約金は、第50条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として6営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑥前各項（第2項および第3項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとし、ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行うものとし、
- ⑦収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、
- ⑧前項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、また、前項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、

<収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

- 第47条 受託者は、収益分配金については第46条第1項に規定する支払開始日および第46条第2項に規定する支払開始前までに、償還金については第46条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第46条第5項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。
- ②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じないものとし、

<収益分配金および償還金の時効>

第48条 受益者が、収益分配金については第46条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第46条第4項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<委託者の自らの募集にかかる受益権の口座管理機関>

第49条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または記録等に関する業務を委任することができます。

<信託契約の一部解約>

第50条 受益者は、自己に帰属する受益権について、委託者に対し、委託者が自ら定める単位または指定販売会社が委託者の承認を得て定める解約単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

②受益者が前項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者（委託者の自らの募集にかかる受益権についての場合に限ります。）または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

③委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合は、この信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行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係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、当該一部解約に係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。

④前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤委託者は、一部解約の実行の請求日がニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合には、原則として第1項の一部解約の実行の請求の受け付けは行いません。

⑥委託者は、信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託者が合理的に判断する場合（一部解約の実行の請求金額が多額な場合を含みます。）、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。

⑦前項により、一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付けの中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付けを解除した後の最初の基準価額の計算日（この日が第5項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第4項の規定に準じて算出した価額とします。

<信託契約の解約>

第51条 委託者は、第5条の規定による信託終了前において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めたとときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることとなる場合には、受託者と合意のうえ、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、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

③委託者は、前各項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

④前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属する

ときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

⑤第3項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

⑥第3項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項から前項までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

#### <信託契約に関する監督官庁の命令>

第52条 委託者は、監督官庁よりこの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、この信託契約を解約し信託を終了させます。

②委託者は、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、第56条の規定にしたがいます。

#### <委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第53条 委託者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、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第56条第2項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

#### <委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第54条 委託者は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### <受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第55条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第56条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### <信託約款の変更等>

第56条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項(前項の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知っている受益者に対し、

書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- ③前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### <反対受益者の受益権買取請求の不適用>

第57条 この信託は、受益者が第50条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

#### <信託期間の延長>

第58条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

#### <他の受益者の氏名等の開示の請求の制限>

第59条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

#### <運用報告書に記載すべき事項の提供>

第60条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

#### <公告>

第61条 委託者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、次のアドレスに掲載します。  
<https://www.am-one.co.jp/>

②前項の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ます。

#### <質権口記載または記録の受益権の取り扱い>

第62条 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係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。



<信託約款に関する疑義の取扱い>

第63条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付則)

第1条 第27条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

②第27条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成27年4月20日

委託者 東京都港区三田三丁目5番27号  
みずほ投信投資顧問株式会社

受託者 東京都中央区八重洲一丁目2番1号  
みずほ信託銀行株式会社

親投資信託  
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 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目指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。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 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、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) 有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。
- 7) スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。
- 8) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。
- 9) 外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行いません。
- 10) 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。
- 11) 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。

- 12) 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、委託者は、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。

親投資信託  
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第15条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 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、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) 有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

- 8) 外国為替予約取引は約款24条の範囲で行ないます。
- 9) 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。
- 10) 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。
- 11) 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、委託者は、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。

親投資信託  
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 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、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 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目指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。
- 6) 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- 4) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 5) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 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、委託者は、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。

親投資信託  
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の株式を主要投資対象とします。

(2) 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）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 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) 有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。
- 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。

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。

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、委託者は、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。



親投資信託 MHAM国内短期債券マザーファンド  
運用の基本方針

約款第16条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は下記の通りとします。

1. 基本方針

この投資信託は、主としてわが国の短期の国債、地方債、政府保証債、金融債等（以下「国債等」といいます。）に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

投資対象

この投資信託は、わが国の短期の国債等を主要投資対象とします。

投資態度

- ①わが国の短期の国債等を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。
- ②投資する個別債券の格付については、スタンダード・アンド・プアーズ (S&P)、ムーディーズ・インベスターズ・サービス (Moody's)、格付投資情報センター (R&I)、日本格付研究所 (JCR) のいずれかの長期信用格付が「AAマイナス」格以上のものとします。
- ③投資する個別債券の残存期間については、原則として1年以下とします。
- ④市場動向および資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- ⑤国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- ⑥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。）を行うことができます。
- ⑦金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

運用制限

- ①株式（新株引受権証券を含みます。）への投資は行いません。
- ②同一発行体が発行する有価証券への投資割合は、国債、地方債、特別の法律により法人の発行する債券を除き、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等への投資割合は、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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。